

## 【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11月28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】	D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060
【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】	D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 10兆円を上限とします。 D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060

（以下、上記を総称して、あるいは個別に、「当ファンド」、「各ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2023年11月29日から2024年 5月28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、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、

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日又はその翌営業日下記のうちいずれかの場合は、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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

各ファンドにつき上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(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。

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

- (1)プル・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. 投資対象ファンド<sup>※</sup>への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券に分散投資します。

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。投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

- 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- 為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

### ? DR(預託証券)とは

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

## 2. 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

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

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

### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各投資対象ファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 3. ターゲット・イヤー<sup>※</sup>に近づくにしたいが、原則として1年に1回、各資産の基本組入比率を変更します。

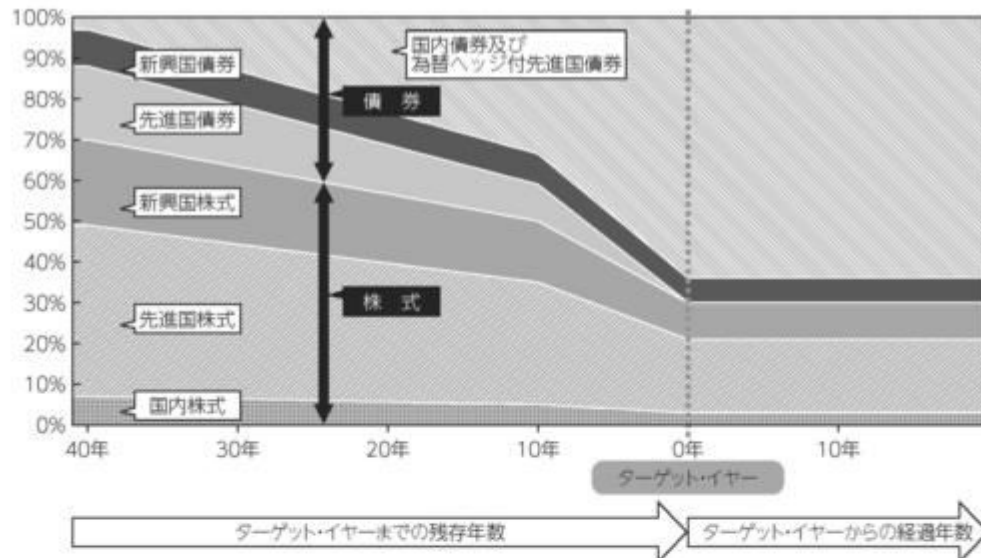
※ターゲット・イヤーとは、ファンドごとにあらかじめ定めた基準日(特定の決算日の翌日)をいいます。

- 定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。
- ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。
- 基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。
- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

#### 各ファンドのターゲット・イヤー

DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	2030年8月の決算日の翌日(第13計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2040年8月の決算日の翌日(第23計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2050年8月の決算日の翌日(第33計算期間開始日)
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2060年8月の決算日の翌日(第43計算期間開始日)

## 基本組入比率の推移のイメージ



※上記は当初設定時における基本組入比率の推移のイメージ図であり、実際のファンドの組入比率と異なる場合があります。

## &lt;ご参考&gt;

## ■ 当初設定時(2019年3月)

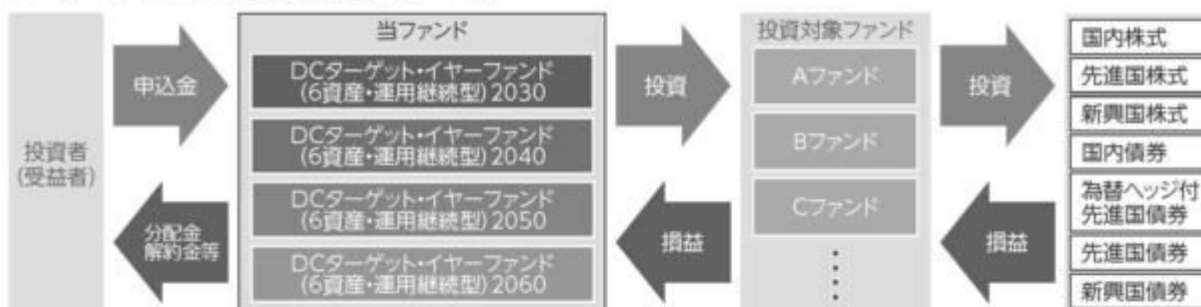
	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2030	5.1%	30.4%	15.2%	32.4%	9.3%	7.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040	5.7%	34.4%	17.2%	22.3%	12.3%	8.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050	6.4%	38.4%	19.2%	12.1%	15.3%	8.6%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060	7.0%	42.0%	21.0%	3.0%	18.0%	9.0%

## ■ 2023年9月末現在

	国内株式	先進国株式	新興国株式	国内債券及び 為替ヘッジ付 先進国債券	先進国債券	新興国債券
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2030	4.4%	26.4%	13.2%	42.6%	6.3%	7.1%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040	5.5%	32.8%	16.4%	26.3%	11.1%	7.9%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050	6.1%	36.8%	18.4%	16.2%	14.1%	8.4%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060	6.8%	40.8%	20.4%	6.0%	17.1%	8.9%

### ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



### 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

- 原則として毎年8月28日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※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。
- 外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質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。

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。

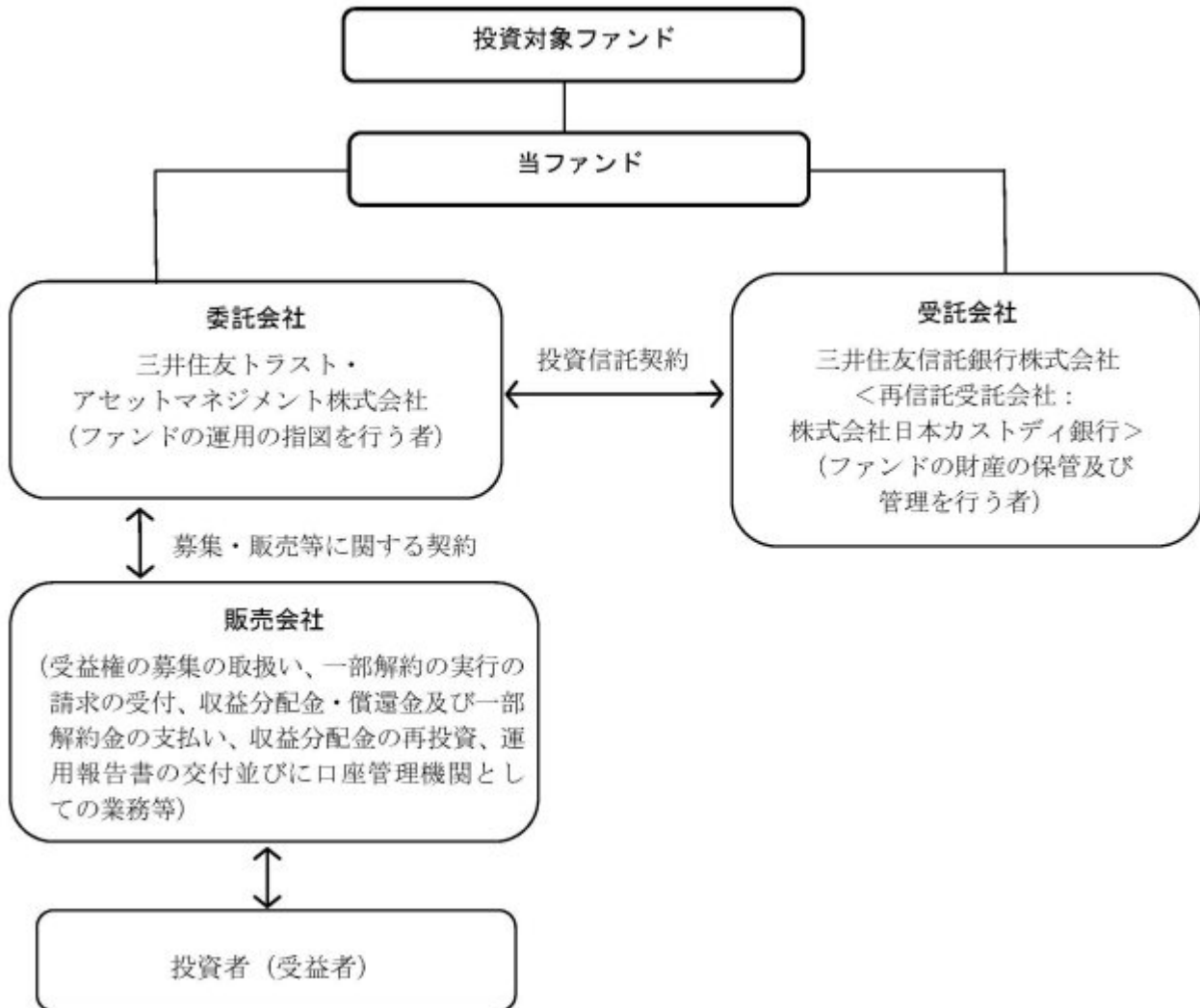
### (2) 【ファンドの沿革】

2019年 3月20日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

### (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年 9月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

## 基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。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。

## 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」ということがあります。）を投資対象とします。

## 投資態度

イ．投資対象ファンドへの投資を通じて、主として日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）及び債券に分散投資します。

ロ．当初設定時の各資産の基本組入比率は以下のとおりとします。

	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2030	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2040	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2050	DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型） 2060
国内株式	5.1%	5.7%	6.4%	7.0%
先進国株式	30.4%	34.4%	38.4%	42.0%
新興国株式	15.2%	17.2%	19.2%	21.0%
国内債券 及び為替ヘッジ 付先進国債券	32.4%	22.3%	12.1%	3.0%
先進国債券	9.3%	12.3%	15.3%	18.0%
新興国債券	7.6%	8.1%	8.6%	9.0%

ハ．（１）年8月の決算日の翌日（第（２）計算期間開始日）（以下、「ターゲット・イヤー」といいます。）に近づくにしたいが、定期的に各資産の基本組入比率を変更することで、債券中心の運用へとシフトします。ターゲット・イヤー以降の各資産の基本組入比率は一定とすることを基本とします。なお、基本組入比率の最終決定は、1年に1回、市場構造及び市場環境の変化等を考慮した上で行います。基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

上記、（１）及び（２）となっている箇所には下の表より各々の数字をあてはめてお読みください。

	（ 1）	（ 2）
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2030	13
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	2040	23
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	2050	33
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	2060	43

ニ．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。

ホ．投資対象ファンドについては、将来除外又は新たに追加する場合があります。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ヘ．為替ヘッジ付先進国債券部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、急激な為替変動等により為替差損が生じる可能性が高いと委託会社が判断した場合には、為替ヘッジ付先進国債券部分以外においても一時的に為替ヘッジを行うことがあります。

ト．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記

の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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

### 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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）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。

### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

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

・全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

以下の内容は、2023年 9月29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、T O P I X (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	<p>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、T O P I X (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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>

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

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。

J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みT O P I Xの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みT O P I X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。

J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値及び配当込みT O P I X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T O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

J P Xは、配当込みT O P I X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、J P Xは、配当込みT O P I X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。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

J P X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。

J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みT O P I X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。

以上の項目に限らず、J P X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.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

<p>投資態度</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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。

### 3.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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。

#### 4. 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	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。

#### 5.外国債券インデックスマザーファンド（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、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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います。投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。）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（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。）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。</p> <p>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。</p>



主な投資制限	<p>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り、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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12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1月15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

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。

#### 6. 外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（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、長期的な投資信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債

投資態度	<p>公社債への実質投資は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）に採用されている国の国債等に分散投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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により為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>運用の効率化を図るため、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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、実質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。</p> <p>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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、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。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年2回：6月・12月の各10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.209%（税抜 0.19%）
信託財産留保額	一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額とします。

設定日	2014年5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

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。

## 7. 外国債券インデックス 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、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
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

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性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。

#### 8. 新興国債券インデックス 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、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（ ）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	新興国の債券

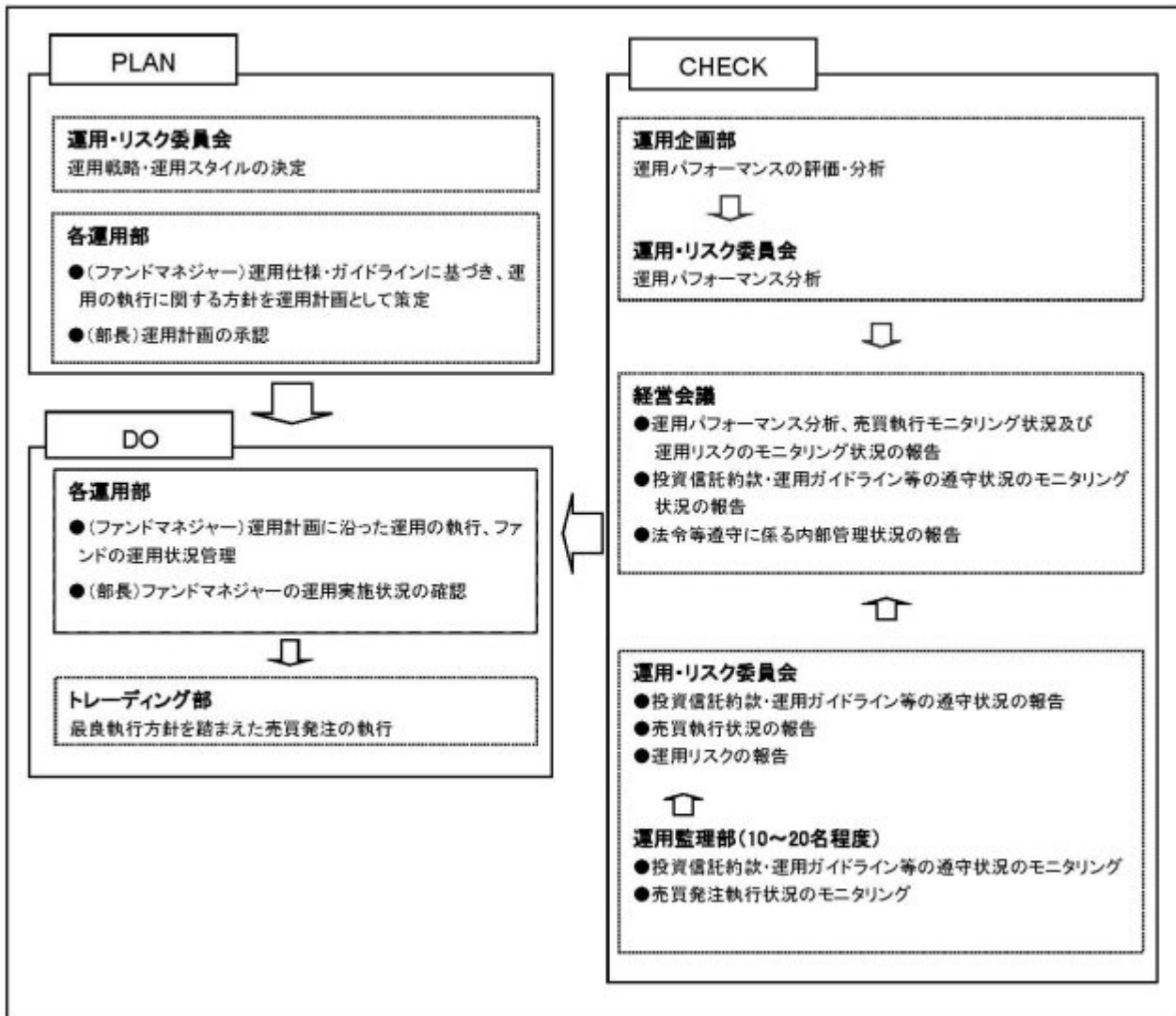
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
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

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティ

ティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

### （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）【配分方針】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です

- ・ 分配対象額は、経費控除後の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。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、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．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への直接投資は行いません。ただし、投資対象ファンドを通じた実質投資割合には制限を設けません。

##### ニ．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。

##### ホ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

（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。

##### ヘ．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。

(八) 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。

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ト．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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク



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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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。

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

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

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

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短時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。

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

## (2) リスクの管理体制

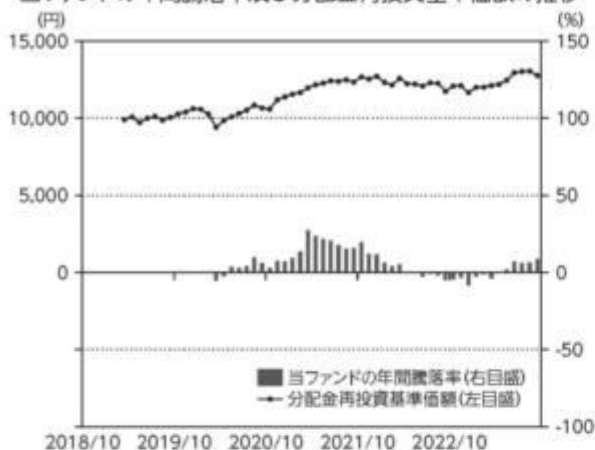
### 委託会社におけるリスク管理体制

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

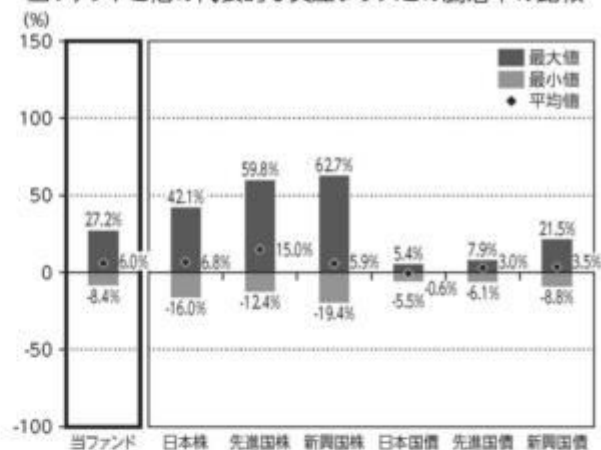
## 〔参考情報〕

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030

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

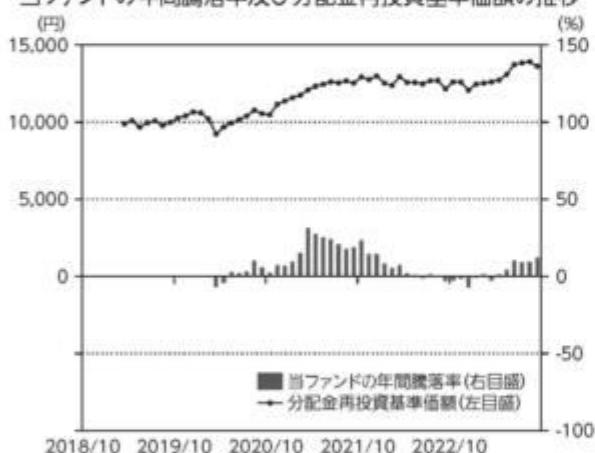


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

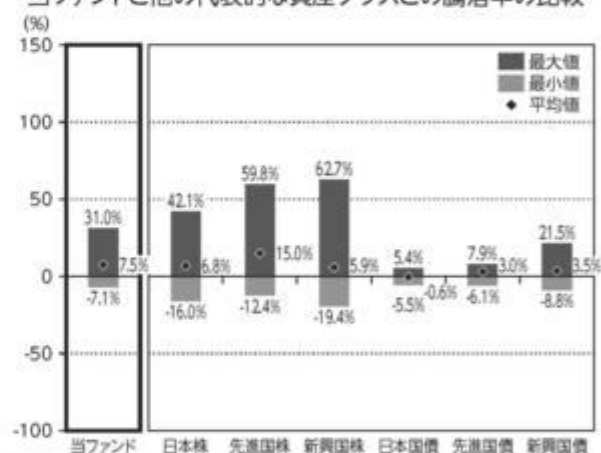


## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

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



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

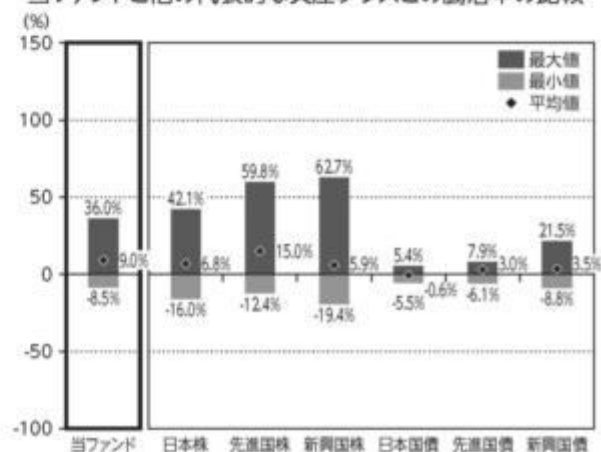


## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050

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



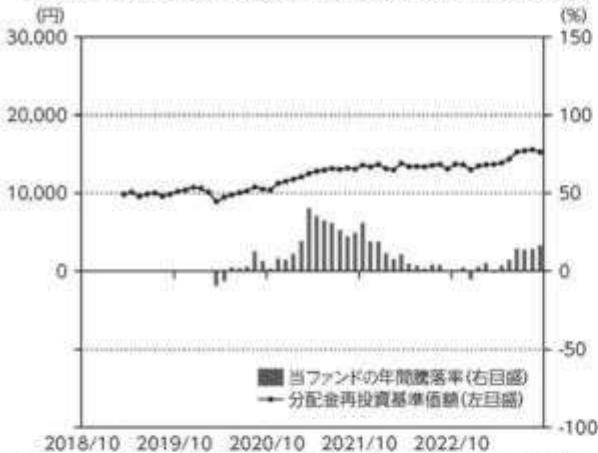
当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## 【参考情報】

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060

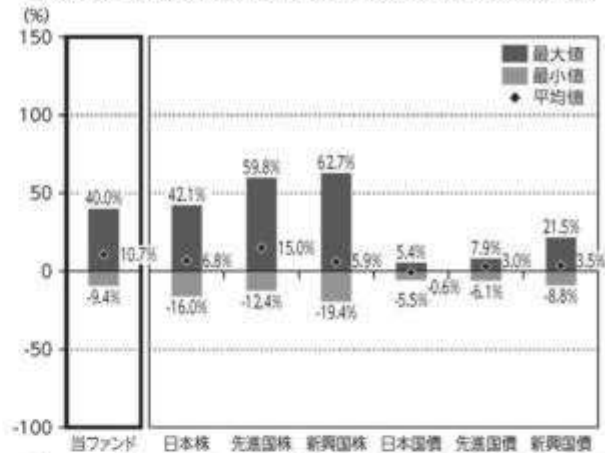
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*当ファンドについては2020年3月～2023年9月の3年7ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2018年10月～2023年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

## 各資産クラスの指数について

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

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。

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

## (3) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.374%（税抜0.34%）（ ）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 0.165% （税抜 0.15%）	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 0.165% （税抜 0.15%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.044% （税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

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。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。

外国債券パッシブファンド私募A （為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	年率 0.209% ( 税抜 0.19% )
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。

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。

実質的な信託報酬率：上限 年率0.583%（税抜 上限0.53%）  
（投資対象とする投資信託証券：上限 年率0.209%（税抜 上限0.19%））

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、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があります。）。

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2023年 9月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

**(参考情報)ファンドの総経費率**

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(1+2)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	0.45%	0.38%	0.07%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	0.46%	0.38%	0.08%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	0.46%	0.38%	0.08%
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	0.46%	0.38%	0.08%

※対象期間は2022年8月30日～2023年8月28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費用は、その他費用に含まれています。

※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9月29日現在の状況について記載してあります。

**【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030】****(1)【投資状況】**

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,653,347,891	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		26,063,865	0.97
合計(純資産総額)		2,679,411,756	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、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

**(2)【投資資産】****【投資有価証券の主要銘柄】****イ. 評価額上位銘柄明細**

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	1,149,999,334	0.8270	951,141,669	0.8080	929,199,461	34.68
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	138,914,736	5.1541	715,988,822	5.1507	715,508,130	26.70
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックスマザーファンド	93,322,616	3.8629	360,501,816	3.8356	357,948,225	13.36
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックスマザーファンド	90,714,141	2.1354	193,711,676	2.0933	189,891,911	7.09

日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	51,861,992	3.3030	171,300,606	3.2760	169,899,885	6.34
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	127,104,056	1.3387	170,161,171	1.3302	169,073,815	6.31
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	51,133,878	2.3381	119,556,460	2.3825	121,826,464	4.55

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	488,321	488,321	9,766	9,766
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	9,108,305	9,108,305	10,876	10,876
第3期計算期間末 (2021年 8月30日)	168,155,570	168,155,570	12,445	12,445
第4期計算期間末 (2022年 8月29日)	769,603,219	769,603,219	12,340	12,340
第5期計算期間末 (2023年 8月28日)	2,645,439,337	2,645,439,337	12,913	12,913
2022年 9月末日	795,408,209		11,738	
10月末日	840,090,023		12,087	
11月末日	873,394,360		12,112	
12月末日	872,287,936		11,662	
2023年 1月末日	912,630,562		12,010	
2月末日	916,893,865		12,014	
3月末日	1,003,279,181		12,110	
4月末日	1,056,703,869		12,201	
5月末日	1,096,542,464		12,465	

6月末日	2,539,715,975		12,958
7月末日	2,633,866,822		13,030
8月末日	2,695,285,620		13,054
9月末日	2,679,411,756		12,770

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	2.3
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.4
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	14.4
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0.8
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	4.6

(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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	10,722,971	2,848,364	8,374,607
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	131,196,373	4,453,274	135,117,706
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	515,248,447	26,679,898	623,686,255
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	1,516,926,128	92,010,119	2,048,602,264

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

## (1) 【投資状況】



資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,045,205,301	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,927,920	0.96
合計(純資産総額)		2,065,133,221	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	132,453,707	5.1539	682,660,438	5.1507	682,229,308	33.04
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	517,632,910	0.8269	428,051,357	0.8080	418,247,391	20.25
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	88,975,398	3.8629	343,707,547	3.8356	341,274,036	16.53
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	70,126,688	3.3028	231,618,602	3.2760	229,735,029	11.12
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	77,464,354	2.1349	165,383,281	2.0933	162,156,132	7.85
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	49,037,152	2.3386	114,679,710	2.3825	116,831,014	5.66
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	71,216,653	1.3387	95,344,458	1.3302	94,732,391	4.59

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （ 3 ） 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	482,826	482,826	9,657	9,657
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	10,262,988	10,262,988	10,807	10,807
第3期計算期間末 (2021年 8月30日)	110,076,954	110,076,954	12,614	12,614
第4期計算期間末 (2022年 8月29日)	535,101,335	535,101,335	12,780	12,780
第5期計算期間末 (2023年 8月28日)	2,008,807,846	2,008,807,846	13,732	13,732
2022年 9月末日	573,770,811		12,151	
10月末日	619,726,502		12,600	
11月末日	638,736,490		12,589	
12月末日	642,416,373		12,065	
2023年 1月末日	679,204,002		12,465	
2月末日	693,787,362		12,527	
3月末日	788,002,053		12,602	
4月末日	840,276,087		12,729	
5月末日	887,554,462		13,089	
6月末日	1,963,954,754		13,734	
7月末日	2,022,143,388		13,835	
8月末日	2,066,006,108		13,907	
9月末日	2,065,133,221		13,619	

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	3.4
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	11.9

第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	16.7
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	1.3
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	7.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	9,066,056	69,464	9,496,592
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	79,505,469	1,737,885	87,264,176
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	348,173,003	16,742,373	418,694,806
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	1,102,286,989	58,067,840	1,462,913,955

(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。

#### 【DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050】

##### (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	779,303,651	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,551,312	0.96
合計(純資産総額)		786,854,963	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	56,474,003	5.1547	291,106,544	5.1507	290,880,647	36.97
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	37,932,311	3.8633	146,543,898	3.8356	145,493,172	18.49
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	33,853,022	3.3028	111,809,762	3.2760	110,902,500	14.09
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	111,207,506	0.8270	91,968,608	0.8080	89,855,664	11.42

日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	31,303,904	2.1348	66,827,575	2.0933	65,528,462	8.33
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	20,664,558	2.3396	48,346,800	2.3825	49,233,309	6.26
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	20,605,847	1.3388	27,587,108	1.3302	27,409,897	3.48

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.04
合計	99.04

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2019年 8月28日)	477,285	477,285	9,546	9,546
第2期計算期間末 (2020年 8月28日)	4,942,635	4,942,635	10,801	10,801
第3期計算期間末 (2021年 8月30日)	45,085,575	45,085,575	12,844	12,844
第4期計算期間末 (2022年 8月29日)	181,774,282	181,774,282	13,247	13,247
第5期計算期間末 (2023年 8月28日)	758,401,238	758,401,238	14,491	14,491
2022年 9月末日	201,613,206		12,589	
10月末日	215,377,506		13,120	
11月末日	225,822,592		13,081	
12月末日	231,265,437		12,496	
2023年 1月末日	250,206,229		12,939	
2月末日	274,913,743		13,046	
3月末日	343,040,465		13,109	
4月末日	361,083,157		13,263	
5月末日	389,662,494		13,695	

6月末日	710,925,414		14,462
7月末日	745,787,522		14,587
8月末日	781,665,617		14,693
9月末日	786,854,963		14,398

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	4.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	13.1
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	18.9
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	3.1
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	9.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	4,213,212	137,106	4,576,106
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	34,461,389	3,934,457	35,103,038
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	122,053,912	19,938,780	137,218,170
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	420,238,869	34,084,620	523,372,419

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	775,530,383	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,427,105	0.95
合計(純資産総額)		782,957,488	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	62,139,282	5.1573	320,476,621	5.1507	320,060,799	40.88
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	41,719,556	3.8644	161,222,078	3.8356	160,019,528	20.44
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	40,764,522	3.3028	134,637,481	3.2760	133,544,574	17.06
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	32,935,267	2.1345	70,300,664	2.0933	68,943,394	8.81
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	22,847,691	2.3417	53,504,024	2.3825	54,434,623	6.95
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	25,502,738	0.8269	21,089,862	0.8080	20,606,212	2.63
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	13,472,601	1.3387	18,036,288	1.3302	17,921,253	2.29

(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、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.05
合計	99.05

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

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## （ 3 ） 【運用実績】

## 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2019年 8月28日)	472,333	472,333	9,447	9,447
第2期計算期間末	(2020年 8月28日)	2,976,184	2,976,184	10,836	10,836
第3期計算期間末	(2021年 8月30日)	37,860,577	37,860,577	13,126	13,126
第4期計算期間末	(2022年 8月29日)	236,061,906	236,061,906	13,780	13,780
第5期計算期間末	(2023年 8月28日)	718,466,887	718,466,887	15,336	15,336
	2022年 9月末日	226,490,126		13,090	
	10月末日	241,167,710		13,709	
	11月末日	253,908,751		13,640	
	12月末日	270,157,320		12,987	
	2023年 1月末日	302,894,827		13,478	
	2月末日	352,269,198		13,634	
	3月末日	421,685,124		13,683	
	4月末日	445,971,812		13,866	
	5月末日	469,098,683		14,378	
	6月末日	670,512,963		15,276	
	7月末日	703,334,502		15,423	
	8月末日	753,828,448		15,569	
	9月末日	782,957,488		15,265	

## 【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	2019年 3月20日～2019年 8月28日	0
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	0
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	0
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	5.5
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	14.7

第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	21.1
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	5.0
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	11.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2019年 3月20日～2019年 8月28日	500,000		500,000
第2期計算期間	2019年 8月29日～2020年 8月28日	2,820,411	573,769	2,746,642
第3期計算期間	2020年 8月29日～2021年 8月30日	33,572,862	7,476,531	28,842,973
第4期計算期間	2021年 8月31日～2022年 8月29日	173,520,838	31,053,827	171,309,984
第5期計算期間	2022年 8月30日～2023年 8月28日	382,072,598	84,901,598	468,480,984

(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	567,182,679,660	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,787,912,121	1.35
合計(純資産総額)		574,970,591,781	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	5,971,395,000	1.04

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

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

##### 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	9,461,500	1,933.20	18,290,971,800	2,677.50	25,333,166,250	4.41
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,218,900	13,273.18	16,178,679,102	12,240.00	14,919,336,000	2.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,628,200	929.89	9,883,056,898	1,268.50	13,481,871,700	2.34
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	55,359,900	162.74	9,009,270,126	176.60	9,776,558,340	1.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	172,400	68,599.15	11,826,493,460	55,500.00	9,568,200,000	1.66
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,206,100	5,657.14	6,823,076,554	7,347.00	8,861,216,700	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,111,500	5,920.19	6,580,291,185	7,128.00	7,922,772,000	1.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	846,300	8,140.92	6,889,660,596	9,275.00	7,849,432,500	1.37
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	364,700	19,731.43	7,196,052,521	20,440.00	7,454,468,000	1.30
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,529,400	4,537.53	6,939,698,382	4,641.00	7,097,945,400	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,202,100	1,343.43	5,645,241,210	1,682.00	7,067,932,200	1.23
日本	株式	三井物産	卸売業	1,275,600	4,643.81	5,923,644,036	5,423.00	6,917,578,800	1.20
日本	株式	任天堂	その他製品	1,087,900	5,913.83	6,433,655,657	6,230.00	6,777,617,000	1.18
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,454,300	2,077.66	5,099,200,938	2,541.00	6,236,376,300	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	1,434,700	4,405.13	6,320,040,011	4,343.00	6,230,902,100	1.08
日本	株式	第一三共	医薬品	1,505,500	4,542.39	6,838,568,145	4,106.00	6,181,583,000	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,335,400	4,356.19	5,817,256,126	4,577.00	6,112,125,800	1.06
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,123,400	4,952.08	5,563,166,672	5,406.00	6,073,100,400	1.06
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,311,400	4,444.89	5,829,028,746	4,609.00	6,044,242,600	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,677,400	3,112.44	5,220,806,856	3,465.00	5,812,191,000	1.01
日本	株式	HOYA	精密機器	365,100	17,157.02	6,264,028,002	15,325.00	5,595,157,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	852,500	5,557.36	4,737,649,400	6,335.00	5,400,587,500	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	207,800	26,765.02	5,561,771,156	23,475.00	4,878,105,000	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,778,000	1,511.19	4,198,085,820	1,690.50	4,696,209,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	937,500	5,374.73	5,038,809,375	4,909.00	4,602,187,500	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,567,800	2,752.68	4,315,656,930	2,734.00	4,286,365,200	0.75
日本	株式	S M C	機械	56,400	74,555.98	4,204,957,272	66,980.00	3,777,672,000	0.66
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	628,300	6,147.32	3,862,361,156	5,855.00	3,678,696,500	0.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,031,000	3,083.36	3,178,944,160	3,440.00	3,546,640,000	0.62
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	2,055,600	1,455.41	2,991,740,796	1,682.00	3,457,519,200	0.60

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.40
		建設業	2.12
		食料品	3.36
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.18
		化学	5.71
		医薬品	5.04
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	1.00
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.50
		機械	5.27
		電気機器	16.40
		輸送用機器	8.73
		精密機器	2.25
		その他製品	2.22
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	2.88
		海運業	0.67
		空運業	0.47
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.94
		卸売業	6.70
		小売業	4.27
		銀行業	7.04
		証券、商品先物取引業	0.77
		保険業	2.40
		その他金融業	1.20
不動産業	1.91		
サービス業	4.65		
	小計	98.65	
合計		98.65	

(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	257	円	6,069,288,100	5,971,395,000	1.04

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

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

## 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	401,505,357,979	68.05
	イギリス	24,048,770,892	4.08
	カナダ	19,977,364,676	3.39
	フランス	18,086,055,796	3.07
	スイス	18,068,171,667	3.06
	ドイツ	13,551,974,450	2.30
	オーストラリア	11,001,412,050	1.86
	アイルランド	10,637,436,027	1.80
	オランダ	10,433,331,381	1.77
	デンマーク	5,449,818,244	0.92
	スウェーデン	4,702,722,134	0.80
	スペイン	4,217,731,360	0.71
	イタリア	3,092,605,394	0.52
	香港	2,806,932,492	0.48
	シンガポール	1,923,319,127	0.33
	フィンランド	1,799,404,712	0.30
	ジャージー	1,693,259,960	0.29
	ベルギー	1,275,022,972	0.22
	ノルウェー	1,198,262,968	0.20
	イスラエル	1,153,389,469	0.20
	キュラソー	962,258,635	0.16
	バミューダ	929,956,200	0.16
	ケイマン	836,634,552	0.14
ニュージーランド	425,919,421	0.07	
ルクセンブルク	344,609,293	0.06	
オーストリア	328,501,688	0.06	

	ポルトガル	317,459,559	0.05
	リベリア	240,992,688	0.04
	パナマ	155,104,947	0.03
	マン島	83,795,416	0.01
	小計	561,247,576,149	95.12
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	110,654,920	0.02
	香港	49,060,147	0.01
	小計	159,715,067	0.03
投資証券	アメリカ	9,370,596,574	1.59
	オーストラリア	684,045,509	0.12
	シンガポール	237,310,576	0.04
	フランス	215,548,708	0.04
	イギリス	159,430,686	0.03
	香港	117,850,510	0.02
	カナダ	55,301,186	0.01
	ベルギー	46,684,626	0.01
	小計	10,886,768,375	1.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,722,711,493	3.00
合計(純資産総額)		590,016,771,084	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	13,008,505,162	2.20
	買建	カナダ	627,071,894	0.11
	買建	ドイツ	2,595,246,554	0.44
	買建	イギリス	893,842,108	0.15
	買建	オーストラリア	592,738,230	0.10

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		730,540,746	0.12

(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	1,177,684	26,243.40	30,906,438,684	25,531.81	30,068,404,364	5.10
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	528,983	49,785.90	26,335,897,323	46,914.27	24,816,851,922	4.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	690,901	17,984.16	12,425,277,477	18,844.08	13,019,399,520	2.21
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	184,802	58,347.30	10,782,697,976	64,452.52	11,910,955,747	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	444,829	18,647.40	8,294,907,661	19,790.92	8,803,579,512	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	395,244	18,761.81	7,415,496,547	19,913.58	7,870,725,148	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	213,419	29,057.98	6,201,526,534	36,853.52	7,865,241,470	1.33
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	165,576	39,224.35	6,494,611,642	45,466.33	7,528,134,182	1.28
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	301,729	15,701.41	4,737,571,523	17,870.32	5,391,994,568	0.91
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	69,912	72,038.12	5,036,329,315	76,300.75	5,334,338,593	0.90
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,275	48,003.94	4,669,583,360	53,409.03	5,195,363,860	0.88
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	60,535	63,847.83	3,865,028,661	81,438.83	4,929,899,635	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	217,897	20,481.98	4,462,964,044	22,076.51	4,810,405,779	0.82
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	179,427	23,087.67	4,142,551,904	23,466.11	4,210,453,791	0.71
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	120,784	33,651.01	4,064,503,906	34,651.70	4,185,371,271	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	177,374	21,763.67	3,860,310,044	21,889.53	3,882,634,771	0.66
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,991	121,568.15	3,767,518,642	124,450.56	3,856,847,305	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	63,267	55,998.26	3,542,842,206	59,748.23	3,780,091,596	0.64
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	135,745	23,060.49	3,130,346,567	25,516.85	3,463,785,102	0.59

アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	75,273	43,801.51	3,297,071,167	45,396.03	3,417,095,682	0.58
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	246,100	12,052.87	2,966,211,799	13,805.28	3,397,480,638	0.58
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	199,766	18,310.78	3,657,873,115	16,820.03	3,360,070,912	0.57
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	133,056	20,599.57	2,740,896,436	22,773.55	3,030,158,134	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	191,177	16,610.69	3,175,582,369	15,601.19	2,982,589,465	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	32,965	75,875.95	2,501,250,719	85,055.67	2,803,860,340	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	110,203	21,901.50	2,413,611,401	24,312.73	2,679,336,137	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	29,993	107,752.83	3,231,830,930	87,026.39	2,610,182,815	0.44
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	102,377	27,456.90	2,810,955,542	25,353.80	2,595,647,006	0.44
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,096	62,134.03	2,118,522,098	75,488.53	2,573,857,212	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	305,497	9,013.69	2,753,655,499	8,348.05	2,550,307,225	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	5.43
		素材	3.92
		資本財	6.48
		商業・専門サービス	1.51
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	2.15
		耐久消費財・アパレル	1.46
		消費者サービス	2.05
		メディア・娯楽	6.01
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.28
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.69
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
ヘルスケア機器・サービス	4.39		

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.37
	銀行	5.23
	金融サービス	6.40
	保険	3.07
	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	9.13
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.54
	電気通信サービス	1.13
	公益事業	2.61
	半導体・半導体製造装置	5.79
	不動産管理・開発	0.32
	小計	95.12
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.03
投資証券		1.85
合計		97.00

(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	401	アメリカドル	90,274,284.55	13,503,227,482	86,966,875	13,008,505,162	2.20
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	24	カナダドル	5,805,348	642,884,237	5,662,560	627,071,894	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	46	スイスフラン	5,080,492	830,457,222	5,038,380	823,573,594	0.14
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	268	ユーロ	11,425,647.6	1,805,252,321	11,213,120	1,771,672,960	0.30
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	35	オーストラリアドル	6,375,395	612,420,444	6,170,500	592,738,230	0.10
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	64	イギリスポンド	4,879,485	890,652,396	4,896,960	893,842,108	0.15

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,340,000.00	648,818,900	648,831,396	0.11
	スイスフラン	買建	500,000.00	81,690,000	81,709,350	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。

## 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	25,544,798,624	16.12
	インド	24,172,969,132	15.25
	台湾	22,196,375,022	14.01
	韓国	18,783,685,843	11.85
	中国	17,334,348,922	10.94
	ブラジル	7,849,290,576	4.95
	サウジアラビア	6,408,016,295	4.04
	南アフリカ	4,336,841,902	2.74
	メキシコ	3,707,861,763	2.34
	インドネシア	3,043,727,108	1.92
	タイ	2,856,111,255	1.80
	アラブ首長国連邦	2,199,506,548	1.39
	マレーシア	2,161,476,562	1.36
	香港	1,480,828,648	0.93
	カタール	1,456,032,144	0.92
	クウェート	1,268,994,166	0.80
	トルコ	1,134,263,590	0.72
	ポーランド	1,023,323,213	0.65
	フィリピン	960,425,115	0.61
	チリ	749,221,114	0.47
	アメリカ	727,548,870	0.46
	ギリシャ	658,022,615	0.42
	バミューダ	626,978,543	0.40
	ハンガリー	363,978,472	0.23
	チェコ	251,537,128	0.16
	ルクセンブルク	198,147,800	0.13
	イギリス	163,875,726	0.10
コロンビア	146,155,217	0.09	



	エジプト	78,781,632	0.05
	シンガポール	25,037,731	0.02
	ペルー	21,499,986	0.01
	オランダ	16,221,009	0.01
	ロシア	117	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	151,945,882,388	95.89
投資信託受益証券	ブラジル	340,695,987	0.22
	メキシコ	114,555,134	0.07
	小計	455,251,121	0.29
投資証券	メキシコ	93,845,186	0.06
	南アフリカ	38,870,151	0.02
	小計	132,715,337	0.08
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,925,761,193	3.74
合計（純資産総額）		158,459,610,039	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	5,959,917,873	3.76

(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		141,111,195	0.09
	売建		2,082,369	0.00

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	3,886,389	2,048.91	7,962,882,311	2,424.05	9,420,811,749	5.95
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	1,059,100	5,000.30	5,295,826,621	5,683.31	6,019,197,857	3.80
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	750,499	6,956.50	5,220,848,745	7,599.24	5,703,222,021	3.60
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	2,603,988	1,413.07	3,679,622,107	1,586.12	4,130,263,486	2.61
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	481,342	4,214.31	2,028,527,190	4,224.54	2,033,448,533	1.28
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サー ビス	806,150	2,680.59	2,160,963,142	2,117.38	1,706,932,336	1.08
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	532,498	2,684.33	1,429,405,063	2,605.49	1,387,420,876	0.88
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	812,223	1,638.70	1,330,995,394	1,706.28	1,385,885,546	0.87
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	94,486	10,237.42	967,292,942	14,301.34	1,351,276,770	0.85
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,741.64	1,265,009,728	2,756.53	1,271,881,108	0.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	87.23	1,326,145,748	83.31	1,266,592,898	0.80
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	87,370	10,063.00	879,204,544	12,743.17	1,113,370,763	0.70
ブラジル	株式	VALE SA	素材	525,387	2,236.82	1,175,197,199	1,980.30	1,040,425,447	0.66
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	474.92	920,528,122	482.02	934,292,908	0.59
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	143,181	5,838.12	835,908,859	6,402.42	916,705,256	0.58
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・ 娯楽	313,630	1,999.16	626,997,308	2,889.43	906,212,558	0.57
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,058,000	761.05	805,197,532	840.84	889,608,720	0.56
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	351,450	1,766.14	620,712,082	2,461.36	865,047,784	0.55
サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	3,335.62	1,025,810,849	2,712.60	834,212,841	0.53
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	241,804	3,007.10	727,129,808	3,406.65	823,741,959	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	133,027	6,266.65	833,634,957	6,054.95	805,471,834	0.51
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	379,111	3,241.84	1,229,020,903	2,123.12	804,898,525	0.51
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自 動車部品	169,000	3,920.47	662,560,207	4,490.85	758,953,650	0.48
インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	8,689,300	86.15	748,651,022	86.08	748,040,114	0.47
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	728,040	795.46	579,132,416	1,022.81	744,646,713	0.47

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	18,612.87	569,386,398	23,706.23	725,197,331	0.46
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,056,515	70.91	713,128,466	70.70	711,066,006	0.45
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	11,785	33,212.01	391,403,651	59,438.50	700,482,723	0.44
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	359,795	1,580.75	568,746,973	1,866.56	671,579,855	0.42
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	594,100	889.20	528,277,590	1,113.66	661,625,790	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.04
		素材	7.60
		資本財	4.51
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	2.00
		自動車・自動車部品	3.65
		耐久消費財・アパレル	1.27
		消費者サービス	2.60
		メディア・娯楽	6.39
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.53
		生活必需品流通・小売り	1.52
		食品・飲料・タバコ	3.55
		家庭用品・パーソナル用品	0.75
		ヘルスケア機器・サービス	1.02
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.67
		銀行	15.98
		金融サービス	2.60
		保険	2.74
		ソフトウェア・サービス	2.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.55
電気通信サービス	2.68		
公益事業	2.49		
半導体・半導体製造装置	8.66		
不動産管理・開発	1.58		
		小計	95.89
投資信託受益証券			0.29
投資証券			0.08
合計			96.26

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	834	アメリカドル	41,022,571	6,136,156,170	39,844,350	5,959,917,873	3.76

(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	930,000.00	139,026,300	139,032,189	0.09
	ブラジルリアル	買建	70,024.50	2,084,368	2,079,006	0.00
	アメリカドル	売建	13,928.29	2,084,368	2,082,369	0.00

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	543,220,316,450	84.51
地方債証券	日本	32,867,650,860	5.11
特殊債券	日本	36,727,047,864	5.71
社債券	日本	27,259,970,000	4.24
	フランス	1,290,105,000	0.20
	スペイン	398,448,000	0.06
	韓国	99,371,000	0.02
	小計	29,047,894,000	4.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		899,227,405	0.14
合計(純資産総額)		642,762,136,579	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,670,000,000	100.04	6,673,134,900	99.22	6,618,507,600	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,210,000,000	100.15	6,219,794,300	99.78	6,196,524,300	0.005	2026/6/20	0.96
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	6,267,000,000	97.88	6,134,139,600	95.63	5,993,445,450	0.100	2031/12/20	0.93
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.44	5,926,373,000	99.98	5,899,115,000	0.100	2026/9/20	0.92
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,910,000,000	100.08	5,914,728,000	99.59	5,886,300,900	0.005	2026/12/20	0.92
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	99.98	5,809,007,400	99.33	5,771,363,500	0.005	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.81	5,739,075,000	0.100	2027/3/20	0.89
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,670,000,000	100.08	5,675,001,500	99.70	5,653,216,800	0.005	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,440,000,000	100.10	5,445,920,600	99.85	5,431,948,800	0.005	2026/3/20	0.85
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,430,000,000	98.19	5,331,733,000	96.20	5,223,985,800	0.100	2031/6/20	0.81
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	100.30	5,195,603,800	99.54	5,156,534,600	0.100	2027/9/20	0.80
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	100.17	5,169,092,800	99.39	5,128,730,400	0.100	2027/12/20	0.80
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	100.37	5,138,944,000	100.14	5,127,526,400	0.100	2025/9/20	0.80
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	100.33	5,066,665,000	100.15	5,057,777,000	0.100	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.56	5,048,312,800	0.300	2025/12/20	0.79
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,230,000,000	98.21	5,136,876,900	95.66	5,003,018,000	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	98.53	5,084,268,600	96.19	4,963,765,200	0.200	2032/3/20	0.77
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	98.02	4,950,010,000	95.90	4,843,253,000	0.100	2031/9/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,970,000,000	98.81	4,911,312,400	97.14	4,828,007,100	0.100	2030/9/20	0.75
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,010,000,000	98.37	4,928,526,100	95.93	4,806,193,200	0.200	2032/6/20	0.75
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.39	4,818,720,000	100.12	4,805,808,000	0.100	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	99.94	4,832,534,150	99.02	4,787,810,400	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	100.08	4,764,093,600	0.100	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	97.83	4,754,732,400	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	98.43	4,774,063,500	96.49	4,680,104,500	0.100	2031/3/20	0.73

日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,810,000,000	98.55	4,740,410,400	96.80	4,656,512,900	0.100	2030/12/20	0.72
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,720,000,000	99.71	4,706,406,400	98.60	4,654,250,400	0.100	2029/3/20	0.72
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	4,740,000,000	100.79	4,777,800,400	98.05	4,647,854,400	0.500	2032/12/20	0.72
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	4,790,000,000	97.61	4,675,901,000	96.69	4,631,882,100	0.400	2033/6/20	0.72
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	100.85	4,599,124,800	100.59	4,587,314,400	0.400	2025/3/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### □.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.51
地方債証券	5.11
特殊債券	5.71
社債券	4.52
合計	99.86

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国債券インデックスマザーファンド（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（%）
国債証券	アメリカ	33,088,905,207	48.82
	フランス	5,570,481,565	8.22
	イタリア	4,992,498,290	7.37
	中国	4,696,776,325	6.93
	ドイツ	4,373,834,616	6.45
	イギリス	3,333,711,275	4.92
	スペイン	3,296,116,431	4.86
	カナダ	1,385,083,367	2.04
	ベルギー	1,217,087,000	1.80

オーストラリア	1,009,150,267	1.49
オランダ	981,120,350	1.45
オーストリア	806,532,133	1.19
メキシコ	674,976,512	1.00
アイルランド	389,263,588	0.57
マレーシア	371,827,723	0.55
フィンランド	358,982,453	0.53
ポーランド	337,609,656	0.50
シンガポール	305,381,298	0.45
デンマーク	218,311,642	0.32
イスラエル	207,303,375	0.31
ニュージーランド	159,171,276	0.23
スウェーデン	133,017,975	0.20
ノルウェー	113,760,293	0.17
小計	68,020,902,617	100.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	237,973,794	0.35
合計(純資産総額)	67,782,928,823	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	162,277,944	0.24
	買建	ドイツ	149,741,340	0.22

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		70,598,181,757	104.15

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.25% 04/30/28	5,040,000	13,088.43	659,656,985	12,868.55	648,575,140	1.250	2028/4/30	0.96
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	3,700,000	14,564.94	538,903,096	14,428.62	533,859,202	3.125	2025/8/15	0.79
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	3,800,000	14,827.27	563,436,496	13,726.30	521,599,483	3.500	2033/2/15	0.77
アメリカ	国債証券	T 4.25% 10/15/25	3,300,000	15,008.83	495,291,517	14,720.77	485,785,587	4.250	2025/10/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 0.75% 11/15/24	3,000,000	13,964.69	418,940,860	14,207.17	426,215,357	0.750	2024/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	2,910,000	14,380.62	418,476,077	14,448.49	420,451,149	2.250	2024/11/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	2,930,000	14,121.92	413,772,388	13,854.26	405,929,911	2.875	2028/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/28	3,160,000	13,165.37	416,025,919	12,808.95	404,763,009	1.500	2028/11/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.875% 01/15/26	2,670,000	14,653.26	391,242,279	14,600.99	389,846,554	3.875	2026/1/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	12,453.70	397,273,147	11,792.86	376,192,357	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.625% 04/15/25	2,600,000	14,470.73	376,239,084	14,382.46	373,944,157	2.625	2025/4/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	3,160,000	12,452.53	393,500,106	11,718.65	370,309,597	1.375	2031/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	2,610,000	14,203.66	370,715,765	14,127.71	368,733,337	2.250	2025/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	2,500,000	15,298.73	382,468,383	14,425.70	360,642,636	4.125	2032/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	2,730,000	14,105.39	385,077,256	13,128.56	358,409,863	2.875	2032/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	2,500,000	14,527.83	363,195,774	14,110.18	352,754,629	3.125	2027/8/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	2,350,000	14,444.94	339,456,104	13,919.70	327,113,054	3.125	2028/11/15	0.48
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	2,050,000	16,274.91	333,635,706	15,862.75	325,186,530	3.500	2026/4/25	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	2,200,000	14,163.06	311,587,410	14,309.43	314,807,468	1.500	2024/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	2,290,000	13,459.20	308,215,873	13,395.00	306,745,633	1.125	2026/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	12,203.62	320,955,325	11,632.18	305,926,390	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	2,200,000	13,470.38	296,348,364	13,518.29	297,402,435	0.750	2026/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	2,390,000	13,806.78	329,982,093	12,370.73	295,660,528	3.625	2053/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	2,150,000	13,432.40	288,796,617	13,466.87	289,537,798	0.750	2026/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	2,000,000	14,533.21	290,664,322	14,410.51	288,210,277	3.000	2025/7/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	2,000,000	14,006.18	280,123,609	14,203.08	284,061,769	1.000	2024/12/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.25% 06/30/29	2,030,000	14,258.47	289,447,052	13,893.41	282,036,243	3.250	2029/6/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 4% 02/28/30	1,950,000	15,134.66	295,125,899	14,420.44	281,198,713	4.000	2030/2/28	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	2,020,000	13,845.10	279,671,111	13,761.94	277,991,272	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	2,000,000	14,366.53	287,330,661	13,824.46	276,489,281	2.750	2028/2/15	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.35
合計	100.35

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。



## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	4	アメリカドル	426,214.34	63,753,140	420,812.52	62,945,136	0.09
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	3	アメリカドル	331,633.41	49,605,725	323,578.14	48,400,818	0.07
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	3	アメリカドル	361,602.15	54,088,450	340,500	50,931,990	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	2	ユーロ	210,654.2	33,283,363	209,570	33,112,060	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	2	ユーロ	233,564.2	36,903,144	229,800	36,308,400	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	4	ユーロ	524,178.4	82,820,187	508,360	80,320,880	0.12

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	228,640,000.00	33,140,688,180	34,166,338,254	50.41
	カナダドル	売建	12,998,000.00	1,395,234,296	1,438,090,921	2.12
	メキシコペソ	売建	83,629,000.00	708,836,131	711,038,845	1.05
	ユーロ	売建	146,176,000.00	22,991,986,623	23,078,836,966	34.05
	イギリスポンド	売建	18,885,000.00	3,465,732,192	3,443,789,281	5.08
	スウェーデンクローナ	売建	9,943,000.00	131,469,862	136,004,330	0.20
	ノルウェークローネ	売建	8,349,000.00	113,885,447	116,204,721	0.17
	デンマーククローネ	売建	10,857,000.00	229,159,068	229,891,546	0.34
	ポーランドズロチ	売建	10,050,000.00	352,462,545	341,970,345	0.50
	オーストラリアドル	売建	10,887,000.00	1,022,869,288	1,044,983,251	1.54
	ニュージーランドドル	売建	1,852,000.00	160,032,009	165,018,570	0.24
	シンガポールドル	売建	2,870,000.00	308,180,673	313,963,074	0.46
	マレーシアリングット	売建	11,944,000.00	374,229,408	380,067,635	0.56
	イスラエルシェケル	売建	5,619,000.00	214,244,041	218,968,496	0.32
	オフショア人民元	売建	235,376,000.00	4,694,718,702	4,813,015,522	7.10

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	136,295,760,998	47.24
	フランス	23,029,341,708	7.98
	イタリア	20,634,945,803	7.15
	中国	19,975,212,680	6.92
	ドイツ	18,085,458,700	6.27
	イギリス	13,764,787,117	4.77
	スペイン	13,642,998,617	4.73
	カナダ	5,722,573,043	1.98
	ベルギー	5,022,933,433	1.74
	オーストラリア	4,182,340,816	1.45
	オランダ	4,065,255,590	1.41
	オーストリア	3,329,965,323	1.15
	メキシコ	2,769,744,057	0.96
	アイルランド	1,615,756,221	0.56
	マレーシア	1,501,068,817	0.52
	フィンランド	1,471,495,150	0.51
	ポーランド	1,400,205,994	0.49
	シンガポール	1,275,634,660	0.44
	デンマーク	888,942,515	0.31
	イスラエル	873,457,768	0.30
ニュージーランド	644,822,300	0.22	
スウェーデン	562,179,424	0.19	
ノルウェー	464,009,058	0.16	
	小計	281,218,889,792	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,304,284,091	2.53
合計(純資産総額)		288,523,173,883	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,958,951,163	0.68
	買建	ドイツ	1,741,449,930	0.60

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		4,441,014,672	1.54

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,155.53	2,121,774,401	14,425.70	2,019,598,769	4.125	2032/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	13,800,000	13,736.23	1,895,600,456	12,951.52	1,787,310,395	2.750	2032/8/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,036.85	1,640,908,464	13,787.06	1,611,708,372	2.375	2027/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,363.57	1,555,337,132	11,718.65	1,474,207,190	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,455.55	1,474,466,483	14,428.62	1,471,719,964	3.125	2025/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	14,395.32	1,461,125,190	14,448.49	1,466,522,051	2.250	2024/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,840.21	1,504,873,313	12,148.11	1,423,759,237	1.875	2032/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	14,228.54	1,431,391,500	13,854.26	1,393,738,881	2.875	2028/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,969.02	1,430,299,003	11,474.42	1,371,193,441	0.625	2030/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,901.59	1,404,060,716	13,128.56	1,325,985,211	2.875	2032/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,158.92	1,355,720,222	11,632.18	1,296,988,313	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	13,534.06	1,285,736,512	13,466.87	1,279,353,066	0.750	2026/4/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	14,230.55	1,252,288,438	14,309.43	1,259,229,874	1.500	2024/11/30	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	8,850,000	14,285.65	1,264,280,070	14,110.18	1,248,751,390	3.125	2027/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.375% 09/30/27	9,880,000	12,798.43	1,264,485,748	12,616.72	1,246,532,171	0.375	2027/9/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,500,000	14,288.10	1,214,488,804	14,384.91	1,222,718,186	1.500	2024/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,853.65	1,233,950,866	12,637.17	1,213,168,590	0.625	2027/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	14,288.39	1,208,798,289	14,302.71	1,210,009,359	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	13,023.10	1,237,194,583	12,703.49	1,206,831,593	1.250	2028/9/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	14,060.81	1,195,169,031	14,111.93	1,199,514,741	1.125	2025/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	14,351.20	1,205,501,440	13,919.70	1,169,255,176	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,828.44	1,205,552,214	14,331.04	1,165,114,323	3.875	2029/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	13,056.35	1,175,071,527	12,800.48	1,152,043,542	1.250	2028/6/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	8,000,000	14,102.58	1,128,207,150	14,203.08	1,136,247,075	1.000	2024/12/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,802.55	1,104,204,239	13,861.27	1,108,901,984	0.375	2025/4/30	0.38
中国	国債証券	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000	2,039.23	1,098,533,677	2,039.75	1,098,815,166	1.990	2025/4/9	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	8,480,000	13,167.13	1,116,572,632	12,900.69	1,093,978,575	1.250	2028/3/31	0.38

アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	12,299.74	1,135,266,132	11,685.93	1,078,612,031	1.250	2031/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/31/28	8,500,000	12,905.07	1,096,931,203	12,672.23	1,077,139,603	0.750	2028/1/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.375% 01/31/26	8,000,000	13,487.90	1,079,032,725	13,458.10	1,076,648,791	0.375	2026/1/31	0.37

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.47
合計	97.47

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	53	アメリカドル	5,603,757.88	838,210,103	5,575,765.89	834,023,061	0.29
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	35	アメリカドル	3,815,098.11	570,662,375	3,775,078.3	564,676,212	0.20
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	33	アメリカドル	3,865,467.4	578,196,614	3,745,500	560,251,890	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	21	ユーロ	2,206,364.1	348,605,528	2,200,485	347,676,630	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,134,706.7	495,283,658	3,102,300	490,163,400	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	45	ユーロ	5,838,044.5	922,411,031	5,719,050	903,609,900	0.31

(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	15,120,000.00	2,235,617,426	2,255,347,584	0.78
	カナダドル	買建	1,560,000.00	170,714,345	172,309,488	0.06
	ユーロ	買建	9,330,000.00	1,468,049,736	1,471,070,430	0.51
	イギリスポンド	買建	1,250,000.00	227,459,959	227,545,625	0.08

オフショア人民元	買建	15,410,000.00	311,822,851	314,741,545	0.11
----------	----	---------------	-------------	-------------	------

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

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

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	中国	11,646,372,512	10.04
	マレーシア	11,632,346,330	10.03
	ブラジル	11,476,759,996	9.90
	タイ	11,446,772,626	9.87
	メキシコ	11,435,630,937	9.86
	インドネシア	11,414,270,498	9.84
	南アフリカ	9,498,521,027	8.19
	ポーランド	8,170,937,822	7.05
	チェコ	6,971,222,746	6.01
	コロンビア	4,851,770,022	4.18
	ルーマニア	4,247,506,230	3.66
	ハンガリー	3,521,870,154	3.04
	ペルー	2,754,539,801	2.38
	チリ	2,253,273,866	1.94
	ウルグアイ	253,390,925	0.22
	ドミニカ共和国	186,702,641	0.16
フィリピン	75,412,227	0.07	
	小計	111,837,300,360	96.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,126,008,624	3.56
	合計(純資産総額)	115,963,308,984	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		2,352,750,725	2.03
	売建		455,205,200	0.39

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.12	2,041,892,301	3.44	2,251,749,199	9.850	2027/6/28	1.94
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,064.82	1,579,594,612	2,356.57	1,802,783,204	0.000	2026/1/1	1.55
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,227.77	1,737,662,192	2,236.58	1,744,539,438	0.000	2026/7/1	1.50
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	212,400,000	829.45	1,761,752,777	805.61	1,711,117,127	10.500	2026/12/21	1.48
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000	2,872.74	1,588,629,853	2,937.13	1,624,234,595	10.000	2025/1/1	1.40
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	50,400,000	2,767.63	1,394,886,037	2,894.93	1,459,046,415	10.000	2027/1/1	1.26
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	49,700,000	2,772.65	1,378,010,370	2,812.04	1,397,587,001	10.000	2029/1/1	1.21
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	757.16	1,327,313,110	763.53	1,338,482,146	5.750	2026/3/5	1.15
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	764.59	1,346,454,004	746.45	1,314,503,906	7.750	2031/5/29	1.13
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	190,600,000	693.86	1,322,500,053	680.38	1,296,806,662	8.000	2030/1/31	1.12
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	45,100,000,000	2.41	1,090,834,148	2.59	1,172,532,531	7.250	2034/10/18	1.01
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	792.20	1,101,165,117	776.42	1,079,224,241	7.500	2027/6/3	0.93
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	821.47	1,054,771,876	826.98	1,061,850,969	8.000	2024/9/5	0.92
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000	671.21	1,110,856,234	634.73	1,050,485,267	8.250	2032/3/31	0.91
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	41,300,000	2,206.43	911,256,000	2,488.69	1,027,832,045	0.000	2025/7/1	0.89
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	37,250,000	2,474.16	921,625,693	2,739.79	1,020,574,477	0.000	2024/7/1	0.88
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000	2,797.31	959,480,459	2,904.27	996,167,371	2.632	2031/4/15	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	615.11	1,117,656,353	537.74	977,077,032	8.750	2048/2/28	0.84
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	665.16	1,004,405,628	611.97	924,089,196	8.875	2035/2/28	0.80
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,194.00	916,679,992	3,208.54	920,851,980	3.955	2025/9/15	0.79
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	105,600,000	815.97	861,673,209	794.37	838,863,685	8.500	2029/5/31	0.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	617.88	900,261,990	566.47	825,347,081	8.500	2037/1/31	0.71
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	36,900,000,000	2.08	768,801,513	2.23	823,153,173	7.250	2050/10/26	0.71
マレーシア	国債証券	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000	2,862.01	782,760,525	2,990.46	817,891,841	3.757	2040/5/22	0.71
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	408.30	829,261,602	401.92	816,306,758	2.125	2026/12/17	0.70
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	109,000,000	741.71	808,473,721	731.97	797,849,863	5.500	2027/3/4	0.69

ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	2,522.92	658,482,620	2,945.53	768,783,484	2.750	2029/10/25	0.66
タイ	国債証券	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000	435.85	784,546,254	425.32	765,591,828	3.775	2032/6/25	0.66
タイ	国債証券	THAIGB 4.875% 06/22/29	169,500,000	456.35	773,524,128	451.26	764,890,495	4.875	2029/6/22	0.66
ポーランド	国債証券	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000	3,050.34	703,104,421	3,303.71	761,507,447	3.250	2025/7/25	0.66

(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	96.44
合計	96.44

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの


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	7,000,000.00	1,046,220,000	1,046,373,300	0.90
	メキシコペソ	買建	50,000,000.00	425,368,500	425,290,000	0.37
	チェココルナ	買建	60,000,000.00	389,508,000	389,166,000	0.34
	ハンガリーフォリント	買建	325,000,000.00	130,994,500	130,807,625	0.11
	南アフリカランド	買建	46,000,000.00	361,155,200	361,113,800	0.31
	ポーランドズロチ	売建	8,500,000.00	289,289,000	289,362,100	0.25
	マレーシアリングgit	売建	2,000,000.00	63,587,400	63,641,600	0.05
	オフショア人民元	売建	5,000,000.00	102,237,500	102,201,500	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。

#### 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：2019年3月20日  
作成基準日：2023年9月29日

**DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030**
**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	12,770円
純資産総額	26.79億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

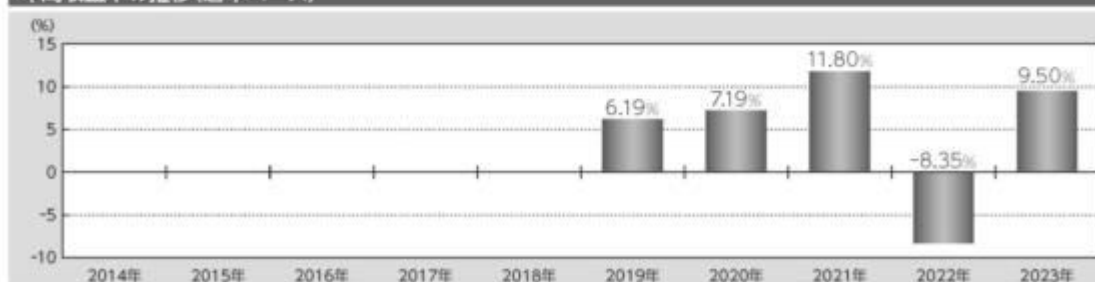
決算期	分配金
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
2023年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	34.7%
外国株式インデックス マザーファンド	26.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	13.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.1%
外国債券インデックス マザーファンド	6.3%
国内債券インデックス マザーファンド	6.3%
国内株式インデックス マザーファンド	4.5%

※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)**


※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までまでの収益率です。

※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。



当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2023年9月29日

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040

## 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 13,619円

純資産総額 20.65億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
2023年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

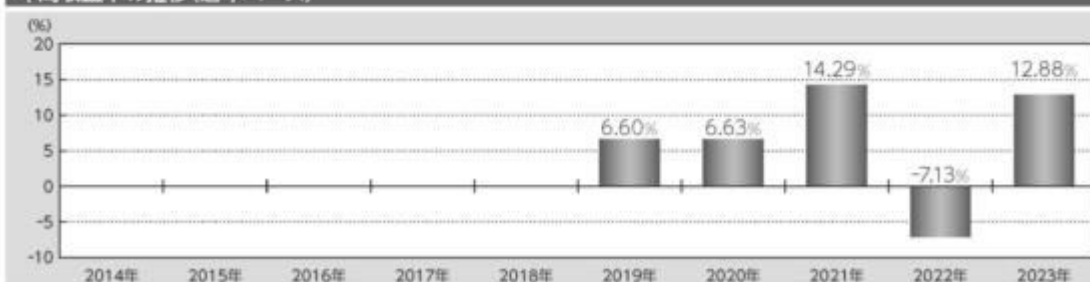
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	33.0%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	20.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.5%
外国債券インデックス マザーファンド	11.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	7.9%
国内株式インデックス マザーファンド	5.7%
国内債券インデックス マザーファンド	4.6%

※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)




※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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


**運用実績**

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2023年9月29日

**DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050****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 14,398円

純資産総額 7.87億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

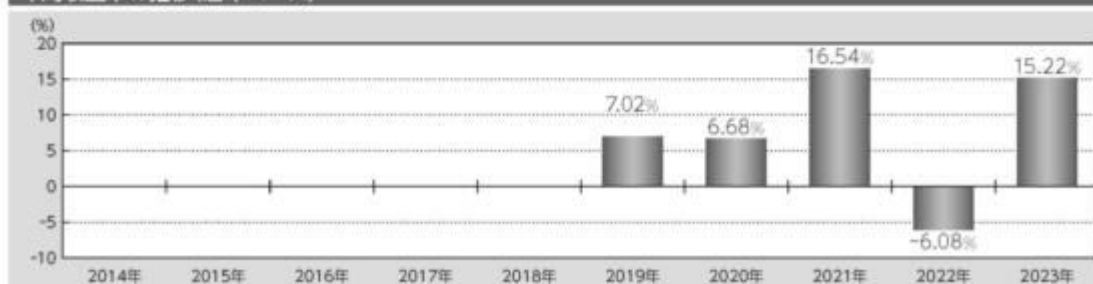
決算期	分配金
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
2023年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	37.0%
新興国株式インデックス マザーファンド	18.5%
外国債券インデックス マザーファンド	14.1%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	11.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.3%
国内株式インデックス マザーファンド	6.3%
国内債券インデックス マザーファンド	3.5%

※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)**

※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

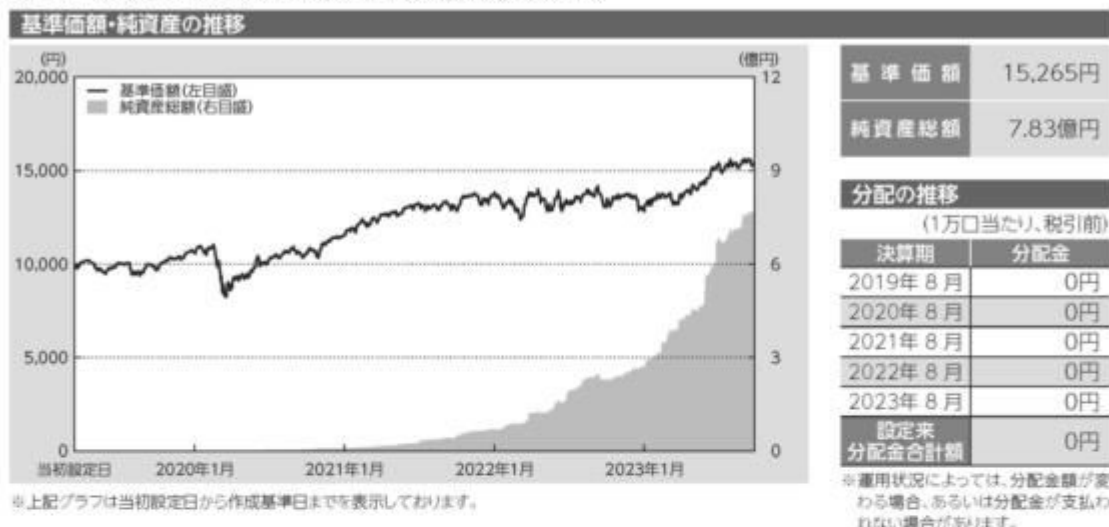
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2019年3月20日

作成基準日：2023年9月29日

## DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060

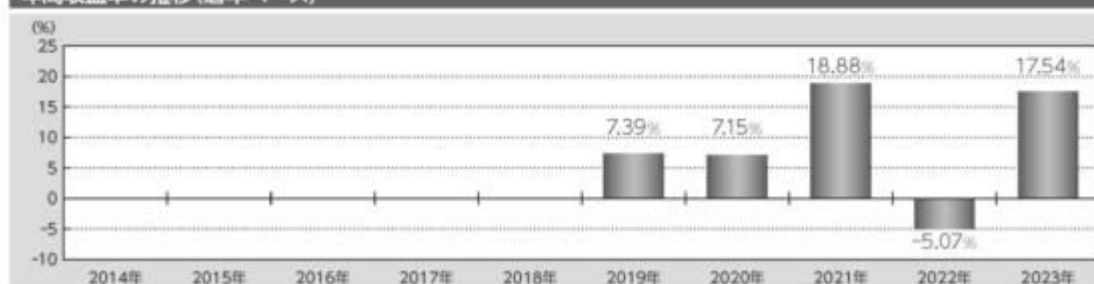


## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	40.9%
新興国株式インデックス マザーファンド	20.4%
外国債券インデックス マザーファンド	17.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	8.8%
国内株式インデックス マザーファンド	7.0%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	2.6%
国内債券インデックス マザーファンド	2.3%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2019年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## &lt; 申込手続 &gt;

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、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。

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

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日又はその翌営業日下記のうちいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を

受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

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  
計算日の基準価額で評価します。

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

#### ・国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

#### ・外貨建資産等の円換算

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

### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### （2）【保管】

該当事項はありません。

### （3）【信託期間】

無期限とします。（2019年 3月20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8月29日から翌年8月28日までとします。

ただし、第1計算期間は2019年3月20日から2019年8月28日までとします。

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

#### （５）【その他】

##### < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

###### (1) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

###### (2) 投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

##### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

###### (1) 投資信託約款の変更等



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

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

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

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

## (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

て取得申込者とします。)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。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,384,350	26,888,615
親投資信託受益証券	761,957,083	2,619,172,926
未収入金	776,715	3,413,165
流動資産合計	771,118,148	2,649,474,706
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	492,227	809,968
未払受託者報酬	112,082	373,971
未払委託者報酬	896,654	2,804,693
未払利息	14	62
その他未払費用	13,952	46,675
流動負債合計	1,514,929	4,035,369
負債合計	1,514,929	4,035,369
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	623,686,255	2,048,602,264
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	145,916,964	596,837,073
(分配準備積立金)	12,369,612	105,647,214
元本等合計	769,603,219	2,645,439,337
純資産合計	769,603,219	2,645,439,337
負債純資産合計	771,118,148	2,649,474,706

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第4期		第5期	
	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日		自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日	
営業収益				
受取配当金		398,807		-
受取利息		28		21
有価証券売買等損益		4,997,591		100,881,927
営業収益合計		5,396,426		100,881,948
営業費用				
支払利息		1,256		8,147
受託者報酬		160,423		562,927
委託者報酬		1,331,658		4,221,796
その他費用		19,935		70,232
営業費用合計		1,513,272		4,863,102
営業利益又は営業損失 ( )		3,883,154		96,018,846
経常利益又は経常損失 ( )		3,883,154		96,018,846
当期純利益又は当期純損失 ( )		3,883,154		96,018,846
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 ( )		392,856		421,018
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		33,037,864		145,916,964
剰余金増加額又は欠損金減少額		114,976,720		375,578,891
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		114,976,720		375,578,891
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,373,630		21,098,646
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,373,630		21,098,646
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		145,916,964		596,837,073

## （ 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2022年 8月30日から2023年 8月28日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	623,686,255口	2,048,602,264口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2340円 (12,340円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2913円 (12,913円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日			第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	6,425,084円	費用控除後の配当等収益額	A	30,297,851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	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	64,205,983円
収益調整金額	C	133,547,352円	収益調整金額	C	491,189,859円
分配準備積立金額	D	5,944,528円	分配準備積立金額	D	11,143,380円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	145,916,964円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	596,837,073円
当ファンドの期末残存口数	F	623,686,255口	当ファンドの期末残存口数	F	2,048,602,264口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,339円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,913円
1万口当たり分配金額	H	- 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	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2023年 8月28日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------



## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	135,117,706円	623,686,255円
期中追加設定元本額	515,248,447円	1,516,926,128円
期中一部解約元本額	26,679,898円	92,010,119円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2022年 8月29日現在)	(2023年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	15,694,603	90,964,952
合計	15,694,603	90,964,952

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	91,140,738	352,058,442	
	国内株式インデックス マザーファンド	49,952,698	116,734,459	
	外国株式インデックス マザーファンド	135,658,380	699,061,197	
	国内債券インデックス マザーファンド	124,041,741	166,091,891	
	外国債券インデックス マザーファンド	50,638,400	167,273,826	
	新興国債券インデックス マザーファンド	88,568,138	189,172,685	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	1,122,528,918	928,780,426	
合計		1,662,529,013	2,619,172,926	

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,556,225	19,799,276
親投資信託受益証券	529,787,662	1,988,909,027
未収入金	612,389	10,674,280
流動資産合計	536,956,276	2,019,382,583
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,114,307	8,090,735
未払受託者報酬	81,013	288,014
未払委託者報酬	649,536	2,160,006
未払利息	10	45
その他未払費用	10,075	35,937
流動負債合計	1,854,941	10,574,737
負債合計	1,854,941	10,574,737
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	418,694,806	1,462,913,955
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	116,406,529	545,893,891
(分配準備積立金)	14,789,422	120,809,390
元本等合計	535,101,335	2,008,807,846
純資産合計	535,101,335	2,008,807,846
負債純資産合計	536,956,276	2,019,382,583

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2021年 8月31日	自	2022年 8月30日
	至	2022年 8月29日	至	2023年 8月28日
営業収益				
受取配当金		151,011		-
受取利息		16		18
有価証券売買等損益		11,078,745		112,257,561
営業収益合計		11,229,772		112,257,579
営業費用				
支払利息		753		5,999
受託者報酬		110,113		426,144
委託者報酬		911,376		3,195,966
その他費用		13,646		53,143
営業費用合計		1,035,888		3,681,252
営業利益又は営業損失（ ）		10,193,884		108,576,327
経常利益又は経常損失（ ）		10,193,884		108,576,327
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,193,884		108,576,327
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（ ）		142,445		1,467,342
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		22,812,778		116,406,529
剰余金増加額又は欠損金減少額		87,909,937		338,539,761
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		87,909,937		338,539,761
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,367,625		16,161,384
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,367,625		16,161,384
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		116,406,529		545,893,891

## (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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2022年 8月30日から2023年 8月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	418,694,806口	1,462,913,955口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2780円 (12,780円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3732円 (13,732円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日			第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,358,748円	費用控除後の配当等収益額	A	23,863,169円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,692,691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	83,245,816円
収益調整金額	C	101,617,107円	収益調整金額	C	425,084,501円
分配準備積立金額	D	4,737,983円	分配準備積立金額	D	13,700,405円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	116,406,529円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	545,893,891円
当ファンドの期末残存口数	F	418,694,806口	当ファンドの期末残存口数	F	1,462,913,955口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,780円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,731円
1万口当たり分配金額	H	- 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	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2023年 8月28日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	87,264,176円	418,694,806円
期中追加設定元本額	348,173,003円	1,102,286,989円
期中一部解約元本額	16,742,373円	58,067,840円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2022年 8月29日現在)	(2023年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	15,458,593	106,483,482
合計	15,458,593	106,483,482

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	85,863,881	331,674,999	
	国内株式インデックス マザーファンド	47,346,435	110,643,883	
	外国株式インデックス マザーファンド	127,801,690	658,574,888	
	国内債券インデックス マザーファンド	68,675,304	91,956,232	
	外国債券インデックス マザーファンド	67,652,859	223,477,689	
	新興国債券インデックス マザーファンド	74,725,221	159,605,599	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	499,124,652	412,975,737	
合計		971,190,042	1,988,909,027	

(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。



## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,205,488	9,255,988
親投資信託受益証券	179,969,007	750,894,420
未収入金	1,368,123	1,921,379
流動資産合計	183,542,618	762,071,787
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,505,122	2,724,160
未払受託者報酬	28,763	109,740
未払委託者報酬	230,917	822,975
未払利息	3	21
その他未払費用	3,531	13,653
流動負債合計	1,768,336	3,670,549
負債合計	1,768,336	3,670,549
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	137,218,170	523,372,419
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	44,556,112	235,028,819
(分配準備積立金)	6,120,706	54,976,360
元本等合計	181,774,282	758,401,238
純資産合計	181,774,282	758,401,238
負債純資産合計	183,542,618	762,071,787

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2021年 8月31日	自	2022年 8月30日
	至	2022年 8月29日	至	2023年 8月28日
営業収益				
受取配当金		36,949		-
受取利息		4		5
有価証券売買等損益		4,804,345		52,177,533
営業収益合計		4,841,298		52,177,538
営業費用				
支払利息		232		2,168
受託者報酬		41,667		158,980
委託者報酬		346,929		1,192,184
その他費用		5,081		19,749
営業費用合計		393,909		1,373,081
営業利益又は営業損失（ ）		4,447,389		50,804,457
経常利益又は経常損失（ ）		4,447,389		50,804,457
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,447,389		50,804,457
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（ ）		30,013		1,244,150
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,982,537		44,556,112
剰余金増加額又は欠損金減少額		35,887,760		152,033,203
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		35,887,760		152,033,203
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,791,587		11,120,803
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,791,587		11,120,803
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		44,556,112		235,028,819

## （ 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2022年 8月30日から2023年 8月28日までとなっております。

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,218,170口	523,372,419口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3247円 (13,247円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4491円 (14,491円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日			第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,102,478円	費用控除後の配当等収益額	A	9,210,178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	2,374,924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	40,350,129円
収益調整金額	C	38,435,406円	収益調整金額	C	180,052,459円
分配準備積立金額	D	1,643,304円	分配準備積立金額	D	5,416,053円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	44,556,112円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	235,028,819円
当ファンドの期末残存口数	F	137,218,170口	当ファンドの期末残存口数	F	523,372,419口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,247円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,490円
1万口当たり分配金額	H	- 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	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2023年 8月28日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	35,103,038円	137,218,170円
期中追加設定元本額	122,053,912円	420,238,869円
期中一部解約元本額	19,938,780円	34,084,620円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2022年 8月29日現在)	(2023年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,537,154	49,981,741
合計	5,537,154	49,981,741

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	36,334,941	140,354,610	
	国内株式インデックス マザーファンド	19,807,783	46,288,808	
	外国株式インデックス マザーファンド	54,086,868	278,715,039	
	国内債券インデックス マザーファンド	19,710,059	26,391,769	
	外国債券インデックス マザーファンド	32,414,941	107,076,274	
	新興国債券インデックス マザーファンド	29,971,159	64,015,398	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	106,420,743	88,052,522	
合計		298,746,494	750,894,420	

(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。

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2022年8月30日から2023年8月28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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,119,402	7,500,906
親投資信託受益証券	233,722,733	711,356,467
未収入金	5,959,281	3,080,396
流動資産合計	242,801,416	721,937,769
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,433,954	2,461,110
未払受託者報酬	33,368	117,091
未払委託者報酬	268,065	878,095
未払利息	5	17
その他未払費用	4,118	14,569
流動負債合計	6,739,510	3,470,882
負債合計	6,739,510	3,470,882
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	171,309,984	468,480,984
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	64,751,922	249,985,903
(分配準備積立金)	8,213,486	65,470,038
元本等合計	236,061,906	718,466,887
純資産合計	236,061,906	718,466,887
負債純資産合計	242,801,416	721,937,769

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2021年 8月31日	自	2022年 8月30日
	至	2022年 8月29日	至	2023年 8月28日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		3,273		-
受取利息		9		16
有価証券売買等損益		8,070,622		63,672,877
<b>営業収益合計</b>		<b>8,073,904</b>		<b>63,672,893</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		372		2,981
受託者報酬		46,943		175,189
委託者報酬		390,173		1,313,712
その他費用		5,757		21,767
<b>営業費用合計</b>		<b>443,245</b>		<b>1,513,649</b>
営業利益又は営業損失（ ）		7,630,659		62,159,244
経常利益又は経常損失（ ）		7,630,659		62,159,244
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,630,659		62,159,244
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（ ）		626,828		2,549,318
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,017,604		64,751,922
剰余金増加額又は欠損金減少額		58,862,038		157,607,246
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		58,862,038		157,607,246
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,131,551		31,983,191
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,131,551		31,983,191
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,751,922		249,985,903



## （ 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	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月29日から翌年8月28日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は2022年 8月30日から2023年 8月28日までとなっております。

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

	第4期 (2022年 8月29日現在)	第5期 (2023年 8月28日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	171,309,984口	468,480,984口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3780円 (13,780円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5336円 (15,336円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第4期 自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日			第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,576,495円	費用控除後の配当等収益額	A	10,230,026円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,427,336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	49,379,900円
収益調整金額	C	56,538,436円	収益調整金額	C	184,515,865円
分配準備積立金額	D	1,209,655円	分配準備積立金額	D	5,860,112円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	64,751,922円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	249,985,903円
当ファンドの期末残存口数	F	171,309,984口	当ファンドの期末残存口数	F	468,480,984口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,779円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,336円
1万口当たり分配金額	H	- 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	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第5期 (2023年 8月28日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第4期	第5期
	自 2021年 8月31日 至 2022年 8月29日	自 2022年 8月30日 至 2023年 8月28日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	28,842,973円	171,309,984円
期中追加設定元本額	173,520,838円	382,072,598円
期中一部解約元本額	31,053,827円	84,901,598円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第4期	第5期
	(2022年 8月29日現在)	(2023年 8月28日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	7,499,251	60,926,764
合計	7,499,251	60,926,764

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	38,117,293	147,239,479	
	国内株式インデックス マザーファンド	20,901,128	48,843,846	
	外国株式インデックス マザーファンド	56,761,933	292,499,916	
	国内債券インデックス マザーファンド	12,259,946	16,416,067	
	外国債券インデックス マザーファンド	37,210,233	122,916,562	
	新興国債券インデックス マザーファンド	30,058,213	64,201,337	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	23,252,672	19,239,260	
合計		218,561,418	711,356,467	

(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 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,047,038,086
株式	563,150,268,210
派生商品評価勘定	37,266,750
未収配当金	725,914,205
差入委託証拠金	176,285,000
流動資産合計	567,136,772,251
資産合計	567,136,772,251
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,656,000
前受金	35,648,700
未払解約金	227,452,798
未払利息	7,059
流動負債合計	264,764,557
負債合計	264,764,557
純資産の部	
元本等	

	2023年 8月28日現在
項目	金額（円）
元本	242,575,517,919
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	324,296,489,775
元本等合計	566,872,007,694
純資産合計	566,872,007,694
負債純資産合計	567,136,772,251

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,575,517,919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 2.3369円 (1万口当たり純資産額) (23,369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 8月28日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月28日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	263,768,603,358円
期中追加設定元本額	20,721,755,794円
期中一部解約元本額	41,914,841,233円
期末元本額	242,575,517,919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）	332,593,078円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,486,085,001円
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,990,817円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,116,107,298円
世界経済インデックスファンド	4,900,989,949円
日本株式インデックス・オープン	3,021,354,539円
D C マイセレクション 2 5	5,497,274,833円
D C マイセレクション 5 0	17,705,457,671円
D C マイセレクション 7 5	18,515,157,521円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,028,994,993円
D C マイセレクション S 2 5	3,222,398,306円
D C マイセレクション S 5 0	9,500,956,859円
D C マイセレクション S 7 5	8,108,901,990円
D C 日本株式インデックス・オープン S	9,051,054,577円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	91,652,195円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	608,900,394円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	477,457,706円
D C 世界経済インデックスファンド	3,711,755,483円
日本株式インデックス・オープン（S M A 専用）	917,307,072円

区分	2023年 8月28日現在
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,668,401円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,059,381円
マイセクション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）	158,838,737円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,072,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,934,767円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	74,059,921円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,846,659円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	48,815,045円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	589,565,943円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	331,236,638円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,233,427,557円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	31,095,300円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	13,271,382円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	347,672,809円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	197,609,005円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	259,729,075円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	21,497,122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）	445,671,710円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,619,327,787円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,211,605円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,241,824,743円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドA	1,573,611,795円
分散投資コア戦略ファンドS	5,972,815,479円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	571,977,177円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	400,775,302円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,015,004円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,636,618円
SMT インデックスバランス・オープン	50,699,263円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,121,035,850円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,794,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,807,474円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	204,018,030円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	35,285,667円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,690,962円
グローバル経済コア	212,980,116円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,481,974円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	961,457,378円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	26,944,114円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	980,337,953円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	232,177,734円



区分	2023年 8月28日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	49,952,698円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	47,346,435円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,807,783円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	20,901,128円
10資産分散投資ファンド	93,091,386円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,498,863,771円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	523,395,403円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	295,613,559円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,756,390円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	614,567,203円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,315,612,423円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,369,143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）	204,617,803円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		33,791,217,923
合計		33,791,217,923

(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 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,527,026,300	-	3,562,675,000	35,648,700
合計		3,527,026,300	-	3,562,675,000	35,648,700

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

第1 有価証券明細表  
(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,100	3,790.00	34,489,000	
ニッスイ	241,400	770.90	186,095,260	
マルハニチロ	35,800	2,544.50	91,093,100	
雪国まいたけ	20,600	897.00	18,478,200	
カネコ種苗	7,400	1,403.00	10,382,200	
サカタのタネ	27,500	4,035.00	110,962,500	
ホクト	21,500	1,840.00	39,560,000	
ホクリヨウ	2,300	1,026.00	2,359,800	
住石ホールディングス	25,000	372.00	9,300,000	
日鉄鉱業	9,700	5,000.00	48,500,000	
三井松島ホールディングス	10,900	2,769.00	30,182,100	
I N P E X	892,800	2,038.50	1,819,972,800	
石油資源開発	28,000	4,705.00	131,740,000	
K & O エナジーグループ	10,900	2,431.00	26,497,900	
ショーボンドホールディングス	32,900	5,864.00	192,925,600	
ミライト・ワン	79,800	1,902.50	151,819,500	
タマホーム	15,200	3,475.00	52,820,000	
サンヨーホームズ	1,900	722.00	1,371,800	
日本アクア	6,700	1,050.00	7,035,000	
ファーストコーポレーション	4,100	752.00	3,083,200	
ベステラ	3,500	1,103.00	3,860,500	
Robot Home	46,900	197.00	9,239,300	
キャンディル	2,900	617.00	1,789,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,276.00	4,210,800	
第一カッター興業	6,200	1,280.00	7,936,000	
安藤・間	139,900	1,174.00	164,242,600	
東急建設	68,700	758.00	52,074,600	
コムシスホールディングス	77,100	3,075.00	237,082,500	
ピーアールホールディングス	38,300	385.00	14,745,500	
高松コンストラクショングループ	15,700	2,581.00	40,521,700	
東建コーポレーション	6,900	7,700.00	53,130,000	
ソネック	1,700	987.00	1,677,900	
ヤマウラ	12,200	1,228.00	14,981,600	
オリエンタル白石	86,800	328.00	28,470,400	
大成建設	158,000	4,854.00	766,932,000	
大林組	603,900	1,311.50	792,014,850	
清水建設	478,800	979.80	469,128,240	

飛島建設	18,600	1,301.00	24,198,600
長谷工コーポレーション	174,300	1,794.00	312,694,200
松井建設	15,800	756.00	11,944,800
銭高組	1,400	3,970.00	5,558,000
鹿島建設	374,400	2,411.00	902,678,400
不動テトラ	11,700	1,842.00	21,551,400
大末建設	4,100	1,460.00	5,986,000
鉄建建設	12,100	2,015.00	24,381,500
西松建設	28,600	3,688.00	105,476,800
三井住友建設	136,200	399.00	54,343,800
大豊建設	7,000	3,975.00	27,825,000
佐田建設	7,200	472.00	3,398,400
ナカノフドー建設	8,000	388.00	3,104,000
奥村組	27,400	4,480.00	122,752,000
東鉄工業	23,200	2,706.00	62,779,200
イチケン	2,500	2,063.00	5,157,500
富士ピー・エス	5,000	461.00	2,305,000
浅沼組	13,500	3,505.00	47,317,500
戸田建設	207,700	812.60	168,777,020
熊谷組	28,300	3,255.00	92,116,500
北野建設	2,100	3,050.00	6,405,000
植木組	3,200	1,520.00	4,864,000
矢作建設工業	23,000	1,269.00	29,187,000
ピーエス三菱	21,400	788.00	16,863,200
日本ハウスホールディングス	36,100	370.00	13,357,000
新日本建設	23,700	1,194.00	28,297,800
東亜道路工業	6,700	4,960.00	33,232,000
日本道路	3,400	9,400.00	31,960,000
東亜建設工業	14,500	3,565.00	51,692,500
日本国土開発	48,000	611.00	29,328,000
若築建設	7,500	3,045.00	22,837,500
東洋建設	56,200	1,086.00	61,033,200
五洋建設	239,400	868.70	207,966,780
世紀東急工業	21,700	1,603.00	34,785,100
福田組	6,300	4,625.00	29,137,500
住友林業	145,800	3,977.00	579,846,600
日本基礎技術	6,800	487.00	3,311,600
巴コーポレーション	12,600	534.00	6,728,400
大和ハウス工業	466,900	4,040.00	1,886,276,000
ライト工業	31,300	2,034.00	63,664,200
積水ハウス	511,900	2,934.00	1,501,914,600
日特建設	16,100	1,078.00	17,355,800

北陸電気工事	11,600	936.00	10,857,600
ユアテック	37,200	941.00	35,005,200
日本リーテック	14,800	1,269.00	18,781,200
四電工	7,100	2,368.00	16,812,800
中電工	26,200	2,371.00	62,120,200
関電工	92,500	1,324.00	122,470,000
きんでん	118,900	1,985.50	236,075,950
東京エネシス	16,800	991.00	16,648,800
トーエネック	5,600	4,025.00	22,540,000
住友電設	16,100	2,927.00	47,124,700
日本電設工業	27,700	2,117.00	58,640,900
エクシオグループ	77,800	3,085.00	240,013,000
新日本空調	9,400	2,424.00	22,785,600
九電工	41,100	4,496.00	184,785,600
三機工業	37,400	1,638.00	61,261,200
日揮ホールディングス	167,000	1,954.00	326,318,000
中外炉工業	5,500	2,035.00	11,192,500
ヤマト	9,400	906.00	8,516,400
太平電業	10,500	3,770.00	39,585,000
高砂熱学工業	40,700	2,922.00	118,925,400
三晃金属工業	1,400	4,095.00	5,733,000
朝日工業社	7,000	2,363.00	16,541,000
明星工業	29,000	950.00	27,550,000
大気社	19,500	4,560.00	88,920,000
ダイダン	11,100	2,990.00	33,189,000
日比谷総合設備	14,400	2,202.00	31,708,800
フィル・カンパニー	3,000	777.00	2,331,000
テスホールディングス	37,400	547.00	20,457,800
インフロニア・ホールディングス	176,900	1,501.50	265,615,350
東洋エンジニアリング	22,300	624.00	13,915,200
レイズネクスト	24,400	1,411.00	34,428,400
ニッポン	45,700	2,046.00	93,502,200
日清製粉グループ本社	156,800	1,885.50	295,646,400
日東富士製粉	3,000	4,880.00	14,640,000
昭和産業	14,800	2,947.00	43,615,600
鳥越製粉	10,100	653.00	6,595,300
中部飼料	23,500	1,144.00	26,884,000
フィード・ワン	24,800	820.00	20,336,000
東洋精糖	2,100	2,175.00	4,567,500
日本甜菜製糖	9,900	1,913.00	18,938,700
D M三井製糖ホールディングス	16,800	2,971.00	49,912,800
塩水港精糖	13,500	268.00	3,618,000

ウェルネオシュガー	8,800	2,152.00	18,937,600
森永製菓	30,900	5,297.00	163,677,300
中村屋	4,200	3,120.00	13,104,000
江崎グリコ	48,500	3,805.00	184,542,500
名糖産業	6,700	1,652.00	11,068,400
井村屋グループ	9,300	2,322.00	21,594,600
不二家	11,600	2,456.00	28,489,600
山崎製パン	113,500	2,741.50	311,160,250
第一屋製パン	2,100	398.00	835,800
モロゾフ	5,500	3,680.00	20,240,000
亀田製菓	10,800	4,380.00	47,304,000
寿スピリッツ	18,000	10,960.00	197,280,000
カルビー	77,600	2,815.00	218,444,000
森永乳業	30,800	5,963.00	183,660,400
六甲バター	12,400	1,391.00	17,248,400
ヤクルト本社	121,100	7,619.00	922,660,900
明治ホールディングス	207,800	3,750.00	779,250,000
雪印メグミルク	41,000	2,397.00	98,277,000
プリマハム	22,800	2,552.00	58,185,600
日本ハム	66,300	4,528.00	300,206,400
林兼産業	3,400	538.00	1,829,200
丸大食品	17,100	1,676.00	28,659,600
S Foods	18,700	3,415.00	63,860,500
柿安本店	6,600	2,489.00	16,427,400
伊藤ハム米久ホールディングス	129,500	827.00	107,096,500
サッポロホールディングス	55,800	4,395.00	245,241,000
アサヒグループホールディングス	391,700	5,543.00	2,171,193,100
キリンホールディングス	706,100	2,019.50	1,425,968,950
宝ホールディングス	115,700	1,270.00	146,939,000
オエノンホールディングス	50,700	369.00	18,708,300
養命酒製造	5,600	1,913.00	10,712,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,800	1,870.00	248,336,000
ライフドリンク カンパニー	3,100	4,000.00	12,400,000
サントリー食品インターナショナル	119,400	4,711.00	562,493,400
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,570.00	53,472,000
伊藤園	57,400	4,307.00	247,221,800
キーコーヒー	19,000	2,097.00	39,843,000
ユニカフェ	3,800	929.00	3,530,200
ジャパンフーズ	1,800	1,086.00	1,954,800
日清オイリオグループ	23,900	4,220.00	100,858,000
不二製油グループ本社	39,500	2,292.50	90,553,750
かどや製油	1,400	3,480.00	4,872,000

J-オイルミルズ	17,300	1,787.00	30,915,100
キッコーマン	112,300	8,418.00	945,341,400
味の素	409,300	6,054.00	2,477,902,200
ブルドックソース	9,000	2,065.00	18,585,000
キューピー	91,100	2,394.00	218,093,400
ハウス食品グループ本社	51,900	3,118.00	161,824,200
カゴメ	72,900	3,384.00	246,693,600
焼津水産化学工業	4,400	1,139.00	5,011,600
アリアケジャパン	14,800	5,377.00	79,579,600
ピエトロ	1,600	1,848.00	2,956,800
エバラ食品工業	4,500	2,980.00	13,410,000
やまみ	1,100	1,712.00	1,883,200
ニチレイ	77,700	3,409.00	264,879,300
東洋水産	85,700	6,085.00	521,484,500
イトアンドホールディングス	7,400	2,120.00	15,688,000
大冷	1,400	1,983.00	2,776,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	985.00	10,638,000
日清食品ホールディングス	59,600	12,575.00	749,470,000
永谷園ホールディングス	8,300	2,382.00	19,770,600
一正蒲鉾	4,800	753.00	3,614,400
フジッコ	17,400	1,941.00	33,773,400
ロック・フィールド	19,000	1,542.00	29,298,000
日本たばこ産業	1,030,100	3,170.00	3,265,417,000
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,441.00	16,859,700
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,716.00	33,950,000
なとり	10,600	1,980.00	20,988,000
イフジ産業	1,900	1,690.00	3,211,000
ファーマフーズ	24,300	1,681.00	40,848,300
ユーグレナ	109,200	795.00	86,814,000
紀文食品	13,200	1,118.00	14,757,600
ピクルスホールディングス	9,900	1,231.00	12,186,900
ミヨシ油脂	4,400	1,136.00	4,998,400
理研ビタミン	14,600	2,307.00	33,682,200
片倉工業	16,200	1,638.00	26,535,600
ゲンゼ	12,400	4,520.00	56,048,000
東洋紡	75,000	1,037.00	77,775,000
ユニチカ	54,300	209.00	11,348,700
富士紡ホールディングス	6,900	3,405.00	23,494,500
倉敷紡績	13,100	2,324.00	30,444,400
シキボウ	6,400	1,033.00	6,611,200
日本毛織	45,900	1,240.00	56,916,000
トーア紡コーポレーション	4,500	431.00	1,939,500

帝国繊維	19,700	1,907.00	37,567,900
帝人	166,000	1,472.00	244,352,000
東レ	1,156,000	780.90	902,720,400
住江織物	2,500	2,212.00	5,530,000
日本フェルト	7,500	420.00	3,150,000
イチカワ	1,800	1,399.00	2,518,200
日東製網	1,200	1,439.00	1,726,800
アツギ	7,200	435.00	3,132,000
ダイニック	3,000	789.00	2,367,000
セーレン	33,500	2,388.00	79,998,000
ソトー	3,900	790.00	3,081,000
東海染工	1,300	1,020.00	1,326,000
小松マテーレ	25,300	739.00	18,696,700
ワコールホールディングス	31,500	3,125.00	98,437,500
ホギメディカル	23,200	3,185.00	73,892,000
T S Iホールディングス	58,300	713.00	41,567,900
マツオカコーポレーション	3,300	1,405.00	4,636,500
ワールド	22,300	1,583.00	35,300,900
三陽商会	4,400	1,933.00	8,505,200
ナイガイ	4,600	287.00	1,320,200
オンワードホールディングス	112,200	517.00	58,007,400
ルックホールディングス	3,700	1,983.00	7,337,100
ゴールドウイン	30,600	10,125.00	309,825,000
デサント	29,800	3,600.00	107,280,000
キング	5,400	648.00	3,499,200
ヤマトインターナショナル	9,800	297.00	2,910,600
特種東海製紙	7,700	3,255.00	25,063,500
王子ホールディングス	718,400	597.80	429,459,520
日本製紙	89,800	1,270.00	114,046,000
三菱製紙	13,800	524.00	7,231,200
北越コーポレーション	109,000	901.00	98,209,000
中越パルプ工業	4,600	1,296.00	5,961,600
巴川製紙所	3,600	689.00	2,480,400
大王製紙	76,200	1,234.50	94,068,900
阿波製紙	2,800	534.00	1,495,200
レンゴー	157,100	1,004.00	157,728,400
トーモク	10,000	2,279.00	22,790,000
ザ・パック	12,800	3,065.00	39,232,000
北の達人コーポレーション	72,700	248.00	18,029,600
クラレ	251,300	1,647.00	413,891,100
旭化成	1,076,900	931.10	1,002,701,590
共和レザー	6,600	604.00	3,986,400

レゾナック・ホールディングス	166,700	2,322.00	387,077,400
住友化学	1,279,300	393.30	503,148,690
住友精化	7,200	4,445.00	32,004,000
日産化学	81,500	6,237.00	508,315,500
ラサ工業	6,600	2,038.00	13,450,800
クレハ	14,700	8,440.00	124,068,000
多木化学	6,700	3,755.00	25,158,500
テイカ	11,600	1,328.00	15,404,800
石原産業	31,200	1,447.00	45,146,400
片倉コープアグリ	2,400	1,181.00	2,834,400
日本曹達	18,500	5,350.00	98,975,000
東ソー	230,200	1,868.50	430,128,700
トクヤマ	55,700	2,328.50	129,697,450
セントラル硝子	27,700	2,907.00	80,523,900
東亜合成	86,500	1,379.50	119,326,750
大阪ソーダ	10,300	7,570.00	77,971,000
関東電化工業	33,300	829.00	27,605,700
デンカ	62,700	2,674.00	167,659,800
信越化学工業	1,433,500	4,534.00	6,499,489,000
日本カーバイド工業	4,400	1,589.00	6,991,600
堺化学工業	13,100	1,929.00	25,269,900
第一稀元素化学工業	15,700	957.00	15,024,900
エア・ウォーター	162,700	1,784.50	290,338,150
日本酸素ホールディングス	167,300	3,335.00	557,945,500
日本化学工業	5,700	1,859.00	10,596,300
東邦アセチレン	2,400	1,518.00	3,643,200
日本パーカラライジング	85,400	1,113.00	95,050,200
高压ガス工業	25,000	757.00	18,925,000
チタン工業	1,400	1,383.00	1,936,200
四国化成ホールディングス	22,100	1,458.00	32,221,800
戸田工業	3,900	1,956.00	7,628,400
ステラ ケミファ	10,200	3,120.00	31,824,000
保土谷化学工業	4,900	3,280.00	16,072,000
日本触媒	26,300	5,437.00	142,993,100
大日精化工業	12,000	2,311.00	27,732,000
カネカ	39,400	4,012.00	158,072,800
三菱瓦斯化学	128,800	1,952.50	251,482,000
三井化学	142,200	3,980.00	565,956,000
J S R	161,000	4,056.00	653,016,000
東京応化工業	27,400	9,800.00	268,520,000
大阪有機化学工業	14,400	2,640.00	38,016,000
三菱ケミカルグループ	1,163,700	856.30	996,476,310



K Hネオケム	28,600	2,221.00	63,520,600
ダイセル	240,200	1,174.50	282,114,900
住友ベークライト	25,500	6,716.00	171,258,000
積水化学工業	349,600	2,240.00	783,104,000
日本ゼオン	103,400	1,563.00	161,614,200
アイカ工業	43,500	3,362.00	146,247,000
U B E	88,900	2,462.00	218,871,800
積水樹脂	23,900	2,512.00	60,036,800
タキロンシーアイ	37,700	621.00	23,411,700
旭有機材	11,500	4,245.00	48,817,500
ニチバン	10,700	1,886.00	20,180,200
リケンテクノス	37,100	698.00	25,895,800
大倉工業	8,000	2,473.00	19,784,000
積水化成成品工業	24,200	451.00	10,914,200
群栄化学工業	4,100	3,425.00	14,042,500
タイガースポリマー	5,200	775.00	4,030,000
ミライアル	3,500	1,511.00	5,288,500
ダイキアクシス	4,800	726.00	3,484,800
ダイキョーニシカワ	38,100	796.00	30,327,600
竹本容器	4,400	797.00	3,506,800
森六ホールディングス	8,700	2,212.00	19,244,400
恵和	12,400	1,184.00	14,681,600
日本化薬	131,700	1,287.00	169,497,900
カーリットホールディングス	15,500	889.00	13,779,500
日本精化	9,800	2,561.00	25,097,800
扶桑化学工業	16,000	4,235.00	67,760,000
トリケミカル研究所	23,000	2,730.00	62,790,000
A D E K A	60,100	2,766.50	166,266,650
日油	53,300	6,415.00	341,919,500
新日本理化	15,800	232.00	3,665,600
ハリマ化成グループ	8,100	827.00	6,698,700
花王	389,900	5,561.00	2,168,233,900
第一工業製薬	6,200	1,647.00	10,211,400
石原ケミカル	7,900	1,599.00	12,632,100
日華化学	4,600	858.00	3,946,800
ニイタカ	2,100	1,970.00	4,137,000
三洋化成工業	10,600	4,105.00	43,513,000
有機合成薬品工業	8,500	292.00	2,482,000
大日本塗料	21,000	966.00	20,286,000
日本ペイントホールディングス	915,700	1,099.50	1,006,812,150
関西ペイント	138,300	2,332.00	322,515,600
神東塗料	9,600	130.00	1,248,000

中国塗料	28,300	1,379.00	39,025,700
日本特殊塗料	7,300	1,239.00	9,044,700
藤倉化成	23,200	455.00	10,556,000
太陽ホールディングス	26,200	2,629.00	68,879,800
D I C	67,400	2,498.00	168,365,200
サカティクス	38,400	1,333.00	51,187,200
東洋インキＳＣホールディングス	37,500	2,200.00	82,500,000
T & K T O K A	15,400	1,406.00	21,652,400
富士フィルムホールディングス	331,300	8,561.00	2,836,259,300
資生堂	360,500	5,814.00	2,095,947,000
ライオン	226,000	1,568.50	354,481,000
高砂香料工業	11,700	2,832.00	33,134,400
マンダム	37,300	1,404.00	52,369,200
ミルボン	23,500	4,359.00	102,436,500
ファンケル	75,500	2,511.50	189,618,250
コーセー	35,100	11,480.00	402,948,000
コタ	15,900	1,617.00	25,710,300
シーボン	1,500	1,543.00	2,314,500
ポーラ・オルビスホールディングス	88,500	1,826.00	161,601,000
ノエビアホールディングス	15,400	5,570.00	85,778,000
アジュバンホールディングス	2,800	933.00	2,612,400
新日本製薬	9,800	1,552.00	15,209,600
アクシージア	8,700	1,091.00	9,491,700
エステー	13,300	1,522.00	20,242,600
アグロ カネショウ	6,900	1,397.00	9,639,300
コニシ	28,800	2,450.00	70,560,000
長谷川香料	33,000	3,395.00	112,035,000
星光P M C	7,000	562.00	3,934,000
小林製薬	50,200	7,217.00	362,293,400
荒川化学工業	14,600	1,012.00	14,775,200
メック	14,200	3,710.00	52,682,000
日本高純度化学	4,300	2,515.00	10,814,500
タカラバイオ	46,500	1,431.00	66,541,500
J C U	19,300	3,270.00	63,111,000
新田ゼラチン	7,100	718.00	5,097,800
O A T アグリオ	4,300	1,733.00	7,451,900
デクセリアルズ	47,200	3,616.00	170,675,200
アース製薬	15,700	4,920.00	77,244,000
北興化学工業	17,400	894.00	15,555,600
大成ラミック	5,400	3,085.00	16,659,000
クミアイ化学工業	68,600	1,103.00	75,665,800
日本農薬	31,700	671.00	21,270,700

アキレス	10,900	1,465.00	15,968,500
有沢製作所	28,100	1,023.00	28,746,300
日東電工	125,300	9,856.00	1,234,956,800
レック	24,600	936.00	23,025,600
三光合成	21,700	646.00	14,018,200
きもと	16,900	184.00	3,109,600
藤森工業	13,600	3,640.00	49,504,000
前澤化成工業	11,100	1,517.00	16,838,700
未来工業	6,200	2,948.00	18,277,600
ウェーブロックホールディングス	3,400	639.00	2,172,600
J S P	12,100	1,955.00	23,655,500
エフピコ	32,700	2,740.50	89,614,350
天馬	14,100	2,544.00	35,870,400
信越ポリマー	31,900	1,336.00	42,618,400
東リ	25,800	366.00	9,442,800
ニフコ	62,300	4,240.00	264,152,000
バルカー	14,400	4,160.00	59,904,000
ユニ・チャーム	359,700	5,700.00	2,050,290,000
ショーエイコーポレーション	3,300	596.00	1,966,800
協和キリン	208,600	2,634.50	549,556,700
武田薬品工業	1,528,100	4,472.00	6,833,663,200
アステラス製薬	1,631,100	2,204.00	3,594,944,400
住友ファーマ	128,100	527.50	67,572,750
塩野義製薬	217,700	6,424.00	1,398,504,800
わかもと製薬	10,800	231.00	2,494,800
日本新薬	40,700	6,254.00	254,537,800
中外製薬	540,500	4,413.00	2,385,226,500
科研製薬	29,600	3,554.00	105,198,400
エーザイ	210,000	9,077.00	1,906,170,000
ロート製薬	167,300	3,824.00	639,755,200
小野薬品工業	333,100	2,790.50	929,515,550
久光製薬	38,400	4,925.00	189,120,000
持田製薬	19,800	3,345.00	66,231,000
参天製薬	314,600	1,342.50	422,350,500
扶桑薬品工業	5,500	2,103.00	11,566,500
日本ケミファ	1,200	1,922.00	2,306,400
ツムラ	54,400	2,746.00	149,382,400
キッセイ薬品工業	26,600	3,425.00	91,105,000
生化学工業	32,900	812.00	26,714,800
栄研化学	28,000	1,398.00	39,144,000
鳥居薬品	9,300	3,785.00	35,200,500
J C R ファーマ	58,400	1,237.00	72,240,800

東和薬品	26,500	2,747.00	72,795,500
富士製薬工業	12,700	1,181.00	14,998,700
ゼリア新薬工業	23,900	2,406.00	57,503,400
そーせいグループ	59,100	1,647.00	97,337,700
第一三共	1,504,200	4,271.00	6,424,438,200
杏林製薬	37,400	1,749.00	65,412,600
大幸薬品	34,200	347.00	11,867,400
ダイト	12,100	2,511.00	30,383,100
大塚ホールディングス	359,100	5,490.00	1,971,459,000
大正製薬ホールディングス	38,400	6,058.00	232,627,200
ペプチドリーム	83,700	1,834.00	153,505,800
あすか製薬ホールディングス	17,700	1,671.00	29,576,700
サワイグループホールディングス	39,500	4,438.00	175,301,000
日本コークス工業	155,700	111.00	17,282,700
ニチレキ	20,400	2,172.00	44,308,800
ユシロ化学工業	8,900	1,434.00	12,762,600
ビーピー・カストロール	4,400	879.00	3,867,600
富士石油	35,200	297.00	10,454,400
MORESCO	3,700	1,203.00	4,451,100
出光興産	191,800	3,061.00	587,099,800
ENEOSホールディングス	2,928,900	537.10	1,573,112,190
コスモエネルギーホールディングス	68,300	5,299.00	361,921,700
横浜ゴム	87,300	2,964.50	258,800,850
TOYO TIRE	99,200	2,177.50	216,008,000
ブリヂストン	505,400	5,624.00	2,842,369,600
住友ゴム工業	169,400	1,486.50	251,813,100
藤倉コンポジット	8,200	1,135.00	9,307,000
オカモト	9,300	4,700.00	43,710,000
フコク	9,100	1,430.00	13,013,000
ニッタ	17,500	3,320.00	58,100,000
住友理工	33,500	1,069.00	35,811,500
三ツ星ベルト	25,200	4,660.00	117,432,000
バンドー化学	27,300	1,514.00	41,332,200
日東紡績	19,500	4,145.00	80,827,500
AGC	161,100	5,034.00	810,977,400
日本板硝子	88,000	735.00	64,680,000
石塚硝子	1,900	2,366.00	4,495,400
日本山村硝子	4,500	2,100.00	9,450,000
日本電気硝子	70,600	2,541.00	179,394,600
オハラ	8,300	1,348.00	11,188,400
住友大阪セメント	24,400	4,060.00	99,064,000
太平洋セメント	110,000	2,814.00	309,540,000

日本ヒューム	15,400	855.00	13,167,000
日本コンクリート工業	34,000	328.00	11,152,000
三谷セキサン	7,300	5,010.00	36,573,000
アジアパイルホールディングス	27,300	646.00	17,635,800
東海カーボン	159,500	1,137.50	181,431,250
日本カーボン	9,900	4,390.00	43,461,000
東洋炭素	12,200	5,800.00	70,760,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,600	5,990.00	51,514,000
TOTO	114,000	3,936.00	448,704,000
日本碍子	200,900	1,930.50	387,837,450
日本特殊陶業	131,500	3,358.00	441,577,000
MARUWA	6,400	26,330.00	168,512,000
品川リフラクトリーズ	4,900	7,140.00	34,986,000
黒崎播磨	3,500	9,990.00	34,965,000
ヨータイ	9,400	1,495.00	14,053,000
東京窯業	11,100	344.00	3,818,400
ニッカトー	5,400	612.00	3,304,800
フジインコーポレーテッド	41,300	3,325.00	137,322,500
クニミネ工業	3,500	1,017.00	3,559,500
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,169.00	2,688,700
ニチアス	43,700	2,978.00	130,138,600
ニチハ	21,700	3,140.00	68,138,000
日本製鉄	795,400	3,408.00	2,710,723,200
神戸製鋼所	357,300	1,805.50	645,105,150
中山製鋼所	36,600	888.00	32,500,800
合同製鐵	8,800	4,200.00	36,960,000
JFEホールディングス	474,700	2,284.50	1,084,452,150
東京製鐵	49,900	1,613.00	80,488,700
共英製鋼	20,300	1,948.00	39,544,400
大和工業	29,300	6,993.00	204,894,900
東京鐵鋼	8,500	3,295.00	28,007,500
大阪製鐵	8,200	1,675.00	13,735,000
淀川製鋼所	20,200	3,410.00	68,882,000
中部鋼鈹	14,600	2,101.00	30,674,600
丸一鋼管	54,100	3,725.00	201,522,500
モリ工業	2,700	3,440.00	9,288,000
大同特殊鋼	22,400	5,948.00	133,235,200
日本高周波鋼業	4,100	490.00	2,009,000
日本冶金工業	13,000	4,430.00	57,590,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,765.00	48,664,000
愛知製鋼	10,300	3,590.00	36,977,000
日本金属	2,600	905.00	2,353,000

大平洋金属	12,600	1,620.00	20,412,000
新日本電工	105,800	278.00	29,412,400
栗本鐵工所	8,500	3,020.00	25,670,000
虹技	1,500	1,481.00	2,221,500
三菱製鋼	11,200	1,419.00	15,892,800
日亜鋼業	12,100	313.00	3,787,300
日本精線	2,400	4,695.00	11,268,000
エンビプロ・ホールディングス	8,200	593.00	4,862,600
シンニッタン	12,900	245.00	3,160,500
新家工業	2,600	2,811.00	7,308,600
大紀アルミニウム工業所	25,300	1,418.00	35,875,400
日本軽金属ホールディングス	47,900	1,558.00	74,628,200
三井金属鉱業	51,700	3,692.00	190,876,400
東邦亜鉛	10,500	1,709.00	17,944,500
三菱マテリアル	118,500	2,412.00	285,822,000
住友金属鉱山	206,000	4,521.00	931,326,000
D O W Aホールディングス	39,900	4,586.00	182,981,400
古河機械金属	26,100	1,748.00	45,622,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,100	3,210.00	83,781,000
東邦チタニウム	32,200	2,004.00	64,528,800
U A C J	24,900	3,135.00	78,061,500
C Kサンエツ	4,300	3,680.00	15,824,000
古河電気工業	59,200	2,475.00	146,520,000
住友電気工業	613,400	1,761.00	1,080,197,400
フジクラ	190,500	1,184.50	225,647,250
S W C C	19,900	1,933.00	38,466,700
タツタ電線	36,100	708.00	25,558,800
カナレ電気	2,100	1,407.00	2,954,700
平河ヒューテック	10,300	1,499.00	15,439,700
リョービ	18,900	2,810.00	53,109,000
アーレスティ	13,200	747.00	9,860,400
A R Eホールディングス	71,900	1,878.00	135,028,200
稲葉製作所	9,200	1,539.00	14,158,800
宮地エンジニアリンググループ	4,900	5,860.00	28,714,000
トーカロ	47,300	1,407.00	66,551,100
アルファC o	4,300	1,475.00	6,342,500
S U M C O	315,600	1,961.00	618,891,600
川田テクノロジーズ	4,200	6,040.00	25,368,000
R S Technologies	11,900	2,806.00	33,391,400
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,416.00	3,865,600
信和	6,500	765.00	4,972,500
東洋製罐グループホールディングス	106,000	2,513.00	266,378,000

ホッカホールディングス	9,500	1,562.00	14,839,000
コロナ	9,900	903.00	8,939,700
横河ブリッジホールディングス	22,200	2,734.00	60,694,800
駒井ハルテック	1,900	1,850.00	3,515,000
高田機工	1,000	2,984.00	2,984,000
三和ホールディングス	163,600	2,151.00	351,903,600
文化シャッター	51,100	1,085.00	55,443,500
三協立山	20,300	860.00	17,458,000
アルインコ	13,500	1,065.00	14,377,500
東洋シャッター	2,700	639.00	1,725,300
L I X I L	258,800	1,795.00	464,546,000
日本フィルコン	7,700	474.00	3,649,800
ノーリツ	29,400	1,600.00	47,040,000
長府製作所	17,800	2,155.00	38,359,000
リンナイ	96,600	2,854.00	275,696,400
ダイニチ工業	5,900	732.00	4,318,800
日東精工	25,700	556.00	14,289,200
三洋工業	1,400	2,078.00	2,909,200
岡部	31,700	736.00	23,331,200
ジーテクト	19,800	1,827.00	36,174,600
東プレ	31,300	1,710.00	53,523,000
高周波熱錬	27,400	1,004.00	27,509,600
東京製綱	10,500	1,167.00	12,253,500
サンコール	10,500	496.00	5,208,000
モリテック スチール	8,700	319.00	2,775,300
パイオラックス	24,500	2,252.00	55,174,000
エイチワン	18,300	759.00	13,889,700
日本発條	157,100	1,121.50	176,187,650
中央発條	13,200	722.00	9,530,400
アドバネクス	1,400	1,019.00	1,426,600
立川ブラインド工業	8,000	1,385.00	11,080,000
三益半導体工業	13,700	2,849.00	39,031,300
日本ドライケミカル	2,800	2,079.00	5,821,200
日本製鋼所	47,900	2,924.00	140,059,600
三浦工業	72,600	3,355.00	243,573,000
タクマ	53,500	1,560.00	83,460,000
ツガミ	38,700	1,174.00	45,433,800
オークマ	17,400	6,791.00	118,163,400
芝浦機械	17,400	4,170.00	72,558,000
アマダ	277,500	1,525.00	423,187,500
アイダエンジニアリング	35,900	995.00	35,720,500
T A K I S A W A	3,100	2,552.00	7,911,200

F U J I	75,600	2,420.50	182,989,800
牧野フライス製作所	19,300	6,450.00	124,485,000
オーエスジー	76,700	1,829.50	140,322,650
ダイジェット工業	1,300	922.00	1,198,600
旭ダイヤモンド工業	48,700	893.00	43,489,100
D M G 森精機	105,500	2,646.00	279,153,000
ソディック	45,800	683.00	31,281,400
ディスコ	83,700	27,465.00	2,298,820,500
日東工器	8,500	2,000.00	17,000,000
日進工具	14,600	1,162.00	16,965,200
パンチ工業	10,600	441.00	4,674,600
富士ダイス	5,500	660.00	3,630,000
豊和工業	6,400	811.00	5,190,400
東洋機械金属	8,100	673.00	5,451,300
エンシュウ	2,600	759.00	1,973,400
島精機製作所	27,700	1,837.00	50,884,900
オプトラン	28,600	1,870.00	53,482,000
N C ホールディングス	2,400	1,929.00	4,629,600
イワキポンプ	11,600	1,872.00	21,715,200
フリー	18,300	1,708.00	31,256,400
ヤマシンフィルタ	41,700	318.00	13,260,600
日阪製作所	16,900	936.00	15,818,400
やまびこ	28,400	1,417.00	40,242,800
野村マイクロ・サイエンス	5,900	5,760.00	33,984,000
平田機工	8,300	7,550.00	62,665,000
P E G A S U S	19,300	573.00	11,058,900
マルマエ	7,600	1,803.00	13,702,800
タツモ	10,500	2,786.00	29,253,000
ナプテスコ	109,200	2,718.50	296,860,200
三井海洋開発	22,000	1,600.00	35,200,000
レオン自動機	18,300	1,352.00	24,741,600
S M C	56,400	69,800.00	3,936,720,000
ホソカワミクロン	11,200	3,895.00	43,624,000
ユニオンツール	7,700	3,660.00	28,182,000
瑞光	12,600	1,393.00	17,551,800
オイレス工業	24,300	2,016.00	48,988,800
日精エー・エス・ビー機械	6,900	4,065.00	28,048,500
サトーホールディングス	24,800	2,040.00	50,592,000
技研製作所	16,400	1,977.00	32,422,800
日本エアーテック	8,800	1,235.00	10,868,000
カワタ	3,400	1,031.00	3,505,400
日精樹脂工業	13,000	1,057.00	13,741,000



オカダアイヨン	3,600	2,167.00	7,801,200
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,651.00	12,989,900
小松製作所	814,800	4,066.00	3,312,976,800
住友重機械工業	102,900	3,513.00	361,487,700
日立建機	69,300	4,328.00	299,930,400
日工	25,900	661.00	17,119,900
巴工業	7,500	2,918.00	21,885,000
井関農機	16,400	1,197.00	19,630,800
TOWA	17,800	3,415.00	60,787,000
丸山製作所	2,000	2,179.00	4,358,000
北川鉄工所	6,900	1,364.00	9,411,600
ローツェ	9,100	11,500.00	104,650,000
タカキタ	3,400	486.00	1,652,400
クボタ	920,200	2,215.00	2,038,243,000
荏原実業	9,200	2,822.00	25,962,400
三菱化工機	5,600	2,772.00	15,523,200
月島ホールディングス	23,600	1,347.00	31,789,200
帝国電機製作所	12,300	2,478.00	30,479,400
新東工業	35,300	1,063.00	37,523,900
澁谷工業	16,400	2,484.00	40,737,600
アイチ コーポレーション	24,300	952.00	23,133,600
小森コーポレーション	40,400	1,129.00	45,611,600
鶴見製作所	13,300	2,929.00	38,955,700
日本ギア工業	4,000	429.00	1,716,000
酒井重工業	1,900	5,010.00	9,519,000
荏原製作所	71,400	7,258.00	518,221,200
石井鐵工所	1,400	2,891.00	4,047,400
西島製作所	15,000	1,850.00	27,750,000
北越工業	17,500	1,882.00	32,935,000
ダイキン工業	207,600	24,840.00	5,156,784,000
オルガノ	23,900	4,160.00	99,424,000
トーヨーカネツ	6,600	3,300.00	21,780,000
栗田工業	97,300	5,621.00	546,923,300
椿本チエイン	24,700	3,795.00	93,736,500
大同工業	4,800	735.00	3,528,000
木村化工機	13,400	737.00	9,875,800
アネスト岩田	29,600	1,198.00	35,460,800
ダイフク	269,000	2,681.50	721,323,500
サムコ	4,700	5,030.00	23,641,000
加藤製作所	5,500	1,296.00	7,128,000
油研工業	1,800	2,178.00	3,920,400
タダノ	100,200	1,145.50	114,779,100

フジテック	61,000	3,748.00	228,628,000
C K D	48,100	1,986.00	95,526,600
平和	57,900	2,222.00	128,653,800
理想科学工業	13,900	2,282.00	31,719,800
S A N K Y O	34,200	6,412.00	219,290,400
日本金銭機械	19,200	1,018.00	19,545,600
マースグループホールディングス	10,300	2,787.00	28,706,100
フクシマガリレイ	12,800	5,200.00	66,560,000
オーイズミ	4,500	422.00	1,899,000
ダイコク電機	9,500	4,715.00	44,792,500
竹内製作所	31,600	4,425.00	139,830,000
アマノ	49,400	3,149.00	155,560,600
J U K I	27,000	618.00	16,686,000
ジャノメ	17,700	640.00	11,328,000
マックス	21,400	2,664.00	57,009,600
グローリー	41,800	3,043.00	127,197,400
新晃工業	17,600	1,987.00	34,971,200
大和冷機工業	26,700	1,408.00	37,593,600
セガサミーホールディングス	139,800	2,928.00	409,334,400
日本ピストンリング	3,900	1,611.00	6,282,900
リケン	6,900	3,135.00	21,631,500
T P R	19,900	1,803.00	35,879,700
ツバキ・ナカシマ	42,800	785.00	33,598,000
ホシザキ	102,600	5,465.00	560,709,000
大豊工業	15,100	834.00	12,593,400
日本精工	319,500	821.20	262,373,400
N T N	342,800	283.00	97,012,400
ジェイテクト	154,800	1,271.00	196,750,800
不二越	12,900	3,880.00	50,052,000
日本トムソン	42,700	561.00	23,954,700
T H K	100,300	2,687.00	269,506,100
ユーシン精機	13,900	699.00	9,716,100
前澤給装工業	12,300	1,209.00	14,870,700
イーグル工業	19,300	1,704.00	32,887,200
前澤工業	6,700	958.00	6,418,600
日本ピラー工業	16,100	4,170.00	67,137,000
キッツ	63,900	1,047.00	66,903,300
マキタ	216,400	3,945.00	853,698,000
三井E & S	83,200	485.00	40,352,000
日立造船	142,600	848.00	120,924,800
三菱重工業	304,100	7,964.00	2,421,852,400
I H I	109,600	3,528.00	386,668,800

スター精密	32,800	1,860.00	61,008,000
日清紡ホールディングス	130,700	1,080.00	141,156,000
イビデン	99,800	8,625.00	860,775,000
コニカミノルタ	389,000	453.90	176,567,100
ブラザー工業	232,500	2,475.50	575,553,750
ミネベアミツミ	302,600	2,465.00	745,909,000
日立製作所	845,600	9,513.00	8,044,192,800
東芝	334,600	4,599.00	1,538,825,400
三菱電機	1,797,100	1,867.00	3,355,185,700
富士電機	105,700	6,699.00	708,084,300
東洋電機製造	3,800	1,035.00	3,933,000
安川電機	206,000	5,631.00	1,159,986,000
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,562.00	29,990,400
明電舎	26,400	2,201.00	58,106,400
オリジン	2,600	1,274.00	3,312,400
山洋電気	7,600	7,050.00	53,580,000
デンヨー	13,200	2,034.00	26,848,800
PHCホールディングス	24,500	1,415.00	34,667,500
ソシオネクスト	24,700	17,000.00	419,900,000
東芝テック	26,000	3,540.00	92,040,000
芝浦メカトロニクス	3,000	23,500.00	70,500,000
マブチモーター	43,300	4,336.00	187,748,800
ニデック	423,100	7,446.00	3,150,402,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,400	489.00	6,552,600
トレックス・セミコンダクター	8,300	2,310.00	19,173,000
東光高岳	10,600	2,229.00	23,627,400
ダブル・スコープ	56,700	1,140.00	64,638,000
ダイヘン	15,700	5,190.00	81,483,000
ヤーマン	30,400	1,026.00	31,190,400
JVCケンウッド	159,100	580.00	92,278,000
ミマキエンジニアリング	16,900	730.00	12,337,000
I - P E X	12,300	1,655.00	20,356,500
大崎電気工業	41,200	628.00	25,873,600
オムロン	159,300	6,862.00	1,093,116,600
日東工業	23,400	3,765.00	88,101,000
I D E C	25,700	3,025.00	77,742,500
正興電機製作所	4,200	1,097.00	4,607,400
不二電機工業	2,600	1,154.00	3,000,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,200	2,687.50	153,725,000
サクサホールディングス	2,400	2,321.00	5,570,400
メルコホールディングス	4,500	3,140.00	14,130,000
テクノメディカ	4,400	2,172.00	9,556,800

日本電気	245,900	7,512.00	1,847,200,800
富士通	173,300	18,235.00	3,160,125,500
沖電気工業	78,600	888.00	69,796,800
岩崎通信機	5,100	825.00	4,207,500
電気興業	7,000	2,488.00	17,416,000
サンケン電気	16,200	10,900.00	176,580,000
ナカヨ	1,900	1,270.00	2,413,000
アイホン	10,600	3,010.00	31,906,000
ルネサスエレクトロニクス	1,134,900	2,488.50	2,824,198,650
セイコーエプソン	223,100	2,293.50	511,679,850
ワコム	132,800	594.00	78,883,200
アルバック	41,300	5,615.00	231,899,500
アクセル	4,600	1,723.00	7,925,800
E I Z O	12,700	4,890.00	62,103,000
日本信号	39,600	966.00	38,253,600
京三製作所	36,400	462.00	16,816,800
能美防災	23,700	1,759.00	41,688,300
ホーチキ	13,200	1,678.00	22,149,600
星和電機	5,800	482.00	2,795,600
エレコム	41,800	1,703.00	71,185,400
パナソニック ホールディングス	2,053,800	1,672.50	3,434,980,500
シャープ	209,400	903.20	189,130,080
アンリツ	122,500	1,050.00	128,625,000
富士通ゼネラル	49,300	2,794.50	137,768,850
ソニーグループ	1,217,900	12,000.00	14,614,800,000
T D K	275,400	5,203.00	1,432,906,200
帝国通信工業	8,100	1,795.00	14,539,500
タムラ製作所	74,600	578.00	43,118,800
アルプスアルパイン	155,600	1,203.00	187,186,800
池上通信機	3,700	734.00	2,715,800
日本電波工業	21,100	1,529.00	32,261,900
鈴木	9,700	1,120.00	10,864,000
メイコー	19,100	3,385.00	64,653,500
日本トリム	4,000	2,954.00	11,816,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	3,415.00	32,784,000
フォスター電機	16,100	905.00	14,570,500
S M K	4,200	2,481.00	10,420,200
ヨコオ	14,000	1,688.00	23,632,000
ホシデン	40,800	1,785.00	72,828,000
ヒロセ電機	28,000	17,665.00	494,620,000
日本航空電子工業	35,700	3,030.00	108,171,000
T O A	19,800	1,057.00	20,928,600

マクセル	35,400	1,544.00	54,657,600
古野電気	22,900	1,282.00	29,357,800
スミダコーポレーション	23,500	1,685.00	39,597,500
アイコム	6,700	3,140.00	21,038,000
リオン	7,300	2,084.00	15,213,200
横河電機	190,200	2,747.00	522,479,400
新電元工業	6,700	3,105.00	20,803,500
アズビル	120,300	4,763.00	572,988,900
東亜ディーケーケー	5,800	877.00	5,086,600
日本光電工業	79,600	3,844.00	305,982,400
チノー	7,200	2,021.00	14,551,200
共和電業	10,700	354.00	3,787,800
日本電子材料	11,400	1,563.00	17,818,200
堀場製作所	32,900	7,460.00	245,434,000
アドバンテスト	135,600	18,060.00	2,448,936,000
小野測器	5,500	452.00	2,486,000
エスベック	13,900	2,260.00	31,414,000
キーエンス	172,200	61,630.00	10,612,686,000
日置電機	9,000	7,650.00	68,850,000
シスメックス	148,600	7,642.00	1,135,601,200
日本マイクロニクス	31,100	2,099.00	65,278,900
メガチップス	14,200	4,210.00	59,782,000
O B A R A G R O U P	9,500	3,940.00	37,430,000
澤藤電機	1,600	1,286.00	2,057,600
原田工業	5,500	816.00	4,488,000
コーセル	21,000	1,282.00	26,922,000
イリソ電子工業	15,900	4,145.00	65,905,500
オブテックスグループ	31,800	1,703.00	54,155,400
千代田インテグレ	6,800	2,746.00	18,672,800
レーザーテック	78,900	22,210.00	1,752,369,000
スタンレー電気	122,200	2,565.00	313,443,000
ウシオ電機	87,600	1,816.50	159,125,400
岡谷電機産業	10,200	311.00	3,172,200
ヘリオス テクノ ホールディング	11,300	446.00	5,039,800
エノモト	3,100	1,737.00	5,384,700
日本セラミック	17,600	2,563.00	45,108,800
遠藤照明	5,400	1,227.00	6,625,800
古河電池	13,000	950.00	12,350,000
双信電機	5,700	342.00	1,949,400
山一電機	14,200	1,750.00	24,850,000
図研	15,100	4,070.00	61,457,000
日本電子	43,200	4,630.00	200,016,000

カシオ計算機	128,300	1,288.00	165,250,400
ファナック	839,500	4,138.00	3,473,851,000
日本シイエムケイ	37,300	598.00	22,305,400
エンプラス	5,100	10,840.00	55,284,000
大真空	21,500	782.00	16,813,000
ローム	79,600	12,165.00	968,334,000
浜松ホトニクス	138,200	6,756.00	933,679,200
三井ハイテック	17,800	9,530.00	169,634,000
新光電気工業	61,000	5,975.00	364,475,000
京セラ	267,500	7,339.00	1,963,182,500
太陽誘電	83,900	4,038.00	338,788,200
村田製作所	522,200	8,087.00	4,223,031,400
双葉電子工業	33,500	538.00	18,023,000
北陸電気工業	4,600	1,418.00	6,522,800
ニチコン	35,400	1,406.00	49,772,400
日本ケミコン	17,300	1,421.00	24,583,300
K O A	26,300	1,835.00	48,260,500
市光工業	31,700	522.00	16,547,400
小糸製作所	207,200	2,420.00	501,424,000
ミツバ	32,300	753.00	24,321,900
S C R E E Nホールディングス	29,400	14,840.00	436,296,000
キャノン電子	19,200	1,838.00	35,289,600
キャノン	858,700	3,602.00	3,093,037,400
リコー	431,700	1,190.50	513,938,850
象印マホービン	51,400	1,745.00	89,693,000
M U T O Hホールディングス	1,800	2,000.00	3,600,000
東京エレクトロン	364,400	20,955.00	7,636,002,000
イノテック	11,700	1,545.00	18,076,500
トヨタ紡織	72,500	2,678.00	194,155,000
芦森工業	2,100	2,158.00	4,531,800
ユニプレス	31,000	1,218.00	37,758,000
豊田自動織機	125,900	10,135.00	1,275,996,500
モリタホールディングス	30,300	1,635.00	49,540,500
三櫻工業	26,400	899.00	23,733,600
デンソー	355,100	9,746.00	3,460,804,600
東海理化電機製作所	48,600	2,257.00	109,690,200
川崎重工業	129,700	3,626.00	470,292,200
名村造船所	29,500	879.00	25,930,500
日本車輛製造	6,600	2,038.00	13,450,800
三菱ロジスネクスト	27,500	1,337.00	36,767,500
近畿車輛	1,600	1,848.00	2,956,800
日産自動車	2,445,600	606.90	1,484,234,640

いすゞ自動車	500,500	1,825.50	913,662,750
トヨタ自動車	9,453,500	2,436.50	23,033,452,750
日野自動車	222,000	560.90	124,519,800
三菱自動車工業	671,600	561.70	377,237,720
エフテック	8,000	757.00	6,056,000
レシップホールディングス	4,500	539.00	2,425,500
G M B	2,300	1,803.00	4,146,900
ファルテック	1,900	591.00	1,122,900
武蔵精密工業	42,100	1,726.00	72,664,600
日産車体	30,400	901.00	27,390,400
新明和工業	54,100	1,366.00	73,900,600
極東開発工業	28,400	1,818.00	51,631,200
トピー工業	14,000	2,190.00	30,660,000
ティラド	4,400	2,046.00	9,002,400
曙ブレーキ工業	105,100	132.00	13,873,200
タチエス	27,300	1,691.00	46,164,300
N O K	66,900	2,025.00	135,472,500
フタバ産業	46,300	631.00	29,215,300
K Y B	16,600	4,705.00	78,103,000
大同メタル工業	33,800	523.00	17,677,400
プレス工業	77,000	660.00	50,820,000
ミクニ	13,300	451.00	5,998,300
太平洋工業	39,500	1,392.00	54,984,000
アイシン	132,800	4,696.00	623,628,800
マツダ	569,500	1,519.50	865,355,250
今仙電機製作所	7,400	650.00	4,810,000
本田技研工業	1,399,500	4,643.00	6,497,878,500
スズキ	316,200	5,492.00	1,736,570,400
S U B A R U	544,700	2,759.50	1,503,099,650
安永	5,100	796.00	4,059,600
ヤマハ発動機	248,000	3,863.00	958,024,000
T B K	11,500	399.00	4,588,500
エクセディ	28,200	2,591.00	73,066,200
豊田合成	50,300	3,044.00	153,113,200
愛三工業	28,500	1,274.00	36,309,000
盟和産業	1,700	1,029.00	1,749,300
日本プラスト	9,200	463.00	4,259,600
ヨロズ	16,200	894.00	14,482,800
エフ・シー・シー	30,500	1,885.00	57,492,500
シマノ	69,900	21,345.00	1,492,015,500
テイ・エス テック	78,800	1,730.00	136,324,000
ジャムコ	6,300	1,463.00	9,216,900

テルモ	529,500	4,295.00	2,274,202,500
クリエートメディック	3,800	923.00	3,507,400
日機装	40,100	1,010.00	40,501,000
日本エム・ディ・エム	10,300	765.00	7,879,500
島津製作所	209,700	4,269.00	895,209,300
JMS	16,000	532.00	8,512,000
長野計器	12,500	2,382.00	29,775,000
ブイ・テクノロジー	8,400	2,375.00	19,950,000
東京計器	13,200	1,444.00	19,060,800
愛知時計電機	6,700	1,598.00	10,706,600
インターアクション	8,200	1,070.00	8,774,000
オーバル	10,200	424.00	4,324,800
東京精密	37,900	7,970.00	302,063,000
マニー	68,900	1,860.00	128,154,000
ニコン	248,900	1,559.50	388,159,550
トプコン	90,600	1,688.50	152,978,100
オリンパス	1,059,800	1,888.50	2,001,432,300
理研計器	10,700	5,100.00	54,570,000
タムロン	12,800	4,440.00	56,832,000
HOYA	364,700	15,940.00	5,813,318,000
シード	5,800	814.00	4,721,200
ノーリツ鋼機	16,300	2,836.00	46,226,800
A & Dホロンホールディングス	25,100	1,667.00	41,841,700
朝日インテック	192,400	2,955.50	568,638,200
シチズン時計	158,400	869.00	137,649,600
リズム	3,600	1,641.00	5,907,600
大研医器	8,700	540.00	4,698,000
メニコン	59,200	2,067.00	122,366,400
シンシア	1,300	586.00	761,800
松風	7,800	2,086.00	16,270,800
セイコーグループ	26,700	2,680.00	71,556,000
ニプロ	143,500	1,150.00	165,025,000
KYORITSU	17,100	174.00	2,975,400
中本パックス	3,500	1,641.00	5,743,500
スノーピーク	29,400	1,618.00	47,569,200
パラマウントベッドホールディングス	39,800	2,371.00	94,365,800
トランザクション	11,300	1,950.00	22,035,000
粧美堂	3,100	500.00	1,550,000
ニホンフラッシュ	16,100	914.00	14,715,400
前田工織	14,500	3,095.00	44,877,500
永大産業	12,200	219.00	2,671,800
アートネイチャー	17,700	785.00	13,894,500



バンダイナムコホールディングス	471,700	3,417.00	1,611,798,900
アイフィスジャパン	3,200	592.00	1,894,400
S H O E I	38,900	2,407.00	93,632,300
フランスベッドホールディングス	19,800	1,201.00	23,779,800
パイロットコーポレーション	24,200	4,595.00	111,199,000
萩原工業	11,500	1,645.00	18,917,500
フジシールインターナショナル	34,900	1,733.00	60,481,700
タカラトミー	78,900	2,306.00	181,943,400
広済堂ホールディングス	7,700	2,849.00	21,937,300
エステールホールディングス	2,700	630.00	1,701,000
タカノ	4,300	826.00	3,551,800
プロネクサス	14,300	1,076.00	15,386,800
ホクシン	8,800	131.00	1,152,800
ウッドワン	3,800	1,057.00	4,016,600
大建工業	10,500	3,040.00	31,920,000
凸版印刷	211,600	3,373.00	713,726,800
大日本印刷	188,100	3,893.00	732,273,300
共同印刷	4,800	3,240.00	15,552,000
N I S S H A	32,600	1,726.00	56,267,600
光村印刷	1,000	1,257.00	1,257,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,000	2,333.00	25,663,000
アシックス	146,700	5,062.00	742,595,400
ツツミ	3,000	2,399.00	7,197,000
ローランド	12,700	3,865.00	49,085,500
小松ウオール工業	6,300	2,879.00	18,137,700
ヤマハ	108,500	4,529.00	491,396,500
河合楽器製作所	4,600	3,380.00	15,548,000
クリナップ	19,300	700.00	13,510,000
ビジョン	109,700	1,674.00	183,637,800
キングジム	15,200	872.00	13,254,400
リンテック	34,600	2,337.00	80,860,200
イトーキ	35,300	1,333.00	47,054,900
任天堂	1,087,000	6,175.00	6,712,225,000
三菱鉛筆	24,400	1,903.00	46,433,200
タカラスタンダード	31,700	1,924.00	60,990,800
コクヨ	74,600	2,231.50	166,469,900
ナカバヤシ	18,500	525.00	9,712,500
グローブライド	13,900	1,899.00	26,396,100
オカムラ	51,800	2,181.00	112,975,800
美津濃	17,100	4,635.00	79,258,500
東京電力ホールディングス	1,551,900	617.90	958,919,010
中部電力	634,400	1,920.50	1,218,365,200

関西電力	664,800	2,008.00	1,334,918,400
中国電力	274,200	955.50	261,998,100
北陸電力	162,500	831.20	135,070,000
東北電力	420,900	1,006.00	423,425,400
四国電力	147,000	1,042.50	153,247,500
九州電力	396,900	947.50	376,062,750
北海道電力	166,300	649.70	108,045,110
沖縄電力	40,300	1,131.00	45,579,300
電源開発	129,600	2,272.00	294,451,200
エフオン	11,100	526.00	5,838,600
イーレックス	30,600	927.00	28,366,200
レノバ	45,900	1,392.00	63,892,800
東京瓦斯	364,000	3,372.00	1,227,408,000
大阪瓦斯	348,700	2,309.50	805,322,650
東邦瓦斯	67,800	2,585.00	175,263,000
北海道瓦斯	10,300	2,320.00	23,896,000
広島ガス	36,300	379.00	13,757,700
西部ガスホールディングス	16,200	1,994.00	32,302,800
静岡ガス	39,100	1,033.00	40,390,300
メタウォーター	20,600	1,893.00	38,995,800
SBSホールディングス	15,300	3,020.00	46,206,000
東武鉄道	189,100	3,889.00	735,409,900
相鉄ホールディングス	56,900	2,779.00	158,125,100
東急	482,800	1,777.50	858,177,000
京浜急行電鉄	195,300	1,310.50	255,940,650
小田急電鉄	261,000	2,097.00	547,317,000
京王電鉄	91,000	4,900.00	445,900,000
京成電鉄	111,000	5,405.00	599,955,000
富士急行	21,200	5,290.00	112,148,000
東日本旅客鉄道	292,000	8,055.00	2,352,060,000
西日本旅客鉄道	219,900	6,022.00	1,324,237,800
東海旅客鉄道	132,600	18,210.00	2,414,646,000
西武ホールディングス	208,300	1,529.00	318,490,700
鴻池運輸	29,300	2,032.00	59,537,600
西日本鉄道	46,000	2,697.00	124,062,000
ハマキョウレックス	13,500	4,170.00	56,295,000
サカイ引越センター	8,200	4,760.00	39,032,000
近鉄グループホールディングス	171,900	4,501.00	773,721,900
阪急阪神ホールディングス	229,200	5,114.00	1,172,128,800
南海電気鉄道	82,100	2,993.00	245,725,300
京阪ホールディングス	94,700	4,048.00	383,345,600
神戸電鉄	4,700	3,055.00	14,358,500

名古屋鉄道	190,000	2,298.00	436,620,000
山陽電気鉄道	12,900	2,228.00	28,741,200
アルプス物流	13,700	1,580.00	21,646,000
ヤマトホールディングス	220,100	2,664.50	586,456,450
山九	43,700	5,026.00	219,636,200
丸運	5,600	249.00	1,394,400
丸全昭和運輸	10,600	3,925.00	41,605,000
センコーグループホールディングス	91,000	1,020.00	92,820,000
トナミホールディングス	3,800	4,710.00	17,898,000
ニッコンホールディングス	55,000	3,307.00	181,885,000
日本石油輸送	1,200	2,544.00	3,052,800
福山通運	13,100	3,620.00	47,422,000
セイノーホールディングス	96,700	2,102.50	203,311,750
エスライングループ本社	3,200	864.00	2,764,800
神奈川中央交通	4,900	3,285.00	16,096,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,500	2,271.00	94,246,500
C & F ロジホールディングス	16,500	1,346.00	22,209,000
九州旅客鉄道	121,500	3,142.00	381,753,000
S Gホールディングス	329,800	2,095.50	691,095,900
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,300	7,458.00	434,801,400
日本郵船	460,100	3,887.00	1,788,408,700
商船三井	303,300	4,035.00	1,223,815,500
川崎汽船	129,400	4,912.00	635,612,800
N S ユナイテッド海運	9,500	4,050.00	38,475,000
飯野海運	64,200	1,024.00	65,740,800
共栄タンカー	3,300	841.00	2,775,300
乾汽船	22,600	1,289.00	29,131,400
日本航空	422,200	2,948.00	1,244,645,600
A N Aホールディングス	467,700	3,250.00	1,520,025,000
パスコ	2,200	1,661.00	3,654,200
トランコム	5,000	7,670.00	38,350,000
日新	13,100	2,589.00	33,915,900
三菱倉庫	36,900	3,860.00	142,434,000
三井倉庫ホールディングス	16,000	4,205.00	67,280,000
住友倉庫	46,400	2,437.00	113,076,800
澁澤倉庫	6,900	3,320.00	22,908,000
東陽倉庫	15,200	277.00	4,210,400
日本トランスシティ	34,600	633.00	21,901,800
ケイヒン	2,000	1,741.00	3,482,000
中央倉庫	8,300	1,109.00	9,204,700
川西倉庫	1,900	1,049.00	1,993,100
安田倉庫	11,700	1,009.00	11,805,300

ファイブホールディングス	2,100	1,089.00	2,286,900
東洋埠頭	3,300	1,400.00	4,620,000
上組	82,400	3,280.00	270,272,000
サンリツ	2,600	727.00	1,890,200
キムラユニティー	5,500	1,422.00	7,821,000
キューソー流通システム	5,900	942.00	5,557,800
東海運	6,700	285.00	1,909,500
エーアイティー	10,800	1,956.00	21,124,800
内外トランスライン	6,900	2,684.00	18,519,600
日本コンセプト	6,100	1,731.00	10,559,100
NEC ネットエスアイ	57,700	1,933.00	111,534,100
クロスキャット	9,900	1,053.00	10,424,700
システナ	290,400	265.00	76,956,000
デジタルアーツ	10,900	4,850.00	52,865,000
日鉄ソリューションズ	29,500	3,970.00	117,115,000
キューブシステム	10,300	1,160.00	11,948,000
コア	7,700	1,726.00	13,290,200
手間いらず	2,900	3,405.00	9,874,500
ラクーンホールディングス	14,400	734.00	10,569,600
ソリトンシステムズ	8,900	1,127.00	10,030,300
ソフトクリエイイトホールディングス	14,200	1,777.00	25,233,400
T I S	188,900	3,412.00	644,526,800
J N Sホールディングス	5,400	455.00	2,457,000
グリー	46,400	621.00	28,814,400
G M Oペパボ	2,500	1,359.00	3,397,500
コーエーテクモホールディングス	108,200	2,277.00	246,371,400
三菱総合研究所	8,500	4,960.00	42,160,000
電算	1,400	1,556.00	2,178,400
A G S	4,900	723.00	3,542,700
ファインデックス	13,800	641.00	8,845,800
ブレインパッド	13,000	942.00	12,246,000
K L a b	34,300	272.00	9,329,600
ポールトゥウィンホールディングス	29,500	702.00	20,709,000
ネクソン	385,000	2,824.50	1,087,432,500
アイスタイル	51,300	486.00	24,931,800
エムアップホールディングス	21,200	1,465.00	31,058,000
エイチーム	10,300	673.00	6,931,900
エニグモ	22,100	373.00	8,243,300
テクノスジャパン	9,500	675.00	6,412,500
コロプラ	67,000	632.00	42,344,000
ブロードリーフ	100,600	529.00	53,217,400
クロス・マーケティンググループ	7,000	718.00	5,026,000

デジタルハーツホールディングス	10,800	1,250.00	13,500,000
システム情報	13,800	746.00	10,294,800
メディアドゥ	6,800	1,148.00	7,806,400
じげん	50,400	593.00	29,887,200
ブイキューブ	20,800	420.00	8,736,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	497.00	1,391,600
サイバーリンクス	4,500	710.00	3,195,000
フィックスターズ	19,500	1,230.00	23,985,000
CARTA HOLDINGS	8,100	1,213.00	9,825,300
オブティム	14,200	897.00	12,737,400
セレス	7,000	985.00	6,895,000
SHIFT	11,500	29,965.00	344,597,500
ティーガイア	18,100	1,725.00	31,222,500
セック	1,600	3,390.00	5,424,000
テクマトリックス	31,600	1,572.00	49,675,200
プロシップ	7,600	1,279.00	9,720,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	2,382.00	107,190,000
GMOペイメントゲートウェイ	34,500	9,471.00	326,749,500
ザッパラス	3,300	504.00	1,663,200
システムリサーチ	5,400	2,564.00	13,845,600
インターネットイニシアティブ	94,300	2,574.50	242,775,350
さくらインターネット	19,400	1,221.00	23,687,400
ヴィンクス	2,800	1,336.00	3,740,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	3,040.00	16,112,000
SRAホールディングス	8,800	3,395.00	29,876,000
システムインテグレータ	3,500	425.00	1,487,500
朝日ネット	18,600	622.00	11,569,200
eBASE	24,300	695.00	16,888,500
アバントグループ	21,800	1,446.00	31,522,800
アドソル日進	7,300	1,745.00	12,738,500
ODKソリューションズ	2,600	575.00	1,495,000
フリービット	9,100	1,172.00	10,665,200
コムチュア	22,900	2,381.00	54,524,900
サイバーコム	1,900	1,341.00	2,547,900
アステリア	13,600	756.00	10,281,600
アイル	8,100	2,640.00	21,384,000
マークライنز	9,400	3,020.00	28,388,000
メディカル・データ・ビジョン	25,700	727.00	18,683,900
gumi	25,500	636.00	16,218,000
ショーケース	2,800	406.00	1,136,800
モバイルファクトリー	2,500	809.00	2,022,500
テラスカイ	7,500	1,958.00	14,685,000

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,824.00	18,240,000
P C Iホールディングス	4,400	1,074.00	4,725,600
アイビーシー	1,800	562.00	1,011,600
ネオジャパン	5,800	1,111.00	6,443,800
P R T I M E S	4,400	1,664.00	7,321,600
ラクス	81,700	2,273.50	185,744,950
ランドコンピュータ	2,800	1,225.00	3,430,000
ダブルスタンダード	7,000	1,391.00	9,737,000
オープンドア	12,100	1,135.00	13,733,500
アカツキ	8,200	1,951.00	15,998,200
ベネフィットジャパン	700	1,204.00	842,800
U b i c o mホールディングス	5,400	1,267.00	6,841,800
カナミックネットワーク	18,700	498.00	9,312,600
ノムラシステムコーポレーション	12,900	117.00	1,509,300
チェンジホールディングス	42,300	1,935.00	81,850,500
シンクロ・フード	7,300	573.00	4,182,900
オークネット	8,500	1,735.00	14,747,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	814.00	1,872,200
セグエグループ	3,700	914.00	3,381,800
エイトレッド	1,800	1,440.00	2,592,000
マクロミル	33,900	729.00	24,713,100
ビーグリー	2,400	1,100.00	2,640,000
オロ	6,300	2,127.00	13,400,100
ユーザーローカル	6,200	2,097.00	13,001,400
テモナ	2,800	286.00	800,800
ニーズウェル	6,300	688.00	4,334,400
マネーフォワード	38,400	5,251.00	201,638,400
サインポスト	4,400	438.00	1,927,200
S u n A s t e r i s k	12,300	1,311.00	16,125,300
電算システムホールディングス	8,300	2,863.00	23,762,900
A p p i e r G r o u p	58,900	1,743.00	102,662,700
ソルクシーズ	9,400	408.00	3,835,200
フェイス	3,300	486.00	1,603,800
プロトコーポレーション	21,600	1,177.00	25,423,200
ハイマックス	5,400	1,405.00	7,587,000
野村総合研究所	344,000	4,158.00	1,430,352,000
サイバネットシステム	14,500	746.00	10,817,000
C Eホールディングス	6,000	566.00	3,396,000
日本システム技術	4,800	2,141.00	10,276,800
インテージホールディングス	19,500	1,729.00	33,715,500
東邦システムサイエンス	3,200	1,918.00	6,137,600
ソースネクスト	88,000	189.00	16,632,000

インフォコム	22,300	2,927.00	65,272,100
シンプレクス・ホールディングス	29,600	2,721.00	80,541,600
HEROZ	5,800	1,715.00	9,947,000
ラクスル	41,400	1,362.00	56,386,800
メルカリ	104,400	3,199.00	333,975,600
I P S	5,600	2,191.00	12,269,600
F I G	13,500	294.00	3,969,000
システムサポート	6,700	1,760.00	11,792,000
イーソル	12,300	759.00	9,335,700
東海ソフト	1,700	1,058.00	1,798,600
ウイングアーク1st	17,800	2,528.00	44,998,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,405.00	6,463,000
サーバーワークス	3,500	3,325.00	11,637,500
東名	900	2,220.00	1,998,000
ヴィッツ	1,200	1,094.00	1,312,800
トピラシステムズ	3,300	936.00	3,088,800
S a n s a n	56,500	1,347.50	76,133,750
L i n k - U	2,800	880.00	2,464,000
ギフトィ	18,800	1,625.00	30,550,000
メドレー	23,200	5,410.00	125,512,000
ベース	5,900	4,380.00	25,842,000
J M D C	28,400	4,275.00	121,410,000
フォーカスシステムズ	12,600	975.00	12,285,000
クレスコ	13,300	1,877.00	24,964,100
フジ・メディア・ホールディングス	165,900	1,505.00	249,679,500
オービック	57,700	25,155.00	1,451,443,500
ジャストシステム	24,800	3,005.00	74,524,000
T D C ソフト	14,600	1,648.00	24,060,800
Zホールディングス	2,457,400	413.00	1,014,906,200
トレンドマイクロ	81,600	6,142.00	501,187,200
I Dホールディングス	11,700	1,376.00	16,099,200
日本オラクル	33,000	10,250.00	338,250,000
アルファシステムズ	5,400	2,975.00	16,065,000
フューチャー	36,900	1,507.00	55,608,300
C A C H o l d i n g s	10,600	1,690.00	17,914,000
S Bテクノロジー	7,300	2,403.00	17,541,900
トーセ	3,400	751.00	2,553,400
オービックビジネスコンサルタント	34,000	5,970.00	202,980,000
伊藤忠テクノソリューションズ	92,700	4,318.00	400,278,600
アイティフォー	22,800	1,049.00	23,917,200
東計電算	2,400	6,430.00	15,432,000
エクスネット	1,600	1,043.00	1,668,800

大塚商会	85,600	6,336.00	542,361,600
サイボウズ	23,800	2,061.00	49,051,800
電通国際情報サービス	21,000	5,730.00	120,330,000
A C C E S S	20,500	937.00	19,208,500
デジタルガレージ	30,700	3,775.00	115,892,500
E Mシステムズ	28,800	717.00	20,649,600
ウェザーニューズ	5,300	6,400.00	33,920,000
C I J	28,700	547.00	15,698,900
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,210.00	7,704,000
日本エンタープライズ	12,200	133.00	1,622,600
WOWOW	13,000	1,128.00	14,664,000
スカラ	16,000	731.00	11,696,000
インテリジェント ウェイブ	6,200	896.00	5,555,200
A N Y C O L O R	6,000	3,260.00	19,560,000
I M A G I C A G R O U P	14,500	614.00	8,903,000
ネットワンシステムズ	64,300	2,780.50	178,786,150
システムソフト	60,600	82.00	4,969,200
アルゴグラフィックス	15,800	3,320.00	52,456,000
マーベラス	28,100	683.00	19,192,300
エイベックス	29,400	1,405.00	41,307,000
B I P R O G Y	63,600	3,737.00	237,673,200
都築電気	9,100	2,325.00	21,157,500
T B Sホールディングス	88,400	2,524.00	223,121,600
日本テレビホールディングス	152,900	1,339.00	204,733,100
朝日放送グループホールディングス	16,200	675.00	10,935,000
テレビ朝日ホールディングス	41,900	1,657.00	69,428,300
スカパーJ S A Tホールディングス	153,300	647.00	99,185,100
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,981.00	36,964,400
日本BS放送	4,200	921.00	3,868,200
ビジョン	26,000	1,684.00	43,784,000
スマートバリュー	2,900	381.00	1,104,900
U S E N - N E X T H O L D I N G S	19,400	3,460.00	67,124,000
ワイヤレスゲート	5,200	206.00	1,071,200
日本通信	159,500	224.00	35,728,000
クロップス	1,900	1,010.00	1,919,000
日本電信電話	55,312,800	166.50	9,209,581,200
K D D I	1,334,300	4,279.00	5,709,469,700
ソフトバンク	2,775,200	1,644.00	4,562,428,800
光通信	20,300	23,600.00	479,080,000
エムティーアイ	11,900	577.00	6,866,300
G M Oインターネットグループ	63,800	2,331.50	148,749,700
ファイバーゲート	9,300	1,441.00	13,401,300



アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	261.00	730,800
KADOKAWA	91,300	3,432.00	313,341,600
学研ホールディングス	28,800	835.00	24,048,000
ゼンリン	29,600	897.00	26,551,200
昭文社ホールディングス	5,000	305.00	1,525,000
インプレスホールディングス	10,300	183.00	1,884,900
アイネット	10,500	1,724.00	18,102,000
松竹	9,900	10,840.00	107,316,000
東宝	108,100	5,512.00	595,847,200
東映	4,800	17,290.00	82,992,000
NTTデータグループ	541,800	1,912.50	1,036,192,500
ピー・シー・エー	9,900	1,214.00	12,018,600
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,088.00	15,451,200
DTS	36,800	3,220.00	118,496,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,800	5,399.00	468,633,200
シーイーシー	24,200	1,663.00	40,244,600
カブコン	171,600	5,999.00	1,029,428,400
アイ・エス・ビー	8,800	1,358.00	11,950,400
ジャステック	10,600	1,435.00	15,211,000
SCSK	140,900	2,512.50	354,011,250
NSW	6,700	2,706.00	18,130,200
アイネス	12,100	1,634.00	19,771,400
TKC	27,500	3,615.00	99,412,500
富士ソフト	34,700	4,500.00	156,150,000
NSD	61,600	2,535.00	156,156,000
コナミグループ	73,900	8,398.00	620,612,200
福井コンピュータホールディングス	12,000	2,694.00	32,328,000
JBCホールディングス	12,600	2,590.00	32,634,000
ミロク情報サービス	15,700	1,531.00	24,036,700
ソフトバンクグループ	851,800	6,572.00	5,598,029,600
高千穂交易	4,300	3,190.00	13,717,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,738.00	3,128,400
伊藤忠食品	4,100	5,990.00	24,559,000
エレマテック	16,400	1,840.00	30,176,000
あらた	13,900	5,260.00	73,114,000
トーメンデバイス	2,600	4,935.00	12,831,000
東京エレクトロン デバイス	6,700	9,770.00	65,459,000
円谷フィールズホールディングス	31,300	2,556.00	80,002,800
双日	181,600	3,105.00	563,868,000
アルフレッサ ホールディングス	182,800	2,466.50	450,876,200
横浜冷凍	49,600	1,303.00	64,628,800
ラサ商事	5,600	1,540.00	8,624,000

アルコニックス	24,000	1,390.00	33,360,000
神戸物産	140,900	3,604.00	507,803,600
ハイパー	2,700	355.00	958,500
あい ホールディングス	29,200	2,345.00	68,474,000
ディーブイエックス	3,400	857.00	2,913,800
ダイワボウホールディングス	74,400	2,878.50	214,160,400
マクニカホールディングス	43,100	6,330.00	272,823,000
ラクト・ジャパン	7,100	2,018.00	14,327,800
グリムス	7,600	2,391.00	18,171,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	978.00	25,917,000
八洲電機	14,700	1,284.00	18,874,800
メディアスホールディングス	11,700	771.00	9,020,700
レスターホールディングス	17,400	2,369.00	41,220,600
ジューテックホールディングス	2,800	1,214.00	3,399,200
大光	5,100	614.00	3,131,400
OCHIホールディングス	2,800	1,378.00	3,858,400
TOKAIホールディングス	90,000	932.00	83,880,000
黒谷	3,400	628.00	2,135,200
Cominix	2,400	849.00	2,037,600
三洋貿易	20,600	1,338.00	27,562,800
ビューティガレージ	2,900	4,565.00	13,238,500
ウイン・パートナーズ	13,300	1,065.00	14,164,500
ミタチ産業	3,100	1,140.00	3,534,000
シップヘルスケアホールディングス	65,500	2,459.00	161,064,500
明治電機工業	6,800	1,484.00	10,091,200
デリカフーズホールディングス	4,800	624.00	2,995,200
スターティアホールディングス	2,400	1,807.00	4,336,800
コメダホールディングス	44,700	2,807.00	125,472,900
ピーバンドットコム	1,800	456.00	820,800
アセンテック	6,200	633.00	3,924,600
富士興産	2,700	1,811.00	4,889,700
協栄産業	1,100	2,172.00	2,389,200
フルサト・マルカホールディングス	18,100	2,767.00	50,082,700
ヤマエグループホールディングス	10,300	4,480.00	46,144,000
小野建	17,900	1,667.00	29,839,300
南陽	2,300	2,116.00	4,866,800
佐島電機	7,600	1,557.00	11,833,200
エコートレーディング	2,400	1,314.00	3,153,600
伯東	10,400	5,030.00	52,312,000
コンドーテック	14,000	1,168.00	16,352,000
中山福	6,500	345.00	2,242,500
ナガイレーベン	23,000	2,277.00	52,371,000

三菱食品	16,800	3,960.00	66,528,000
松田産業	13,900	2,198.00	30,552,200
第一興商	70,500	2,790.50	196,730,250
メディバルホールディングス	174,200	2,461.00	428,706,200
S P K	8,100	1,955.00	15,835,500
萩原電気ホールディングス	7,400	3,780.00	27,972,000
アズワン	25,900	5,760.00	149,184,000
スズデン	6,400	2,196.00	14,054,400
尾家産業	2,900	1,943.00	5,634,700
シモジマ	12,500	1,143.00	14,287,500
ドウシシャ	19,300	2,323.00	44,833,900
小津産業	2,700	1,569.00	4,236,300
高速	9,500	2,076.00	19,722,000
たけびし	7,000	1,870.00	13,090,000
リックス	2,500	3,035.00	7,587,500
丸文	16,300	1,164.00	18,973,200
ハピネット	15,500	2,507.00	38,858,500
橋本総業ホールディングス	7,200	1,131.00	8,143,200
日本ライフライン	53,400	1,128.00	60,235,200
タカショー	15,900	634.00	10,080,600
I D O M	55,100	797.00	43,914,700
進和	11,200	2,248.00	25,177,600
エスケイジャパン	3,000	693.00	2,079,000
ダイトロン	7,200	3,070.00	22,104,000
シークス	26,000	1,508.00	39,208,000
田中商事	3,500	676.00	2,366,000
オーハシテクニカ	8,800	1,603.00	14,106,400
白銅	6,600	2,304.00	15,206,400
ダイコー通産	1,300	1,152.00	1,497,600
伊藤忠商事	1,122,400	5,514.00	6,188,913,600
丸紅	1,421,400	2,349.50	3,339,579,300
高島	1,900	3,630.00	6,897,000
長瀬産業	83,500	2,501.50	208,875,250
蝶理	9,800	2,833.00	27,763,400
豊田通商	159,600	8,610.00	1,374,156,000
三共生興	26,100	705.00	18,400,500
兼松	70,700	2,043.00	144,440,100
ツカモトコーポレーション	1,700	1,289.00	2,191,300
三井物産	1,292,700	5,399.00	6,979,287,300
日本紙パルプ商事	9,700	4,675.00	45,347,500
カメイ	19,400	1,448.00	28,091,200
東都水産	600	6,280.00	3,768,000

OU Gホールディングス	1,800	2,481.00	4,465,800
スターゼン	13,800	2,579.00	35,590,200
山善	49,100	1,129.00	55,433,900
椿本興業	2,900	5,020.00	14,558,000
住友商事	1,108,900	2,944.00	3,264,601,600
内田洋行	7,400	6,480.00	47,952,000
三菱商事	1,110,600	6,999.00	7,773,089,400
第一実業	6,400	5,290.00	33,856,000
キャノンマーケティングジャパン	42,200	3,764.00	158,840,800
西華産業	7,200	2,089.00	15,040,800
佐藤商事	12,700	1,454.00	18,465,800
菱洋エレクトロ	15,500	3,355.00	52,002,500
東京産業	16,700	828.00	13,827,600
ユアサ商事	15,700	4,245.00	66,646,500
神鋼商事	4,600	5,630.00	25,898,000
トルク	6,600	246.00	1,623,600
阪和興業	32,700	4,625.00	151,237,500
正栄食品工業	12,100	4,510.00	54,571,000
カナデン	12,200	1,295.00	15,799,000
RYODEN	14,700	2,312.00	33,986,400
岩谷産業	41,500	7,474.00	310,171,000
ナイス	3,300	1,527.00	5,039,100
ニチモウ	1,600	3,925.00	6,280,000
極東貿易	10,900	1,840.00	20,056,000
アステナホールディングス	34,200	454.00	15,526,800
三愛オブリ	48,200	1,660.00	80,012,000
稲畑産業	36,800	3,185.00	117,208,000
G S Iクレオス	10,600	2,148.00	22,768,800
明和産業	24,300	662.00	16,086,600
クワザワホールディングス	3,900	510.00	1,989,000
ワキタ	33,500	1,331.00	44,588,500
東邦ホールディングス	45,400	2,877.50	130,638,500
サンゲツ	45,700	2,919.00	133,398,300
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,288.00	30,010,400
シナネンホールディングス	5,900	4,020.00	23,718,000
伊藤忠エネクス	45,200	1,466.00	66,263,200
サンリオ	51,600	7,410.00	382,356,000
サンワテクノス	9,300	2,193.00	20,394,900
リョーサン	19,300	4,030.00	77,779,000
新光商事	24,500	1,143.00	28,003,500
トーホー	7,800	3,070.00	23,946,000
三信電気	7,400	2,162.00	15,998,800

東陽テクニカ	18,500	1,334.00	24,679,000
モスフードサービス	26,800	3,340.00	89,512,000
加賀電子	14,800	6,560.00	97,088,000
ソーダニッカ	8,900	898.00	7,992,200
立花エレテック	13,300	2,617.00	34,806,100
フォーバル	7,200	1,224.00	8,812,800
PALTAC	28,600	4,719.00	134,963,400
三谷産業	31,900	321.00	10,239,900
西本Wismettacホールディングス	4,600	4,500.00	20,700,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,978.00	1,978,000
コア商事ホールディングス	10,300	692.00	7,127,600
KPPグループホールディングス	42,500	634.00	26,945,000
ヤマタネ	8,100	1,894.00	15,341,400
丸紅建材リース	1,100	2,577.00	2,834,700
泉州電業	9,100	3,840.00	34,944,000
トラスコ中山	38,300	2,503.00	95,864,900
オートバックスセブン	63,400	1,610.00	102,074,000
モリト	13,100	1,220.00	15,982,000
加藤産業	22,500	4,105.00	92,362,500
北恵	3,100	820.00	2,542,000
イエローハット	32,200	1,874.00	60,342,800
JKホールディングス	14,000	975.00	13,650,000
日伝	10,800	2,518.00	27,194,400
北沢産業	6,500	318.00	2,067,000
杉本商事	8,100	2,236.00	18,111,600
因幡電機産業	47,200	3,145.00	148,444,000
東テク	6,100	5,230.00	31,903,000
ミスミグループ本社	274,900	2,491.50	684,913,350
アルテック	6,600	252.00	1,663,200
タキヒヨー	3,000	1,113.00	3,339,000
蔵王産業	2,000	2,594.00	5,188,000
スズケン	53,300	4,190.00	223,327,000
ジェコス	10,900	943.00	10,278,700
グローセル	14,700	423.00	6,218,100
ローソン	45,200	7,002.00	316,490,400
サンエー	14,000	4,830.00	67,620,000
カワチ薬品	14,500	2,283.00	33,103,500
エービーシー・マート	26,600	7,729.00	205,591,400
ハードオフコーポレーション	5,200	1,475.00	7,670,000
アスクル	37,900	1,929.00	73,109,100
ゲオホールディングス	18,000	2,536.00	45,648,000
アダストリア	22,200	2,943.00	65,334,600

くら寿司	21,500	3,080.00	66,220,000
キャンドウ	6,700	2,943.00	19,718,100
I Kホールディングス	5,100	380.00	1,938,000
パルグループホールディングス	18,000	4,020.00	72,360,000
エディオン	72,400	1,460.00	105,704,000
サーラコーポレーション	38,900	743.00	28,902,700
ワッツ	6,600	626.00	4,131,600
ハローズ	8,400	4,000.00	33,600,000
あみやき亭	4,500	3,440.00	15,480,000
大黒天物産	5,700	6,280.00	35,796,000
ハニーズホールディングス	14,700	1,651.00	24,269,700
ファーマライズホールディングス	3,300	633.00	2,088,900
アルペン	15,300	1,889.00	28,901,700
ハブ	4,500	930.00	4,185,000
クオールホールディングス	25,300	1,844.00	46,653,200
ジーンズホールディングス	10,900	3,475.00	37,877,500
ビックカメラ	97,300	1,107.00	107,711,100
D C Mホールディングス	106,300	1,230.00	130,749,000
MonotaRO	258,500	1,714.00	443,069,000
東京一番フーズ	3,700	529.00	1,957,300
きちりホールディングス	2,900	852.00	2,470,800
アークランドサービスホールディングス	15,100	3,045.00	45,979,500
J . フロント リテイリング	226,800	1,491.00	338,158,800
ドトール・日レスホールディングス	32,500	2,289.00	74,392,500
マツキヨココカラ & カンパニー	110,500	8,315.00	918,807,500
ブロンコビリー	10,800	2,958.00	31,946,400
Z O Z O	120,600	2,887.50	348,232,500
トレジャー・ファクトリー	7,900	1,410.00	11,139,000
物語コーポレーション	30,600	4,575.00	139,995,000
三越伊勢丹ホールディングス	307,000	1,647.00	505,629,000
H a m e e	6,800	1,122.00	7,629,600
マーケットエンタープライズ	1,500	1,220.00	1,830,000
ウエルシアホールディングス	94,700	2,631.50	249,203,050
クリエイトSDホールディングス	30,200	3,685.00	111,287,000
丸善C H I ホールディングス	15,700	339.00	5,322,300
ミサワ	3,000	615.00	1,845,000
ティーライフ	2,000	1,406.00	2,812,000
チムニー	3,700	1,458.00	5,394,600
シュッピン	14,000	1,145.00	16,030,000
オイシックス・ラ・大地	24,700	1,645.00	40,631,500
ネクステージ	41,700	3,210.00	133,857,000
ジョイフル本田	53,300	1,691.00	90,130,300

鳥貴族ホールディングス	6,900	3,055.00	21,079,500
ホットランド	14,200	1,637.00	23,245,400
すかいらーくホールディングス	249,300	1,992.00	496,605,600
SFPホールディングス	10,000	2,333.00	23,330,000
綿半ホールディングス	14,400	1,361.00	19,598,400
ヨシックスホールディングス	2,600	2,776.00	7,217,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	59,800	1,130.00	67,574,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	720.00	6,408,000
BEENOS	8,000	1,669.00	13,352,000
あさひ	15,600	1,284.00	20,030,400
日本調剤	12,800	1,338.00	17,126,400
コスモス薬品	18,100	16,865.00	305,256,500
トーエル	6,000	764.00	4,584,000
セブン&アイ・ホールディングス	627,800	6,027.00	3,783,750,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,000	1,134.00	155,358,000
ツルハホールディングス	38,300	10,545.00	403,873,500
サンマルクホールディングス	14,900	1,868.00	27,833,200
フェリシモ	3,200	1,014.00	3,244,800
トリドールホールディングス	45,400	3,915.00	177,741,000
TOKYO BASE	20,200	310.00	6,262,000
ウイルプラスホールディングス	2,300	1,138.00	2,617,400
JMホールディングス	14,000	1,863.00	26,082,000
サツドラホールディングス	6,100	780.00	4,758,000
アレンザホールディングス	14,100	1,012.00	14,269,200
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,551.00	8,065,200
パロックジャパンリミテッド	12,300	851.00	10,467,300
クスリのアオキホールディングス	16,300	9,169.00	149,454,700
力の源ホールディングス	7,000	2,245.00	15,715,000
FOOD & LIFE COMPANIES	97,300	2,547.00	247,823,100
メディカルシステムネットワーク	17,100	391.00	6,686,100
はるやまホールディングス	6,000	510.00	3,060,000
ノジマ	59,800	1,267.00	75,766,600
カップ・クリエイト	28,600	1,602.00	45,817,200
ライトオン	9,200	554.00	5,096,800
良品計画	199,100	1,866.00	371,520,600
パリミキホールディングス	16,600	365.00	6,059,000
アドヴァングループ	17,800	985.00	17,533,000
アルビス	6,100	2,452.00	14,957,200
コナカ	13,200	431.00	5,689,200
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,605.00	2,889,000

G - 7ホールディングス	23,100	1,236.00	28,551,600	
イオン北海道	27,100	851.00	23,062,100	
コジマ	30,800	660.00	20,328,000	
ヒマラヤ	4,300	963.00	4,140,900	
コーナン商事	24,700	3,555.00	87,808,500	
エコス	7,000	2,069.00	14,483,000	
ワタミ	22,000	1,033.00	22,726,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	367,800	2,793.00	1,027,265,400	
西松屋チェーン	40,600	1,709.00	69,385,400	
ゼンショーホールディングス	99,800	6,981.00	696,703,800	
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,020.00	12,138,000	
ハークスレイ	5,000	707.00	3,535,000	
サイゼリヤ	27,000	4,390.00	118,530,000	
V Tホールディングス	70,100	502.00	35,190,200	
魚力	5,900	2,168.00	12,791,200	
フジ・コーポレーション	10,600	1,860.00	19,716,000	
ユナイテッドアローズ	19,600	2,094.00	41,042,400	
ハイデイ日高	27,200	2,798.00	76,105,600	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	9,700	183.00	1,775,100	
コロワイド	83,900	2,361.00	198,087,900	
壱番屋	14,500	5,580.00	80,910,000	
P L A N T	3,400	788.00	2,679,200	
スギホールディングス	36,800	6,502.00	239,273,600	
薬王堂ホールディングス	10,400	2,560.00	26,624,000	
スクロール	27,500	985.00	27,087,500	
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,914.00	30,432,600	
木曽路	27,800	2,624.00	72,947,200	
S R S ホールディングス	30,500	1,050.00	32,025,000	
千趣会	34,700	402.00	13,949,400	
リテールパートナーズ	27,300	1,440.00	39,312,000	
ケーヨー	29,500	861.00	25,399,500	
上新電機	16,500	2,228.00	36,762,000	
日本瓦斯	96,700	2,264.50	218,977,150	
ロイヤルホールディングス	35,200	2,632.00	92,646,400	
いなげや	17,800	1,497.00	26,646,600	
チヨダ	17,900	993.00	17,774,700	
ライフコーポレーション	16,000	3,640.00	58,240,000	
リンガーハット	23,500	2,370.00	55,695,000	
M r M a x H D	26,300	602.00	15,832,600	
A O K I ホールディングス	34,000	1,010.00	34,340,000	
オークワ	29,300	873.00	25,578,900	



コメリ	28,200	3,025.00	85,305,000
青山商事	39,300	1,508.00	59,264,400
しまむら	21,400	15,670.00	335,338,000
はせがわ	7,000	344.00	2,408,000
高島屋	137,400	2,167.00	297,745,800
松屋	31,000	1,068.00	33,108,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	88,800	1,679.00	149,095,200
近鉄百貨店	8,000	2,666.00	21,328,000
丸井グループ	134,400	2,499.50	335,932,800
アクシアル リテイリング	12,500	3,680.00	46,000,000
イオン	617,500	3,078.00	1,900,665,000
イズミ	27,700	3,600.00	99,720,000
平和堂	30,500	2,414.00	73,627,000
フジ	28,000	1,818.00	50,904,000
ヤオコー	20,600	7,619.00	156,951,400
ゼビオホールディングス	25,100	1,007.00	25,275,700
ケーズホールディングス	129,100	1,350.00	174,285,000
Olympicグループ	5,400	524.00	2,829,600
日産東京販売ホールディングス	16,600	440.00	7,304,000
シルバーライフ	3,900	1,169.00	4,559,100
Genky DrugStores	8,100	5,230.00	42,363,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,135.00	2,724,000
ブックオフグループホールディングス	8,300	1,209.00	10,034,700
ギフトホールディングス	8,000	2,531.00	20,248,000
アインホールディングス	25,200	5,077.00	127,940,400
元気寿司	5,300	4,360.00	23,108,000
ヤマダホールディングス	748,000	466.30	348,792,400
アーケランズ	26,900	1,648.00	44,331,200
ニトリホールディングス	73,700	16,505.00	1,216,418,500
グルメ杵屋	15,200	1,150.00	17,480,000
愛眼	9,000	181.00	1,629,000
ケーユーホールディングス	11,000	1,200.00	13,200,000
吉野家ホールディングス	71,500	2,771.00	198,126,500
松屋フーズホールディングス	8,700	4,170.00	36,279,000
サガミホールディングス	29,600	1,354.00	40,078,400
関西フードマーケット	16,800	1,432.00	24,057,600
王将フードサービス	12,100	6,890.00	83,369,000
ミニストップ	13,300	1,467.00	19,511,100
アークス	33,600	2,572.00	86,419,200
パローホールディングス	35,000	2,094.00	73,290,000
ベルク	9,100	6,690.00	60,879,000
大庄	7,000	1,119.00	7,833,000

ファーストリテイリング	82,000	33,090.00	2,713,380,000
サンドラッグ	69,300	4,252.00	294,663,600
サクスパー ホールディングス	17,800	929.00	16,536,200
ヤマザワ	2,600	1,289.00	3,351,400
やまや	2,700	2,965.00	8,005,500
ペルーナ	44,500	720.00	32,040,000
いよぎんホールディングス	201,800	994.00	200,589,200
しずおかフィナンシャルグループ	376,700	1,179.00	444,129,300
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	142,800	958.30	136,845,240
楽天銀行	59,000	1,879.00	110,861,000
島根銀行	3,900	505.00	1,969,500
じもとホールディングス	10,000	406.00	4,060,000
めぶきフィナンシャルグループ	841,400	404.00	339,925,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	3,755.00	81,483,500
九州フィナンシャルグループ	298,300	689.90	205,797,170
ゆうちょ銀行	465,800	1,170.50	545,218,900
富山第一銀行	53,800	834.00	44,869,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	909,800	637.20	579,724,560
西日本フィナンシャルホールディングス	105,200	1,475.00	155,170,000
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,714.00	26,052,800
第四北越フィナンシャルグループ	26,600	3,595.00	95,627,000
ひろぎんホールディングス	221,200	875.70	193,704,840
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,170.00	33,852,000
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,590.00	78,980,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	4,900.00	87,710,000
プロクレアホールディングス	20,800	1,982.00	41,225,600
あいちフィナンシャルグループ	23,700	2,429.00	57,567,300
あおぞら銀行	106,600	2,838.00	302,530,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,619,100	1,155.50	12,270,370,050
りそなホールディングス	2,143,100	761.70	1,632,399,270
三井住友トラスト・ホールディングス	304,700	5,433.00	1,655,435,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,205,100	6,580.00	7,929,558,000
千葉銀行	472,500	1,026.50	485,021,250
群馬銀行	329,000	655.70	215,725,300
武蔵野銀行	21,800	2,582.00	56,287,600
千葉興業銀行	26,400	748.00	19,747,200
筑波銀行	74,400	230.00	17,112,000
七十七銀行	54,300	3,075.00	166,972,500
秋田銀行	11,400	1,819.00	20,736,600
山形銀行	18,800	1,082.00	20,341,600
岩手銀行	11,600	2,404.00	27,886,400
東邦銀行	134,100	269.00	36,072,900

東北銀行	5,500	1,073.00	5,901,500
ふくおかフィナンシャルグループ	135,400	3,392.00	459,276,800
スルガ銀行	149,500	594.00	88,803,000
八十二銀行	358,100	780.10	279,353,810
山梨中央銀行	17,400	1,470.00	25,578,000
大垣共立銀行	32,300	1,982.00	64,018,600
福井銀行	15,200	1,531.00	23,271,200
清水銀行	6,700	1,542.00	10,331,400
富山銀行	1,700	1,752.00	2,978,400
滋賀銀行	28,200	3,175.00	89,535,000
南都銀行	25,500	2,606.00	66,453,000
百五銀行	159,500	494.00	78,793,000
京都銀行	53,700	8,538.00	458,490,600
紀陽銀行	60,700	1,484.00	90,078,800
ほくほくフィナンシャルグループ	107,800	1,292.00	139,277,600
山陰合同銀行	106,100	901.00	95,596,100
鳥取銀行	3,600	1,263.00	4,546,800
百十四銀行	15,500	2,195.00	34,022,500
四国銀行	26,900	919.00	24,721,100
阿波銀行	23,800	2,219.00	52,812,200
大分銀行	10,200	2,392.00	24,398,400
宮崎銀行	11,100	2,593.00	28,782,300
佐賀銀行	9,900	1,796.00	17,780,400
琉球銀行	38,900	1,035.00	40,261,500
セブン銀行	607,400	306.10	185,925,140
みずほフィナンシャルグループ	2,452,200	2,385.50	5,849,723,100
高知銀行	3,900	966.00	3,767,400
山口フィナンシャルグループ	166,300	1,137.00	189,083,100
名古屋銀行	11,200	4,235.00	47,432,000
北洋銀行	256,900	297.00	76,299,300
大光銀行	3,400	1,213.00	4,124,200
愛媛銀行	22,800	867.00	19,767,600
トマト銀行	3,700	1,108.00	4,099,600
京葉銀行	77,600	583.00	45,240,800
栃木銀行	77,600	284.00	22,038,400
北日本銀行	5,900	2,141.00	12,631,900
東和銀行	31,100	561.00	17,447,100
福島銀行	11,900	224.00	2,665,600
大東銀行	4,400	670.00	2,948,000
トモニホールディングス	137,000	403.00	55,211,000
フィデアホールディングス	17,500	1,492.00	26,110,000
池田泉州ホールディングス	217,100	257.00	55,794,700

F P G	57,500	1,471.00	84,582,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,624.00	22,736,000
マーキュリアホールディングス	6,000	771.00	4,626,000
S B I ホールディングス	245,600	2,943.00	722,800,800
ジャフコ グループ	56,700	1,808.50	102,541,950
大和証券グループ本社	1,212,700	806.50	978,042,550
野村ホールディングス	3,055,400	558.80	1,707,357,520
岡三証券グループ	149,100	576.00	85,881,600
丸三証券	56,700	522.00	29,597,400
東洋証券	56,700	324.00	18,370,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	184,900	448.00	82,835,200
光世証券	2,800	586.00	1,640,800
水戸証券	45,900	420.00	19,278,000
いちよし証券	31,500	690.00	21,735,000
松井証券	100,300	818.00	82,045,400
マネックスグループ	183,000	522.00	95,526,000
極東証券	21,300	784.00	16,699,200
岩井コスモホールディングス	19,400	1,731.00	33,581,400
アイザワ証券グループ	24,700	847.00	20,920,900
マネーパートナーズグループ	12,300	286.00	3,517,800
スパークス・グループ	19,000	1,497.00	28,443,000
かんぽ生命保険	197,400	2,321.50	458,264,100
S O M P O ホールディングス	291,000	6,298.00	1,832,718,000
アニコム ホールディングス	57,600	659.00	37,958,400
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	345,100	5,221.00	1,801,767,100
第一生命ホールディングス	828,400	2,657.50	2,201,473,000
東京海上ホールディングス	1,676,000	3,218.00	5,393,368,000
T & D ホールディングス	455,000	2,330.50	1,060,377,500
アドバンスクリエイト	9,800	1,117.00	10,946,600
全国保証	44,400	4,998.00	221,911,200
あんしん保証	6,600	280.00	1,848,000
イントラスト	4,700	909.00	4,272,300
日本モーゲージサービス	6,900	564.00	3,891,600
C a s a	4,800	854.00	4,099,200
アルヒ	21,300	926.00	19,723,800
プレミアグループ	28,800	1,671.00	48,124,800
ネットプロテクションズホールディングス	57,200	351.00	20,077,200
クレディセゾン	107,600	2,206.50	237,419,400
芙蓉総合リース	15,600	11,750.00	183,300,000
みずほリース	25,300	4,680.00	118,404,000
東京センチュリー	31,700	5,480.00	173,716,000
日本証券金融	62,600	1,224.00	76,622,400

アイフル	281,800	343.00	96,657,400
リコーリース	16,200	4,230.00	68,526,000
イオンフィナンシャルサービス	97,600	1,276.50	124,586,400
アコム	303,600	342.50	103,983,000
ジャックス	18,100	5,050.00	91,405,000
オリエントコーポレーション	44,600	1,098.00	48,970,800
オリックス	1,113,100	2,657.00	2,957,506,700
三菱HCキャピタル	661,500	926.20	612,681,300
九州リースサービス	5,700	832.00	4,742,400
日本取引所グループ	476,600	2,558.00	1,219,142,800
イー・ギャランティ	27,700	1,955.00	54,153,500
アサックス	5,600	658.00	3,684,800
NECキャピタルソリューション	8,400	3,125.00	26,250,000
大東建託	62,200	15,970.00	993,334,000
いちご	197,700	287.00	56,739,900
日本駐車場開発	182,600	221.00	40,354,600
スター・マイカ・ホールディングス	20,300	611.00	12,403,300
SREホールディングス	8,500	3,305.00	28,092,500
ADワークスグループ	28,500	210.00	5,985,000
ヒューリック	396,100	1,269.50	502,848,950
三栄建築設計	8,700	2,024.00	17,608,800
野村不動産ホールディングス	106,200	3,595.00	381,789,000
三重交通グループホールディングス	37,400	592.00	22,140,800
サムティ	27,300	2,298.00	62,735,400
ディア・ライフ	29,700	849.00	25,215,300
地主	13,300	1,868.00	24,844,400
プレサンスコーポレーション	27,100	1,871.00	50,704,100
ハウスコム	2,500	894.00	2,235,000
JPMC	10,400	1,115.00	11,596,000
サンセイランディック	4,000	965.00	3,860,000
フージャースホールディングス	26,100	1,053.00	27,483,300
オープンハウスグループ	62,200	4,831.00	300,488,200
東急不動産ホールディングス	510,600	896.50	457,752,900
飯田グループホールディングス	148,800	2,330.00	346,704,000
イーランド	2,200	1,493.00	3,284,600
ムゲンエステート	8,300	988.00	8,200,400
And Doホールディングス	10,100	1,020.00	10,302,000
シーアールイー	9,900	1,470.00	14,553,000
ケイアイスター不動産	8,300	4,645.00	38,553,500
グッドコムアセット	16,500	943.00	15,559,500
ジェイ・エス・ビー	4,300	5,690.00	24,467,000
ロードスターキャピタル	11,400	1,682.00	19,174,800

テンポイノベーション	4,000	1,224.00	4,896,000
フェイスネットワーク	3,500	1,353.00	4,735,500
パーク24	110,500	2,033.50	224,701,750
パラカ	6,300	2,060.00	12,978,000
三井不動産	723,800	3,130.00	2,265,494,000
三菱地所	1,023,500	1,810.50	1,853,046,750
平和不動産	27,700	3,850.00	106,645,000
東京建物	148,500	1,885.00	279,922,500
京阪神ビルディング	29,000	1,285.00	37,265,000
住友不動産	306,700	3,662.00	1,123,135,400
テオオーシー	31,800	623.00	19,811,400
東京楽天地	3,000	4,170.00	12,510,000
レオパレス21	190,900	368.00	70,251,200
スターツコーポレーション	24,600	3,035.00	74,661,000
フジ住宅	24,700	721.00	17,808,700
空港施設	21,700	585.00	12,694,500
明和地所	6,000	1,039.00	6,234,000
ゴールドクレスト	16,500	1,919.00	31,663,500
エスリード	8,200	2,948.00	24,173,600
日神グループホールディングス	28,500	515.00	14,677,500
日本エスコン	37,900	820.00	31,078,000
MIRARTHホールディングス	85,700	467.00	40,021,900
AVANTIA	7,100	891.00	6,326,100
イオンモール	88,300	1,760.00	155,408,000
毎日コムネット	5,100	747.00	3,809,700
ファースト住建	5,200	1,148.00	5,969,600
カチタス	45,800	2,254.00	103,233,200
トーセイ	28,600	1,768.00	50,564,800
穴吹興産	2,500	2,009.00	5,022,500
サンフロンティア不動産	28,700	1,434.00	41,155,800
FJネクストホールディングス	18,500	1,048.00	19,388,000
インテリックス	2,800	505.00	1,414,000
ランドビジネス	4,100	275.00	1,127,500
サンネクスタグループ	4,000	960.00	3,840,000
グランディハウス	10,600	601.00	6,370,600
日本空港ビルデング	60,100	6,759.00	406,215,900
明豊ファシリティワークス	6,300	741.00	4,668,300
LIFULL	61,500	229.00	14,083,500
MIXI	40,400	2,420.00	97,768,000
ジェイエイシーリクルートメント	16,100	2,625.00	42,262,500
日本M&Aセンターホールディングス	304,100	795.50	241,911,550
メンバーズ	5,400	1,181.00	6,377,400

中広	2,400	419.00	1,005,600
UTグループ	26,100	2,449.00	63,918,900
アイティメディア	6,900	1,122.00	7,741,800
E・Jホールディングス	10,500	1,662.00	17,451,000
オープンアップグループ	53,200	2,046.00	108,847,200
コシダカホールディングス	53,200	1,250.00	66,500,000
アルトナー	3,000	1,694.00	5,082,000
パソナグループ	21,700	1,625.00	35,262,500
CDS	3,100	1,711.00	5,304,100
リンクアンドモチベーション	51,000	442.00	22,542,000
エス・エム・エス	67,400	2,739.50	184,642,300
サニーサイドアップグループ	4,000	796.00	3,184,000
パーソルホールディングス	195,300	2,535.00	495,085,500
リニカル	7,100	711.00	5,048,100
クックパッド	50,400	163.00	8,215,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	669.00	4,214,700
学情	9,200	1,837.00	16,900,400
スタジオアリス	9,000	2,175.00	19,575,000
シミックホールディングス	8,700	1,752.00	15,242,400
エプロ	3,600	745.00	2,682,000
NJS	4,000	2,985.00	11,940,000
総合警備保障	328,800	920.00	302,496,000
カカクコム	130,000	1,720.00	223,600,000
アイロムグループ	6,500	1,825.00	11,862,500
セントケア・ホールディング	11,700	785.00	9,184,500
サイネックス	2,500	648.00	1,620,000
ルネサンス	12,700	927.00	11,772,900
ディップ	31,100	3,520.00	109,472,000
デジタルホールディングス	14,100	1,037.00	14,621,700
新日本科学	18,900	2,132.00	40,294,800
キャリアデザインセンター	2,600	2,127.00	5,530,200
ベネフィット・ワン	82,200	1,232.50	101,311,500
エムスリー	349,800	2,854.00	998,329,200
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	503.00	3,822,800
アウトソーシング	113,800	1,122.00	127,683,600
ウェルネット	9,500	589.00	5,595,500
ワールドホールディングス	8,100	2,366.00	19,164,600
ディー・エヌ・エー	71,000	1,497.50	106,322,500
博報堂DYホールディングス	225,900	1,318.00	297,736,200
ぐるなび	33,300	338.00	11,255,400
タカミヤ	24,600	506.00	12,447,600
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	731.00	6,432,800

ファンコミュニケーションズ	35,400	392.00	13,876,800
ライク	6,800	1,504.00	10,227,200
ビジネス・ブレークスルー	5,100	409.00	2,085,900
エスプール	51,400	482.00	24,774,800
WDBホールディングス	9,200	2,041.00	18,777,200
ティア	7,600	457.00	3,473,200
C D G	1,500	1,320.00	1,980,000
アドウェイズ	24,800	591.00	14,656,800
バリューコマース	15,800	1,261.00	19,923,800
インフォマート	184,500	440.00	81,180,000
J Pホールディングス	51,800	326.00	16,886,800
エコナックホールディングス	23,800	85.00	2,023,000
C Lホールディングス	5,300	826.00	4,377,800
プレステージ・インターナショナル	75,000	571.00	42,825,000
アミューズ	9,800	1,584.00	15,523,200
ドリームインキュベータ	5,500	2,891.00	15,900,500
クイック	13,700	2,098.00	28,742,600
T A C	7,200	200.00	1,440,000
電通グループ	174,000	4,336.00	754,464,000
イオンファンタジー	7,700	3,200.00	24,640,000
シーティーエス	20,000	701.00	14,020,000
ネクシィーズグループ	4,100	728.00	2,984,800
H . U . グループホールディングス	51,900	2,623.50	136,159,650
アルプス技研	16,900	2,554.00	43,162,600
日本空調サービス	19,400	779.00	15,112,600
オリエンタルランド	936,700	5,114.00	4,790,283,800
ダスキン	39,500	3,234.00	127,743,000
明光ネットワークジャパン	21,900	668.00	14,629,200
ファルコホールディングス	8,200	2,042.00	16,744,400
ラウンドワン	148,500	580.00	86,130,000
リゾートトラスト	70,000	2,296.00	160,720,000
ビー・エム・エル	21,900	2,828.00	61,933,200
リソー教育	81,600	251.00	20,481,600
早稲田アカデミー	10,000	1,377.00	13,770,000
ユー・エス・エス	182,100	2,547.50	463,899,750
東京個別指導学院	21,600	486.00	10,497,600
サイバーエージェント	391,300	901.00	352,561,300
楽天グループ	1,515,000	551.20	835,068,000
クリーク・アンド・リバー社	10,500	2,149.00	22,564,500
S B I グローバルアセットマネジメント	29,400	540.00	15,876,000
テー・オー・ダブリュー	35,700	305.00	10,888,500
山田コンサルティンググループ	9,200	1,551.00	14,269,200



セントラルスポーツ	6,800	2,421.00	16,462,800
フルキャストホールディングス	17,000	2,038.00	34,646,000
エン・ジャパン	32,100	2,583.00	82,914,300
リソルホールディングス	1,100	4,790.00	5,269,000
テクノプロ・ホールディングス	104,800	3,529.00	369,839,200
アトラグループ	3,400	270.00	918,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	2,287.00	21,497,800
K e e P e r 技研	11,000	6,750.00	74,250,000
ファーストロジック	3,800	567.00	2,154,600
三機サービス	2,100	1,069.00	2,244,900
G u n o s y	14,600	605.00	8,833,000
デザインワン・ジャパン	4,700	165.00	775,500
イー・ガーディアン	6,800	2,624.00	17,843,200
リブセンス	6,600	324.00	2,138,400
ジャパンマテリアル	54,300	2,568.00	139,442,400
ベクトル	28,000	1,284.00	35,952,000
ウチヤマホールディングス	5,900	352.00	2,076,800
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,169.00	17,535,000
キャリアリンク	6,600	2,377.00	15,688,200
I B J	14,000	620.00	8,680,000
アサンテ	8,900	1,622.00	14,435,800
バリューHR	15,700	1,245.00	19,546,500
M & A キャピタルパートナーズ	14,400	2,732.00	39,340,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,013.00	6,685,800
E R I ホールディングス	3,200	2,162.00	6,918,400
アビスト	1,900	3,460.00	6,574,000
シグマクシス・ホールディングス	27,100	1,572.00	42,601,200
ウィルグループ	15,000	1,094.00	16,410,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,600	140.00	2,044,000
メドピア	15,900	1,015.00	16,138,500
レアジョブ	2,600	1,082.00	2,813,200
リクルートホールディングス	1,310,300	4,984.00	6,530,535,200
エラン	23,800	819.00	19,492,200
土木管理総合試験所	6,400	336.00	2,150,400
日本郵政	2,129,800	1,112.50	2,369,402,500
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,540.00	36,960,000
鎌倉新書	20,500	650.00	13,325,000
S M N	3,500	391.00	1,368,500
グローバルキッズCOMPANY	2,600	641.00	1,666,600
エアトリ	13,100	2,345.00	30,719,500
アトラエ	10,800	1,046.00	11,296,800
ストライク	7,600	3,040.00	23,104,000

ソラスト	49,200	657.00	32,324,400
セラク	5,600	1,299.00	7,274,400
インソース	38,700	1,105.00	42,763,500
ペイカレント・コンサルティング	140,100	4,914.00	688,451,400
Orchestra Holdings	4,100	1,070.00	4,387,000
アイモバイル	8,100	1,232.00	9,979,200
キャリアインデックス	5,100	263.00	1,341,300
MS - Japan	4,100	1,155.00	4,735,500
船場	2,800	819.00	2,293,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,300	2,337.00	147,932,100
フルテック	1,900	1,126.00	2,139,400
GameWith	4,500	335.00	1,507,500
MS&Consulting	1,800	663.00	1,193,400
ウェルビー	13,600	558.00	7,588,800
エル・ティー・エス	2,400	3,475.00	8,340,000
ミダックホールディングス	10,900	1,688.00	18,399,200
日総工産	13,600	834.00	11,342,400
キュービーネットホールディングス	8,600	1,574.00	13,536,400
RPAホールディングス	24,800	363.00	9,002,400
スプリックス	3,800	804.00	3,055,200
マネジメントソリューションズ	9,800	3,740.00	36,652,000
プロレド・パートナーズ	4,900	502.00	2,459,800
テノ・ホールディングス	1,900	613.00	1,164,700
フロンティア・マネジメント	6,100	1,290.00	7,869,000
ピアラ	2,900	432.00	1,252,800
コプロ・ホールディングス	2,100	2,486.00	5,220,600
ギークス	2,000	727.00	1,454,000
アンビスホールディングス	19,000	2,912.00	55,328,000
カーブスホールディングス	48,700	714.00	34,771,800
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,251.00	13,260,600
Fast Fitness Japan	6,200	1,471.00	9,120,200
ダイレクトマーケティングミックス	21,500	534.00	11,481,000
ポピンズ	2,800	1,257.00	3,519,600
LITALICO	13,900	2,151.00	29,898,900
コンフィデンス・インターワークス	900	1,631.00	1,467,900
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	460.00	2,714,000
リログループ	98,700	1,690.00	166,803,000
東祥	12,500	1,205.00	15,062,500
ID&Eホールディングス	10,800	3,410.00	36,828,000
ビーウィズ	4,600	2,464.00	11,334,400
TREホールディングス	37,500	1,146.00	42,975,000
人・夢・技術グループ	6,800	1,709.00	11,621,200

大栄環境	45,100	2,234.00	100,753,400	
日本管財ホールディングス	18,700	2,660.00	49,742,000	
エイチ・アイ・エス	51,600	1,969.00	101,600,400	
ラックランド	8,100	2,979.00	24,129,900	
共立メンテナンス	30,400	6,103.00	185,531,200	
イチネンホールディングス	19,000	1,339.00	25,441,000	
建設技術研究所	9,200	4,400.00	40,480,000	
スペース	13,100	908.00	11,894,800	
燦ホールディングス	7,700	2,168.00	16,693,600	
スバル興業	800	10,800.00	8,640,000	
東京テアトル	4,300	1,129.00	4,854,700	
タナベコンサルティンググループ	4,900	1,155.00	5,659,500	
ナガワ	4,800	7,000.00	33,600,000	
東京都競馬	14,900	3,915.00	58,333,500	
カナモト	27,600	2,475.00	68,310,000	
ニシオホールディングス	16,500	3,560.00	58,740,000	
トランス・コスモス	22,100	3,195.00	70,609,500	
乃村工藝社	77,500	848.00	65,720,000	
藤田観光	7,800	4,750.00	37,050,000	
KNT-CTホールディングス	10,600	1,503.00	15,931,800	
トーカイ	15,800	1,886.00	29,798,800	
セコム	180,300	10,240.00	1,846,272,000	
セントラル警備保障	9,600	2,933.00	28,156,800	
丹青社	34,700	770.00	26,719,000	
メイテック	69,200	2,544.00	176,044,800	
応用地質	16,600	2,765.00	45,899,000	
船井総研ホールディングス	36,900	2,660.00	98,154,000	
進学会ホールディングス	4,900	291.00	1,425,900	
オオバ	7,700	885.00	6,814,500	
いであ	3,300	1,660.00	5,478,000	
学究社	7,200	1,969.00	14,176,800	
ベネッセホールディングス	66,200	1,852.50	122,635,500	
イオンディライト	19,700	3,200.00	63,040,000	
ナック	8,100	975.00	7,897,500	
ダイセキ	36,200	4,360.00	157,832,000	
ステップ	6,600	1,780.00	11,748,000	
合 計	254,326,100		563,150,268,210	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,925,249,442
コール・ローン	215,028,436
株式	559,308,883,315
投資信託受益証券	163,326,854
投資証券	11,411,318,638
派生商品評価勘定	8,696,190
未収入金	2,434,553
未収配当金	822,999,489
前払金	174,119,657
差入委託証拠金	4,670,766,562
流動資産合計	584,702,823,136
資産合計	584,702,823,136
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	182,806,917
未払金	47
未払解約金	178,371,099
未払利息	498
流動負債合計	361,178,561
負債合計	361,178,561
純資産の部	
元本等	
元本	113,397,092,534
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	470,944,552,041
元本等合計	584,341,644,575
純資産合計	584,341,644,575
負債純資産合計	584,702,823,136

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2023年 8月28日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	113,397,092,534口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 5.1531円 (1万口当たり純資産額) (51,531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 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2023年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	127,813,585,667円
期中追加設定元本額	14,537,707,732円
期中一部解約元本額	28,954,200,865円

区分	2023年 8月28日現在
期末元本額	113,397,092,534円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,583,777,049円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,444,304円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,040,198,819円
世界経済インデックスファンド	12,359,279,873円
外国株式インデックス・オープン	882,859,318円
D Cマイセレクション25	651,152,398円
D Cマイセレクション50	3,522,393,245円
D Cマイセレクション75	4,352,289,363円
D C外国株式インデックス・オープン	12,561,511,126円
D CマイセレクションS25	412,332,308円
D CマイセレクションS50	1,892,734,322円
D CマイセレクションS75	1,866,741,539円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	20,742,675円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	137,799,181円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	108,051,144円
D C世界経済インデックスファンド	9,355,979,272円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	984,145,822円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,777,533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）	23,414,892円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	8,128,323円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	35,143,695円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	7,702,248円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,324,805円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	178,617,411円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	137,379,058円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,042,091,497円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	69,652,340円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,797,112円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	122,081,438円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	39,823,046円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	824,893,776円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	895,513,424円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,124,963,332円
コア投資戦略ファンド（安定型）	113,740,322円
コア投資戦略ファンド（成長型）	283,481,970円
分散投資コア戦略ファンドA	1,510,074,324円
分散投資コア戦略ファンドS	7,640,398,474円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,439,697,159円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	998,642,227円



区分	2023年 8月28日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	133,649,708円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	512,466,486円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,303,172円
S M T インデックスバランス・オープン	128,545,358円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	76,157,099円
外国株式 S M T B セレクション（ S M A 専用）	4,291,568,581円
S M T 世界経済インデックス・オープン	243,584,446円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	986,357,925円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	170,723,221円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,283,169円
M y S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	996,402,967円
グローバル経済コア	524,785,713円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	15,292,579円
D C ターゲット・イヤードファンド 2 0 5 5	6,097,568円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	116,500,119円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	27,008,065円
D C ターゲット・イヤードファンド（6資産・運用継続型） 2 0 3 0	135,658,380円
D C ターゲット・イヤードファンド（6資産・運用継続型） 2 0 4 0	127,801,690円
D C ターゲット・イヤードファンド（6資産・運用継続型） 2 0 5 0	54,086,868円
D C ターゲット・イヤードファンド（6資産・運用継続型） 2 0 6 0	56,761,933円
1 0 資産分散投資ファンド	53,269,375円
F O F s 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）	53,293,331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）	23,713,018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）	449,439,295円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,430,098,484円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,202,635円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	68,475,569円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,679,257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）	70,265,140円
S M T A M 海外バランスファンド 2 0 2 0 - 0 1（適格機関投資家専用）	194,200,383円
S M T A M 海外バランスファンド 2 0 2 0 - 0 8（適格機関投資家専用）	186,765,260円
S M T A M 海外バランスファンド 2 0 2 0 - 1 1（適格機関投資家専用）	185,818,200円
S M T A M 海外バランスファンド 2 0 2 1 - 0 4（適格機関投資家専用）	189,041,134円
S M T A M 海外バランスファンド 2 0 2 1 - 0 7（適格機関投資家専用）	187,171,165円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド 2 0 2 1 - 1 1（適格機関投資家専用）	85,911,878円
S M T A M 海外バランスファンド 2 0 2 3 - 0 2（適格機関投資家専用）	120,414,728円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

2023年 8月28日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	16,387,901,962
投資信託受益証券	21,756,599
投資証券	111,869,188
合計	16,478,014,551

(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 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	14,071,745,913	-	13,897,626,256	174,119,657
合計		14,071,745,913	-	13,897,626,256	174,119,657

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2023年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	532,915,000	-	532,923,930	8,930
	アメリカドル	498,100,000	-	498,111,900	11,900
	ユーロ	34,815,000	-	34,812,030	2,970
合計		532,915,000	-	532,923,930	8,930

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	42.73	999,540.16	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.39	2,736,779.48	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	161.20	2,917,558.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	85.13	722,072.66	
	CHEVRON CORP	133,788	159.12	21,288,346.56	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	116.52	10,496,121.60	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.74	1,513,106.04	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	50.43	2,534,410.08	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	149.55	1,984,079.85	
	EOG RESOURCES INC	43,691	127.08	5,552,252.28	
	EQT CORPORATION	27,026	42.04	1,136,173.04	
	EXXON MOBIL	301,729	108.25	32,662,164.25	
	HALLIBURTON CO	70,302	38.15	2,682,021.30	
	HESS CORP	19,804	150.60	2,982,482.40	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	57.10	766,795.90	
	KINDER MORGAN INC	144,061	17.34	2,498,017.74	
	MARATHON OIL CORP	50,360	25.62	1,290,223.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	32,827	143.98	4,726,431.46	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,406	61.84	3,302,627.04	
	ONEOK INC	31,321	64.95	2,034,298.95	
	OVINTIV INC	14,661	46.66	684,082.26	
	PHILLIPS 66	34,260	113.89	3,901,871.40	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	233.78	4,061,693.72	
	SCHLUMBERGER	105,564	56.46	5,960,143.44	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	84.48	1,461,335.04	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,902.16	1,013,851.28	
	VALERO ENERGY CORP	26,571	133.12	3,537,131.52	
	WILLIAMS COS	90,577	34.67	3,140,304.59	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	288.30	4,759,256.40	
	ALBEMARLE CORP	8,403	189.74	1,594,385.22	
	ALCOA CORP	15,500	28.23	437,565.00	
	AMCOR PLC	110,292	9.42	1,038,950.64	
AVERY DENNISON CORP	6,638	184.36	1,223,781.68		
BALL CORP	21,539	52.62	1,133,382.18		
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	118.21	1,014,478.22		

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	73.58	967,503.42
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.66	630,380.00
CORTEVA INC	51,304	49.94	2,562,121.76
CROWN HOLDINGS INC	9,940	88.53	879,988.20
DOW INC	51,372	53.98	2,773,060.56
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	74.64	2,546,642.16
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	81.93	723,605.76
ECOLAB INC	18,665	180.48	3,368,659.20
FMC CORP	8,264	87.95	726,818.80
FREEMONT-MCMORAN INC	105,762	38.33	4,053,857.46
INT'L PAPER CO	25,191	33.93	854,730.63
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	66.04	1,275,034.28
LINDE PLC	36,447	381.59	13,907,810.73
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	96.51	1,905,589.95
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	437.24	1,911,176.04
MOSAIC CO/THE	27,732	38.99	1,081,270.68
NEWMONT CORPORATION	61,808	38.31	2,367,864.48
NUCOR CORP	18,727	165.40	3,097,445.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,893	146.04	860,613.72
PPG INDUSTRIES INC	17,495	138.37	2,420,783.15
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	275.74	1,137,703.24
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	99.75	1,042,986.00
SEALED AIR CORP	11,690	35.23	411,838.70
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	264.63	4,829,497.50
STEEL DYNAMICS INC	11,618	101.76	1,182,247.68
VULCAN MATERIALS CO	10,153	214.83	2,181,168.99
WESTLAKE CORP	2,222	131.22	291,570.84
WESTROCK CO	21,356	31.77	678,480.12
3 M COMPANY	40,676	98.95	4,024,890.20
AECOM	10,456	86.87	908,312.72
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	60.59	725,141.12
ALLEGION PLC	5,598	109.84	614,884.32
AMETEK INC	17,753	157.59	2,797,695.27
AXON ENTERPRISE INC	5,367	198.43	1,064,973.81
BOEING CO	42,311	223.41	9,452,700.51
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	129.19	1,422,381.90
CARLISLE COS INC	3,456	259.28	896,071.68
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	55.02	3,414,706.26
CATERPILLAR	38,381	272.56	10,461,125.36
CUMMINS INC	10,414	232.05	2,416,568.70
DEERE&CO	20,925	390.21	8,165,144.25
DOVER CORP	10,657	142.67	1,520,434.19

EATON CORP	29,584	224.25	6,634,212.00
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	97.64	4,147,063.72
FASTENAL CO	44,011	57.16	2,515,668.76
FERGUSON PLC	14,498	156.30	2,266,037.40
FORTIVE CORP	25,894	77.02	1,994,355.88
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	65.94	679,841.40
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	114.94	598,952.34
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	223.59	3,801,924.36
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	111.97	9,074,272.74
GRACO INC	13,378	77.32	1,034,386.96
GRAINGER (WW) INC	3,363	714.56	2,403,065.28
HEICO CORP	3,640	166.39	605,659.60
HEICO CORP-CLASS A	4,690	133.67	626,912.30
HONEYWELL INTL INC	49,482	186.30	9,218,496.60
HOWMET AEROSPACE INC	26,751	48.18	1,288,863.18
HUBBELL INC	3,709	323.46	1,199,713.14
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	218.55	542,441.10
IDEX CORP	5,916	226.14	1,337,844.24
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	240.57	5,450,835.06
INGERSOLL-RAND INC	31,562	68.90	2,174,621.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	46.45	589,915.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	58.53	2,942,068.98
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	178.46	2,620,149.72
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	360.72	911,178.72
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	451.09	7,642,366.78
MASCO CORP	15,277	56.66	865,594.82
NORDSON CORP	4,121	238.60	983,270.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	429.56	4,613,474.40
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	83.87	2,576,234.79
OWENS CORNING	6,460	135.52	875,459.20
PACCAR INC	38,842	84.78	3,293,024.76
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	403.21	3,844,607.35
PENTAIR PLC	10,813	67.05	725,011.65
QUANTA SERVICES INC	10,250	205.27	2,104,017.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	303.31	2,567,822.46
RTX CORP	108,761	84.69	9,210,969.09
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.10	513,018.80
SMITH (A.O.) CORP	9,016	69.75	628,866.00
SNAP-ON INC	4,000	264.65	1,058,600.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	89.22	1,123,993.56
TEXTRON	13,437	75.22	1,010,731.14
TORO CO	8,812	99.42	876,089.04

TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	202.58	3,449,532.24
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	864.77	3,531,720.68
UNITED RENTALS INC	5,364	449.12	2,409,079.68
WABTEC CORP	13,304	111.72	1,486,322.88
WATSCO INC	2,656	349.65	928,670.40
XYLEM INC	16,864	101.17	1,706,130.88
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	253.05	7,793,686.95
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	114.54	1,058,349.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	183.69	1,522,790.10
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	71.38	761,481.84
CINTAS CORP	6,804	496.01	3,374,852.04
CLARIVATE PLC	27,357	7.14	195,328.98
COPART INC	63,766	43.80	2,792,950.80
EQUIFAX INC	9,160	197.98	1,813,496.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	134.60	1,166,578.20
LEIDOS HOLDINGS	8,529	95.79	816,992.91
PAYCHEX INC	24,118	121.87	2,939,260.66
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	286.39	1,212,861.65
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	198.05	677,925.15
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	146.05	2,403,252.75
ROBERT HALF INC	7,185	74.96	538,587.60
ROLLINS INC	17,468	39.37	687,715.16
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	55.89	860,817.78
TRANSUNION	15,741	78.99	1,243,381.59
VERISK ANALYTICS INC	10,738	237.19	2,546,946.22
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	137.86	2,726,181.50
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	158.33	4,787,265.88
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	93.76	784,489.92
CSX CORP	152,261	30.91	4,706,387.51
DELTA AIR LINES INC	9,648	41.70	402,321.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.32	1,403,849.60
FEDEX CORP	17,749	258.73	4,592,198.77
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.70	418,140.70
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	187.66	1,078,669.68
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	54.56	743,270.88
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	210.65	3,564,198.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	409.04	3,008,898.24
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	31.22	422,500.26
U-HAUL HOLDING CO	6,606	52.63	347,673.78
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	43.96	5,922,423.08
UNION PACIFIC CORP	45,361	224.18	10,169,028.98
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	168.87	9,079,126.68

APTIV PLC	19,053	97.61	1,859,763.33
BORGWARNER INC	19,781	39.90	789,261.90
FORD MOTOR COMPANY	290,797	11.91	3,463,392.27
GENERAL MOTORS CO	103,664	32.95	3,415,728.80
LEAR CORP	3,648	140.53	512,653.44
LUCID GROUP INC	61,234	6.02	368,628.68
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	20.07	1,030,313.52
TESLA INC	212,019	238.59	50,585,613.21
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	521.52	1,096,756.56
DR HORTON INC	22,973	114.94	2,640,516.62
GARMIN LTD	10,561	103.35	1,091,479.35
HASBRO INC	10,572	69.68	736,656.96
LENNAR CORP-CL A	18,864	114.04	2,151,250.56
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	365.59	3,151,020.21
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	96.07	399,939.41
NIKE B	91,582	98.84	9,051,964.88
NVR INC	247	6,081.14	1,502,041.58
PULTE GROUP INC	16,747	77.17	1,292,365.99
VF CORP	25,718	18.87	485,298.66
WHIRLPOOL CORP	3,785	134.00	507,190.00
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	125.79	3,865,400.91
ARAMARK	16,686	37.26	621,720.36
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,042.51	8,515,985.49
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	51.85	910,486.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	15.90	1,141,779.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,876.78	3,841,768.66
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	155.99	1,436,199.93
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	380.72	1,084,290.56
DOORDASH INC - A	19,212	78.02	1,498,920.24
EXPEDIA GROUP INC	11,638	106.94	1,244,567.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	147.02	2,819,108.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	110.71	419,258.77
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	52.62	1,344,967.20
MARRIOTT INTL A	19,516	199.79	3,899,101.64
MCDONALD'S CORP	54,264	284.58	15,442,449.12
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	42.17	959,536.18
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	99.77	1,707,663.32
STARBUCKS CORP	85,428	95.48	8,156,665.44
VAIL RESORTS INC	3,014	220.82	665,551.48
WYNN RESORTS LTD	6,702	95.48	639,906.96
YUM BRANDS INC	19,972	129.74	2,591,167.28
ACTIVISION BLIZZARD INC	55,381	91.66	5,076,222.46

ALPHABET INC-CL A	442,712	129.88	57,499,434.56
ALPHABET INC-CL C	399,244	130.69	52,177,198.36
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	416.78	2,997,481.76
COMCAST CORP-CL A	312,679	45.47	14,217,514.13
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	119.69	2,361,842.77
FOX CORP - CLASS A	21,544	32.43	698,671.92
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.15	311,901.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.33	921,760.63
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	88.82	812,969.46
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	64.45	991,176.55
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	23.28	316,235.52
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	84.79	984,666.27
MATCH GROUP INC	22,730	43.79	995,346.70
META PLATFORMS INC-CLASS A	164,626	285.50	47,000,723.00
NETFLIX INC	33,103	416.03	13,771,841.09
NEWS CORP-CLASS A	33,479	20.74	694,354.46
OMNICOM GROUP	14,048	79.86	1,121,873.28
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	14.44	469,415.52
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	26.91	1,231,589.97
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	26.81	764,165.43
ROKU INC	9,122	76.95	701,937.90
SEA LTD-ADR	28,338	36.17	1,024,985.46
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.04	244,290.72
SNAP INC - A	63,578	9.25	588,096.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	141.42	1,819,651.14
THE WALT DISNEY CO	135,788	83.36	11,319,287.68
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	75.91	2,549,285.53
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	12.27	2,176,857.51
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	17.91	392,855.85
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	64.08	295,793.28
AMAZON.COM	686,233	133.26	91,447,409.58
AUTOZONE INC	1,368	2,453.40	3,356,251.20
BATH & BODY WORKS INC	13,528	34.84	471,315.52
BEST BUY COMPANY INC	15,285	72.67	1,110,760.95
BURLINGTON STORES INC	5,108	154.27	788,011.16
CARMAX INC	10,695	78.42	838,701.90
CHEWY INC - CLASS A	6,878	25.76	177,177.28
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	111.67	552,766.50
EBAY	41,952	43.59	1,828,687.68
ETSY INC	10,294	72.31	744,359.14
GENUINE PARTS CO	9,903	153.04	1,515,555.12
HOME DEPOT	75,273	322.86	24,302,640.78



LKQ CORP	19,286	51.78	998,629.08
LOWES COMPANIES	44,328	223.07	9,888,246.96
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,237.84	4,150,477.52
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	931.04	4,261,370.08
POOL CORP	2,664	353.98	943,002.72
ROSS STORES INC	25,425	119.00	3,025,575.00
TJX COMPANIES INC	85,671	88.82	7,609,298.22
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	213.54	1,675,434.84
ULTA BEAUTY INC	3,920	407.15	1,596,028.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.08	552,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	534.01	17,603,639.65
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	154.98	2,524,159.26
DOLLAR TREE INC	16,318	123.31	2,012,172.58
KROGER CO	50,664	46.54	2,357,902.56
SYSCO CORP	36,197	69.76	2,525,102.72
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	121.79	4,167,653.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	25.26	1,302,582.42
WALMART INC	110,203	157.82	17,392,237.46
ALTRIA GROUP INC	132,765	43.67	5,797,847.55
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	80.83	3,283,152.94
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	68.09	1,634,568.54
BUNGE LIMITED	11,604	112.71	1,307,886.84
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	42.08	667,767.52
COCA-COLA CO	305,497	60.39	18,448,963.83
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	63.48	977,211.12
CONAGRA BRANDS INC	33,324	30.02	1,000,386.48
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	259.49	3,108,430.71
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	60.32	798,757.44
GENERAL MILLS INC	43,531	68.37	2,976,214.47
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	217.31	2,377,806.02
HORMEL FOODS CORP	23,338	39.38	919,050.44
JM SMUCKER CO	7,850	142.10	1,115,485.00
KELLOGG CO	18,819	61.24	1,152,475.56
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	33.28	2,175,546.88
KRAFT HEINZ CO/THE	56,982	33.85	1,928,840.70
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	96.35	1,144,252.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	81.48	1,474,136.16
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	62.85	921,946.65
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	71.50	7,244,666.00
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	57.34	3,345,674.32
PEPSICO INC	102,377	179.42	18,368,481.34
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	95.07	10,968,416.04

TYSON FOODS INC	23,306	54.01	1,258,757.06
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	93.30	1,804,981.80
CLOROX COMPANY	9,570	154.53	1,478,852.10
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	73.83	4,338,324.63
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	153.20	2,600,263.60
KENVUE INC	111,921	22.97	2,570,825.37
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	129.21	3,184,122.03
PROCTER & GAMBLE CO	175,356	153.54	26,924,160.24
ABBOTT LABORATORIES	129,183	104.21	13,462,160.43
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	356.35	1,871,906.55
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,469	179.48	2,237,936.12
BAXTER INTERNATIONAL	34,687	41.53	1,440,551.11
BECTON DICKINSON & CO	21,103	280.01	5,909,051.03
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	50.76	5,423,096.88
CARDINAL HEALTH	19,151	87.63	1,678,202.13
CENTENE CORP	40,934	63.48	2,598,490.32
CVS HEALTH CORP	95,131	67.32	6,404,218.92
DAVITA INC	4,627	100.61	465,522.47
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	37.53	667,058.22
DEXCOM INC	28,772	100.76	2,899,066.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	76.17	3,431,610.84
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	452.52	7,981,095.24
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	68.59	2,052,281.39
HCA HEALTHCARE INC	15,457	273.28	4,224,088.96
HENRY SCHEIN INC	8,755	76.85	672,821.75
HOLOGIC INC	18,875	75.41	1,423,363.75
HUMANA INC	9,297	478.94	4,452,705.18
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	492.68	3,038,850.24
INSULET CORP	5,246	183.00	960,018.00
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	297.55	7,746,714.25
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	212.19	1,389,420.12
MASIMO CORP	2,669	110.75	295,591.75
MCKESSON CORP	10,179	423.30	4,308,770.70
MEDTRONIC PLC	98,891	82.19	8,127,851.29
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	318.96	1,449,673.20
NOVOCURE LTD	7,933	29.77	236,165.41
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	132.39	1,149,012.81
RESMED INC	10,920	160.98	1,757,901.60
STERIS PLC	6,933	226.40	1,569,631.20
STRYKER CORP	25,363	278.12	7,053,957.56
TELEFLEX INC	3,934	216.14	850,294.76
THE CIGNA GROUP	22,079	279.23	6,165,119.17

THE COOPER COS INC	3,504	371.38	1,301,315.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,339	489.12	33,915,091.68
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	131.25	613,200.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	189.13	2,128,658.15
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	115.24	1,757,870.96
ABBVIE INC	131,130	146.69	19,235,459.70
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	119.68	2,607,946.88
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	189.26	1,825,034.18
AMGEN	39,709	256.38	10,180,593.42
AVANTOR INC	49,647	21.77	1,080,815.19
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	381.78	707,438.34
BIO-TECHNE CORP	12,980	80.16	1,040,476.80
BIOGEN INC	10,740	264.43	2,839,978.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	93.64	1,384,280.12
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	62.08	9,705,587.20
CATALENT INC	13,739	44.89	616,743.71
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	200.39	842,439.56
DANAHER CORP	51,486	255.53	13,156,217.58
ELI LILLY & CO	60,041	553.65	33,241,699.65
EXACT SCIENCES CORP	12,208	80.46	982,255.68
GILEAD SCIENCES INC	92,825	76.86	7,134,529.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	106.67	1,665,972.06
ILLUMINA INC	11,423	158.08	1,805,747.84
INCYTE CORP	15,212	63.86	971,438.32
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	219.01	3,030,222.36
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	141.25	702,153.75
JOHNSON & JOHNSON	179,427	166.25	29,829,738.75
MERCK & CO	188,628	110.21	20,788,691.88
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,175.45	1,912,457.15
MODERNA INC	24,153	111.93	2,703,445.29
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	107.52	724,899.84
PFIZER	419,551	36.38	15,263,265.38
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	830.35	6,636,157.20
REPLIGEN CORP	4,353	164.77	717,243.81
REVVITY INC	8,524	114.94	979,748.56
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	30.21	908,807.43
SEAGEN INC	9,758	199.81	1,949,745.98
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	9.70	893,767.70
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	541.59	15,527,385.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	229.01	828,558.18
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	350.06	6,702,598.82
VIATRIS INC	89,720	10.97	984,228.40

WATERS CORP	4,749	273.37	1,298,234.13
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	393.73	2,270,640.91
ZOETIS INC	34,383	182.82	6,285,900.06
BANK OF AMERICA CORP	535,131	28.50	15,251,233.50
CITIGROUP	144,682	41.24	5,966,685.68
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	26.84	1,060,770.48
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.42	1,383,356.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,361.68	1,043,046.88
FIRST HORIZON CORP	44,308	12.22	541,443.76
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.85	1,238,115.20
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	147.05	32,041,753.85
KEY CORP	71,223	10.88	774,906.24
M & T BANK CORP	11,807	125.58	1,482,723.06
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	117.74	3,491,932.92
REGIONS FINL CORP	70,810	18.54	1,312,817.40
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	28.81	2,782,296.94
US BANCORP	113,859	35.51	4,043,133.09
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	41.61	593,899.53
WELLS FARGO & CO	279,720	41.23	11,532,855.60
ALLY FINANCIAL INC	21,529	25.92	558,031.68
AMERICAN EXPRESS	47,011	158.32	7,442,781.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	334.13	2,611,560.08
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	83.15	2,391,976.05
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	99.97	1,277,616.60
BANK NEW YORK CO	61,254	43.73	2,678,637.42
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	96,495	355.93	34,345,465.35
BLACKROCK INC	11,143	675.96	7,532,222.28
BLACKSTONE INC	52,505	99.66	5,232,648.30
BLOCK INC	39,463	55.86	2,204,403.18
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,372	100.85	2,760,466.20
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	29.98	469,756.62
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	151.23	1,080,387.12
CME GROUP INC	26,740	203.22	5,434,102.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,895	74.26	809,062.70
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	88.74	1,684,906.38
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	27.73	775,968.59
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	429.57	1,352,286.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	54.74	2,343,419.40
FISERV INC	46,319	121.48	5,626,832.12
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	265.24	1,343,175.36
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.79	672,345.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	51.06	220,374.96

GLOBAL PAYMENTS INC	18,535	121.71	2,255,894.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	320.15	7,943,561.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	115.80	4,817,743.20
INVESCO LTD	26,420	15.19	401,319.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	158.37	825,582.81
KKR & CO INC	44,805	59.50	2,665,897.50
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	234.13	1,242,527.91
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	244.55	784,271.85
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	402.89	25,489,641.63
MOODY'S CORP	12,261	334.43	4,100,446.23
MORGAN STANLEY	93,231	83.22	7,758,683.82
MSCI INC	5,952	531.15	3,161,404.80
NASDAQ INC	24,183	52.73	1,275,169.59
NORTHERN TRUST CORP	15,902	74.67	1,187,402.34
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	61.19	4,851,510.34
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	109.70	1,733,918.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	102.27	1,583,753.22
S&P GLOBAL INC	24,377	388.27	9,464,857.79
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	58.15	6,494,947.95
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	61.32	585,606.00
STATE STREET CORP	26,059	67.55	1,760,285.45
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	31.85	929,892.60
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.23	431,839.43
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	85.30	772,903.30
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	242.57	29,298,574.88
AFLAC	43,196	74.25	3,207,303.00
ALLSTATE CORP	18,556	105.14	1,950,977.84
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	114.69	724,726.11
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	57.85	3,154,791.90
AON PLC	15,249	332.07	5,063,735.43
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	74.62	1,978,176.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	227.60	3,621,798.80
ASSURANT INC	4,726	138.73	655,637.98
BROWN & BROWN INC	16,344	73.07	1,194,256.08
CHUBB LTD	30,784	201.63	6,206,977.92
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	104.22	1,157,884.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	280.88	608,386.08
EVEREST GROUP LTD	3,288	352.88	1,160,269.44
FNF GROUP	20,461	40.01	818,644.61
GLOBE LIFE INC	5,948	111.46	662,964.08
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	71.79	1,775,438.49
LOEWS CORP	12,757	62.06	791,699.42

MARKEL GROUP INC	1,007	1,465.64	1,475,899.48
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	194.21	7,146,733.79
METLIFE INC	48,925	62.41	3,053,409.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	76.33	1,414,852.88
PROGRESSIVE CORP	43,513	132.58	5,768,953.54
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	93.74	2,486,078.54
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	161.64	2,771,641.08
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	205.60	1,527,402.40
WR BERKLEY CORP	17,572	60.93	1,070,661.96
WEYERHAEUSER CO	52,615	32.63	1,716,827.45
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	318.76	14,963,550.68
ADOBE INC	34,096	525.06	17,902,445.76
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	102.82	1,180,784.88
ANSYS INC	6,794	304.89	2,071,422.66
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	193.12	462,329.28
ATLASSIAN CORP-CL A	10,436	191.02	1,993,484.72
AUTODESK INC	15,965	215.92	3,447,162.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	47.35	701,395.55
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	105.26	783,450.18
BLACK KNIGHT INC	11,543	74.76	862,954.68
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	232.51	4,721,813.08
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	134.43	831,583.98
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	62.20	1,261,602.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	70.06	2,543,668.42
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	149.58	2,478,690.18
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	158.91	492,621.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	92.60	1,640,501.60
DOCUSIGN INC	14,969	48.29	722,853.01
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	27.29	629,525.72
DYNATRACE INC	14,790	46.69	690,545.10
EPAM SYSTEMS INC	4,768	244.08	1,163,773.44
FAIR ISAAC CORP	1,816	851.89	1,547,032.24
FORTINET INC	48,642	58.81	2,860,636.02
GARTNER INC	5,655	342.49	1,936,780.95
GEN DIGITAL INC	43,555	20.20	879,811.00
GODADDY INC - CLASS A	11,388	71.52	814,469.76
HUBSPOT INC	3,646	512.75	1,869,486.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	145.35	9,800,369.10
INTUIT INC	20,854	519.05	10,824,268.70
MICROSOFT CORP	525,636	322.98	169,769,915.28
MONDAY.COM LTD	231	169.19	39,082.89
MONGODB INC	5,325	363.46	1,935,424.50

OKTA INC	11,505	72.23	831,006.15
ORACLE CORP	120,407	116.06	13,974,436.42
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	14.53	1,899,666.73
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	230.76	5,190,484.68
PTC INC	8,226	144.85	1,191,536.10
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	494.79	3,907,851.42
SALESFORCE INC	74,331	209.47	15,570,114.57
SERVICENOW INC	15,145	563.65	8,536,479.25
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	152.55	2,948,181.30
SPLUNK INC	11,101	115.94	1,287,049.94
SYNOPSYS INC	11,321	442.24	5,006,599.04
TWILIO INC - A	12,842	59.37	762,429.54
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	378.79	1,264,779.81
UIPATH INC - CLASS A	28,419	15.03	427,137.57
UNITY SOFTWARE INC	16,437	34.72	570,692.64
VERISIGN INC	6,723	205.74	1,383,190.02
VMWARE INC-CLASS A	17,149	162.55	2,787,569.95
WIX.COM LTD	5,010	92.48	463,324.80
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	236.97	3,593,413.08
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	67.70	1,120,231.90
ZSCALER INC	7,204	142.76	1,028,443.04
AMPHENOL CORPORATION	44,247	86.30	3,818,516.10
APPLE INC	1,176,051	178.61	210,054,469.11
ARISTA NETWORKS INC	19,289	180.90	3,489,380.10
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	130.41	565,718.58
CDW CORP/DE	9,584	204.00	1,955,136.00
CISCO SYSTEMS	304,444	55.70	16,957,530.80
COGNEX CORP	14,352	46.93	673,539.36
CORNING	58,221	32.43	1,888,107.03
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	56.21	1,018,750.04
F5 INC	4,851	157.29	763,013.79
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.62	1,619,319.84
HP INC	68,329	30.84	2,107,266.36
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.08	711,013.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	129.20	1,787,869.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	278.78	3,401,673.56
NETAPP INC	15,191	74.72	1,135,071.52
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	64.42	821,741.52
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	128.64	2,932,348.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	408.55	1,356,386.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	52.15	923,993.70
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	39.49	1,018,447.10

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	268.39	1,117,039.18
AT&T INC	529,966	14.11	7,477,820.26
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	17.47	271,064.52
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.80	354,737.20
T-MOBILE US INC	44,785	133.35	5,972,079.75
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	33.35	10,411,169.65
AES CORP	54,375	18.06	982,012.50
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	50.78	1,055,106.84
AMEREN CORPORATION	20,898	80.45	1,681,244.10
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	79.33	2,944,570.94
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	140.42	2,031,596.56
ATMOS ENERGY CORP	11,302	117.70	1,330,245.40
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.22	1,339,490.52
CMS ENERGY CORP	23,697	57.11	1,353,335.67
CONSOLIDATED EDISON INC	24,527	89.88	2,204,486.76
CONSTELLATION ENERGY	25,114	105.87	2,658,819.18
DOMINION ENERGY INC	60,549	48.52	2,937,837.48
DTE ENERGY COMPANY	15,851	104.92	1,663,086.92
DUKE ENERGY CORP	57,283	90.58	5,188,694.14
EDISON INTL	25,571	69.93	1,788,180.03
ENERGY CORP	16,181	94.80	1,533,958.80
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.38	762,514.62
EVERGY INC	18,475	56.89	1,051,042.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	65.17	1,788,916.50
EXELON CORP	73,907	40.30	2,978,452.10
FIRSTENERGY CORP	39,425	36.27	1,429,944.75
NEXTERA ENERGY INC	150,399	67.96	10,221,116.04
NISOURCE INC	32,351	26.58	859,889.58
NRG ENERGY INC	19,068	37.16	708,566.88
PG&E CORP	129,525	16.70	2,163,067.50
PPL CORPORATION	58,459	25.27	1,477,258.93
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	61.12	2,180,944.96
SEMPRA	45,886	71.56	3,283,602.16
SOUTHERN CO	81,133	68.09	5,524,345.97
UGI CORP	18,019	22.71	409,211.49
VISTRA CORP	22,676	30.12	683,001.12
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	85.10	1,995,339.70
XCEL ENERGY INC	39,963	57.58	2,301,069.54
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	102.25	12,231,963.00
ANALOG DEVICES	37,601	178.16	6,698,994.16
APPLIED MATERIALS	62,818	144.36	9,068,406.48
BROADCOM INC	30,991	851.82	26,398,753.62



	ENPHASE ENERGY INC	9,617	124.09	1,193,373.53
	ENTEGRIS INC	10,321	96.48	995,770.08
	FIRST SOLAR INC	7,921	177.45	1,405,581.45
	INTEL CORP	310,036	33.25	10,308,697.00
	KLA CORP	10,294	481.73	4,958,928.62
	LAM RESEARCH CORP	10,237	660.27	6,759,183.99
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	88.54	971,992.12
	MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	53.50	3,407,629.00
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	79.37	3,231,787.66
	MICRON TECHNOLOGY	81,347	63.72	5,183,430.84
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	489.08	1,726,941.48
	NVIDIA CORP	183,596	460.18	84,487,207.28
	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	196.20	3,788,622.00
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	92.32	2,955,255.52
	QORVO INC	6,249	101.53	634,460.97
	QUALCOMM	82,879	110.32	9,143,211.28
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	105.39	1,184,794.38
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	161.70	672,025.20
	TERADYNE INC	12,318	103.78	1,278,362.04
	TEXAS INSTRUMENTS	67,444	167.81	11,317,777.64
	WOLFSPEED INC	10,256	45.29	464,494.24
	CBRE GROUP INC-A	22,995	82.58	1,898,927.10
	COSTAR GROUP INC	29,397	80.20	2,357,639.40
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.55	350,385.00
	ZILLOW GROUP INC-C	8,809	49.97	440,185.73
	アメリカドル 小計	25,479,131		2,839,718,357.78 (416,160,725,332)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	19.74	738,276.00
	CAMECO CORP	31,793	49.50	1,573,753.50
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	82.81	6,815,842.67
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	25.62	2,851,326.66
	ENBRIDGE	150,513	46.83	7,048,523.79
	IMPERIAL OIL	16,488	75.03	1,237,094.64
	KEYERA CORP	18,607	33.40	621,473.80
	PARKLAND CORP	4,564	36.35	165,901.40
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	41.33	1,575,954.23
	SUNCOR ENERGY	98,973	44.77	4,431,021.21
	TC ENERGY CORP	75,669	48.07	3,637,408.83
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	66.48	1,662,598.32
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	64.37	2,323,757.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	21.64	2,893,852.28
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,275	60.05	496,913.75

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	33.39	1,447,790.40
FRANCO-NEVADA CORP	13,695	188.33	2,579,179.35
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.66	604,536.02
KINROSS GOLD CORP	108,451	6.55	710,354.05
LUNDIN MINING CORP	31,977	9.98	319,130.46
NUTRIEN LTD	37,152	82.91	3,080,272.32
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	21.36	478,805.76
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	54.40	1,924,998.40
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	102.24	358,351.20
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	57.25	1,826,618.50
CAE INC	25,999	31.79	826,508.21
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	110.36	575,306.68
WSP GLOBAL INC	9,951	186.53	1,856,160.03
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	43.96	614,165.16
RB GLOBAL INC	14,445	80.68	1,165,422.60
THOMSON REUTERS CORP	11,033	172.42	1,902,309.86
AIR CANADA	13,805	22.32	308,127.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	152.98	6,461,416.26
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	106.87	7,400,533.76
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	173.30	1,011,552.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	76.93	1,558,140.22
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	104.43	320,600.10
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	39.45	387,399.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	92.36	2,131,022.28
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.01	471,352.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	152.63	688,819.19
DOLLARAMA INC	22,000	85.81	1,887,820.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	71.29	4,050,769.09
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	35.08	243,104.40
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.55	1,505,010.15
METRO INC	18,840	69.90	1,316,916.00
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	149.53	781,443.78
SAPUTO INC	20,898	28.86	603,116.28
BANK MONTREAL	52,757	112.16	5,917,225.12
BANK NOVA SCOTIA	88,533	62.12	5,499,669.96
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	53.98	3,635,229.12
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	98.16	2,366,735.76
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	121.02	12,466,996.32
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	80.37	10,882,580.22
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	45.19	1,310,555.19
BROOKFIELD CORP	104,769	44.17	4,627,646.73
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.48	667,217.92

	IGM FINANCIAL INC	7,685	37.85	290,877.25
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	22.17	95,353.17
	ONEX CORP	6,603	81.80	540,125.40
	TMX GROUP LTD	23,425	29.51	691,271.75
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,132.93	1,987,159.22
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.22	909,177.36
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	83.17	580,277.09
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	194.68	2,580,483.40
	MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.33	3,182,801.94
	POWER CORP OF CANADA	43,577	36.07	1,571,822.39
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	64.59	2,817,028.26
	CGI INC - CL A	16,084	138.07	2,220,717.88
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,723.35	4,057,791.50
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	100.04	698,679.36
	OPEN TEXT CORP	20,463	53.13	1,087,199.19
	SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	75.57	6,724,747.59
	BCE INC	6,203	56.32	349,352.96
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	53.41	1,489,124.21
	TELUS CORP	32,908	23.35	768,401.80
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.07	521,807.26
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	25.99	634,026.05
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	39.01	440,617.95
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.19	332,329.56
	EMERA INC	17,459	50.74	885,869.66
	FORTIS INC	35,547	53.43	1,899,276.21
	HYDRO ONE LTD	20,587	36.04	741,955.48
	NORTHLAND POWER INC	17,854	25.58	456,705.32
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	199.07	535,498.30
	カナダドル 小計	3,016,123		175,935,083.14 (18,960,523,909)
ユーロ	ENI	174,687	14.15	2,472,519.79
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	12.34	489,627.39
	NESTE OIL OYJ	32,766	33.03	1,082,260.98
	OMV AG	12,549	42.11	528,438.39
	REPSOL SA	89,536	14.07	1,260,219.20
	TENARIS SA	40,648	14.97	608,703.80
	TOTALENERGIES SE	175,847	57.32	10,079,550.04
	AIR LIQUIDE	38,920	162.84	6,337,732.80
	AKZO NOBEL	12,357	73.66	910,216.62
	ARCELORMITTAL	32,320	24.07	778,104.00
	ARKEMA	4,369	93.32	407,715.08
	BASF SE	64,204	45.02	2,890,785.10

COVESTRO AG	14,454	48.27	697,694.58
CRH PLC	55,581	52.54	2,920,225.74
DSM-FIRMENICH AG	13,707	84.49	1,158,104.43
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.31	277,600.47
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	73.46	790,796.90
OCI NV	7,248	22.35	161,992.80
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	36.68	715,406.72
SOLVAY SA	5,356	102.00	546,312.00
STORA ENSO OYJ R	42,169	11.13	469,340.97
SYMRISE AG	10,018	93.30	934,679.40
UMICORE	17,605	23.36	411,252.80
UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.88	1,264,641.12
VOESTALPINE AG	7,152	26.70	190,958.40
WACKER CHEMIE AG	1,770	132.10	233,817.00
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	31.67	519,483.01
AIRBUS SE	44,063	129.88	5,722,902.44
ALSTOM	24,388	25.32	617,504.16
BOUYGUES ORD	16,606	31.29	519,601.74
BRENTAG SE	12,514	72.04	901,508.56
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.98	970,691.48
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.27	1,115,735.25
DASSAULT AVIATION SA	2,130	175.40	373,602.00
EIFFAGE	5,924	91.96	544,771.04
FERROVIAL SE	37,026	28.90	1,070,051.40
GEA GROUP AG	13,382	35.79	478,941.78
IMCD NV	4,641	123.65	573,859.65
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	73.86	915,716.28
KNORR-BREMSE AG	5,022	60.96	306,141.12
KONE OYJ-B	26,369	41.95	1,106,179.55
LEGRAND SA	19,340	89.12	1,723,580.80
METSO CORPORATION	51,970	10.28	534,251.60
MTU AERO ENGINES AG	3,962	204.60	810,625.20
PRYSMIAN SPA	21,155	36.40	770,042.00
RATIONAL AG	483	680.50	328,681.50
RHEINMETALL AG	2,795	243.30	680,023.50
SAFRAN SA	24,910	145.10	3,614,441.00
SAINT-GOBAIN	36,177	58.04	2,099,713.08
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	156.52	6,312,138.56
SIEMENS	56,492	136.40	7,705,508.80
SIEMENS ENERGY AG	36,841	12.92	475,985.72
THALES SA	8,524	132.70	1,131,134.80
VINCI S.A.	39,327	102.34	4,024,725.18

WARTSILA OYJ	41,917	11.02	461,925.34
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.38	611,279.74
RANDSTAD NV	6,064	53.58	324,909.12
TELEPERFORMANCE	4,734	118.60	561,452.40
WOLTERS KLUWER	18,738	109.50	2,051,811.00
ADP	2,382	119.00	283,458.00
AENA SME SA	5,508	139.95	770,844.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	8.09	367,187.61
DHL GROUP	74,810	42.18	3,155,859.85
GETLINK	21,115	15.01	317,041.72
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,611	96.51	2,375,207.61
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	89.65	447,443.15
CONTINENTAL AG	8,168	67.40	550,523.20
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	100.05	733,466.55
FERRARI NV	9,370	286.80	2,687,316.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,618	67.00	4,262,406.00
MICHELIN	47,236	28.42	1,342,447.12
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	48.67	571,629.15
RENAULT SA	11,597	36.40	422,188.78
STELLANTIS NV	162,367	16.72	2,714,776.24
VALEO SA	16,596	17.46	289,766.16
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	112.10	1,718,268.80
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	132.65	329,767.90
ADIDAS AG	11,414	176.44	2,013,886.16
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,883.20	4,434,936.00
KERING	5,534	487.60	2,698,378.40
LVMH	20,525	785.30	16,118,282.50
MONCLER SPA	14,605	62.36	910,767.80
PUMA SE	9,220	60.16	554,675.20
SEB SA	2,282	99.35	226,716.70
ACCOR	14,436	32.34	466,860.24
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	61.12	1,962,257.60
DELIVERY HERO SE	13,414	34.37	461,106.25
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	164.55	2,146,061.10
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	12.35	192,407.63
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.58	264,158.64
SODEXO	6,173	99.26	612,731.98
BOLLORE SE	83,646	5.31	444,578.49
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.26	1,226,883.42
SCOUT24 SE	3,716	61.46	228,385.36
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	22.86	1,504,782.36
VIVENDI SE	61,243	8.18	501,090.22

D' IETEREN GROUP	2,217	151.00	334,767.00
INDITEX	81,082	34.21	2,773,815.22
PROSUS	59,578	62.53	3,725,412.34
ZALANDO SE	17,664	26.45	467,212.80
CARREFOUR	39,746	18.21	723,774.66
HELLOFRESH SE	13,805	26.36	363,899.80
JERONIMO MARTINS	14,298	23.86	341,150.28
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.59	353,259.97
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.06	2,131,254.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	52.25	3,313,799.50
DANONE (GROUPE)	47,639	53.51	2,549,162.89
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	11.90	402,969.70
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	74.25	706,266.00
HEINEKEN NV	20,157	89.52	1,804,454.64
JDE PEET'S BV	7,000	26.26	183,820.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	85.58	906,463.36
PERNOD-RICARD	15,339	193.20	2,963,494.80
REMY COINTREAU	1,032	148.75	153,510.00
BEIERSDORF AG	7,430	120.95	898,658.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	64.34	564,905.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	71.92	820,966.80
LOREAL	17,902	401.45	7,186,757.90
AMPLIFON SPA	11,650	29.87	347,985.50
BIOMERIEUX	3,044	95.66	291,189.04
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	87.94	301,634.20
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	93.02	192,551.40
ESSILORLUXOTTICA	21,384	174.04	3,721,671.36
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	44.32	752,775.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	29.34	988,435.26
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	20.39	1,464,870.87
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	45.43	979,788.81
ARGENX SE	4,177	469.20	1,959,848.40
BAYER	72,310	50.05	3,619,115.50
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	55.86	570,889.20
GRIFOLS SA	27,685	12.82	354,921.70
IPSEN	3,532	119.10	420,661.20
MERCK KGAA	9,080	160.30	1,455,524.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	35.55	111,235.95
QIAGEN N.V.	17,038	41.23	702,476.74
RECORDATI SPA	5,163	45.84	236,671.92
SANOFI	84,347	98.71	8,325,892.37
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	346.60	632,198.40

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	248.50	391,139.00
UCB (GROUPE)	9,389	81.68	766,893.52
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.18	365,026.72
AIB GROUP PLC	88,299	4.25	375,623.94
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.15	3,155,959.95
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.53	4,327,083.67
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.15	809,365.72
BNP PARIBAS	82,574	58.31	4,814,889.94
CAIXABANK	336,789	3.78	1,274,746.36
COMMERZBANK AG	81,889	9.94	813,976.66
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.46	1,140,328.09
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	32.86	833,855.36
FINECOBANK SPA	41,585	12.59	523,763.07
ING GROEP NV-CVA	269,040	13.15	3,538,414.08
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.44	3,055,763.49
KBC GROEP NV	18,057	60.20	1,087,031.40
MEDIOBANCA	25,262	11.80	298,217.91
SOCIETE GENERALE	53,019	25.91	1,373,987.38
UNICREDIT SPA	139,080	21.75	3,024,990.00
ADYEN NV	1,609	765.00	1,230,885.00
AMUNDI SA	4,626	53.00	245,178.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	9.89	1,330,467.72
DEUTSCHE BOERSE	14,123	163.00	2,302,049.00
EDENRED	20,131	58.74	1,182,494.94
EURAZEO SA	3,357	52.75	177,081.75
EURONEXT NV	6,480	66.35	429,948.00
EXOR NV	7,825	80.30	628,347.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	72.56	617,848.40
NEXI SPA	48,458	6.51	315,461.58
SOFINA	1,238	202.60	250,818.80
WENDEL	2,023	82.50	166,897.50
WORLDLINE SA	20,332	29.65	602,843.80
AEGON	148,741	4.74	706,073.52
AGEAS	11,086	36.61	405,858.46
ALLIANZ SE-REG	29,979	222.10	6,658,335.90
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	18.61	1,325,701.96
AXA SA	136,364	27.39	3,735,691.78
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	196.00	873,180.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	355.50	3,702,177.00
NN GROUP NV	16,208	34.17	553,827.36
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.09	464,723.32
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.08	1,327,930.56

TALANX AG	5,053	61.60	311,264.80
BECHTLE AG	7,659	43.85	335,847.15
CAPGEMINI SA	12,235	162.55	1,988,799.25
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	35.70	1,690,738.86
NEMETSCHKE SE	5,455	61.26	334,173.30
SAP SE	77,618	126.16	9,792,286.88
NOKIA OYJ	396,129	3.49	1,385,065.04
CELLNEX TELECOM SA	41,890	34.29	1,436,408.10
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.25	4,639,155.52
ELISA A	10,227	44.38	453,874.26
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.13	338,073.75
KPN (KON.)	216,358	3.17	687,802.08
ORANGE	128,563	10.26	1,319,313.50
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.27	234,025.52
TELEFONICA	373,259	3.68	1,376,205.93
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.69	167,519.35
ACCIONA SA	2,181	126.30	275,460.30
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	26.02	141,470.74
E.ON SE	166,881	11.34	1,893,264.94
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	17.64	383,705.28
ELIA GROUP SA/NV	987	104.30	102,944.10
ENAGAS	21,663	15.53	336,534.70
ENDESA	25,972	19.02	494,117.30
ENEL	596,378	6.10	3,643,273.20
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.29	1,172,538.50
ENGIE	129,254	14.79	1,912,183.67
FORTUM OYJ	32,550	12.05	392,390.25
IBERDROLA SA	444,395	10.96	4,872,791.17
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.20	262,262.00
REDEIA CORP SA	30,678	14.89	456,795.42
RWE STAMM	44,929	39.27	1,764,361.83
SNAM SPA	147,559	4.67	689,543.20
TERNA SPA	95,819	7.49	718,259.22
VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.06	1,396,854.86
VERBUND AG	6,430	74.65	479,999.50
ASM INTERNATIONAL NV	3,400	422.95	1,438,030.00
ASML HOLDING NV	29,993	594.20	17,821,840.60
INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	31.97	3,103,813.25
STMICROELECTRONICS NV	50,286	42.44	2,134,137.84
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	60.90	321,247.50
VONOVIA SE	52,580	20.40	1,072,632.00
	13,658,431		344,962,154.96



ユーロ 小計				(54,597,160,265)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.75	6,255,381.31
	SHELL PLC-NEW	508,994	23.78	12,106,422.29
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	20.31	1,895,471.37
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.01	418,431.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	53.82	587,929.68
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.25	286,065.00
	GLENCORE PLC	793,369	4.26	3,380,941.99
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	15.43	259,964.64
	MONDI PLC	41,710	12.67	528,465.70
	RIO TINTO PLC REG	83,678	47.45	3,970,939.49
	ASHTED GROUP PLC	33,317	53.88	1,795,119.96
	BAE SYSTEMS PLC	219,532	9.91	2,176,440.24
	BUNZL PLC	22,799	27.24	621,044.76
	DCC PLC	6,622	41.95	277,792.90
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.03	1,290,895.27
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.89	420,703.64
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	97.14	535,629.96
	EXPERIAN PLC	67,859	27.12	1,840,336.08
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	41.33	574,073.70
	RELX PLC	141,442	25.28	3,575,653.76
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	5.87	1,068,092.91
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.31	315,720.22
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	39.09	271,753.68
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	21.67	645,245.92
	PERSIMMON PLC	25,686	9.87	253,520.82
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.09	288,665.67
	COMPASS GROUP PLC	129,701	20.19	2,618,663.19
	ENTAIN PLC	49,630	11.56	573,722.80
	INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	58.78	667,917.14
	PEARSON	55,305	8.32	460,580.04
	WHITBREAD PLC	17,434	33.58	585,433.72
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.87	425,351.94
	INFORMA PLC	110,598	7.17	792,987.66
WPP PLC	85,821	7.47	641,597.79	
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.39	287,486.75	
KINGFISHER PLC	153,717	2.27	349,091.30	
NEXT PLC	7,832	67.80	531,009.60	
OCADO GROUP PLC	54,753	7.41	406,157.75	
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.61	388,489.36	
TESCO PLC	525,585	2.60	1,367,046.58	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.53	502,702.20	

	BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.89	4,087,720.32	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	22.73	408,230.80	
	DIAGEO	167,595	32.67	5,476,166.62	
	IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.71	1,213,087.77	
	HALEON PLC	346,790	3.27	1,136,604.22	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	56.88	3,008,098.80	
	UNILEVER PLC	187,760	40.36	7,578,932.40	
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.59	726,421.05	
	ASTRAZENECA	115,201	106.60	12,280,426.60	
	GSK PLC	304,379	13.74	4,182,167.46	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	21.22	140,476.40	
	BARCLAYS	1,129,529	1.43	1,626,295.85	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	5.87	8,729,000.46	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.41	2,018,061.54	
	NATWEST GROUP PLC	426,244	2.25	962,458.95	
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.11	1,352,791.12	
	3I GROUP PLC	74,757	19.24	1,438,324.68	
	ABRDN PLC	153,430	1.61	247,175.73	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.53	249,283.34	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	81.82	2,442,245.18	
	M&G PLC	131,539	1.85	243,347.15	
	SCHRODERS PLC	39,932	4.02	160,686.36	
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	8.50	348,102.73	
	WISE PLC - A	49,048	6.39	313,711.00	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.90	388,494.50	
	AVIVA PLC	193,334	3.69	714,755.79	
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.12	869,696.26	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.05	257,657.05	
	PRUDENTIAL	212,226	9.46	2,009,355.76	
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.51	729,496.56	
	HALMA PLC	31,069	20.78	645,613.82	
	BT GROUP PLC	464,863	1.12	522,273.58	
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.71	1,115,425.08	
	CENTRICA PLC	453,631	1.46	665,476.67	
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.77	2,543,150.24	
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.68	413,642.24	
	SSE PLC	81,692	16.16	1,320,551.18	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.20	465,437.16	
	イギリスボンド 小計	20,310,344		129,269,783.04 (23,855,445,762)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.98	243,224.04	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	652.00	374,248.00	

GIVAUDAN-REG	678	2,849.00	1,931,622.00
HOLCIM LTD	41,204	57.52	2,370,054.08
SIG GROUP AG	26,203	22.34	585,375.02
SIKA AG-BR	10,856	239.70	2,602,183.20
ABB LTD	116,833	32.91	3,844,974.03
GEBERIT AG-REG	2,530	443.20	1,121,296.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	183.00	374,784.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	193.70	598,920.40
VAT GROUP AG	1,956	346.00	676,776.00
ADECCO GROUP AG-REG	8,571	37.43	320,812.53
SGS SA	10,147	79.98	811,557.06
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	264.40	999,696.40
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	123.00	4,766,004.00
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	245.80	610,321.40
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	46.70	183,904.60
DUFREY AG-REG	7,820	39.12	305,918.40
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,551.00	434,280.00
CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	8	101,600.00	812,800.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,330.00	847,060.00
NESTLE SA - REGISTERED	204,409	106.24	21,716,412.16
ALCON INC	38,399	73.64	2,827,702.36
SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	234.70	912,278.90
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	131.80	1,125,572.00
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	81.45	150,682.50
LONZA GROUP AG-REG	5,536	473.30	2,620,188.80
NOVARTIS	152,294	89.72	13,663,817.68
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	274.80	608,682.00
ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	259.20	13,535,942.40
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	96.45	239,871.15
JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	59.06	902,968.34
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	916.80	1,443,043.20
UBS GROUP AG	249,657	21.63	5,400,080.91
BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	136.10	323,781.90
HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	131.70	389,173.50
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	537.40	1,299,970.60
SWISS RE LTD	22,063	84.60	1,866,529.80
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	407.30	4,555,243.20
TEMENOS AG - REG	5,150	67.36	346,904.00
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	59.10	632,488.20
SWISSCOM	1,856	530.40	984,422.40
BKW AG	1,744	157.50	274,680.00
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	83.60	474,764.40

	スイスフラン 小計	1,103,720		101,111,011.56 (16,755,105,725)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	284.95	6,340,707.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	403.30	2,170,963.90	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	139.65	4,998,073.50	
	ALFA LAVAL AB	18,955	369.70	7,007,663.50	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	240.00	18,234,480.00	
	ATLAS COPCO A	207,097	145.75	30,184,387.75	
	ATLAS COPCO B	108,178	125.65	13,592,565.70	
	BEIJER REF AB	26,868	121.00	3,251,028.00	
	EPIROC AB-A	53,479	205.40	10,984,586.60	
	EPIROC AB-B	28,804	175.10	5,043,580.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	87.86	3,401,236.32	
	INDUTRADE AB	22,644	200.80	4,546,915.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	194.60	2,724,789.20	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	197.90	3,556,263.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	81.92	10,063,708.16	
	SAAB AB-B	6,388	566.80	3,620,718.40	
	SANDVIK AB	75,334	201.40	15,172,267.60	
	SKANSKA B	25,507	154.45	3,939,556.15	
	SKF AB-B	21,050	178.55	3,758,477.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	221.20	2,989,296.80	
	VOLVO B	114,238	217.80	24,881,036.40	
	SECURITAS B	28,375	86.00	2,440,250.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	42.96	2,141,083.44	
	EVOLUTION AB	13,186	1,173.80	15,477,726.80	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	23.89	1,269,681.83	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	159.90	6,612,024.90	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	255.00	12,615,870.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	187.25	3,332,301.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	221.40	3,173,769.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	118.16	27,960,909.76	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	123.35	13,568,623.35	
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	90.30	10,902,460.80		
SWEDBANK AB-A	58,652	190.80	11,190,801.60		
EQT AB	31,471	206.60	6,501,908.60		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	281.70	3,329,130.60		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	280.80	3,135,974.40		
INVESTOR AB-A SHS	26,088	206.50	5,387,172.00		
INVESTOR AB-B SHS	128,538	209.65	26,947,991.70		
KINNEVIK AB - B	18,792	123.65	2,323,630.80		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	437.00	3,181,360.00		

	ERICSSON (LM) B	214,689	54.14	11,623,262.46	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	96.70	14,396,502.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	75.74	3,541,753.88	
	TELIA CO AB	123,760	21.48	2,658,364.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	48.60	2,755,620.00	
	SAGAX AB-B	17,402	221.30	3,851,062.60	
	スウェーデンクローナ 小計	2,691,864		380,781,538.40 (5,056,778,829)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	282.30	5,111,041.50	
	EQUINOR ASA	73,436	320.70	23,550,925.20	
	NORSK HYDRO	100,517	58.04	5,834,006.68	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	381.60	4,769,236.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	444.00	3,838,380.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	77.25	1,476,788.25	
	MOWI ASA	31,968	188.35	6,021,172.80	
	ORKLA	37,417	80.54	3,013,565.18	
	SALMAR ASA	5,423	500.00	2,711,500.00	
	DNB BANK ASA	71,795	210.30	15,098,488.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	160.30	2,977,412.20	
	TELENOR ASA	51,193	108.90	5,574,917.70	
	ノルウェークローネ 小計	448,688		79,977,434.81 (1,097,290,405)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	458.50	3,889,455.50	
	NOVOZYMES A/S	17,111	304.20	5,205,166.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,617.00	1,220,835.00	
	VESTAS WIND SYSSEMS A/S	72,778	164.36	11,961,792.08	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,740.00	2,790,060.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,960.00	3,965,760.00	
	DSV A/S	14,203	1,304.00	18,520,712.00	
	PANDORA A/S	7,957	694.40	5,525,340.80	
	CARLSBERG AS-B	6,810	1,016.00	6,918,960.00	
	COLOPLAST-B	9,208	780.00	7,182,240.00	
	DEMANT A/S	8,512	291.70	2,482,950.40	
	GENMAB A/S	4,628	2,573.00	11,907,844.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	123,050	1,278.00	157,257,900.00	
	DANSKE BANK A/S	46,499	154.95	7,205,020.05	
	TRYG A/S	29,772	128.55	3,827,190.60	
ORSTED A/S	12,910	554.80	7,162,468.00		
	デンマーククローネ 小計	363,201		257,023,694.63 (5,459,183,273)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	33.71	695,403.59	
	SANTOS	218,974	7.72	1,690,479.28	

WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	37.67	5,316,555.45
BHP GROUP LTD	377,956	43.02	16,259,667.12
BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.46	711,394.20
FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	20.93	2,564,029.65
IGO LTD	56,345	12.96	730,231.20
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,156	44.15	1,243,087.40
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	65.57	944,798.13
NEWCREST MINING LIMITED	60,966	25.46	1,552,194.36
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	11.17	823,027.94
ORICA LTD	38,288	14.97	573,171.36
PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.70	984,579.50
RIO TINTO LTD	28,272	107.90	3,050,548.80
SOUTH32 LTD	346,773	3.48	1,206,770.04
REECE LTD	16,814	19.59	329,386.26
BRAMBLES LTD	108,007	14.06	1,518,578.42
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.67	1,094,755.92
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.68	440,094.88
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.24	530,400.00
TRANSURBAN GROUP	224,973	13.08	2,942,646.84
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	39.96	1,846,551.60
IDP EDUCATION LTD	17,793	25.98	462,262.14
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.02	913,705.26
REA GROUP LTD	3,586	161.38	578,708.68
SEEK LTD	28,001	23.19	649,343.19
WESFARMERS LTD	84,329	51.00	4,300,779.00
COLES GROUP LTD	108,486	15.91	1,726,012.26
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.50	604,455.50
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	37.41	3,444,376.11
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.87	759,205.20
COCHLEAR LIMITED	4,783	264.98	1,267,399.34
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	48.42	586,220.94
SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	31.88	868,411.20
CSL LIMITED	35,855	263.42	9,444,924.10
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	24.34	5,393,963.06
COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	99.57	12,496,134.57
NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	27.89	6,506,681.22
WESTPAC BANKING	255,840	21.32	5,454,508.80
ASX LTD	14,549	57.28	833,366.72
MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	171.79	4,656,367.95
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	31.93	441,017.16
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.68	946,640.16
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.57	828,893.31

	QBE INSURANCE GROUP	104,083	14.49	1,508,162.67	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.05	1,237,975.20	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	71.65	988,841.65	
	XERO LTD	11,340	118.67	1,345,717.80	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.01	1,236,952.67	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.65	947,010.65	
	オーストラリアドル 小計	5,120,036		117,476,388.45 (11,055,702,917)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.90	651,441.90	
	EBOS GROUP LTD	14,283	36.05	514,902.15	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	22.28	890,754.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	5.05	490,895.35	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.27	405,123.51	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.29	584,777.76	
	ニュージーランドドル 小計	409,088		3,537,895.07 (306,664,744)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	41.05	7,204,110.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	77.00	8,239,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.00	1,012,000.00	
	MTR CORP	125,000	31.90	3,987,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.72	1,766,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	49.90	8,682,600.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	26.20	5,187,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	16.74	2,442,366.00	
	WH GROUP LTD	658,301	3.97	2,613,454.97	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	21.15	5,953,725.00	
	HANG SENG BANK	59,400	97.40	5,785,560.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	287.60	25,395,080.00	
	AIA GROUP LTD	865,600	67.65	58,557,840.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	38.55	1,445,625.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	58.90	6,007,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.83	5,274,150.31	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	38.80	4,345,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	42.60	5,197,029.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	12.10	1,899,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.66	1,844,180.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.25	2,661,095.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	16.32	2,225,640.00	
	SINO LAND CO	315,400	8.88	2,800,752.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	88.65	9,308,250.00		
SWIRE PACIFIC A	10,000	65.35	653,500.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	17.02	1,637,324.00		

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	31.85	3,917,550.00	
	香港ドル 小計	5,609,853		186,045,432.68 (3,475,328,682)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	32.51	260,080.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.70	755,760.00	
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.14	305,696.32	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.82	563,068.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.85	742,074.20	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.90	264,984.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.55	634,030.00	
	DBS GROUP	130,200	32.90	4,283,580.00	
	OCBC BANK	257,100	12.36	3,177,756.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	28.08	2,639,520.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.51	627,660.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	13.12	337,184.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.34	1,300,204.62	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.14	399,408.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.66	285,048.00	
UOL GROUP LIMITED	47,500	6.38	303,050.00		
	シンガポールドル 小計	4,346,866		16,879,103.14 (1,824,968,631)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	22.88	1,359,689.76	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	752.60	1,615,079.60	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	32.24	3,169,514.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	30.45	3,425,990.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.39	1,929,305.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	130.40	1,630,391.20	
	NICE LTD	4,991	747.00	3,728,277.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	108.10	1,081,000.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	204.00	313,548.00	
	イスラエルシェケル 小計	400,926		18,252,795.36 (704,004,841)	
	合 計	82,958,271		559,308,883,315 (559,308,883,315)	

## (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	725,455.90	
		LENLEASE GROUP	64,786	491,077.88	
		オーストラリアドル 小計	148,076	1,216,533.78 (114,487,994)	



	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,614,500.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,614,500.00 (48,838,860)	
		投資信託受益証券合計	463,076	163,326,854 (163,326,854)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,442,096.02	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	882,081.68	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	6,149,816.73	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	737,193.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,829,560.35	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	720,688.59	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	830,382.84	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,213,829.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,691,047.70	
		EQUINIX INC	6,951	5,358,664.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	950,793.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,664,923.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,234,834.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,007,605.49	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	829,293.85	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	506,464.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	915,710.95	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	876,575.12	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,519,020.00	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,426,851.42	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	898,068.75	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,330,792.35	
		PROLOGIS INC	68,641	8,419,505.06	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,273,326.10	
		REALTY INCOME CORP	49,099	2,749,544.00	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	765,548.09	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,682,371.11	
		SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,595,400.47	
		SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,044,115.08	
		UDR INC	23,815	932,833.55	
		VENTAS INC	31,565	1,359,188.90	
		VICI PROPERTIES INC	74,643	2,278,104.36	
		WELLTOWER INC	36,855	2,986,360.65	
WP CAREY INC	16,024	1,031,144.40			
		アメリカドル 小計	900,424	67,133,736.05 (9,838,449,018)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	234,087.30	

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	299,266.80	
カナダドル 小計		20,377	533,354.10 (57,479,571)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	208,106.28	
	GECINA SA	3,139	296,792.45	
	KLEPIERRE	17,225	406,854.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	491,489.55	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	329,565.28	
ユーロ 小計		48,695	1,732,808.06 (274,251,531)	
イギリスポ ンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	249,280.54	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	329,966.11	
	SEGRE PLC	78,133	566,151.71	
イギリスポンド 小計		213,836	1,145,398.36 (211,371,813)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	715,084.00	
	GOODMAN GROUP	116,335	2,626,844.30	
	GPT GROUP	167,884	686,645.56	
	MIRVAC GROUP	266,683	624,038.22	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,033,276.93	
	STOCKLAND	207,412	864,908.04	
	VICINITY CENTERS	305,149	553,845.43	
オーストラリアドル 小計		1,538,836	7,104,642.48 (668,617,903)	
香港ドル	LINK REIT	166,900	6,425,650.00	
香港ドル 小計		166,900	6,425,650.00 (120,031,142)	
シンガポ ールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	781,379.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	639,819.81	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	470,093.74	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	338,800.00	
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,230,093.05 (241,117,660)	
投資証券合計		4,014,924	11,411,318,638 (11,411,318,638)	
合計			11,574,645,492 (11,574,645,492)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。

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

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

4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 606銘柄	97.7%			72.9%
	投資証券 34銘柄			2.3%	1.7%
カナダドル	株式 85銘柄	99.7%			3.3%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221銘柄	99.5%			9.6%
	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%			1.0%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.4%			1.9%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.6%	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	95.4%			0.6%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.3%		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。

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 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,407,790,206
コール・ローン	73,933,013
株式	149,581,754,771
投資信託受益証券	476,268,741
投資証券	132,975,759
派生商品評価勘定	3,465,420
未収入金	7,195,216
未収配当金	384,405,354
前払金	245,548,922
差入委託証拠金	1,069,421,763
流動資産合計	157,382,759,165
資産合計	157,382,759,165
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	248,940,822
未払金	2,611,623
未払解約金	37,267,231
未払利息	171
流動負債合計	288,819,847
負債合計	288,819,847
純資産の部	
元本等	
元本	40,668,171,523
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	116,425,767,795
元本等合計	157,093,939,318
純資産合計	157,093,939,318
負債純資産合計	157,382,759,165

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>

	2023年 8月28日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,668,171,523口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.8628円 (38,628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 8月28日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2023年 8月28日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	31,545,220,148円
期中追加設定元本額	12,901,862,027円
期中一部解約元本額	3,778,910,652円
期末元本額	40,668,171,523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	7,701,845,275円
世界経済インデックスファンド	9,478,249,195円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,965,884,305円
DC世界経済インデックスファンド	7,132,873,602円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	102,108,779円
コア投資戦略ファンド（安定型）	50,323,436円
コア投資戦略ファンド（成長型）	125,428,063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

区分	2023年 8月28日現在
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,108,816,154円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	769,609,590円
コア投資戦略ファンド（切替型）	59,134,295円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	394,986,246円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,501,665円
S M T インデックスバランス・オープン	97,163,605円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	1,906,572,221円
S M T 世界経済インデックス・オープン	230,746,180円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	952,873,052円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	163,763,843円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,422,508円
グローバル経済コア	408,703,408円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	187,805,328円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	51,001,497円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,615,652円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	91,140,738円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	85,863,881円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	36,334,941円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	38,117,293円
1 0 資産分散投資ファンド	13,164,952円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,402,495,369円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	100,299,309円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,074,009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）	10,415,944円
F O F s 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）	23,293,240円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,187,307,637
投資信託受益証券	46,671,038
投資証券	3,875,411
合計	7,237,854,086

(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



区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,381,801,172	-	7,136,252,250	245,548,922
合計		7,381,801,172	-	7,136,252,250	245,548,922

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2023年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	283,806,400	-	283,879,920	73,520
	香港ドル	283,806,400	-	283,879,920	73,520
合計		283,806,400	-	283,879,920	73,520

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.36	190,141.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.17	138,318.10	
	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	77.79	1,225,114.71	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	24.39	1,556,838.09	
NIO INC - ADR	201,974	10.83	2,187,378.42	
H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	40.26	1,214,201.34	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	6.71	531,888.28	
YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	53.05	3,525,278.60	
AUTOHOME INC-ADR	12,283	29.00	356,207.00	
IQIYI INC-ADR	59,454	4.63	275,272.02	
JOYY INC	6,185	32.33	199,961.05	
KANZHUN LTD	38,815	14.30	555,054.50	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	6.48	735,784.56	
VK CO LTD	19,368	0.00	-	
WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	12.49	65,560.01	
YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	22.62	242,622.12	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	79.91	6,470,632.34	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	15.72	859,506.72	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,037	69.78	560,821.86	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.19	483,064.40	
CREDICORP LTD	10,882	141.52	1,540,020.64	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.17	133,535.61	
QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	15.80	327,897.40	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.27	320,651.28	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	35.72	279,866.20	
KE HOLDINGS INC	92,870	14.32	1,329,898.40	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.50	76,368.43	
アメリカドル 小計	2,059,883		25,381,883.68 (3,719,715,053)	
メキシコペソ				
CEMEX SAB-SPONS	2,214,261	13.61	30,136,092.21	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	81.55	39,869,142.60	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	233.27	8,164,450.00	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	37.58	6,709,984.16	
ALFA S.A.B. -A	313,500	10.70	3,354,450.00	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	137.31	14,005,620.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	461.80	15,504,935.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	306.64	18,392,267.20	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	165.70	7,072,904.50	
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	590,690	14.74	8,706,770.60	

	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	67.83	56,114,402.40	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	165.22	13,527,387.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	195.55	61,234,527.00	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	294.01	7,632,499.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	86.98	15,812,964.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	39.99	7,270,182.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	53.06	7,571,662.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	145.02	59,791,746.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	36.47	9,908,899.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,969,540	15.88	78,916,295.20	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	15.95	3,526,545.00	
	メキシコペソ 小計	11,688,330		473,223,725.97 (4,149,178,306)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	17.89	2,899,969.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	594,100	35.04	20,817,264.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	31.97	23,275,438.80	
	PRIQ SA	130,000	46.39	6,030,700.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	18.51	1,399,356.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	11.90	1,182,860.00	
	GERDAU SA-PREF	155,590	24.79	3,857,076.10	
	SUZANO SA	121,779	49.90	6,076,772.10	
	VALE SA	525,387	62.07	32,610,771.09	
	WEG SA	255,844	36.36	9,302,487.84	
	CCR SA	248,600	12.55	3,119,930.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	93,140	63.01	5,868,751.40	
	RUMO SA	244,300	22.65	5,533,395.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	16.61	3,595,184.67	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	2.92	892,060.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.46	3,193,580.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	10.54	1,397,604.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	27.04	5,118,131.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	12.37	1,877,766.00	
	AMBEV SA	756,200	13.99	10,579,238.00	
	JBS SA	110,000	18.53	2,038,300.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	15.28	1,532,706.24	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.59	4,797,256.86	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	29.21	2,795,397.00	
	HYPERA SA	54,500	40.09	2,184,905.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.21	4,306,763.83	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	14.83	12,281,939.06	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	46.93	7,344,545.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	26.86	20,958,347.66	

	ITAUSA SA	774,657	9.34	7,235,296.38	
	ITAUSA SA-RIGHTS	10,773	2.93	31,564.89	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	13.49	11,971,147.41	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	30.34	3,304,026.00	
	TOTVS SA	57,900	27.85	1,612,515.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	41.40	3,701,160.00	
	TIM SA	96,100	14.70	1,412,670.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	39.94	1,477,780.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	36.45	7,716,465.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.24	2,592,762.48	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	58.94	2,976,470.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	34.46	937,312.00	
	ENEVA SA	102,200	12.43	1,270,346.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	42.07	1,945,737.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	31.61	5,218,811.00	
	ブラジルリアル 小計	11,732,271		260,272,559.51 (7,822,595,885)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,112.00	552,665,376.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,565.00	212,785,225.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	53,800.00	1,143,303,800.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	57.00	140,287,716.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,115.00	149,820,255.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,848.50	566,439,552.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,400.00	47,264,000.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	91.96	697,351,347.88	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	24,802.00	173,341,178.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	40.87	472,055,407.03	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	101.98	356,044,303.70	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	56.16	143,841,372.48	
	チリペソ 小計	28,286,435		4,655,199,533.09 (805,968,660)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	27,002	28,700.00	774,957,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	27,680.00	1,704,119,200.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	15,520.00	783,930,720.00	
	コロンビアペソ 小計	139,078		3,263,007,320.00 (115,804,129)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	22.46	116,814.46	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	36.90	748,885.50	
	OPAP SA	20,586	15.15	311,877.90	
	JUMBO SA	19,341	28.54	551,992.14	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.50	395,633.83	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.54	662,660.71	

	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	6.35	467,908.56	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.10	369,518.70	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	10.10	564,509.20	
	TERNA ENERGY SA	13,651	16.27	222,101.77	
	ユーロ 小計	926,142		4,411,902.77	(698,271,851)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	133.50	19,035,765.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	43.82	11,343,595.76	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	25.62	3,409,176.54	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	26.56	445,756.48	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	52.80	6,231,667.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	37.78	7,523,206.96	
	KOC HOLDING AS	89,884	137.00	12,314,108.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	51.30	15,325,772.40	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	851.60	6,115,339.60	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	238.00	20,614,370.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	860.20	14,081,474.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	266.80	8,431,680.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	257.00	20,875,596.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	29.94	17,550,319.02	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	59.50	12,576,634.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	18.68	7,181,768.84	
YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	16.62	6,168,130.74		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	58.00	8,299,278.00		
	トルコリラ 小計	3,176,329		197,523,638.94	(1,092,088,447)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	711.00	9,458,433.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	86.00	5,221,060.00	
	CEZ AS	25,283	946.00	23,917,718.00	
	チェココルナ 小計	99,296		38,597,211.00	(253,722,626)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,746.00	122,260,158.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,165.00	263,411,265.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	14,305.00	572,500,405.00	
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		958,171,828.00	(397,678,677)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	62.56	6,442,366.24	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	110.45	2,229,543.70	
	LPP SA	124	12,670.00	1,571,080.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	156.10	1,046,494.40	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	14.25	514,576.99	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	32.56	2,728,784.17	

	PEPCO GROUP NV	22,887	31.38	718,194.06
	DINO POLSKA SA	9,471	377.30	3,573,408.30
	BANK PEKAO SA	27,684	106.40	2,945,577.60
	M BANK SA	1,423	413.80	588,837.40
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	37.13	4,837,927.61
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	376.40	2,763,905.20
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	39.84	3,447,315.36
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	8.82	880,635.20
	ポーランドズロチ 小計	635,320		34,288,646.23 (1,214,627,288)
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 (117)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	5.36	1,763,440.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	9.03	2,185,260.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.37	16,909,278.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	455,500	22.15	10,089,325.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	7.82	172,040.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.58	17,956,440.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	11.14	4,779,060.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.60	1,224,000.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	22.00	5,225,000.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	7.54	4,188,470.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.12	2,999,360.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	2.73	786,240.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.78	3,871,800.00
	DONGYUE GROUP	147,000	6.92	1,017,240.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	39.00	2,107,560.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	11.98	2,803,320.00

NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.41	1,605,240.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	15.70	1,491,500.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.50	1,900,500.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	12.24	11,077,200.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.52	968,000.00
BOC AVIATION LTD	23,800	58.35	1,388,730.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.37	660,520.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	7.97	1,936,710.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	3.97	508,160.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.10	2,894,600.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.54	3,774,680.00
CITIC LTD	1,038,000	7.68	7,971,840.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	3.80	3,556,800.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.81	1,385,280.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.38	1,355,640.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	11.30	1,808,000.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	408,800	9.61	3,928,568.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	27.25	1,697,675.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	2.76	1,062,804.24
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.69	1,217,660.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.16	1,031,680.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.46	1,566,074.62
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.16	2,487,680.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	7.48	3,875,014.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.48	1,123,467.52
JD LOGISTICS INC	326,200	10.60	3,457,720.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.97	2,244,340.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	115.80	2,026,500.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.08	865,712.96
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.84	1,810,400.00
BYD CO LTD-H	158,000	223.60	35,328,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	2.93	779,380.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	34.85	2,035,240.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.51	9,015,480.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.32	4,601,750.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.12	1,476,377.28
LI AUTO INC-CLASS A	171,642	152.30	26,141,076.60
MINTH GROUP LTD	176,000	22.80	4,012,800.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	65.10	10,882,246.20
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	13.72	3,210,480.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	87.45	17,385,060.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	2.89	1,265,820.00

HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	23.00	7,143,800.00
LI NING CO LTD	380,000	37.10	14,098,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	75.20	9,181,920.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.83	1,291,950.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	43.15	1,898,600.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	21.60	5,054,400.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	235,000	13.46	3,163,100.00
MEITUAN-CLASS B	787,350	132.20	104,087,670.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	43.25	10,574,625.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	18.44	3,075,792.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.06	1,110,740.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	311.60	27,313,921.20
BAIDU INC-CLASS A	351,450	131.90	46,356,255.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	115.90	3,082,940.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	31.25	1,612,500.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.98	2,510,640.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	31.20	5,341,440.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	65.25	24,299,100.00
NETEASE INC	313,630	153.50	48,142,205.00
TENCENT HOLDINGS LTD	968,500	320.00	309,920,000.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,575,888	87.50	225,390,200.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	5.87	610,480.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	105.80	952,200.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	11.72	2,953,440.00
JD.COM INC - CL A	360,461	130.00	46,859,930.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	24.80	1,602,080.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.46	2,648,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	23.90	2,198,800.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.55	3,567,200.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	43.60	8,434,420.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	18.44	990,228.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	132.57	2,015,064.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.38	2,470,320.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	458,000	24.80	11,358,400.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	46.70	11,488,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.73	917,580.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.15	11,911,590.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	7.87	1,534,650.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	11.86	4,933,760.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	67.60	7,841,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	5.92	473,600.00



WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	556,000	5.19	2,885,640.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	16.34	784,320.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	29.45	2,576,875.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	17.82	445,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	39.15	2,951,910.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	13.16	868,560.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	7.89	3,149,688.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	13.14	1,687,176.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	21.85	4,177,720.00
3SBIO INC	445,500	6.68	2,975,940.00
AKESO INC	61,000	33.05	2,016,050.00
BEIGENE LTD	110,905	119.10	13,208,785.50
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.20	2,766,400.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	5.80	8,051,328.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.21	1,766,190.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.03	1,472,580.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	18.16	2,397,120.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	43.70	222,870.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	9.94	1,212,680.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	33.80	6,861,400.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	50,175	18.24	915,192.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	18.78	1,370,940.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.01	5,932,710.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	83.65	5,327,501.20
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	567,000	44.35	25,146,450.00
ZAI LAB LTD	128,250	18.90	2,423,925.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	2.57	10,112,950.00
BANK OF CHINA LTD-H	12,394,200	2.64	32,720,688.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.37	5,993,345.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.48	5,446,896.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	14,601,620	4.10	59,866,642.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.24	840,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	30.75	19,124,132.25
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.77	1,868,088.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	3.46	30,200,661.90
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	3.96	4,257,000.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.76	632,320.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.14	1,999,620.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	16.86	5,921,232.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.10	4,600,977.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.33	1,279,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	11.34	1,004,724.00

HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.01	1,789,572.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	10.84	2,883,440.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,109,000	11.42	12,664,780.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	17.56	6,788,696.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	7.95	1,462,990.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	19.48	2,053,192.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.64	4,957,920.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	8.47	10,141,029.36
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	44.45	44,627,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	23.20	2,693,520.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	5.00	1,380,000.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	11.02	1,396,234.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	12.36	6,093,480.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	15.02	1,073,930.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	32.85	5,272,425.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	17.26	1,156,420.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	6.32	436,080.00
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	8.04	9,551,520.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	61.50	7,349,250.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	12.10	29,090,820.00
ZTE CORP-H	82,908	23.75	1,969,065.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.78	5,523,960.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	28.80	1,713,600.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.76	1,073,600.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.98	2,827,440.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.76	3,619,264.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	6.05	2,734,600.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.86	1,904,760.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,800	22.35	2,386,980.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	16.16	4,159,584.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	65.70	7,686,900.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.06	2,702,760.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.11	2,893,440.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.56	3,046,880.00
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	19.54	1,250,560.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.35	4,251,150.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	18.98	1,708,200.00
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	18.44	792,920.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	6.58	5,895,594.46
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	19.80	1,810,789.20
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.07	669,713.00

	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	15.66	9,153,896.40	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	9.09	2,045,250.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.85	17,234,385.35	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	34.00	4,046,000.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	9.25	2,918,375.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	8.47	2,888,270.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	7.49	543,025.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	3.90	702,000.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	16.44	5,647,140.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	9.25	2,965,550.00	
	香港ドル 小計	128,836,254		1,798,395,658.29 (33,594,030,896)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.09	864,566.12	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.82	1,928,888.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.90	2,873,160.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.88	3,697,088.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.48	714,560.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.20	739,961.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	7.20	772,423.20	
	MISC BHD	217,540	7.16	1,557,586.40	
	GENTING BHD	271,600	4.40	1,195,040.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.61	964,917.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.51	458,209.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	4.02	1,086,766.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	21.74	2,483,708.04	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	129.40	931,680.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.84	1,163,923.20	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.44	678,912.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.37	1,079,591.02	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.97	1,368,921.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.81	408,969.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.67	1,103,569.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	5.61	5,161,211.22	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.76	2,396,729.92	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.20	302,720.60	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.02	7,951,175.10	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,122,900	4.08	8,661,432.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.64	1,237,117.08	
AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.57	1,390,598.73		
CELCOMDIGI BHD	498,000	4.40	2,191,200.00		
MAXIS BHD	267,900	4.06	1,087,674.00		
TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.06	1,374,053.12		

	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.06	2,531,704.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.97	4,404,496.75	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.03	832,341.00	
	マレーシアリングット 小計	12,038,592		65,594,893.00 (2,071,073,473)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	8.85	15,161,820.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	159.00	31,927,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,377,500	35.50	48,901,250.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	52.25	15,340,861.25	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	29.50	6,088,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	38.00	18,473,092.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	39.00	7,905,300.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	319.00	41,597,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	71.50	46,825,350.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	9.05	7,393,850.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.35	5,949,825.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.10	3,322,230.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.25	12,061,038.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	40.75	7,424,650.00	
	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	35.25	6,260,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	65.50	62,644,200.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	35.75	8,505,282.50	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	85.75	3,970,225.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	20.50	11,406,200.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	29.00	8,499,900.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	27.75	52,394,775.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	258.00	21,336,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	132.00	10,982,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.30	8,465,945.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,200	117.00	9,500,400.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	48.50	4,922,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	40.50	3,636,900.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	50.25	3,834,075.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	107.50	53,320,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	218.00	44,428,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	73.50	8,955,975.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	7.00	14,109,326.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	37.25	11,957,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	137.00	9,754,400.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	65.00	14,293,500.00	

	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	55.75	3,802,150.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	50.25	20,245,725.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	36.00	12,817,800.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	69.00	26,109,600.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.30	7,237,600.00	
	タイパーツ 小計	20,515,990		739,761,188.25 (3,077,406,543)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	47.25	11,242,665.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	598.00	32,537,180.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	36.40	21,334,877.20	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	825.00	29,935,125.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	204.80	31,361,024.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	239.80	14,630,198.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	115.00	10,989,400.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	105.10	24,677,690.20	
	BDO UNIBANK INC	394,773	140.50	55,465,606.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	54.75	8,830,463.25	
	PLDT INC	10,460	1,200.00	12,552,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	344.40	18,315,192.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	28.10	35,993,290.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	29.60	45,979,160.00	
	フィリピンペソ 小計	4,913,210		353,843,871.15 (916,278,704)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,590.00	5,600,357,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	26,050.00	5,233,445,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,990.00	1,961,742,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	1,030.00	2,978,975,270.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	9,300.00	2,271,060,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,220.00	5,227,016,340.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	5,950.00	1,809,990,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,875.00	2,714,965,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,450.00	21,138,585,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	84.00	11,309,751,936.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,890.00	6,180,843,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	5,150.00	4,909,495,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,425.00	6,848,145,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,125.00	3,057,337,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,760.00	4,351,824,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,810.00	7,581,185,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,275.00	80,593,257,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,900.00	36,000,572,800.00	
BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	9,100.00	11,759,930,000.00		

	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,600.00	61,378,251,200.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,020.00	2,897,412,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	3,720.00	27,155,256,000.00	
	インドネシアルピア 小計	193,375,608		312,959,396,546.00 (3,004,410,206)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	58,400.00	302,512,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	71,000.00	453,477,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	173,000.00	1,595,752,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD-RIGHTS	684	34,500.00	23,598,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	35,300.00	645,142,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	34,850.00	389,936,650.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	499,000.00	600,796,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	121,500.00	230,607,000.00	
	LG CHEM LTD	8,087	560,000.00	4,528,720,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	342,000.00	299,934,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	129,600.00	300,153,600.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	577,000.00	6,799,945,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	86,000.00	201,068,000.00	
	SKC CO LTD	1,432	88,900.00	127,304,800.00	
	CJ CORP	1,230	66,900.00	82,287,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	51,800.00	223,154,400.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	16,700.00	1,369,450,100.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	342,500.00	2,819,460,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	37,650.00	248,226,450.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	110,000.00	640,860,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	120,100.00	254,011,500.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	111,800.00	700,874,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	33,500.00	327,228,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	82,600.00	238,135,800.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	48,500.00	650,676,000.00	
	LG CORP	16,658	82,300.00	1,370,953,400.00	
	LG ENERGY SOLUTION	5,668	546,000.00	3,094,728,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	462,500.00	2,200,575,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	13,780	79,000.00	1,088,620,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	11,910	104,900.00	1,249,359,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	33,150.00	613,805,400.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	8,210.00	781,337,490.00	
	SK INC	6,394	142,500.00	911,145,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	43,450.00	506,627,000.00	
	HMM CO LTD	35,545	17,000.00	604,265,000.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	171,300.00	478,440,900.00	
	KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	23,150.00	620,929,300.00	

STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,335.00	128,905,560.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,066	37,950.00	268,154,700.00
HANON SYSTEMS	19,000	9,130.00	173,470,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	227,000.00	2,303,596,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	20,743	186,200.00	3,862,346,600.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	103,000.00	622,326,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	101,600.00	350,418,400.00
KIA CORP	39,244	78,100.00	3,064,956,400.00
COWAY CO LTD	9,036	42,000.00	379,512,000.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	101,200.00	305,320,400.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	98,300.00	1,696,068,200.00
KANGWON LAND INC	28,528	15,560.00	443,895,680.00
HYBE CO LTD	2,474	237,000.00	586,338,000.00
KAKAO CORP	52,020	48,100.00	2,502,162,000.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	28,250.00	85,343,250.00
KRAFTON INC	3,793	155,100.00	588,294,300.00
NAVER CORP	21,578	211,000.00	4,552,958,000.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	247,000.00	669,123,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	42,550.00	104,885,750.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	44,950.00	206,994,750.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	88,500.00	386,125,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	161,000.00	262,752,000.00
EMART	3,594	72,900.00	262,002,600.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	304,000.00	559,056,000.00
KT&G CORP	13,993	86,900.00	1,215,991,700.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	125,500.00	394,321,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	127,300.00	478,902,600.00
LG H&H CO LTD	1,321	449,000.00	593,129,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	65,000.00	998,400,000.00
HLB INC	23,903	28,850.00	689,601,550.00
CELLTRION INC	17,544	143,500.00	2,517,564,000.00
CELLTRION PHARM INC	2,066	69,200.00	142,967,200.00
HANMI PHARM CO LTD	1,179	301,000.00	354,879,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	757,000.00	2,024,975,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	84,700.00	270,785,900.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	74,000.00	155,400,000.00
YUHAN CORPORATION	13,195	75,600.00	997,542,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	38,750.00	1,985,898,750.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,650.00	301,714,500.00
KAKAOBANK CORP	35,459	24,450.00	866,972,550.00
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	52,500.00	3,391,447,500.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	35,200.00	2,385,785,600.00

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	11,560.00	890,744,240.00
	KAKAOPAY CORP	3,065	42,900.00	131,488,500.00
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	50,700.00	233,321,400.00
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	51,500.00	874,212,500.00
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,720.00	208,420,800.00
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,340.00	125,186,380.00
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	36,300.00	578,876,100.00
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	81,200.00	818,008,800.00
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	254,500.00	1,053,375,500.00
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	67,100.00	813,990,100.00
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	138,700.00	1,010,290,800.00
	COSMOAM&T CO LTD	3,780	163,600.00	618,408,000.00
	L&F CO LTD	4,327	220,500.00	954,103,500.00
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	13,090.00	501,360,090.00
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	254,500.00	686,132,000.00
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	48,250.00	104,509,500.00
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	146,000.00	1,348,018,000.00
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	743,174	67,100.00	49,866,975,400.00
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	125,351	55,200.00	6,919,375,200.00
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	595,000.00	5,249,685,000.00
	LG UPLUS CORP	22,125	10,300.00	227,887,500.00
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	17,830.00	788,799,200.00
	SK HYNIX INC	83,801	116,500.00	9,762,816,500.00
	韓国ウォン 小計	2,403,811		165,471,363,740.00 (18,367,321,375)
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	111,240	79.60	8,854,704.00
	ASIA CEMENT CORP	454,176	39.60	17,985,369.60
	CHINA STEEL	1,779,261	26.30	46,794,564.30
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	60.70	32,903,102.70
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	79.30	47,407,443.20
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	65.30	50,330,105.60
	TAIWAN CEMENT	913,419	35.10	32,061,006.90
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	860.00	15,959,020.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	28.30	10,245,392.40
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,485.00	13,365,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	36.35	18,255,442.55
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	23.75	11,043,750.00
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	33.05	12,757,300.00
	EVERGREEN MARINE	183,215	105.50	19,329,182.50
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.85	14,089,200.00
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	45.90	3,425,746.50
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	42.05	9,124,850.00



CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	37.40	6,622,081.40
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	492.50	19,668,972.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	168.00	13,255,368.00
GIANT MANUFACTURING	35,713	191.00	6,821,183.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	300.00	9,300,000.00
POU CHEN	273,780	28.70	7,857,486.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	690.00	37,301,400.00
MOMO.COM INC	6,600	510.00	3,366,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	268.00	23,729,792.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	71.10	55,201,684.50
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	352.50	8,812,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	17.35	10,555,358.30
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	23.50	62,069,069.50
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,002,537	24.35	48,761,775.95
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	26.25	43,400,647.50
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	20.60	31,278,236.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,684,994	35.65	60,070,036.10
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	17.10	30,633,692.40
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	17.75	35,511,555.25
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	13.80	10,764,000.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	26.40	39,994,046.40
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	42.40	29,255,364.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	220,702	178.00	39,284,956.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,433,822	24.40	34,985,256.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	44.50	68,132,036.50
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	11.70	30,141,844.20
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,110,906	62.80	69,764,896.80
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	9.35	18,062,947.10
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	472.00	33,040,000.00
ACER INC	617,803	36.25	22,395,358.75
ADVANTECH CO LTD	76,261	345.00	26,310,045.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	413.00	52,488,996.00
AUO CORP	1,268,072	17.70	22,444,874.40
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	167.50	19,882,250.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	33.15	26,710,944.00
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	345.50	104,652,986.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	181.00	26,064,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	108.00	209,330,784.00
INNOLUX CORP	1,390,080	14.35	19,947,648.00
INVENTEC CO LTD	280,511	55.80	15,652,513.80
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	1,930.00	29,027,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	145.00	51,250,540.00

	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	171.50	17,150,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	231.00	4,851,000.00	
	PEGATRON CORP	340,474	78.90	26,863,398.60	
	QUANTA COMPUTER INC	408,270	244.00	99,617,880.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	59.50	12,024,950.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	179.50	37,874,500.00	
	WISTRON CORP	344,000	111.00	38,184,000.00	
	WIWYNN CORP	16,000	1,610.00	25,760,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	54.70	14,259,852.40	
	YAGEO CORPORATION	42,588	470.00	20,016,360.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	95.10	13,116,382.20	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	116.50	68,072,697.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	70.40	15,206,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	93.30	22,877,160.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	116.50	59,917,697.50	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	1,755.00	21,060,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,430.00	18,590,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	454.50	19,089,000.00	
	MEDIATEK INC	241,804	694.00	167,811,976.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	65.00	16,835,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	392.50	37,697,662.50	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	787.00	6,296,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	26.90	15,494,400.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	430.00	26,635,920.00	
	SILERGY CORP	53,000	250.00	13,250,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,828,389	546.00	2,090,300,394.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	43.50	73,993,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	67.80	12,746,400.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	128.00	4,096,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	25.75	8,986,750.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	34.50	10,697,967.00	
	新台湾ドル 小計	54,058,888		4,897,104,755.20 (22,547,739,424)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	350.20	32,761,210.00	
	COAL INDIA LTD	181,265	227.75	41,283,103.75	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	261.60	15,545,580.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	91.80	54,807,904.80	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	212.25	100,008,379.50	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	174.75	94,322,710.50	
	PETRONET LNG LTD	83,779	218.90	18,339,223.10	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	471,182	2,469.95	1,163,795,980.90	
	ACC LTD	14,288	1,960.75	28,015,196.00	

AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	434.80	31,972,148.40
ASIAN PAINTS LTD	56,921	3,259.95	185,559,613.95
BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	702.75	20,695,284.75
GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,774.75	83,134,614.25
HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	449.90	80,824,535.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	634.80	44,292,535.20
JSW STEEL LTD	99,332	773.00	76,783,636.00
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,632.50	46,485,102.50
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,528.20	73,722,312.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	23,852.10	33,082,862.70
SRF LTD	19,164	2,311.15	44,290,878.60
TATA STEEL LTD	1,137,948	116.90	133,026,121.20
ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	8,070.40	134,694,976.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	583.10	40,613,498.10
VEDANTA LTD	107,173	233.35	25,008,819.55
ABB LTD INDIA	5,256	4,241.60	22,293,849.60
ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	2,494.85	57,386,539.70
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	133.35	67,662,456.75
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	417.50	29,394,505.00
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,309.15	46,692,143.90
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	10,646	3,910.85	41,634,909.10
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,639.45	283,978,425.50
SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,784.95	41,729,073.75
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	658.00	15,129,394.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	806.40	84,334,924.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	663.80	17,560,829.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,456.45	64,975,558.95
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,588.60	44,252,458.40
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,373.20	20,957,729.20
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,021.85	30,984,535.70
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,341.65	59,721,968.80
HERO MOTOCORP LTD	13,719	2,911.25	39,939,438.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,520.05	228,177,745.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,508.50	202,806,796.50
MRF LTD	432	108,531.95	46,885,802.40
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	95.88	49,976,011.80
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	586.45	34,770,034.05
TATA MOTORS LTD	277,381	605.45	167,940,326.45
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,881.45	60,948,430.40
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,339.30	55,251,482.20
PAGE INDUSTRIES LTD	886	39,301.65	34,821,261.90
TITAN CO LTD	56,531	3,066.25	173,338,178.75

INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	391.95	64,474,599.15
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	484.55	21,286,281.50
ZOMATO LTD	842,242	90.94	76,593,487.48
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,208.40	60,415,790.40
TRENT LTD	37,950	2,013.00	76,393,350.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,532.95	101,014,106.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	4,525.55	68,313,177.25
ITC LTD	480,447	443.85	213,246,400.95
MARICO LTD	81,711	560.05	45,762,245.55
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	22,214.55	114,316,074.30
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	832.15	77,588,833.85
UNITED SPIRITS LTD	32,483	1,007.80	32,736,367.40
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	875.40	70,345,393.20
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,971.05	51,247,300.00
DABUR INDIA LTD	79,726	558.05	44,491,094.30
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,030.25	65,313,729.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,567.35	332,476,959.70
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	4,859.20	70,759,670.40
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	553.40	66,513,699.40
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	828.85	29,353,722.75
CIPLA LTD	88,546	1,209.40	107,087,532.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,633.90	79,698,694.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,778.50	105,867,898.50
LUPIN LTD	26,552	1,077.55	28,611,107.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,107.65	160,782,043.40
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,939.85	23,704,967.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	737.55	22,225,331.70
AXIS BANK LTD	359,795	983.15	353,732,454.25
BANDHAN BANK LTD	74,811	235.75	17,636,693.25
BANK OF BARODA	248,313	189.75	47,117,391.75
HDFC BANK LTD	461,405	1,561.95	720,691,539.75
ICICI BANK LTD	812,223	970.45	788,221,810.35
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,780.00	299,242,920.00
STATE BANK OF INDIA	268,868	570.25	153,321,977.00
YES BANK LTD	2,352,478	16.86	39,662,779.08
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	7,208.70	318,422,696.40
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,503.80	82,709,000.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	7,225.50	21,640,372.50
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,081.20	59,262,734.40
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,255.35	15,595,213.05
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	820.50	49,800,247.50
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,863.10	71,887,713.50

	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	628.20	88,029,666.00
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,325.50	44,577,890.50
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	548.60	24,860,357.60
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,294.90	94,185,846.40
	HCL TECHNOLOGIES LTD	139,039	1,154.70	160,548,333.30
	INFOSYS LTD	513,793	1,420.55	729,868,646.15
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,123.25	80,429,901.75
	MPHASIS LTD	19,317	2,391.80	46,202,400.60
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,380.60	484,037,688.60
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,301.45	30,512,759.55
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,189.50	112,761,031.50
	WIPRO LTD	182,000	409.95	74,610,900.00
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	873.40	313,528,765.00
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	979.45	41,704,981.00
	ADANI POWER LTD	85,623	324.90	27,818,912.70
	GAIL INDIA LTD	504,548	116.45	58,754,614.60
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	441.10	11,787,956.40
	NTPC LTD	664,141	217.85	144,683,116.85
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	600,735	242.40	145,618,164.00
	TATA POWER CO LTD	199,512	245.30	48,940,293.60
	DLF LTD	87,983	474.90	41,783,126.70
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,594.50	20,288,418.00
	インドルピー 小計	18,376,154		12,701,710,209.66 (22,609,044,173)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.09	964,016.26
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.76	1,766,184.80
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.89	839,018.25
	INDUSTRIES QATAR	282,919	12.50	3,536,487.50
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.87	3,121,390.73
	DUKHAN BANK	319,751	4.23	1,352,546.73
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.28	2,615,415.08
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.09	2,164,637.97
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	19.77	5,131,600.05
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.00	11,860,832.00
	OOREDOO QSC	72,800	11.48	835,744.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	18.13	1,749,762.56
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.69	558,355.59
	カタールリアル 小計	4,842,933		36,495,991.52 (1,468,963,658)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	161.60	5,529,467.20
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	185.00	2,713,950.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	682.77	6,821,555.07

	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	322.01	21,717,320.43	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	230.69	33,265,498.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	75.10	7,499,561.10	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	97.82	14,755,853.54	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	410.25	2,203,863.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	130.17	6,257,141.73	
	SASOL LTD	88,115	238.62	21,026,001.30	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	31.55	12,459,852.20	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	275.53	13,859,985.59	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	78.03	3,162,477.87	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	138.19	3,939,796.90	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,120.00	95,443,920.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	16.38	7,789,967.64	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	99.72	3,744,884.88	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	77.12	13,597,489.92	
	BID CORP LTD	58,066	407.24	23,646,797.84	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	276.00	9,776,472.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	261.43	22,280,110.32	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	186.75	10,491,988.50	
	ABSA GROUP LTD	140,135	185.60	26,009,056.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,625.65	23,734,490.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	216.90	13,688,775.90	
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	195.53	39,813,623.07	
	FIRSTRAND LTD	816,636	73.40	59,941,082.40	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	407.89	7,010,405.43	
	REMGRO LTD	74,679	158.00	11,799,282.00	
	DISCOVERY LIMITED	58,396	148.01	8,643,191.96	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.82	12,495,089.92	
	OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	39.87	2,875,942.71	
	SANLAM LTD	307,490	64.95	19,971,475.50	
	MTN GROUP LTD	255,377	124.99	31,919,571.23	
	VODACOM GROUP	79,334	109.21	8,664,066.14	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	63,952	115.92	7,413,315.84	
	南アフリカランド 小計	5,273,289		615,963,323.13 (4,847,631,353)	
アラブ首長国連邦 ディールハム	MULTIPLY GROUP	519,646	4.00	2,078,584.00	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	4.23	1,825,016.58	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.82	1,696,164.04	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.60	4,054,298.00	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.68	1,984,141.08	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.68	2,982,817.92	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	17.25	4,661,985.00	

	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.90	10,063,864.10	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	20.00	11,170,720.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.36	3,890,454.16	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.90	7,649,809.20	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	5,964,783		52,057,854.08 (2,080,231,849)	
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.59	193,384.82	
	BOUBYAN BANK K.S.C	162,047	0.61	99,982.99	
	GULF BANK	144,000	0.25	37,296.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.75	969,735.75	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,101,927	0.92	1,019,282.47	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.51	153,164.28	
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.85	120,551.25	
	クウェートディナール 小計	3,462,996		2,593,397.56 (1,233,964,493)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.07	890,469.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	27.89	2,482,210.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	12.96	829,440.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.44	576,380.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.71	771,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	16.40	1,577,680.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.37	1,752,527.04	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	8.11	645,556.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	15.70	155,430.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	16.58	514,809.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	29.00	812,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.82	956,226.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	26.09	768,089.60	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.17	2,279,815.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	26.76	560,086.80	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	22.96	472,976.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	13.86	1,277,892.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	21.53	447,824.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	54.28	559,084.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	46.93	525,616.00	
	GEM CO LTD-A	289,800	6.18	1,790,964.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	32.50	806,845.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.34	532,014.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.73	1,140,175.00	
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.29	1,905,509.00		
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	61.00	146,400.00		
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	13.34	133,400.00		

INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.77	815,970.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.30	258,000.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.35	253,105.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	66.67	676,033.80
LB GROUP CO LTD-A	15,300	17.12	261,936.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	12.84	604,764.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.56	1,073,952.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.72	72,540.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	17.84	849,184.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.76	569,772.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	14.73	817,146.75
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	25.75	186,739.00
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	31.82	570,850.80
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.07	879,862.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	33.98	551,835.20
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	7.16	785,294.48
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	4.00	549,600.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	10.90	537,370.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	47.96	517,968.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	99.98	95,980.80
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	21.24	1,059,876.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	73.88	734,367.20
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	57.00	649,800.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	14.22	139,356.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.10	1,027,960.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	92.80	3,739,840.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.56	391,813.12
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	43.70	720,394.50
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	46.56	84,739.20
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	66.90	274,290.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	22.22	831,028.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	45.49	337,080.90
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	15.46	2,000,524.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	12.30	3,309,930.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	37.75	430,350.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	37.19	576,445.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	28.49	239,316.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	10.09	645,760.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	28.20	1,557,063.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.28	1,375,068.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	7.58	1,744,158.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.67	3,188,808.00



CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	228.34	9,083,365.20
CRRG CORP LTD-A	185,800	5.94	1,103,652.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	17.24	744,768.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	48.60	1,918,387.80
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	5.80	132,240.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	74.68	179,232.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	9.28	186,630.08
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	134.39	506,650.30
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	23.19	134,502.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	57.05	359,415.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	32.59	857,768.80
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	40.97	304,570.98
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	62.45	715,427.20
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	13.53	556,083.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	14.22	683,982.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.64	1,204,476.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	14.57	527,434.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	22.58	1,896,268.40
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	88.54	525,927.60
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	37.92	475,289.28
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	50.51	589,704.25
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	14.80	597,920.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.23	853,536.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	145.71	400,993.92
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.17	635,623.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.39	2,136,613.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	64.84	1,841,002.12
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	9.26	232,055.60
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	98.18	981,800.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	13.54	551,078.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	176.30	722,124.80
TBEA CO LTD-A	29,274	14.58	426,814.92
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	11.61	501,552.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.12	1,220,328.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	24.89	786,524.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	49.43	408,291.80
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	27.68	202,064.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	7.87	709,874.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.17	494,217.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	40.20	442,200.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.45	218,855.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.24	2,080,804.00

CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.32	172,800.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	9.39	1,723,065.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.31	1,173,255.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	43.48	2,308,788.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	39.10	207,972.90
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.08	225,552.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.26	794,282.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	9.63	210,319.20
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	78.30	845,640.00
BYD CO LTD -A	17,000	232.60	3,954,200.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	135.34	1,218,060.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.08	567,044.16
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	37.96	702,260.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.46	633,178.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	138.70	1,165,080.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	17.58	515,094.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	68.60	48,020.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.04	598,104.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.76	854,167.04
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	66.96	187,488.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	34.65	1,507,275.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	26.81	744,245.60
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	40.57	321,801.24
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	91.41	703,857.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.58	2,282,838.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.81	427,482.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	46.85	374,800.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	40.34	1,056,908.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.04	403,099.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	24.52	600,740.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.82	472,752.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.38	1,028,772.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	398.00	1,154,200.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2,800	12.82	35,896.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	28.66	467,158.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	13.00	296,400.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.12	314,880.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	107.50	2,227,400.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	7.36	813,280.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	26.38	588,036.58
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	37.10	526,671.60
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	32.67	349,569.00

ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	270.61	432,976.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	59.65	131,230.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	74.37	1,360,971.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	132.31	396,930.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.55	389,725.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	87.39	690,381.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	5,980	16.80	100,464.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	40.08	2,166,604.56
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	20.34	557,316.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	45.77	778,090.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	25.83	2,029,721.40
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	26.75	917,578.50
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	59.87	1,035,751.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	135.34	1,231,594.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	90.80	508,480.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	32.25	370,875.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	35.09	245,630.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,824.98	20,987,270.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	231.60	4,261,440.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	40.79	1,368,830.82
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.80	316,240.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	29.39	1,475,378.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	230.85	2,165,373.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	66.88	762,432.00
TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	8.66	1,278,216.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	17.20	656,352.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	161.55	6,704,325.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	34.82	351,682.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.29	81,037.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	18.85	559,845.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	17.40	1,596,432.60
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	30.04	480,640.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	60.93	172,919.34
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	37.00	359,640.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	20.85	257,497.50
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	15,496	9.23	143,028.08
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	18.24	269,952.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.54	162,453.60
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	25.44	183,396.96
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,900	277.99	2,196,121.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	95.45	190,900.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	127.45	35,686.00

BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	83,180	23.34	1,941,421.20
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	56.46	1,603,464.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	50.18	526,237.66
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	45.22	728,042.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	51.46	283,030.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	89.00	806,963.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	137.00	301,400.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	46.25	471,750.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	42.39	629,491.50
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	50.06	1,110,981.58
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	64.45	515,600.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	20.86	393,211.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	420.52	874,681.60
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	40.72	1,592,233.44
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	15,562	24.14	375,666.68
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	12.71	351,838.22
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	36.19	690,432.82
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.98	447,418.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	26.61	289,516.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	27.36	191,520.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	22.58	213,155.20
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	27.46	308,430.72
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	23.35	396,950.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	79.06	1,301,643.84
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	52.95	526,323.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	270.60	1,055,340.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	16.38	147,747.60
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	25.32	1,683,780.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	15.86	552,689.28
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	31.44	304,968.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.48	3,591,708.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.54	263,320.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	14.00	2,203,600.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.58	2,856,402.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	11.48	1,293,796.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.06	1,621,964.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	8.34	1,230,150.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	26.85	1,565,355.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.04	274,820.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.04	754,396.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.06	2,556,018.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	31.56	5,870,160.00

CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.00	1,094,400.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.59	1,039,056.20
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.58	666,252.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.66	2,696,276.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	16.01	3,290,055.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.23	1,340,862.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.85	686,275.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.05	3,082,965.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.68	450,800.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	11.40	905,160.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	8.28	474,692.40
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.26	124,574.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.66	404,422.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.46	414,423.60
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	23.43	3,305,504.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	25.76	620,816.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	15.79	1,854,172.33
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	17.32	62,352.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.11	367,822.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.26	924,756.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.94	1,191,452.26
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.56	2,151,956.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.95	1,080,885.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.06	1,073,473.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	163.28	881,712.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	16.85	530,775.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.61	755,324.70
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	10.30	417,932.80
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.65	963,480.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	8.58	2,639,208.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.35	495,900.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.49	458,413.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	7.60	2,392,480.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	27.30	2,735,460.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	47.01	4,926,648.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	10.29	276,801.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	27.60	113,160.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	356.40	1,718,917.20
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	12.08	415,527.84
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	40.34	1,301,610.44
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.30	350,910.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	34.16	565,757.92

IFLYTEK CO LTD - A	10,800	51.37	554,796.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	9.82	326,024.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	102.63	307,890.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	47.55	453,199.05
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	74.72	410,960.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	16.89	222,441.30
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	20.15	763,685.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.77	432,042.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	23.26	467,526.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	29.89	836,920.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.36	360,528.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	87.33	794,703.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	20.32	916,432.00
GOERTEK INC -A	26,900	14.42	387,898.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.57	278,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	51.86	363,020.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	37.44	738,017.28
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	10.95	183,960.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	31.00	1,439,950.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	109.20	188,697.60
NINESTAR CORP-A	18,543	28.26	524,025.18
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	14.07	341,901.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	62.83	299,070.80
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	122.49	788,223.15
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	17.86	509,010.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	8.18	384,460.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	24.42	447,862.80
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	41.10	172,620.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.23	388,323.30
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	111.44	523,768.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	35.60	560,700.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	19.40	587,820.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	106.95	930,465.00
ZTE CORP-A	76,400	33.71	2,575,444.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	5.12	2,164,736.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.22	1,254,836.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.95	1,194,435.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.16	3,986,140.80
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	17.13	952,428.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.46	1,092,322.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.98	2,296,162.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	14.95	1,379,885.00

	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	130.55	926,513.35
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	82.95	840,947.10
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	140.52	1,605,019.44
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	55.31	1,163,279.92
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	89.10	558,835.20
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	29.76	629,959.68
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	23.90	179,250.00
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	70.49	528,675.00
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	27.32	934,398.64
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	29.81	888,338.00
	JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	10.41	239,284.26
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	25.53	2,561,680.20
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	48.02	1,011,061.10
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	257.00	796,700.00
	SG MICRO CORP-A	4,095	73.50	300,982.50
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	83.65	660,835.00
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	193.28	541,184.00
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	24.53	904,543.75
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.33	272,807.50
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.30	411,127.80
	TONGWEI CO LTD-A	31,600	31.59	998,244.00
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	34.22	869,803.96
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	91.11	624,923.49
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	89.18	650,122.20
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	32.93	467,606.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	55.75	948,976.50
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.78	753,766.00
	CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	13.44	721,728.00
	GEMDALE CORP-A	45,500	7.32	333,060.00
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.87	2,023,236.00
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	13.98	1,143,564.00
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	13.81	176,768.00
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.36	345,748.00
	オフショア人民元 小計	25,698,238		351,326,001.60 (7,069,768,262)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	10.52	472,758.28
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	34.80	14,486,335.20
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	42.65	502,203.75
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	12.70	405,485.60
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	136.00	5,088,168.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	36.40	1,719,572.40
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	40.40	8,518,097.60

SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	141.80	1,325,688.20	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	88.40	12,723,765.60	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	25.20	2,150,139.60	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	12.30	1,272,201.30	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	43.10	2,201,504.90	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	175.40	737,907.80	
JARIR MARKETING CO	125,000	14.76	1,845,000.00	
NAHDI MEDICAL CO	6,431	155.00	996,805.00	
ALMARAI CO	30,130	67.30	2,027,749.00	
SAVOLA	36,289	36.55	1,326,362.95	
DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	146.00	997,618.00	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	254.80	2,985,491.60	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	108.40	1,726,161.60	
AL RAJHI BANK	291,473	72.50	21,131,792.50	
ALINMA BANK	161,322	35.35	5,702,732.70	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	25.60	2,202,393.60	
BANK AL-JAZIRA	97,894	17.76	1,738,597.44	
BANK ALBILAD	89,702	42.00	3,767,484.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	39.00	3,698,565.00	
RIYAD BANK	234,479	30.05	7,046,093.95	
SAUDI AWWAL BANK	147,895	35.55	5,257,667.25	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	16.42	1,159,908.80	
THE SAUDI NATIONAL BANK	437,009	35.90	15,688,623.10	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	197.80	2,167,294.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	206.20	2,932,782.60	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	360.00	1,590,120.00	
ELM CO	2,436	800.00	1,948,800.00	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	45.75	2,234,613.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.60	1,230,908.80	
SAUDI TELECOM CO	301,319	40.25	12,128,089.75	
ACWA POWER CO	16,922	194.00	3,282,868.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	20.74	3,362,140.66	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	18.80	1,898,630.80	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	8.96	413,835.52	
サウジアラビアリアル 小計	3,940,254		164,092,958.45 (6,424,239,323)	
合計	1,303,082,725		149,581,754,771 (149,581,754,771)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----



投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	14,202,876.80	
	メキシコペソ 小計		97,360	14,202,876.80	(124,529,403)
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,449,660.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,227,825.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,758,548.00	
KLABIN SA-UNIT		100,000	2,267,000.00		
ブラジルリアル 小計		383,600	11,703,033.00	(351,739,338)	
投資信託受益証券合計			480,960	476,268,741	(476,268,741)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,945,263.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	9,945,263.00	(87,199,071)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	5,816,605.95	
	南アフリカランド 小計		478,733	5,816,605.95	(45,776,688)
投資証券合計			870,433	132,975,759	(132,975,759)
合計				609,244,500	(609,244,500)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 34銘柄	100.0%			2.5%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.1%			2.8%
	投資信託受益証券 1銘柄		2.9%		0.1%
	投資証券 1銘柄			2.0%	0.1%
ブラジルリアル	株式 44銘柄	95.7%			5.2%
	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%			0.5%
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%			0.7%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式	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	194銘柄	100.0%			22.4%
マレーシアリングギット	株式	33銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%			2.0%
フィリピンペソ	株式	14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	102銘柄	100.0%			12.2%
新台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%			15.0%
インドルピー	株式	115銘柄	100.0%			15.1%
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%			3.2%
	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%			4.7%
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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 8月28日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	854,868,321
国債証券	541,247,560,250

	2023年 8月28日現在
項目	金額（円）
地方債証券	32,820,291,393
特殊債券	36,993,673,559
社債券	29,518,908,000
未収入金	398,195,000
未収利息	1,510,790,475
前払費用	47,975,948
流動資産合計	643,392,262,946
資産合計	643,392,262,946
負債の部	
流動負債	
未払金	753,773,700
未払解約金	186,125,240
未払利息	1,980
流動負債合計	939,900,920
負債合計	939,900,920
純資産の部	
元本等	
元本	479,811,102,684
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	162,641,259,342
元本等合計	642,452,362,026
純資産合計	642,452,362,026
負債純資産合計	643,392,262,946

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	479,811,102,684口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 99,548,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3390円 (1万口当たり純資産額) (13,390円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 8月28日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2023年 8月28日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	455,969,657,054円
期中追加設定元本額	51,474,560,051円
期中一部解約元本額	27,633,114,421円
期末元本額	479,811,102,684円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,440,712,642円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,702,392円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,672,612,385円
世界経済インデックスファンド	5,894,314,978円
D C マイセレクション 2 5	28,056,716,206円
D C マイセレクション 5 0	33,561,754,386円
D C マイセレクション 7 5	10,706,483,111円
D C 日本債券インデックス・オープン	412,135,649円
D C 日本債券インデックス・オープン S	90,533,721,501円
D C 日本債券インデックス・オープン P	64,147,224,282円
D C マイセレクション S 2 5	15,651,352,423円

区分	2023年 8月28日現在
DCマイセレクションS50	18,054,394,779円
DCマイセレクションS75	4,435,363,177円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	476,818,706円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,735,856,649円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,086,760,408円
DC世界経済インデックスファンド	4,433,596,497円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,105,261円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,793,161円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,961,710円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	65,407,639円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	105,883,657円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	27,699,115円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,405,141円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,278,431,813円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	732,678,934円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,145,002,682円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	63,921,454円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	50,028,540円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	918,205,566円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,020,348,131円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,351,018,350円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	102,320,595円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,489,158,858円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,841,602,417円
分散投資コア戦略ファンドA	19,359,832,385円
分散投資コア戦略ファンドS	26,054,049,871円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	274,698,013円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,771,943,190円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,117,575円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,567,886円
SMT インデックスバランス・オープン	73,586,059円
SMT 世界経済インデックス・オープン	44,771,069円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	98,080,328円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	157,014,664円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,518,602円
グローバル経済コア	233,061,754円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	41,384,067円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,038,380円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	124,041,741円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	68,675,304円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,710,059円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	12,259,946円

区分	2023年 8月28日現在
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	480,983,119円
10資産分散投資ファンド	306,346,994円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	90,423,736,244円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	40,008,023円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,565,168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）	463,288,024円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 8月28日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	12,914,252,750	
地方債証券	366,489,369	
特殊債券	417,399,053	
社債券	205,243,000	
合計	13,903,384,172	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第440回利付国債（2年）	420,000,000	420,378,000	
	第441回利付国債（2年）	440,000,000	440,404,800	
	第442回利付国債（2年）	2,400,000,000	2,402,256,000	
	第443回利付国債（2年）	3,300,000,000	3,302,904,000	
	第444回利付国債（2年）	2,925,000,000	2,927,340,000	
	第445回利付国債（2年）	1,160,000,000	1,160,823,600	

第446回利付国債（2年）	3,060,000,000	3,061,836,000	
第448回利付国債（2年）	50,000,000	50,016,500	
第449回利付国債（2年）	1,220,000,000	1,220,207,400	
第450回利付国債（2年）	50,000,000	50,004,500	
第451回利付国債（2年）	740,000,000	740,066,600	
第141回利付国債（5年）	8,820,000,000	8,836,846,200	
第142回利付国債（5年）	3,910,000,000	3,917,937,300	
第143回利付国債（5年）	4,480,000,000	4,489,049,600	
第144回利付国債（5年）	5,050,000,000	5,059,999,000	
第145回利付国債（5年）	5,120,000,000	5,128,960,000	
第146回利付国債（5年）	4,800,000,000	4,807,728,000	
第147回利付国債（5年）	4,540,000,000	4,535,323,800	
第148回利付国債（5年）	6,210,000,000	6,200,374,500	
第149回利付国債（5年）	5,070,000,000	5,059,150,200	
第150回利付国債（5年）	6,410,000,000	6,391,987,900	
第151回利付国債（5年）	4,510,000,000	4,493,222,800	
第152回利付国債（5年）	210,000,000	209,924,400	
第153回利付国債（5年）	5,810,000,000	5,782,460,600	
第154回利付国債（5年）	5,180,000,000	5,169,536,400	
第155回利付国債（5年）	2,730,000,000	2,745,178,800	
第156回利付国債（5年）	3,650,000,000	3,654,672,000	
第157回利付国債（5年）	1,460,000,000	1,460,000,000	
第158回利付国債（5年）	3,730,000,000	3,713,140,400	
第159回利付国債（5年）	950,000,000	944,575,500	
第160回利付国債（5年）	300,000,000	299,571,000	
第1回利付国債（40年）	550,000,000	652,888,500	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,291,635,200	
第3回利付国債（40年）	650,000,000	741,331,500	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,082,819,500	
第5回利付国債（40年）	1,150,000,000	1,259,917,000	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,352,131,200	
第7回利付国債（40年）	1,340,000,000	1,373,124,800	
第8回利付国債（40年）	1,490,000,000	1,414,159,000	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,568,643,400	
第10回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,661,110,800	
第11回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,192,473,750	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	896,292,000	
第13回利付国債（40年）	2,330,000,000	1,598,706,200	
第14回利付国債（40年）	2,170,000,000	1,590,566,600	
第15回利付国債（40年）	2,970,000,000	2,391,117,300	
第16回利付国債（40年）	1,030,000,000	907,852,300	
第335回利付国債（10年）	3,710,000,000	3,732,816,500	



第336回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,289,305,600	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,813,020,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,590,506,400	
第339回利付国債(10年)	3,970,000,000	3,999,417,700	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,465,085,600	
第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	5,051,274,600	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,766,664,000	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,672,990,400	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,904,484,000	
第345回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,281,369,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,747,930,000	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,545,953,000	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,251,394,800	
第349回利付国債(10年)	5,120,000,000	5,104,640,000	
第350回利付国債(10年)	6,670,000,000	6,639,851,600	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,807,392,150	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,199,332,500	
第353回利付国債(10年)	4,385,000,000	4,347,113,600	
第354回利付国債(10年)	4,720,000,000	4,672,233,600	
第355回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,605,478,000	
第356回利付国債(10年)	4,630,000,000	4,568,050,600	
第357回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,338,709,300	
第358回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,833,817,000	
第359回利付国債(10年)	4,145,000,000	4,065,250,200	
第360回利付国債(10年)	5,070,000,000	4,960,437,300	
第361回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,575,423,300	
第362回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,629,766,400	
第363回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,266,774,200	
第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,885,875,000	
第365回利付国債(10年)	6,367,000,000	6,144,155,000	
第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,010,360,000	
第367回利付国債(10年)	4,900,000,000	4,745,944,000	
第368回利付国債(10年)	4,930,000,000	4,762,577,200	
第369回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,694,022,000	
第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,800,853,800	
第371回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,708,070,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	126,329,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	180,894,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	135,280,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	129,316,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	56,488,500	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	402,706,500	

第7回利付国債(30年)	380,000,000	436,076,600	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	941,290,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	257,155,200	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	166,928,000	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	285,828,400	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	216,320,700	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	451,736,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	878,347,500	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	402,301,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	236,954,000	
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,328,529,700	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	367,116,750	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	618,441,100	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	571,320,000	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	584,045,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	644,004,000	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	513,136,200	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	931,834,800	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	702,342,000	
第26回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,834,223,500	
第27回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,213,895,000	
第28回利付国債(30年)	2,020,000,000	2,418,828,800	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,977,313,400	
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,422,458,900	
第31回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,407,965,400	
第32回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,763,770,600	
第33回利付国債(30年)	2,120,000,000	2,376,986,400	
第34回利付国債(30年)	1,865,000,000	2,146,335,250	
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,772,416,800	
第36回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,703,551,400	
第37回利付国債(30年)	2,295,000,000	2,520,736,200	
第38回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,628,988,000	
第39回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,608,929,700	
第40回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,355,923,800	
第41回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,344,053,700	
第42回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,480,024,000	
第43回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,416,179,000	
第44回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,425,141,000	
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,466,035,200	
第46回利付国債(30年)	1,830,000,000	1,861,842,000	
第47回利付国債(30年)	1,650,000,000	1,706,545,500	
第48回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,792,440,000	
第49回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,721,211,600	

第50回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,519,493,600	
第51回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,300,696,200	
第52回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,327,961,000	
第53回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,222,496,100	
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,494,817,600	
第55回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,377,814,500	
第56回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,365,151,600	
第57回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,318,079,700	
第58回利付国債(30年)	2,260,000,000	1,941,249,600	
第59回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,144,922,700	
第60回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,188,640,000	
第61回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,127,304,000	
第62回利付国債(30年)	1,165,000,000	913,488,150	
第63回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,101,971,000	
第64回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,150,670,400	
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,059,468,350	
第66回利付国債(30年)	1,465,000,000	1,099,438,550	
第67回利付国債(30年)	1,665,000,000	1,315,599,750	
第68回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,267,649,600	
第69回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,154,667,800	
第70回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,603,024,600	
第71回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,212,288,400	
第72回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,338,738,800	
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,495,457,700	
第74回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,749,845,200	
第75回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,316,192,700	
第76回利付国債(30年)	1,960,000,000	1,874,798,800	
第77回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,873,721,300	
第78回利付国債(30年)	1,250,000,000	1,193,837,500	
第79回利付国債(30年)	500,000,000	453,680,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	644,571,900	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	369,694,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	205,648,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	134,310,800	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	278,110,800	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	299,164,000	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	175,871,800	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	279,814,500	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	228,395,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	405,943,200	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	625,764,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	303,853,300	

第84回利付国債(20年)	470,000,000	491,366,200
第85回利付国債(20年)	290,000,000	305,213,400
第86回利付国債(20年)	510,000,000	539,360,700
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,930,686,600
第88回利付国債(20年)	420,000,000	446,371,800
第89回利付国債(20年)	350,000,000	370,996,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	670,874,400
第91回利付国債(20年)	450,000,000	480,568,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	938,361,600
第93回利付国債(20年)	410,000,000	437,523,300
第94回利付国債(20年)	610,000,000	653,114,800
第95回利付国債(20年)	830,000,000	898,416,900
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,709,011,500
第97回利付国債(20年)	900,000,000	974,655,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	474,720,400
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,635,028,000
第100回利付国債(20年)	480,000,000	523,579,200
第101回利付国債(20年)	715,000,000	786,371,300
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,303,003,200
第103回利付国債(20年)	400,000,000	439,792,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	174,393,600
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,290,046,800
第106回利付国債(20年)	680,000,000	746,816,800
第107回利付国債(20年)	700,000,000	767,655,000
第108回利付国債(20年)	840,000,000	912,382,800
第109回利付国債(20年)	520,000,000	566,394,400
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,210,187,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,075,817,300
第112回利付国債(20年)	790,000,000	871,670,200
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,235,069,400
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,585,694,200
第115回利付国債(20年)	700,000,000	781,144,000
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,857,407,200
第117回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,646,514,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	731,438,400
第119回利付国債(20年)	530,000,000	580,328,800
第120回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,373,276,400
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,621,953,900
第122回利付国債(20年)	900,000,000	986,850,000
第123回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,036,834,800
第124回利付国債(20年)	760,000,000	845,158,000
第125回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,444,211,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	812,979,100

第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,128,079,200	
第128回利付国債（20年）	970,000,000	1,074,469,000	
第129回利付国債（20年）	740,000,000	814,125,800	
第130回利付国債（20年）	1,685,000,000	1,856,145,450	
第131回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,443,842,400	
第132回利付国債（20年）	660,000,000	722,607,600	
第133回利付国債（20年）	990,000,000	1,091,801,700	
第134回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,634,512,000	
第135回利付国債（20年）	630,000,000	690,612,300	
第136回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,141,948,500	
第137回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,317,036,000	
第138回利付国債（20年）	980,000,000	1,058,654,800	
第139回利付国債（20年）	830,000,000	903,596,100	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,734,742,100	
第141回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,757,504,000	
第142回利付国債（20年）	1,175,000,000	1,301,606,250	
第143回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,983,581,600	
第144回利付国債（20年）	710,000,000	767,055,600	
第145回利付国債（20年）	2,335,000,000	2,566,958,900	
第146回利付国債（20年）	2,760,000,000	3,035,061,600	
第147回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,571,644,800	
第148回利付国債（20年）	2,130,000,000	2,299,739,700	
第149回利付国債（20年）	2,860,000,000	3,086,769,400	
第150回利付国債（20年）	2,830,000,000	3,022,496,600	
第151回利付国債（20年）	2,445,000,000	2,557,029,900	
第152回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,861,984,800	
第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,646,820,100	
第154回利付国債（20年）	2,635,000,000	2,744,879,500	
第155回利付国債（20年）	2,650,000,000	2,694,281,500	
第156回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,585,436,600	
第157回利付国債（20年）	3,070,000,000	2,811,874,400	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,609,227,500	
第159回利付国債（20年）	2,840,000,000	2,720,918,800	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	2,012,712,000	
第161回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,264,474,800	
第162回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,166,470,500	
第163回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,155,033,200	
第164回利付国債（20年）	1,860,000,000	1,726,470,600	
第165回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,876,085,400	
第166回利付国債（20年）	1,880,000,000	1,782,841,600	
第167回利付国債（20年）	2,290,000,000	2,100,319,300	
第168回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,061,115,000	

	第169回利付国債(20年)	2,000,000,000	1,760,820,000	
	第170回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,121,009,000	
	第171回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,710,041,200	
	第172回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,014,152,000	
	第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,066,801,500	
	第174回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,311,452,000	
	第175回利付国債(20年)	2,050,000,000	1,818,268,000	
	第176回利付国債(20年)	2,660,000,000	2,349,099,200	
	第177回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,012,211,300	
	第178回利付国債(20年)	2,280,000,000	1,998,579,600	
	第179回利付国債(20年)	2,495,000,000	2,178,858,550	
	第180回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,161,412,500	
	第181回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,174,356,000	
	第182回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,312,544,000	
	第183回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,470,036,400	
	第184回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,648,362,000	
	第185回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,079,941,000	
	国債証券合計	545,612,000,000	541,247,560,250	
地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	99,589,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	78,617,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,983,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,729,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,074,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	108,457,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	105,597,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,704,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,768,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,606,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	79,135,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	217,160,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,190,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,332,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,494,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,876,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,694,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	297,231,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	194,740,000	
	第830回東京都公募公債	300,000,000	288,585,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,111,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,734,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,982,000	

平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	197,660,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	195,974,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,877,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	201,560,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	98,116,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	237,996,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,389,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	218,902,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,042,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,254,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	105,009,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,024,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,703,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,092,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,841,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,675,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,678,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	219,096,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	218,018,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,332,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,558,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	151,841,070	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,798,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,746,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,606,880	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,846,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	197,642,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,783,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	96,806,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	154,051,200	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	174,811,000	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	191,862,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	110,107,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	108,726,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,817,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	91,126,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	93,462,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,696,305	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	108,314,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	100,749,000	

第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,694,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,651,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,544,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	442,408,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,561,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	91,738,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	292,920,000	
第1回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,190,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	99,991,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	83,987,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,312,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,775,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,774,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,713,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,807,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,739,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	301,208,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	110,456,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,529,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,147,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,675,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	199,606,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	278,319,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,288,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	82,808,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	194,556,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,169,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	156,544,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,695,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	109,741,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	219,906,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,141,674	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,700,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	378,159,600	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,902,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	99,149,000	



第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	108,135,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	109,343,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	87,963,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	221,046,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	184,232,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	218,902,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	182,946,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,727,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,616,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,048,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,712,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,818,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,580,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,449,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,303,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,588,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,382,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,203,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,100,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	111,348,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,504,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,210,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,716,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	82,808,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	92,351,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	292,110,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,310,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	90,911,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	98,876,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,600,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	218,686,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	110,113,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,312,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,528,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,786,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,617,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,796,000	

令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	291,612,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,044,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,498,800	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,730,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	290,067,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,593,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,822,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	217,444,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	98,598,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,649,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,579,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,126,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,044,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,584,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,452,106	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,757,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,773,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,820,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,748,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,352,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,190,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,392,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,452,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,830,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,017,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,386,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,204,148	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,691,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,798,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,132,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,586,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,670,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,824,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,935,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,702,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,931,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	98,198,260	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,728,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,685,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,574,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	220,258,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	77,947,000	

第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	275,025,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	94,223,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	192,716,000	
第1回名古屋市長募公債（12年）	100,000,000	101,686,000	
第1回名古屋市長募公債（30年）	100,000,000	117,140,000	
第5回名古屋市長募公債（30年）	100,000,000	117,462,000	
第9回名古屋市長募公債（20年）	100,000,000	108,692,000	
第11回名古屋市長募公債（30年）	100,000,000	104,544,000	
第499回名古屋市長募公債（10年）	100,000,000	99,928,000	
第512回名古屋市長募公債（10年）	300,000,000	292,023,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,660,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	127,912,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	218,990,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,782,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,405,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,305,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,181,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	103,741,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	328,995,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,798,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,814,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,881,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,338,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,467,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	209,534,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	292,050,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,356,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	104,317,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,485,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,080,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	196,268,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	108,715,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,786,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,776,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,503,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,744,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,738,000	
	100,000,000	109,803,000	

平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）			
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	106,305,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,156,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,524,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,791,050	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,282,600	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	535,832,000	
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,193,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,408,000	
令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	287,622,000	
令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,329,000	
令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	98,078,000	
平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,757,000	
平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,740,000	
平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,473,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,360,000	
地方債証券合計	32,680,430,000	32,820,291,393	
特殊債券			
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,656,000	
第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,916,000	
第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,765,000	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	64,093,000	
第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,350,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,174,000	
第21回道路債券	100,000,000	117,101,000	
第28回道路債券	200,000,000	236,652,000	
第33回道路債券	200,000,000	239,138,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,015,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,772,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,560,000	
第42回道路債券	200,000,000	206,514,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,788,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,560,000	

第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	219,804,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,300,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,352,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,486,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,852,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,800,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,492,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,129,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,561,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,588,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,333,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,042,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,217,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	556,998,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,297,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	84,246,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,450,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,608,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,422,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,594,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	259,000,000	260,432,270	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,110,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	402,096,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,556,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,214,000	
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,519,000	
	112,000,000	112,797,440	

第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,868,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,000,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	78,374,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,358,000	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,069,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	204,407,550	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,260,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,179,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,750,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,412,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	295,875,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,622,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	119,466,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,360,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	277,623,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	212,416,400	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,608,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,243,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,220,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	342,831,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,867,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	353,895,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	235,658,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	116,026,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	219,374,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,622,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	154,368,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,646,000	

第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,772,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,913,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	534,725,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,596,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,539,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,552,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	422,075,460	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,948,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,408,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,016,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,568,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,012,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,683,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,416,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,509,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,656,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,272,100	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,774,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,689,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,645,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,538,000	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,977,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,001,600	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,265,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,392,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,042,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,570,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	712,348,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,805,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,184,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,570,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,198,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,040,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,089,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,631,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,411,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,443,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,556,000	

第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,443,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	103,170,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,841,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,153,000	
第19回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,740,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,906,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,882,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,600,580	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,688,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,601,400	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	185,644,250	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,916,400	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,861,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	202,274,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	128,186,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	70,860,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	149,782,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,757,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,283,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	104,109,000	103,331,305	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,971,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	71,402,000	71,084,975	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,978,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,972,000	9,990,049	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	123,840,000	122,644,944	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	141,411,000	139,616,494	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	50,324,000	49,799,120	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,324,000	10,404,011	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	177,867,000	176,072,321	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	122,068,000	120,741,120	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,431,000	10,529,572	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,241,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,932,000	14,485,797	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,718,000	14,241,204	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,499,000	16,208,699	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,733,000	18,547,476	



第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,899,000	19,816,357	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,367,000	20,272,407	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,076,000	41,895,049	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,175,000	18,938,531	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,534,000	19,271,282	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,143,000	18,881,782	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,175,000	17,859,595	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,216,000	10,314,482	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,394,000	37,690,354	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,089,000	19,773,149	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,605,000	26,435,882	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,295,000	25,083,129	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,487,000	25,300,703	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,784,000	54,355,907	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,324,000	66,626,560	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,945,000	34,556,688	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,801,000	35,711,394	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,479,000	36,438,706	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,773,000	31,583,253	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,722,000	30,282,259	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,081,000	36,067,828	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	165,384,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,878,000	93,606,225	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,396,000	126,625,176	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,278,000	36,769,929	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,674,000	38,183,352	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,435,000	38,815,122	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,917,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,347,000	122,399,078	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,394,000	41,583,170	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,858,000	87,503,932	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,190,000	49,087,684	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,855,000	52,517,785	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,818,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,946,000	51,877,431	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,937,000	162,196,099	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,420,000	109,377,326	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,230,000	53,184,222	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,474,000	57,353,304	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,661,000	61,431,591	
	69,338,000	67,111,556	

第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,804,000	66,397,924	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,202,000	67,020,060	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,852,000	67,931,768	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,007,000	67,931,292	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,162,000	69,795,808	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,347,000	70,031,172	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,051,000	69,532,817	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,057,000	69,537,887	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,896,000	70,346,826	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,342,000	142,758,407	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,858,000	70,271,541	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,930,000	143,848,508	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,607,000	71,886,082	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,762,000	143,080,779	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,078,000	72,314,378	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,472,000	145,457,046	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,316,000	146,218,790	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,993,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,021,000	74,330,656	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,302,000	73,805,398	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,771,000	73,578,094	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,776,000	151,316,703	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,536,000	75,684,071	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,643,000	74,957,789	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,588,000	151,734,674	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,480,000	76,854,380	

第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,649,000	230,342,610	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,420,000	155,036,586	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,222,000	79,985,633	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,074,000	80,519,138	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,550,000	165,812,027	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,412,000	83,835,794	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,890,000	167,613,888	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	169,329,795	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,981,000	84,367,335	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,966,000	170,354,156	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,968,000	170,096,556	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,549,000	85,927,379	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,068,000	86,842,220	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,656,000	258,981,382	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,236,000	87,047,725	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,440,000	89,302,476	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,048,000	90,933,372	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,851,000	91,798,419	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,394,000	183,774,748	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,292,000	95,126,280	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,262,000	195,178,037	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,594,000	98,608,789	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,159,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,125,000	99,189,431	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,901,000	99,782,117	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,348,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	79,175,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	288,858,000	

	第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,005,000	
	第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,432,000	
	い第832号商工債	200,000,000	199,792,000	
	い第833号商工債	100,000,000	99,868,000	
	い第843号商工債	200,000,000	199,508,000	
	い第847号商工債	100,000,000	99,595,000	
	い第850号商工債	200,000,000	198,924,000	
	い第876号商工債	300,000,000	298,749,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,746,000	
	第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,538,000	
	第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,396,000	
	第385回信金中金債（5年）	400,000,000	396,768,000	
	第16号商工債（10年）	100,000,000	100,401,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,662,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	107,844,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,402,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	195,538,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	486,300,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,164,000	
	第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,675,000	
	第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,638,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,378,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,048,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,861,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,897,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,528,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,860,000	
	第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,934,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,859,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,094,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,580,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,586,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,019,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,497,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,696,000	
	特殊債券合計	36,917,807,000	36,993,673,559	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	99,897,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	300,000,000	299,244,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,676,000	

第14回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,930,000	
第32回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,272,000	
第33回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,001,000	
第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,236,000	
第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,552,000	
第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債(2023)	100,000,000	99,595,000	
第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,186,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,202,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,261,000	
第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,877,000	
第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,550,000	
第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,208,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,864,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,435,000	
第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,093,000	
第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,912,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,619,000	
第16回キリンホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,814,000	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,632,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,760,000	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,794,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,929,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,712,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,792,000	
第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,656,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,877,000	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,245,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,380,000	

第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,721,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,039,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,378,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,614,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,387,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,789,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	95,863,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,721,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,932,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,554,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,099,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	82,402,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,764,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,888,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,468,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,510,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,887,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	200,000,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,621,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,100,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,816,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,052,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,404,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,674,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,374,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,745,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,598,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,745,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,482,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,283,000	
第14回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	99,466,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,715,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,695,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,561,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,933,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,982,000	

第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,326,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,766,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,806,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,000,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,551,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	94,966,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,818,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,198,000	
第29回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,477,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,254,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,796,000	
第25回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,492,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,682,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,869,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,298,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,823,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,538,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	109,450,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,984,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,494,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,294,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,736,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,857,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	96,581,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	110,433,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,793,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,153,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,406,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,942,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,380,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,522,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,312,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,198,000	
	100,000,000	99,514,000	

第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,712,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,919,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,732,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,439,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,674,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,282,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,648,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,369,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,015,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,419,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,558,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,716,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,216,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,446,000	
第36回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,502,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,188,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,645,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,129,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,750,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,917,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,817,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,027,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,668,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	198,416,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,572,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,380,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	85,862,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,159,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,617,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,585,000	



第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,803,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,314,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,304,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,933,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,445,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,094,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,783,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,644,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,004,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,495,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	218,840,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,248,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,163,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,464,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,205,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,387,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,186,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	72,032,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,682,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,743,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	76,289,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,287,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,265,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	84,925,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,878,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,375,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,416,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	79,985,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,836,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	60,595,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,916,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,412,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	156,404,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,564,000	

第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,284,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	175,424,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,501,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,383,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,454,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,897,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	84,053,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,801,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,688,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,464,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,199,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,685,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,261,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,520,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,074,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,748,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,341,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	196,030,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,091,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	295,632,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,857,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,602,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,864,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,321,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,613,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,026,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,727,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,069,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,380,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,416,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,494,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,880,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,080,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,066,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,387,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,354,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	196,482,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,926,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	89,570,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,163,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,899,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	91,083,000	

第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,631,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,794,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,647,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,834,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,466,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,034,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,400,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,451,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,939,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,659,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	271,629,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,253,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	96,105,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	76,934,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,046,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,170,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,652,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	198,526,000	
社債券合計	30,300,000,000	29,518,908,000	
合計		640,580,433,202	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

	2023年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2023年 8月28日現在
項目	金額（円）
預金	191,441,535
コール・ローン	845,291,479
国債証券	70,823,845,403
派生商品評価勘定	25,435,560
未収入金	54,699
未収利息	439,315,241
前払費用	56,138,226
差入委託証拠金	39,625,822
流動資産合計	72,421,147,965
資産合計	72,421,147,965
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,570,325,360
前受金	1,177,078
未払金	1,814,837
未払解約金	1,497,723
未払利息	1,958
流動負債合計	1,574,816,956
負債合計	1,574,816,956
純資産の部	
元本等	
元本	85,624,967,947
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,778,636,938
元本等合計	70,846,331,009
純資産合計	70,846,331,009
負債純資産合計	72,421,147,965

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2023年 8月28日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月28日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	85,624,967,947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 14,778,636,938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 0.8274円 (1万口当たり純資産額) (8,274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 8月28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 8月28日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ること及び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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月28日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	73,902,368,400円
期中追加設定元本額	15,875,590,000円
期中一部解約元本額	4,152,990,453円
期末元本額	85,624,967,947円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	21,359,219,267円
分散投資コア戦略ファンドS	29,219,673,666円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	1,122,528,918円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	499,124,652円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	106,420,743円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,252,672円
10資産分散投資ファンド	500,011,873円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	7,387,203,047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）	2,677,592,091円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,453,844,937円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,494,089,320円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,476,371,846円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,362,083,959円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,328,829,914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）	3,360,641,896円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,254,079,146円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

2023年 8月28日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,362,215,995
合計	2,362,215,995

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックスマザーファンド（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）

#### 債券関連

（2023年 8月28日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	696,409,497	-	697,586,575	1,177,078
	合計	696,409,497	-	697,586,575	1,177,078

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

（2023年 8月28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	70,684,472,006	-	72,230,538,884	1,546,066,878
	アメリカドル	34,179,995,122	-	35,285,920,426	1,105,925,304
	カナダドル	1,441,823,600	-	1,444,825,953	3,002,353
	メキシコペソ	728,009,822	-	757,414,912	29,405,090
	ユーロ	23,447,388,911	-	23,767,968,874	320,579,963
	イギリスポンド	3,540,165,444	-	3,588,304,769	48,139,325
	スウェーデンクローナ	138,392,730	-	136,186,781	2,205,949
	ノルウェークローネ	115,133,430	-	112,672,362	2,461,068
	デンマーククローネ	236,938,097	-	239,934,801	2,996,704
	ポーランドズロチ	360,615,769	-	361,551,312	935,543
	オーストラリアドル	1,069,285,458	-	1,056,246,516	13,038,942



	ニュージーランド ドル	156,609,918	-	154,106,704	2,503,214
	シンガポールドル	325,063,542	-	329,042,627	3,979,085
	マレーシアリン ギット	372,122,703	-	372,895,359	772,656
	イスラエルシェケ ル	211,335,522	-	211,061,672	273,850
	オフショア人民元	4,361,591,938	-	4,412,405,816	50,813,878
	合計	70,684,472,006	-	72,230,538,884	1,546,066,878

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	1,000,000.00	918,515.62	
		T 0.25% 06/30/25	1,940,000.00	1,776,615.62	
		T 0.25% 07/31/25	600,000.00	547,546.87	
		T 0.25% 08/31/25	400,000.00	363,765.62	
		T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,134,326.17	
		T 0.25% 10/31/25	1,240,000.00	1,120,940.63	
		T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,392,335.93	
		T 0.375% 04/30/25	1,550,000.00	1,431,873.04	
		T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	851,015.62	
		T 0.375% 08/15/24	500,000.00	476,448.13	
		T 0.375% 09/15/24	1,000,000.00	949,189.04	
		T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	862,896.09	
		T 0.375% 11/30/25	800,000.00	722,968.75	
		T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,533,121.09	
		T 0.5% 02/28/26	650,000.00	583,958.98	
		T 0.5% 03/31/25	1,270,000.00	1,179,512.50	
		T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,639,343.75	

T 0.5% 05/31/27	1,350,000.00	1,161,263.66	
T 0.5% 06/30/27	1,920,000.00	1,647,374.99	
T 0.5% 08/31/27	1,150,000.00	980,644.53	
T 0.5% 10/31/27	1,200,000.00	1,017,515.62	
T 0.625% 03/31/27	260,000.00	226,078.12	
T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,271,257.02	
T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	889,140.62	
T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,574,337.50	
T 0.625% 10/15/24	2,250,000.00	2,133,544.92	
T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,419,760.93	
T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,161,770.69	
T 0.75% 01/31/28	1,270,000.00	1,080,194.53	
T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	1,986,445.31	
T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	1,934,160.16	
T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,076,390.62	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,824,580.07	
T 0.75% 11/15/24	3,000,000.00	2,838,164.07	
T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	899,101.56	
T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,081,603.91	
T 1.125% 01/15/25	820,000.00	774,739.84	
T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,563,837.89	
T 1.125% 02/28/25	1,300,000.00	1,223,117.19	
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	710,625.00	
T 1.125% 02/29/28	740,000.00	639,030.47	
T 1.125% 05/15/40	870,000.00	531,005.85	
T 1.125% 08/15/40	830,000.00	502,085.16	
T 1.125% 08/31/28	1,400,000.00	1,192,789.06	
T 1.125% 10/31/26	2,290,000.00	2,052,054.68	
T 1.25% 03/31/28	1,370,000.00	1,187,618.75	
T 1.25% 04/30/28	5,040,000.00	4,359,206.27	
T 1.25% 05/15/50	1,500,000.00	771,269.53	
T 1.25% 05/31/28	560,000.00	483,350.00	
T 1.25% 06/30/28	1,950,000.00	1,679,589.82	
T 1.25% 08/15/31	750,000.00	598,974.60	
T 1.25% 08/31/24	380,000.00	364,669.40	
T 1.25% 09/30/28	40,000.00	34,221.09	
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,436,312.49	
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,165,277.34	
T 1.375% 01/31/25	300,000.00	284,003.90	
T 1.375% 08/15/50	1,550,000.00	824,739.25	
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	399,196.87	
T 1.375% 10/31/28	1,100,000.00	945,376.94	

T 1.375% 11/15/31	3,160,000.00	2,532,814.07
T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	874,559.76
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	540,890.62
T 1.5% 02/15/25	1,630,000.00	1,543,979.29
T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,486,765.43
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,713,296.86
T 1.5% 09/30/24	260,000.00	249,396.87
T 1.5% 10/31/24	260,000.00	248,594.53
T 1.5% 11/30/24	2,200,000.00	2,097,390.63
T 1.5% 11/30/28	3,160,000.00	2,729,264.85
T 1.625% 02/15/26	1,200,000.00	1,110,281.25
T 1.625% 05/15/26	2,020,000.00	1,858,873.43
T 1.625% 05/15/31	2,010,000.00	1,665,473.43
T 1.625% 08/15/29	870,000.00	746,160.93
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	301,292.57
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	236,732.03
T 1.625% 11/15/50	1,320,000.00	751,884.38
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	363,609.37
T 1.75% 01/31/29	750,000.00	653,789.06
T 1.75% 03/15/25	1,100,000.00	1,043,496.09
T 1.75% 07/31/24	260,000.00	251,429.23
T 1.75% 08/15/41	1,740,000.00	1,153,259.76
T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	904,230.47
T 1.75% 12/31/24	1,560,000.00	1,488,459.35
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	820,125.00
T 1.875% 02/15/32	2,260,000.00	1,878,536.72
T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,040,606.25
T 1.875% 02/15/51	1,320,000.00	802,260.94
T 1.875% 06/30/26	100,000.00	92,507.81
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	212,192.96
T 1.875% 08/31/24	660,000.00	637,214.71
T 1.875% 11/15/51	690,000.00	417,679.10
T 1% 07/31/28	120,000.00	101,793.75
T 1% 12/15/24	2,000,000.00	1,891,875.00
T 2.125% 05/15/25	280,000.00	266,142.18
T 2.125% 05/31/26	420,000.00	391,576.17
T 2.125% 07/31/24	160,000.00	155,275.70
T 2.125% 09/30/24	650,000.00	627,757.81
T 2.125% 11/30/24	400,000.00	384,343.75
T 2.25% 02/15/27	1,120,000.00	1,035,037.49
T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	864,652.34
T 2.25% 03/31/26	220,000.00	206,482.03
T 2.25% 05/15/41	1,270,000.00	923,280.08

T 2.25% 08/15/27	1,440,000.00	1,320,468.75	
T 2.25% 08/15/46	780,000.00	529,166.01	
T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	676,857.81	
T 2.25% 10/31/24	2,800,000.00	2,700,687.50	
T 2.25% 11/15/24	2,910,000.00	2,803,262.10	
T 2.25% 11/15/25	2,610,000.00	2,462,677.73	
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	584,200.00	
T 2.25% 12/31/24	1,860,000.00	1,786,399.22	
T 2.375% 02/15/42	1,520,000.00	1,115,567.18	
T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,195,597.26	
T 2.375% 04/30/26	310,000.00	291,430.27	
T 2.375% 05/15/27	1,740,000.00	1,608,412.50	
T 2.375% 05/15/29	1,490,000.00	1,337,624.22	
T 2.375% 05/15/51	2,050,000.00	1,404,490.23	
T 2.375% 11/15/49	1,060,000.00	730,282.02	
T 2.5% 01/31/25	330,000.00	317,431.63	
T 2.5% 02/15/45	450,000.00	325,520.50	
T 2.5% 02/15/46	800,000.00	573,062.48	
T 2.5% 02/28/26	1,500,000.00	1,417,910.16	
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	307,584.37	
T 2.625% 01/31/26	290,000.00	275,188.47	
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,049,914.06	
T 2.625% 03/31/25	330,000.00	317,019.13	
T 2.625% 04/15/25	2,600,000.00	2,496,203.11	
T 2.625% 05/31/27	1,210,000.00	1,128,372.26	
T 2.625% 12/31/25	250,000.00	237,534.18	
T 2.75% 02/15/28	2,000,000.00	1,859,687.50	
T 2.75% 02/28/25	550,000.00	530,234.37	
T 2.75% 05/31/29	2,400,000.00	2,197,265.61	
T 2.75% 06/30/25	190,000.00	182,169.92	
T 2.75% 08/15/32	1,700,000.00	1,509,082.01	
T 2.75% 08/15/42	360,000.00	279,070.31	
T 2.75% 08/15/47	790,000.00	589,722.66	
T 2.75% 08/31/25	230,000.00	219,955.46	
T 2.75% 11/15/42	990,000.00	765,664.45	
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	634,046.87	
T 2.875% 04/30/25	880,000.00	847,653.12	
T 2.875% 05/15/28	2,930,000.00	2,732,339.44	
T 2.875% 05/15/32	3,580,000.00	3,217,944.54	
T 2.875% 05/15/43	1,280,000.00	1,005,749.99	
T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	787,608.00	
T 2.875% 05/15/52	1,790,000.00	1,370,573.62	

T 2.875% 05/31/25	1,460,000.00	1,404,451.55
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	479,960.94
T 2.875% 08/15/28	1,730,000.00	1,609,170.31
T 2.875% 08/15/45	550,000.00	424,144.53
T 2.875% 11/15/46	550,000.00	421,652.34
T 2.875% 11/30/25	540,000.00	516,480.46
T 2% 02/15/25	1,480,000.00	1,412,475.00
T 2% 02/15/50	1,170,000.00	737,716.98
T 2% 08/15/25	650,000.00	613,183.59
T 2% 08/15/51	2,100,000.00	1,313,894.52
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,518,837.88
T 2% 11/15/41	1,650,000.00	1,139,531.25
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	149,125.78
T 3.125% 02/15/43	630,000.00	516,132.42
T 3.125% 05/15/48	760,000.00	608,385.93
T 3.125% 08/15/25	3,700,000.00	3,567,464.85
T 3.125% 08/15/44	770,000.00	624,602.34
T 3.125% 08/31/27	2,500,000.00	2,369,238.27
T 3.125% 08/31/29	1,920,000.00	1,790,549.99
T 3.125% 11/15/28	3,630,000.00	3,410,073.03
T 3.125% 11/15/41	330,000.00	274,589.64
T 3.25% 05/15/42	530,000.00	446,556.05
T 3.25% 06/30/27	1,300,000.00	1,239,722.65
T 3.25% 06/30/29	2,030,000.00	1,908,437.89
T 3.375% 05/15/33	1,210,000.00	1,127,001.55
T 3.375% 05/15/44	410,000.00	346,706.25
T 3.375% 08/15/42	1,000,000.00	856,367.19
T 3.375% 11/15/48	910,000.00	762,409.37
T 3.5% 01/31/30	900,000.00	855,140.62
T 3.5% 02/15/33	3,800,000.00	3,577,343.75
T 3.5% 02/15/39	100,000.00	90,812.50
T 3.625% 02/15/44	590,000.00	519,107.81
T 3.625% 02/15/53	1,990,000.00	1,768,923.43
T 3.625% 08/15/43	570,000.00	502,980.47
T 3.75% 04/15/26	590,000.00	574,593.16
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	237,666.40
T 3.75% 11/15/43	570,000.00	511,552.73
T 3.875% 01/15/26	2,670,000.00	2,608,777.72
T 3.875% 02/15/43	300,000.00	275,625.00
T 3.875% 05/15/43	250,000.00	229,531.25
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	365,510.74
T 3.875% 09/30/29	1,400,000.00	1,359,914.06
T 3.875% 11/30/29	1,500,000.00	1,456,552.74

T 3.875% 12/31/27	1,500,000.00	1,462,207.03	
T 3.875% 12/31/29	1,000,000.00	970,781.25	
T 3% 02/15/47	180,000.00	141,032.81	
T 3% 02/15/48	710,000.00	555,186.71	
T 3% 02/15/49	1,210,000.00	947,155.86	
T 3% 05/15/42	370,000.00	299,353.12	
T 3% 05/15/45	480,000.00	379,087.49	
T 3% 05/15/47	630,000.00	493,344.14	
T 3% 07/15/25	2,000,000.00	1,925,625.00	
T 3% 07/31/24	2,200,000.00	2,152,314.97	
T 3% 08/15/48	1,250,000.00	977,246.10	
T 3% 08/15/52	1,500,000.00	1,179,316.41	
T 3% 09/30/25	1,340,000.00	1,287,001.95	
T 3% 10/31/25	270,000.00	259,057.61	
T 3% 11/15/44	680,000.00	538,926.56	
T 3% 11/15/45	320,000.00	251,924.99	
T 4.125% 10/31/27	2,600,000.00	2,558,359.38	
T 4.125% 11/15/32	2,500,000.00	2,471,875.00	
T 4.25% 05/15/39	150,000.00	148,634.76	
T 4.25% 10/15/25	3,300,000.00	3,250,628.89	
T 4.25% 11/15/40	200,000.00	196,589.84	
T 4.375% 02/15/38	210,000.00	212,510.15	
T 4.375% 05/15/40	300,000.00	299,917.96	
T 4.375% 05/15/41	800,000.00	795,593.75	
T 4.375% 11/15/39	350,000.00	350,683.59	
T 4.5% 02/15/36	110,000.00	113,643.75	
T 4.5% 05/15/38	110,000.00	112,569.53	
T 4.5% 07/15/26	860,000.00	854,221.87	
T 4.5% 08/15/39	350,000.00	356,330.07	
T 4.625% 02/15/40	160,000.00	165,075.00	
T 4.75% 02/15/41	150,000.00	156,495.11	
T 4% 02/28/30	1,950,000.00	1,907,039.05	
T 4% 11/15/42	830,000.00	777,606.25	
T 4% 11/15/52	1,650,000.00	1,571,044.92	
T 5.0% 05/15/37	250,000.00	270,273.43	
T 5.25% 11/15/28	150,000.00	155,419.92	
T 5.375% 02/15/31	60,000.00	64,068.75	
T 6.0% 02/15/26	420,000.00	430,582.03	
T 6.25% 05/15/30	990,000.00	1,096,927.72	
アメリカドル 小計	267,850,000.00	235,086,236.39	(34,451,887,942)
カナダドル CAN 0.25% 03/01/26	600,000.00	539,538.08	

CAN 0.5% 09/01/25	860,000.00	790,774.83	
CAN 0.5% 12/01/30	740,000.00	586,557.01	
CAN 0.75% 10/01/24	470,000.00	448,800.67	
CAN 1.25% 03/01/25	50,000.00	47,366.95	
CAN 1.25% 03/01/27	30,000.00	27,065.97	
CAN 1.25% 06/01/30	1,010,000.00	856,825.46	
CAN 1.5% 04/01/25	570,000.00	540,135.95	
CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	157,336.32	
CAN 1.5% 06/01/31	840,000.00	712,369.86	
CAN 1.5% 09/01/24	490,000.00	472,744.49	
CAN 1.5% 12/01/31	830,000.00	698,206.40	
CAN 1.75% 12/01/53	760,000.00	513,236.74	
CAN 1% 06/01/27	340,000.00	303,528.18	
CAN 1% 09/01/26	530,000.00	480,005.72	
CAN 2.25% 06/01/25	160,000.00	153,224.75	
CAN 2.25% 06/01/29	270,000.00	248,081.78	
CAN 2.5% 12/01/32	370,000.00	334,861.89	
CAN 2.75% 06/01/33	280,000.00	258,406.96	
CAN 2.75% 08/01/24	390,000.00	381,498.17	
CAN 2.75% 09/01/27	350,000.00	331,697.07	
CAN 2.75% 12/01/48	250,000.00	217,003.73	
CAN 2.75% 12/01/55	120,000.00	102,342.26	
CAN 2.75% 12/01/64	180,000.00	150,279.18	
CAN 2% 06/01/28	290,000.00	265,611.79	
CAN 2% 06/01/32	490,000.00	426,675.75	
CAN 2% 12/01/51	860,000.00	626,869.31	
CAN 3.25% 09/01/28	30,000.00	28,933.86	
CAN 3.5% 03/01/28	190,000.00	185,310.07	
CAN 3.5% 12/01/45	220,000.00	216,814.40	
CAN 3% 04/01/26	490,000.00	471,794.28	
CAN 3% 11/01/24	650,000.00	634,354.55	
CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	198,794.01	
CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	241,135.34	
CAN 5.75% 06/01/33	260,000.00	302,659.29	
CAN 5% 06/01/37	180,000.00	204,907.08	
カナダドル 小計	14,730,000.00	13,155,748.15 (1,417,794,978)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,584,390.00
	MBONO 10% 12/05/24	6,060,000.00	5,997,361.41
	MBONO 5.5% 03/04/27	8,220,000.00	7,197,432.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	10,230,000.00	9,270,995.91
	MBONO 5% 03/06/25	2,390,000.00	2,212,673.95
	MBONO 7.5% 05/26/33	2,930,000.00	2,606,484.05

	MBONO 7.5% 06/03/27	7,760,000.00	7,253,504.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,450,000.00	9,576,380.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	5,800,000.00	4,991,973.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,720,000.00	5,139,591.60
	MBONO 8.5% 05/31/29	5,180,000.00	4,998,751.80
	MBONO 8.5% 11/18/38	5,880,000.00	5,494,036.80
	MBONO 8% 07/31/53	2,810,000.00	2,443,646.25
	MBONO 8% 09/05/24	8,790,000.00	8,526,616.35
	MBONO 8% 11/07/47	6,310,000.00	5,527,623.10
	メキシコペソ 小計	90,030,000.00	82,821,461.02 (726,170,288)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	350,000.00	288,547.00
	BGB 0.35% 06/22/32	560,000.00	441,386.96
	BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	121,954.00
	BGB 0.5% 10/22/24	270,000.00	261,493.65
	BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	57,880.05
	BGB 0.8% 06/22/25	510,000.00	488,682.00
	BGB 0.8% 06/22/27	410,000.00	378,353.74
	BGB 0.8% 06/22/28	390,000.00	353,425.02
	BGB 0.9% 06/22/29	390,000.00	348,318.75
	BGB 0% 10/22/27	280,000.00	248,129.84
	BGB 0% 10/22/31	160,000.00	124,975.63
	BGB 1.25% 04/22/33	80,000.00	67,865.68
	BGB 1.4% 06/22/53	210,000.00	127,608.49
	BGB 1.45% 06/22/37	220,000.00	173,184.00
	BGB 1.6% 06/22/47	260,000.00	179,552.62
	BGB 1.7% 06/22/50	280,000.00	190,922.61
	BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	172,557.21
	BGB 1% 06/22/26	330,000.00	312,237.15
	BGB 1% 06/22/31	450,000.00	386,721.45
	BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	127,799.28
	BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	119,847.52
	BGB 2.75% 04/22/39	120,000.00	109,699.56
	BGB 3.3% 06/22/54	220,000.00	206,390.80
	BGB 3.45% 06/22/43	100,000.00	98,310.00
	BGB 3.75% 06/22/45	240,000.00	248,005.41
	BGB 3% 06/22/33	340,000.00	334,310.02
	BGB 3% 06/22/34	210,000.00	205,025.10
	BGB 4.25% 03/28/41	370,000.00	406,970.40
	BGB 4.5% 03/28/26	350,000.00	362,001.85
	BGB 4% 03/28/32	270,000.00	288,177.48
	BGB 5.5% 03/28/28	440,000.00	487,933.60



BGB 5% 03/28/35	400,000.00	464,273.20
BKO 0.4% 09/13/24	700,000.00	679,219.51
BKO 2.5% 03/13/25	470,000.00	465,329.14
BKO 2.8% 06/12/25	390,000.00	387,954.06
BTPS 0.25% 03/15/28	330,000.00	282,981.27
BTPS 0.35% 02/01/25	270,000.00	257,756.81
BTPS 0.45% 02/15/29	660,000.00	552,800.16
BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	510,549.60
BTPS 0.5% 07/15/28	510,000.00	437,555.52
BTPS 0.6% 08/01/31	620,000.00	479,464.60
BTPS 0.85% 01/15/27	490,000.00	447,281.80
BTPS 0.9% 04/01/31	350,000.00	280,722.05
BTPS 0.95% 03/01/37	340,000.00	224,043.00
BTPS 0.95% 06/01/32	450,000.00	348,939.45
BTPS 0.95% 08/01/30	810,000.00	666,439.65
BTPS 0.95% 09/15/27	310,000.00	278,926.84
BTPS 0.95% 12/01/31	590,000.00	465,191.99
BTPS 0% 04/01/26	600,000.00	546,683.40
BTPS 0% 08/01/26	510,000.00	459,191.25
BTPS 0% 08/15/24	560,000.00	540,847.44
BTPS 1.1% 04/01/27	430,000.00	393,804.75
BTPS 1.2% 08/15/25	340,000.00	324,357.96
BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	445,437.12
BTPS 1.35% 04/01/30	730,000.00	624,442.00
BTPS 1.45% 03/01/36	290,000.00	210,489.25
BTPS 1.45% 05/15/25	350,000.00	337,567.65
BTPS 1.45% 11/15/24	1,000,000.00	973,823.00
BTPS 1.5% 04/30/45	370,000.00	220,830.06
BTPS 1.5% 06/01/25	690,000.00	664,952.31
BTPS 1.6% 06/01/26	260,000.00	246,360.92
BTPS 1.65% 03/01/32	510,000.00	424,731.06
BTPS 1.65% 12/01/30	730,000.00	625,536.27
BTPS 1.7% 09/01/51	330,000.00	189,222.99
BTPS 1.8% 03/01/41	250,000.00	170,278.50
BTPS 1.85% 07/01/25	340,000.00	329,256.00
BTPS 2.05% 08/01/27	470,000.00	443,030.46
BTPS 2.1% 07/15/26	580,000.00	556,207.24
BTPS 2.15% 03/01/72	120,000.00	67,610.76
BTPS 2.15% 09/01/52	210,000.00	131,641.23
BTPS 2.2% 06/01/27	350,000.00	332,698.80
BTPS 2.25% 09/01/36	440,000.00	349,866.00
BTPS 2.45% 09/01/33	780,000.00	673,298.34
BTPS 2.45% 09/01/50	400,000.00	274,396.80

BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	273,644.28	
BTPS 2.5% 12/01/24	710,000.00	700,271.58	
BTPS 2.5% 12/01/32	690,000.00	607,140.66	
BTPS 2.65% 12/01/27	740,000.00	710,391.12	
BTPS 2.7% 03/01/47	310,000.00	231,537.45	
BTPS 2.8% 03/01/67	220,000.00	150,003.36	
BTPS 2.8% 06/15/29	670,000.00	635,247.10	
BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	420,836.24	
BTPS 2.95% 09/01/38	320,000.00	269,232.00	
BTPS 2% 02/01/28	580,000.00	540,763.00	
BTPS 2% 12/01/25	380,000.00	366,907.10	
BTPS 3.1% 03/01/40	280,000.00	235,752.72	
BTPS 3.25% 03/01/38	200,000.00	174,760.60	
BTPS 3.25% 09/01/46	510,000.00	420,292.02	
BTPS 3.35% 03/01/35	410,000.00	374,990.10	
BTPS 3.4% 04/01/28	400,000.00	394,802.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	420,000.00	355,535.88	
BTPS 3.5% 01/15/26	380,000.00	378,984.50	
BTPS 3.5% 03/01/30	770,000.00	755,918.24	
BTPS 3.7% 06/15/30	230,000.00	227,106.60	
BTPS 3.75% 09/01/24	200,000.00	200,078.00	
BTPS 3.8% 04/15/26	550,000.00	552,087.25	
BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	314,333.25	
BTPS 3.85% 09/15/26	250,000.00	251,304.25	
BTPS 3.85% 12/15/29	320,000.00	319,744.00	
BTPS 3% 08/01/29	620,000.00	594,145.38	
BTPS 4.4% 05/01/33	140,000.00	143,041.36	
BTPS 4.45% 09/01/43	170,000.00	167,745.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	610,000.00	622,761.20	
BTPS 4.5% 10/01/53	130,000.00	127,265.97	
BTPS 4.75% 09/01/28	390,000.00	408,381.09	
BTPS 4.75% 09/01/44	410,000.00	421,084.76	
BTPS 4% 02/01/37	730,000.00	705,065.39	
BTPS 4% 10/30/31	150,000.00	150,259.05	
BTPS 5.0% 08/01/39	590,000.00	625,821.85	
BTPS 5.25% 11/01/29	510,000.00	551,493.09	
BTPS 5.75% 02/01/33	590,000.00	665,378.40	
BTPS 5% 03/01/25	580,000.00	591,174.28	
BTPS 5% 08/01/34	780,000.00	830,394.24	
BTPS 5% 09/01/40	680,000.00	722,015.84	
BTPS 6.5% 11/01/27	500,000.00	555,207.15	
BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	546,988.80	

DBR 0.25% 02/15/27	540,000.00	497,130.48
DBR 0.25% 02/15/29	470,000.00	416,182.18
DBR 0.25% 08/15/28	690,000.00	617,011.80
DBR 0.5% 02/15/25	60,000.00	57,749.28
DBR 0.5% 02/15/26	680,000.00	641,995.02
DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	639,520.70
DBR 0.5% 08/15/27	90,000.00	82,915.11
DBR 0% 02/15/30	650,000.00	554,153.60
DBR 0% 02/15/31	780,000.00	649,615.98
DBR 0% 02/15/32	850,000.00	690,353.85
DBR 0% 05/15/35	550,000.00	406,535.80
DBR 0% 05/15/36	510,000.00	365,886.24
DBR 0% 08/15/26	590,000.00	544,389.46
DBR 0% 08/15/29	380,000.00	327,727.20
DBR 0% 08/15/30	550,000.00	463,558.70
DBR 0% 08/15/31	780,000.00	641,768.40
DBR 0% 08/15/50	1,110,000.00	556,849.26
DBR 0% 08/15/52	560,000.00	266,952.56
DBR 0% 11/15/27	600,000.00	538,468.80
DBR 0% 11/15/28	560,000.00	491,307.60
DBR 1.25% 08/15/48	840,000.00	631,913.52
DBR 1.7% 08/15/32	750,000.00	702,155.25
DBR 1.8% 08/15/53	570,000.00	470,263.68
DBR 1% 05/15/38	480,000.00	382,212.96
DBR 1% 08/15/24	700,000.00	684,959.80
DBR 1% 08/15/25	390,000.00	375,074.70
DBR 2.1% 11/15/29	540,000.00	526,275.90
DBR 2.3% 02/15/33	900,000.00	882,585.00
DBR 2.5% 07/04/44	710,000.00	690,041.90
DBR 2.5% 08/15/46	740,000.00	721,144.80
DBR 3.25% 07/04/42	450,000.00	485,681.40
DBR 4.0% 01/04/37	660,000.00	757,631.61
DBR 4.25% 07/04/39	440,000.00	526,849.40
DBR 4.75% 07/04/28	570,000.00	626,525.58
DBR 4.75% 07/04/34	580,000.00	697,593.84
DBR 4.75% 07/04/40	460,000.00	586,408.46
DBR 5.5% 01/04/31	780,000.00	935,095.20
DBR 5.625% 01/04/28	600,000.00	674,298.60
DBR 6.25% 01/04/30	490,000.00	596,575.49
DBR 6.5% 07/04/27	440,000.00	500,565.56
FRTR 0.25% 11/25/26	590,000.00	540,576.29
FRTR 0.5% 05/25/25	1,380,000.00	1,317,669.54
FRTR 0.5% 05/25/26	830,000.00	775,268.14

FRTR 0.5% 05/25/29	1,000,000.00	873,762.00	
FRTR 0.5% 05/25/40	620,000.00	393,210.38	
FRTR 0.5% 05/25/72	310,000.00	110,728.90	
FRTR 0.5% 06/25/44	470,000.00	269,844.12	
FRTR 0.75% 02/25/28	1,090,000.00	990,819.81	
FRTR 0.75% 05/25/28	1,500,000.00	1,356,727.50	
FRTR 0.75% 05/25/52	800,000.00	412,154.40	
FRTR 0.75% 05/25/53	730,000.00	366,676.81	
FRTR 0.75% 11/25/28	1,250,000.00	1,119,811.25	
FRTR 0% 02/25/25	1,050,000.00	1,000,640.36	
FRTR 0% 02/25/26	1,180,000.00	1,094,288.34	
FRTR 0% 02/25/27	1,250,000.00	1,128,082.50	
FRTR 0% 03/25/25	880,000.00	836,968.00	
FRTR 0% 05/25/32	770,000.00	594,166.65	
FRTR 0% 11/25/29	1,260,000.00	1,052,779.76	
FRTR 0% 11/25/30	1,240,000.00	1,004,662.25	
FRTR 0% 11/25/31	1,280,000.00	1,004,492.80	
FRTR 1.25% 05/25/34	1,140,000.00	943,855.02	
FRTR 1.25% 05/25/36	1,000,000.00	791,687.00	
FRTR 1.25% 05/25/38	300,000.00	227,093.83	
FRTR 1.5% 05/25/31	1,340,000.00	1,208,386.54	
FRTR 1.5% 05/25/50	810,000.00	536,880.96	
FRTR 1.75% 05/25/66	390,000.00	248,901.12	
FRTR 1.75% 06/25/39	590,000.00	477,828.02	
FRTR 1.75% 11/25/24	780,000.00	764,859.22	
FRTR 1% 05/25/27	1,200,000.00	1,117,365.60	
FRTR 1% 11/25/25	550,000.00	525,071.80	
FRTR 2.5% 05/25/30	1,300,000.00	1,267,289.68	
FRTR 2.5% 05/25/43	280,000.00	242,067.00	
FRTR 2.5% 09/24/26	370,000.00	364,030.42	
FRTR 2.75% 02/25/29	570,000.00	564,226.47	
FRTR 2.75% 10/25/27	1,110,000.00	1,101,506.28	
FRTR 2% 05/25/48	700,000.00	531,794.83	
FRTR 2% 11/25/32	1,000,000.00	916,736.75	
FRTR 3.25% 05/25/45	640,000.00	620,321.76	
FRTR 3.5% 04/25/26	2,050,000.00	2,072,222.00	
FRTR 3% 05/25/33	240,000.00	238,241.52	
FRTR 3% 05/25/54	250,000.00	225,667.21	
FRTR 4.5% 04/25/41	860,000.00	984,740.42	
FRTR 4.75% 04/25/35	570,000.00	653,943.90	
FRTR 4% 04/25/55	480,000.00	524,203.20	
FRTR 4% 04/25/60	410,000.00	451,378.14	

FRTR 4% 10/25/38	770,000.00	829,986.85
FRTR 5.5% 04/25/29	1,040,000.00	1,176,174.06
FRTR 5.75% 10/25/32	1,090,000.00	1,323,156.45
IRISH 0.2% 05/15/27	90,000.00	81,330.48
IRISH 0.2% 10/18/30	280,000.00	231,071.12
IRISH 0.35% 10/18/32	90,000.00	71,524.68
IRISH 0.4% 05/15/35	130,000.00	95,988.10
IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	63,057.10
IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	155,376.12
IRISH 0% 10/18/31	190,000.00	150,489.50
IRISH 1.1% 05/15/29	230,000.00	208,411.51
IRISH 1.3% 05/15/33	130,000.00	111,612.49
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	215,191.20
IRISH 1.5% 05/15/50	190,000.00	127,829.34
IRISH 1.7% 05/15/37	180,000.00	148,604.94
IRISH 1% 05/15/26	270,000.00	256,512.69
IRISH 2.4% 05/15/30	190,000.00	184,457.32
IRISH 2% 02/18/45	260,000.00	204,948.12
IRISH 3% 10/18/43	50,000.00	47,778.10
IRISH 5.4% 03/13/25	270,000.00	279,071.91
NETHER 0.25% 07/15/25	410,000.00	389,109.76
NETHER 0.25% 07/15/29	220,000.00	189,918.52
NETHER 0.5% 01/15/40	370,000.00	252,562.14
NETHER 0.5% 07/15/26	390,000.00	364,256.88
NETHER 0.5% 07/15/32	280,000.00	229,382.94
NETHER 0.75% 07/15/27	350,000.00	323,460.90
NETHER 0.75% 07/15/28	370,000.00	335,556.33
NETHER 0% 01/15/26	350,000.00	326,223.65
NETHER 0% 01/15/27	420,000.00	381,596.04
NETHER 0% 01/15/29	370,000.00	318,553.72
NETHER 0% 01/15/38	250,000.00	163,286.00
NETHER 0% 01/15/52	390,000.00	176,751.90
NETHER 0% 07/15/30	300,000.00	248,151.30
NETHER 0% 07/15/31	400,000.00	321,977.85
NETHER 2.5% 01/15/30	180,000.00	176,452.20
NETHER 2.5% 01/15/33	390,000.00	379,371.55
NETHER 2.5% 07/15/33	140,000.00	135,950.08
NETHER 2.75% 01/15/47	480,000.00	466,548.24
NETHER 2% 01/15/54	200,000.00	163,866.00
NETHER 3.75% 01/15/42	430,000.00	475,928.16
NETHER 4% 01/15/37	410,000.00	455,742.06
NETHER 5.5% 01/15/28	350,000.00	387,350.95
OBL 0% 04/10/26	760,000.00	706,127.40

OBL 0% 04/11/25	760,000.00	723,165.08
OBL 0% 04/16/27	160,000.00	145,395.20
OBL 0% 10/09/26	1,170,000.00	1,074,653.19
OBL 0% 10/10/25	1,060,000.00	995,943.14
OBL 0% 10/18/24	520,000.00	501,097.90
OBL 1.3% 10/15/27	1,240,000.00	1,176,555.40
OBL 2.2% 04/13/28	200,000.00	196,563.60
OBL 2.4% 10/19/28	600,000.00	594,571.20
RAGB 0.25% 10/20/36	40,000.00	27,232.60
RAGB 0.5% 02/20/29	540,000.00	472,598.82
RAGB 0.5% 04/20/27	330,000.00	301,921.95
RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	29,318.74
RAGB 0.75% 02/20/28	270,000.00	245,003.94
RAGB 0.75% 03/20/51	200,000.00	110,233.20
RAGB 0.75% 10/20/26	280,000.00	261,611.28
RAGB 0.85% 06/30/20	110,000.00	43,056.97
RAGB 0.9% 02/20/32	330,000.00	276,241.35
RAGB 0% 02/20/30	310,000.00	255,172.78
RAGB 0% 02/20/31	400,000.00	318,920.00
RAGB 0% 04/20/25	230,000.00	218,336.24
RAGB 0% 10/20/40	120,000.00	68,716.20
RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	336,497.00
RAGB 1.5% 02/20/47	230,000.00	163,075.29
RAGB 1.5% 11/02/86	40,000.00	22,359.95
RAGB 1.65% 10/21/24	230,000.00	225,384.82
RAGB 1.85% 05/23/49	100,000.00	75,463.40
RAGB 2.1% 09/20/17	170,000.00	117,728.57
RAGB 2.4% 05/23/34	180,000.00	167,525.64
RAGB 2.9% 02/20/33	190,000.00	185,972.67
RAGB 2% 07/15/26	110,000.00	106,888.65
RAGB 3.15% 06/20/44	200,000.00	195,603.00
RAGB 3.15% 10/20/53	60,000.00	58,216.80
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	99,657.09
RAGB 4.15% 03/15/37	440,000.00	479,390.12
RAGB 4.85% 03/15/26	200,000.00	208,542.40
RAGB 6.25% 07/15/27	240,000.00	268,188.72
RFGB 0.125% 04/15/36	110,000.00	74,674.10
RFGB 0.125% 04/15/52	110,000.00	48,245.34
RFGB 0.125% 09/15/31	180,000.00	142,931.61
RFGB 0.25% 09/15/40	90,000.00	54,422.46
RFGB 0.5% 04/15/26	170,000.00	159,468.16
RFGB 0.5% 04/15/43	150,000.00	89,958.74

RFGB 0.5% 09/15/27	130,000.00	117,977.47
RFGB 0.5% 09/15/28	170,000.00	150,583.62
RFGB 0.5% 09/15/29	110,000.00	95,035.05
RFGB 0.75% 04/15/31	130,000.00	110,135.35
RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	66,923.57
RFGB 0% 09/15/24	80,000.00	77,213.52
RFGB 0% 09/15/26	110,000.00	100,475.57
RFGB 0% 09/15/30	130,000.00	105,372.93
RFGB 1.125% 04/15/34	220,000.00	180,079.02
RFGB 1.375% 04/15/27	90,000.00	85,124.88
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	69,995.94
RFGB 1.5% 09/15/32	60,000.00	52,617.36
RFGB 2.625% 07/04/42	140,000.00	127,509.83
RFGB 2.75% 04/15/38	40,000.00	37,425.86
RFGB 2.75% 07/04/28	150,000.00	148,639.65
RFGB 4% 07/04/25	180,000.00	182,477.70
SPGB 0.1% 04/30/31	490,000.00	382,819.41
SPGB 0.5% 04/30/30	550,000.00	458,433.25
SPGB 0.5% 10/31/31	600,000.00	476,774.40
SPGB 0.6% 10/31/29	460,000.00	391,744.28
SPGB 0.7% 04/30/32	600,000.00	478,224.00
SPGB 0.8% 07/30/27	780,000.00	710,871.72
SPGB 0.8% 07/30/29	510,000.00	442,033.83
SPGB 0.85% 07/30/37	310,000.00	211,809.36
SPGB 0% 01/31/25	530,000.00	504,932.84
SPGB 0% 01/31/26	540,000.00	498,920.53
SPGB 0% 01/31/27	840,000.00	752,296.44
SPGB 0% 01/31/28	810,000.00	703,161.00
SPGB 0% 05/31/25	510,000.00	480,924.79
SPGB 1.2% 10/31/40	430,000.00	284,278.37
SPGB 1.25% 10/31/30	730,000.00	633,191.37
SPGB 1.3% 10/31/26	330,000.00	310,794.33
SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	460,658.50
SPGB 1.4% 07/30/28	420,000.00	385,222.32
SPGB 1.45% 04/30/29	620,000.00	562,179.42
SPGB 1.45% 10/31/27	550,000.00	511,996.10
SPGB 1.45% 10/31/71	170,000.00	77,580.18
SPGB 1.5% 04/30/27	460,000.00	432,592.28
SPGB 1.6% 04/30/25	600,000.00	582,789.00
SPGB 1.85% 07/30/35	580,000.00	479,213.40
SPGB 1.9% 10/31/52	360,000.00	227,638.44
SPGB 1.95% 04/30/26	590,000.00	570,027.91
SPGB 1.95% 07/30/30	610,000.00	558,298.36

	SPGB 1% 07/30/42	250,000.00	152,454.00	
	SPGB 1% 10/31/50	450,000.00	228,877.65	
	SPGB 2.15% 10/31/25	500,000.00	488,396.50	
	SPGB 2.35% 07/30/33	420,000.00	379,181.88	
	SPGB 2.55% 10/31/32	530,000.00	491,606.27	
	SPGB 2.7% 10/31/48	480,000.00	380,019.09	
	SPGB 2.75% 10/31/24	530,000.00	525,317.18	
	SPGB 2.8% 05/31/26	320,000.00	315,507.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	460,000.00	383,764.20	
	SPGB 3.15% 04/30/33	540,000.00	523,212.48	
	SPGB 3.45% 07/30/43	220,000.00	202,524.74	
	SPGB 3.45% 07/30/66	340,000.00	294,457.00	
	SPGB 3.55% 10/31/33	320,000.00	319,070.92	
	SPGB 3.9% 07/30/39	180,000.00	179,282.60	
	SPGB 4.2% 01/31/37	480,000.00	501,304.75	
	SPGB 4.65% 07/30/25	510,000.00	522,120.15	
	SPGB 4.7% 07/30/41	490,000.00	537,456.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	490,000.00	547,391.74	
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,010,000.00	1,099,193.10	
	SPGB 5.15% 10/31/44	360,000.00	418,718.88	
	SPGB 5.75% 07/30/32	440,000.00	517,142.56	
	SPGB 5.9% 07/30/26	520,000.00	556,914.84	
	ユーロ 小計	162,920,000.00	148,029,804.03 (23,428,677,083)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	230,000.00	205,911.91	
	UKT 0.125% 01/31/28	400,000.00	329,095.20	
	UKT 0.25% 01/31/25	590,000.00	551,738.50	
	UKT 0.25% 07/31/31	550,000.00	398,860.00	
	UKT 0.375% 10/22/26	640,000.00	558,048.00	
	UKT 0.375% 10/22/30	490,000.00	370,252.03	
	UKT 0.5% 01/31/29	400,000.00	322,324.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	450,000.00	131,758.38	
	UKT 0.625% 06/07/25	180,000.00	166,811.54	
	UKT 0.625% 07/31/35	540,000.00	347,652.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	300,000.00	116,508.48	
	UKT 0.875% 01/31/46	340,000.00	162,338.65	
	UKT 0.875% 07/31/33	550,000.00	393,664.70	
	UKT 0.875% 10/22/29	420,000.00	340,383.28	
	UKT 1.125% 01/31/39	400,000.00	246,240.26	
	UKT 1.125% 10/22/73	240,000.00	86,509.77	
	UKT 1.25% 07/22/27	170,000.00	149,637.74	
	UKT 1.25% 07/31/51	580,000.00	275,975.13	



	UKT 1.25% 10/22/41	530,000.00	311,179.96
	UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	365,252.00
	UKT 1.5% 07/22/47	440,000.00	240,814.20
	UKT 1.5% 07/31/53	320,000.00	159,936.00
	UKT 1.625% 10/22/28	240,000.00	208,425.50
	UKT 1.625% 10/22/54	300,000.00	154,085.19
	UKT 1.625% 10/22/71	290,000.00	134,026.04
	UKT 1.75% 01/22/49	240,000.00	137,194.80
	UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	230,806.75
	UKT 1.75% 09/07/37	430,000.00	303,790.70
	UKT 1% 01/31/32	880,000.00	670,416.73
	UKT 2.5% 07/22/65	350,000.00	221,690.00
	UKT 2.75% 09/07/24	390,000.00	380,588.98
	UKT 2% 09/07/25	610,000.00	574,186.90
	UKT 3.25% 01/22/44	500,000.00	405,850.40
	UKT 3.25% 01/31/33	650,000.00	590,623.80
	UKT 3.5% 01/22/45	480,000.00	402,362.88
	UKT 3.5% 07/22/68	380,000.00	311,444.04
	UKT 3.5% 10/22/25	320,000.00	308,539.52
	UKT 3.75% 01/29/38	260,000.00	235,242.80
	UKT 3.75% 07/22/52	330,000.00	283,708.39
	UKT 3.75% 10/22/53	420,000.00	359,142.00
	UKT 4.125% 01/29/27	830,000.00	808,737.39
	UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	379,158.00
	UKT 4.25% 06/07/32	490,000.00	486,153.50
	UKT 4.25% 09/07/39	340,000.00	324,327.63
	UKT 4.25% 12/07/27	540,000.00	530,955.00
	UKT 4.25% 12/07/40	350,000.00	332,621.51
	UKT 4.25% 12/07/46	410,000.00	384,001.90
	UKT 4.25% 12/07/49	320,000.00	299,811.20
	UKT 4.25% 12/07/55	420,000.00	396,321.40
	UKT 4.5% 09/07/34	350,000.00	350,307.58
	UKT 4.5% 12/07/42	440,000.00	430,007.60
	UKT 4.75% 12/07/30	400,000.00	408,846.07
	UKT 4.75% 12/07/38	420,000.00	425,266.63
	UKT 4% 01/22/60	320,000.00	290,267.20
	UKT 4% 10/22/63	120,000.00	108,743.81
	UKT 5% 03/07/25	370,000.00	369,377.06
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	479,256.75
	イギリスポンド 小計	23,630,000.00	18,947,177.38 (3,496,512,113)
スウェーデン ンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,560,000.00	1,271,423.40
	SGB 0.75% 05/12/28	1,300,000.00	1,177,374.45

	SGB 0.75% 11/12/29	1,740,000.00	1,536,094.93	
	SGB 1.75% 11/11/33	600,000.00	545,413.36	
	SGB 1% 11/12/26	1,890,000.00	1,767,093.12	
	SGB 2.25% 06/01/32	880,000.00	842,870.36	
	SGB 2.5% 05/12/25	1,850,000.00	1,820,105.97	
	SGB 3.5% 03/30/39	1,010,000.00	1,083,235.10	
スウェーデンクローナ 小計		10,830,000.00	10,043,610.69	(133,379,149)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	880,000.00	721,340.40	
	NGB 1.375% 08/19/30	1,230,000.00	1,042,738.28	
	NGB 1.5% 02/19/26	980,000.00	918,381.52	
	NGB 1.75% 02/17/27	820,000.00	758,340.10	
	NGB 1.75% 03/13/25	1,470,000.00	1,414,850.44	
	NGB 1.75% 09/06/29	1,240,000.00	1,097,722.40	
	NGB 2.125% 05/18/32	910,000.00	792,844.78	
	NGB 2% 04/26/28	850,000.00	779,122.24	
	NGB 3% 08/15/33	620,000.00	576,910.00	
ノルウェークローネ 小計		9,000,000.00	8,102,250.16	(111,162,872)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,340,000.00	667,160.88	
	DGB 0.5% 11/15/27	1,630,000.00	1,484,034.96	
	DGB 0.5% 11/15/29	1,470,000.00	1,284,503.05	
	DGB 0% 11/15/24	820,000.00	788,784.74	
	DGB 0% 11/15/31	1,920,000.00	1,538,123.13	
	DGB 1.75% 11/15/25	1,880,000.00	1,826,997.90	
	DGB 2.25% 11/15/33	620,000.00	590,529.66	
	DGB 4.5% 11/15/39	2,430,000.00	2,934,203.13	
デンマーククローネ 小計		12,110,000.00	11,114,337.45	(236,068,527)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	740,000.00	633,189.88	
	POLGB 0.75% 04/25/25	480,000.00	445,824.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	850,000.00	640,751.25	
	POLGB 1.75% 04/25/32	810,000.00	598,306.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	820,000.00	790,606.28	
	POLGB 2.5% 07/25/26	1,240,000.00	1,147,297.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,780,000.00	1,603,335.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,010,000.00	901,607.81	
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,610,000.00	1,387,989.05	
	POLGB 3.25% 07/25/25	960,000.00	924,344.06	
	POLGB 3.75% 05/25/27	480,000.00	454,153.92	
	POLGB 6% 10/25/33	170,000.00	175,142.50	
	POLGB 7.5% 07/25/28	320,000.00	347,263.96	

ポーランドズロチ 小計		11,270,000.00	10,049,811.81 (356,000,513)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	650,000.00	620,752.30
	ACGB 0.25% 11/21/25	410,000.00	378,512.28
	ACGB 0.5% 09/21/26	580,000.00	524,346.39
	ACGB 1.25% 05/21/32	630,000.00	498,299.78
	ACGB 1.5% 06/21/31	660,000.00	546,993.32
	ACGB 1.75% 06/21/51	450,000.00	253,397.01
	ACGB 1.75% 11/21/32	910,000.00	744,259.63
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	580,908.02
	ACGB 1% 12/21/30	280,000.00	226,401.60
	ACGB 2.25% 05/21/28	420,000.00	390,598.90
	ACGB 2.5% 05/21/30	530,000.00	483,268.86
	ACGB 2.75% 05/21/41	290,000.00	229,210.54
	ACGB 2.75% 06/21/35	240,000.00	207,342.84
	ACGB 2.75% 11/21/27	370,000.00	354,022.76
	ACGB 2.75% 11/21/28	230,000.00	217,517.28
	ACGB 2.75% 11/21/29	440,000.00	410,590.92
	ACGB 3.25% 04/21/25	530,000.00	524,176.29
	ACGB 3.25% 04/21/29	560,000.00	540,721.79
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	199,798.67
	ACGB 3.5% 12/21/34	400,000.00	375,095.53
	ACGB 3.75% 04/21/37	340,000.00	320,277.11
	ACGB 3.75% 05/21/34	370,000.00	356,573.19
	ACGB 3% 03/21/47	320,000.00	249,896.98
	ACGB 3% 11/21/33	480,000.00	434,003.05
ACGB 4.25% 04/21/26	470,000.00	474,592.84	
ACGB 4.5% 04/21/33	420,000.00	431,865.29	
ACGB 4.75% 04/21/27	500,000.00	515,049.55	
オーストラリアドル 小計		12,450,000.00	11,088,472.72 (1,043,536,167)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	70,000.00	56,187.28
	NZGB 0.5% 05/15/26	110,000.00	97,071.43
	NZGB 1.5% 05/15/31	450,000.00	350,036.13
	NZGB 1.75% 05/15/41	100,000.00	60,313.46
	NZGB 2.75% 04/15/25	210,000.00	200,956.54
	NZGB 2.75% 04/15/37	130,000.00	99,682.57
	NZGB 2.75% 05/15/51	120,000.00	77,086.92
	NZGB 2% 05/15/32	120,000.00	94,656.77
	NZGB 3.5% 04/14/33	110,000.00	97,355.27
	NZGB 3% 04/20/29	190,000.00	171,576.19
	NZGB 4.25% 05/15/34	120,000.00	112,077.14
	NZGB 4.5% 04/15/27	190,000.00	186,272.00

	NZGB 4.5% 05/15/30	120,000.00	116,572.96	
ニュージーランドドル 小計		2,040,000.00	1,719,844.66	(149,076,135)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	160,000.00	149,840.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	70,000.00	65,443.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	160,000.00	141,840.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	280,000.00	220,080.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	140,000.00	134,988.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	180,000.00	160,830.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	220,000.00	215,310.70	
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	62,784.75	
	SIGB 2.625% 05/01/28	140,000.00	136,430.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	260,000.00	246,870.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	120,000.00	113,280.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	140,000.00	132,163.50	
	SIGB 2.875% 07/01/29	190,000.00	186,105.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	130,000.00	126,815.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	230,000.00	231,753.75	
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	321,568.00	
	SIGB 3% 08/01/72	60,000.00	59,670.00	
	SIGB 3% 09/01/24	230,000.00	228,414.39	
	シンガポールドル 小計		3,100,000.00	2,934,186.09
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	300,000.00	275,363.68	
	MGS 3.502% 05/31/27	470,000.00	467,700.77	
	MGS 3.582% 07/15/32	250,000.00	244,489.93	
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	590,907.00	
	MGS 3.757% 05/22/40	910,000.00	867,517.61	
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	491,948.09	
	MGS 3.844% 04/15/33	290,000.00	288,836.78	
	MGS 3.882% 03/14/25	360,000.00	362,961.10	
	MGS 3.885% 08/15/29	650,000.00	653,860.28	
	MGS 3.892% 03/15/27	430,000.00	434,192.50	
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	424,925.25	
	MGS 3.9% 11/30/26	370,000.00	374,118.61	
	MGS 3.906% 07/15/26	410,000.00	414,847.67	
	MGS 3.955% 09/15/25	170,000.00	171,547.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	410,000.00	412,762.08	
	MGS 4.065% 06/15/50	210,000.00	200,290.95	
	MGS 4.232% 06/30/31	940,000.00	963,014.86	
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	610,882.26	
	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	275,893.83	

	MGS 4.457% 03/31/53	480,000.00	493,347.79
	MGS 4.498% 04/15/30	480,000.00	500,316.38
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	404,824.56
	MGS 4.696% 10/15/42	150,000.00	160,118.04
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	254,793.50
	MGS 4.762% 04/07/37	260,000.00	278,148.13
	MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	338,828.82
	MGS 4.921% 07/06/48	520,000.00	563,627.06
	MGS 4.935% 09/30/43	130,000.00	141,404.54
マレーシアリングット 小計		11,500,000.00	11,661,469.07 (368,195,725)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	430,000.00	410,070.09
	ILGOV 0.5% 02/27/26	290,000.00	266,283.94
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	619,414.09
	ILGOV 1.3% 04/30/32	160,000.00	129,836.16
	ILGOV 1.5% 05/31/37	410,000.00	300,342.42
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	485,567.83
	ILGOV 1% 03/31/30	950,000.00	793,763.38
	ILGOV 2.25% 09/28/28	360,000.00	334,992.31
	ILGOV 2.8% 11/29/52	140,000.00	105,862.54
	ILGOV 2% 03/31/27	360,000.00	336,935.08
	ILGOV 3.75% 03/31/47	600,000.00	557,123.46
	ILGOV 5.5% 01/31/42	480,000.00	561,267.26
	ILGOV 6.25% 10/30/26	440,000.00	469,065.91
イスラエルシェケル 小計		5,790,000.00	5,370,524.47 (207,139,517)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	7,480,000.00	7,467,916.65
	CGB 1.99% 09/15/24	4,140,000.00	4,136,474.33
	CGB 2.18% 08/25/25	4,860,000.00	4,864,365.25
	CGB 2.24% 05/25/25	3,000,000.00	3,006,103.50
	CGB 2.26% 02/24/25	10,120,000.00	10,141,590.00
	CGB 2.28% 11/25/25	4,010,000.00	4,015,720.66
	CGB 2.29% 12/25/24	4,300,000.00	4,315,778.42
	CGB 2.3% 05/15/26	6,830,000.00	6,841,891.71
	CGB 2.37% 01/20/27	6,900,000.00	6,912,327.54
	CGB 2.44% 10/15/27	7,400,000.00	7,422,979.96
	CGB 2.46% 02/15/26	7,080,000.00	7,117,630.89
	CGB 2.47% 09/02/24	3,260,000.00	3,274,766.49
	CGB 2.48% 04/15/27	4,660,000.00	4,684,979.46
	CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,537,074.05
	CGB 2.6% 09/01/32	6,430,000.00	6,421,218.61
	CGB 2.62% 06/25/30	2,710,000.00	2,723,731.29
CGB 2.62% 09/25/29	4,450,000.00	4,472,471.61	

CGB 2.64% 01/15/28	6,730,000.00	6,797,545.64	
CGB 2.68% 05/21/30	4,820,000.00	4,860,278.33	
CGB 2.69% 08/12/26	4,950,000.00	5,019,440.08	
CGB 2.69% 08/15/32	4,550,000.00	4,583,070.31	
CGB 2.75% 02/17/32	5,150,000.00	5,205,239.93	
CGB 2.75% 06/15/29	4,900,000.00	4,973,377.99	
CGB 2.76% 05/15/32	2,940,000.00	2,974,711.40	
CGB 2.79% 12/15/29	5,400,000.00	5,479,358.94	
CGB 2.8% 03/24/29	4,090,000.00	4,159,659.65	
CGB 2.8% 03/25/30	2,420,000.00	2,459,760.11	
CGB 2.8% 11/15/32	3,250,000.00	3,297,900.12	
CGB 2.85% 06/04/27	3,850,000.00	3,919,884.04	
CGB 2.89% 11/18/31	2,750,000.00	2,809,961.55	
CGB 2.91% 10/14/28	4,460,000.00	4,566,379.92	
CGB 2.94% 10/17/24	2,000,000.00	2,023,617.40	
CGB 3.01% 05/13/28	4,920,000.00	5,063,215.78	
CGB 3.02% 05/27/31	7,650,000.00	7,911,425.73	
CGB 3.02% 10/22/25	4,500,000.00	4,588,081.65	
CGB 3.03% 03/11/26	6,730,000.00	6,883,951.44	
CGB 3.12% 10/25/52	1,850,000.00	1,926,193.73	
CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,339,544.83	
CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,130,682.05	
CGB 3.19% 04/15/53	430,000.00	457,329.29	
CGB 3.25% 11/22/28	3,500,000.00	3,653,842.50	
CGB 3.27% 11/19/30	1,380,000.00	1,455,152.17	
CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,217,520.25	
CGB 3.32% 04/15/52	2,730,000.00	2,952,494.72	
CGB 3.39% 03/16/50	4,370,000.00	4,764,189.29	
CGB 3.53% 10/18/51	2,550,000.00	2,857,868.38	
CGB 3.72% 04/12/51	3,980,000.00	4,597,506.55	
CGB 3.81% 09/14/50	2,200,000.00	2,573,419.64	
CGB 3.86% 07/22/49	1,470,000.00	1,727,318.79	
CGB 4.08% 10/22/48	3,420,000.00	4,123,062.04	
オフショア人民元 小計	212,590,000.00	217,710,004.66	(4,381,000,194)
合計		70,823,845,403	(70,823,845,403)

## 有価証券明細表注記

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

## 4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 226銘柄	100.0%	48.6%
カナダドル	国債証券 36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 351銘柄	100.0%	33.1%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 50銘柄	100.0%	6.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 8月28日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	800,925,411
コール・ローン	1,359,861,791
国債証券	282,874,711,571
派生商品評価勘定	13,009,991
未収入金	8,261,142
未収利息	1,815,281,222
前払金	6,204,083
前払費用	104,179,874
差入委託証拠金	119,353,795
流動資産合計	287,101,788,880

	2023年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産合計	287,101,788,880
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,762,907
未払金	116,066
未払解約金	102,661,123
未払利息	3,150
流動負債合計	110,543,246
負債合計	110,543,246
純資産の部	
元本等	
元本	86,879,656,566
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	200,111,589,068
元本等合計	286,991,245,634
純資産合計	286,991,245,634
負債純資産合計	287,101,788,880

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月28日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>



2023年 8月28日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,879,656,566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 3.3033円 (1万口当たり純資産額) (33,033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 8月28日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2023年 8月28日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月28日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券          売買目的有価証券          「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引          「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務          短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	101,070,365,995円
期中追加設定元本額	15,582,009,240円
期中一部解約元本額	29,772,718,669円
期末元本額	86,879,656,566円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,178,080,539円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	535,563,095円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	368,681,116円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,476,263,229円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,301,974円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,824,575,997円
世界経済インデックスファンド	17,915,123,341円
DCマイセレクション25	2,006,619,815円
DCマイセレクション50	1,782,261,047円
DCマイセレクション75	1,350,654,438円
DC外国債券インデックス・オープン	2,265,502,586円
DCマイセレクションS25	1,057,596,457円
DCマイセレクションS50	956,833,359円
DCマイセレクションS75	515,955,716円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,221,569円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	97,975,454円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	52,818,293円
DC世界経済インデックスファンド	13,522,070,493円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	397,683,437円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	918,807円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,033,203円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	18,962,955円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	30,441,408円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	54,159,658円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,893,873円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	56,884,660円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	935,794,701円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	393,286,244円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,609,226,149円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	56,615,690円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	33,833,114円

区分	2023年 8月28日現在
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	378,442,202円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	142,301,660円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	189,717,521円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	664,839,829円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,946,272,757円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	635,702,212円
外国債券ファンド・シリーズ1	736,801,779円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	668,506,885円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,322,495,054円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	239,808,874円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,081,780円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,324,301,258円
S M T インデックスバランス・オープン	179,904,328円
S M T 世界経済インデックス・オープン	350,442,392円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	459,699,643円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	735,654,813円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,351,787円
グローバル経済コア	775,346,595円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A 対応型）	20,784,359円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	2,270,742円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	50,638,400円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	67,652,859円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	32,414,941円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	37,210,233円
M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード）	273,940,083円
10資産分散投資ファンド	26,157,930円
F O F s 用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	12,163,354,620円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	189,009,292円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	514,216,666円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	121,934,451円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	58,333,833円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,639,383,347
合計	2,639,383,347

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2023年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,179,504,862	-	1,173,300,779	6,204,083
合計		1,179,504,862	-	1,173,300,779	6,204,083

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年 8月28日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,266,538,122	-	1,277,989,289	11,451,167
	アメリカドル	649,879,212	-	659,054,869	9,175,657
	カナダドル	51,353,032	-	51,595,824	242,792
	ユーロ	411,358,072	-	412,296,741	938,669
	イギリスポンド	67,721,046	-	68,095,022	373,976
	オフショア人民元	86,226,760	-	86,946,833	720,073
合計		1,266,538,122	-	1,277,989,289	11,451,167

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,582,210.91	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,479,968.75	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,745,406.22	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,722,382.82	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,254,343.76	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,186,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,390,312.48	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,680,585.91	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,764,481.35	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,264,647.66	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,358,248.41	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,711,132.82	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,607,343.76	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,042,792.98	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,705,575.00	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,536,668.75	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,010,683.58	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,971,734.35	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,973,742.21	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,359,472.67	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,521,484.37	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,141,011.69	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,113,124.96	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,313,531.25	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,817,070.32	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,125,390.62	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,140,874.97	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,229,648.48	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,417,578.14	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,546,289.11	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,587,968.76	
		T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,628,771.47	
		T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,274,153.93	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,192,812.48			

T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,352,421.86	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,825,050.83	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,424,671.89	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,279,140.63	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,997,304.73	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,908,437.52	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,043,701.16	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,145,593.77	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,313,262.12	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,351,100.00	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,919,375.04	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,853,697.27	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,178,750.00	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,751,953.08	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,371,380.83	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,127,509.73	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,283,867.17	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,391,098.06	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,786,718.76	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,032,912.08	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,025,206.23	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,083,164.87	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,775,078.14	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,195,912.09	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,408,906.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,434,673.64	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,834,960.90	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,153,359.37	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,389,562.54	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,477,685.57	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,181,312.52	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,088,932.04	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,938,418.74	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,789,179.68	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,549,421.86	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,930,304.72	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,345,132.04	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,230,312.50	
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,992,128.90	
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,101,871.09	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,583,515.64	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,741,792.21	

T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,408,414.10
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,011,304.70
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,646,406.24
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,788,180.44
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,792,861.04
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,997,595.69
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,937,968.75
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,567,500.00
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,020,648.03
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,356,367.19
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,658,271.12
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,828,906.25
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,128,980.44
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,860,003.91
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,039,160.17
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,696,369.54
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,904,951.19
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,112,605.47
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,685,859.37
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,076,546.87
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,777,701.14
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,151,640.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,983,015.62
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,186,320.32
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,036,591.79
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,404,832.01
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,444,253.91
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,805,943.75
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,395,383.62
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,583,705.09
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,856,672.10
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,824,675.77
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,809,570.30
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,032,694.73
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,755,003.89
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,611,320.34
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,037,203.12
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,450,461.90
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,049,315.62
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,964,814.43
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,238,093.74
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,529,795.71
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,090,476.56



T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,218,505.83	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,273,339.83	
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,250,195.27	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,744,199.19	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,023,261.73	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,598,664.02	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,655,858.60	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,275,109.37	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,852,968.76	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,045,281.25	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,381,342.93	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,078,558.61	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,160,791.02	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,649,181.25	
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	5,819,195.28	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,674,660.91	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,241,173.46	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,646,212.50	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,773,695.32	
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,916,601.55	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,074,012.50	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,733,950.18	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,254,589.86	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,911,462.87	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,964,035.14	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,281,875.00	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	869,900.38	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,638,515.62	
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,466,833.57	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,834,632.83	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,492,556.25	
T 3.125% 08/31/27	1,850,000.00	1,753,236.32	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,667,933.55	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,891,078.10	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,496,618.14	
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,820,351.57	
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,264,968.75	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,545,331.25	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,969,644.53	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,440,406.25	
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,648,437.50	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	699,256.25	

T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,111,625.00
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,422,367.18
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,764,843.76
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,726,882.81
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,692,382.82
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,350,957.01
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,745,625.00
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,358,950.19
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,438,639.85
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,894,515.85
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,253,624.99
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	781,953.12
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	782,773.44
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,982,203.12
T 3% 05/15/45	700,000.00	552,835.93
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,513,705.86
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,643,406.25
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,540,839.86
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,088,296.88
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,033,886.72
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,797,363.30
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,219,109.36
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,050,351.57
T 4.125% 11/15/32	7,550,000.00	7,465,062.50
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	891,808.59
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,796,769.51
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	727,382.42
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,011,953.12
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,899,480.46
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	646,419.92
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	961,874.99
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,126,106.25
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	562,847.65
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,730,746.09
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,423,771.87
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	782,475.58
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,371,015.62
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,063,406.25
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,404,416.03
T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,426,757.83
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	432,437.50
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,346,972.65
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,082,234.37

	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,742,832.02
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,538,416.01
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,163,408.20
	アメリカドル 小計	1,076,150,000.00	938,869,018.03 (137,591,254,592)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,050,244.74
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,767,711.91
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,513,951.22
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	668,426.54
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,364,168.34
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,696,134.54
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,376,401.35
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,383,506.14
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	842,212.07
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,366,795.65
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,157,741.61
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,045,189.39
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,951,650.26
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	723,111.25
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,385,676.89
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,225,798.05
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	220,517.14
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,081,573.96
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	295,322.24
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	821,688.37
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,516,329.48
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	911,415.66
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	392,312.05
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	517,628.31
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	375,520.13
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,323,565.62
	CAN 2% 12/01/51	3,450,000.00	2,514,766.44
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,131,366.80
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,034,796.01
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	1,994,410.30
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,290,212.94
	CAN 3% 10/01/25	510,000.00	492,664.13
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,108,009.01
CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	774,250.36	
CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,633,143.89	
CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,885,800.22	
CAN 5% 06/01/37	630,000.00	717,174.78	

	カナダドル 小計	58,410,000.00	52,551,187.79 (5,663,441,508)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,031,023.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,244,119.61
	MBONO 5.5% 03/04/27	20,900,000.00	18,300,040.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,080,571.33
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,183,071.40
	MBONO 7.5% 05/26/33	18,500,000.00	16,457,322.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,453,342.30
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	37,233,332.00
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,624,197.85
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,951,990.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,400,000.00	31,266,324.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,670,000.00	13,707,061.20
	MBONO 8% 07/31/53	14,950,000.00	13,000,893.75
	MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,495,997.53
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,549,846.00
	メキシコペソ 小計	359,700,000.00	331,579,132.97 (2,907,252,679)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	857,396.80
	BGB 0.35% 06/22/32	1,570,000.00	1,237,459.87
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	310,982.70
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,375,262.90
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	169,781.48
	BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,820,580.00
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,393,449.14
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,449,948.80
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,455,793.75
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	691,218.84
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,304,433.24
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	738,039.27
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	638,042.47
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	629,760.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	745,833.96
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	750,053.12
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	534,105.65
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,381,412.87
	BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,091,413.87
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	624,796.48
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	501,861.49
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	365,665.20
	BGB 3.3% 06/22/54	690,000.00	647,316.60
BGB 3.45% 06/22/43	360,000.00	353,916.00	

BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	961,020.98
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,101,256.60
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	927,494.50
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,034,852.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,179,091.74
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,152,709.92
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,262,237.60
BGB 5% 03/28/35	1,730,000.00	2,007,981.59
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,765,970.75
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,371,699.67
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,613,801.06
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	795,803.20
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,440,631.92
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	553,699.83
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,733,782.32
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,772,999.52
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,115,337.60
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,443,722.80
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,159,281.40
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,342,023.96
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	672,129.00
BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,201,902.55
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,834,765.95
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,340,648.36
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,687,306.54
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,040,951.36
BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,152,480.00
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,448,698.50
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	715,598.25
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,335,353.75
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,809,588.30
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,582,490.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	856,473.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,218,301.70
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,918,431.31
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	746,047.50
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,322,514.59
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,023,345.36
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,590,659.46
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,176,523.46
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	963,317.04
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	449,535.24

BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,614,680.00
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,582,773.32
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,380,928.32
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	332,419.57
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	639,400.26
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,167,295.04
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,630,057.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,899,046.60
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	692,851.92
BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,150,062.20
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,909,579.10
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,683,737.70
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,689,578.88
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	829,053.45
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	565,921.78
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,474,619.30
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,358,153.32
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	992,793.00
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,107,111.00
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,109,054.90
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,195,603.08
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	838,850.88
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,870,711.54
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,024,363.20
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,540,655.48
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	907,568.15
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,316,840.32
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	296,226.00
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,150,838.50
BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,355,123.25
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,320,199.65
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,857,712.00
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,079,508.83
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	476,248.65
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	408,689.60
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	838,727.54
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,123,513.60
BTPS 4.5% 10/01/53	650,000.00	636,329.85
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,753,954.53
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,540,554.00
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,752,652.55
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	858,156.12
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,252,158.75

BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,842,716.20
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,930,482.89
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,571,292.80
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,190,302.58
BTPS 5% 08/01/34	3,080,000.00	3,278,992.64
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,601,380.60
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,998,118.61
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,299,098.40
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,550,346.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,785,987.28
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,683,046.82
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,351,798.60
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,964,463.04
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,832,330.99
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,612,898.86
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	322,447.65
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,253,239.68
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	941,110.33
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,972,582.46
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,759,191.28
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,599,855.52
DBR 0% 08/15/26	1,050,000.00	968,828.70
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,544,198.00
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,980,659.90
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,249,048.96
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,739,857.40
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,197,297.08
DBR 0% 08/15/52	2,200,000.00	1,048,742.20
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,171,824.16
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,745,896.65
DBR 1.25% 08/15/48	3,230,000.00	2,429,857.94
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,958,414.12
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,963,557.12
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,520,889.07
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,957,028.00
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,337,003.90
DBR 2.1% 11/15/29	3,160,000.00	3,079,688.60
DBR 2.3% 02/15/33	3,130,000.00	3,069,434.50
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,701,854.20
DBR 2.5% 08/15/46	3,040,000.00	2,962,540.80
DBR 2.6% 08/15/33	150,000.00	150,526.20
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,975,104.36

DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,800,941.14
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,275,031.50
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,571,809.81
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,561,853.24
DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,256,397.77
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,716,404.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,652,241.16
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,521,876.25
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,138,780.12
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,287,961.08
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,427,850.47
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,203,261.00
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,451,359.90
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,706,025.76
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	353,618.10
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	849,721.93
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,272,342.30
FRTR 0.75% 05/25/28	5,490,000.00	4,965,622.65
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,514,667.42
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,587,258.52
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,873,418.56
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,134,699.45
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,727,999.26
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,115,244.96
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,555,769.00
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,530,995.60
FRTR 0% 11/25/29	3,580,000.00	2,991,231.39
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,266,374.73
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,316,180.00
FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,584,993.19
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,523,007.15
FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	832,677.42
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,662,207.77
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,902,281.92
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	944,547.84
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,364,843.76
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,079,249.20
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,329,791.70
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,086,013.28
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,429,848.87
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	449,553.00
FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	885,479.40
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	494,935.50



FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,304,518.84
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,172,761.76
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,658,536.56
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,985,298.50
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,781,273.20
FRTR 3% 05/25/33	1,880,000.00	1,866,225.24
FRTR 3% 05/25/54	1,210,000.00	1,092,229.36
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,938,961.68
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,799,338.80
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,118,654.60
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,959,641.69
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,964,238.75
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,695,144.67
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,357,918.95
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,011,516.70
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	605,460.24
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	643,698.12
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	373,517.77
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	450,405.70
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	227,005.56
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	703,762.44
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	673,242.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	960,505.22
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	369,179.79
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	421,416.10
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	538,228.80
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	478,838.14
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	950,047.00
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	766,954.12
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	772,496.76
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	449,114.14
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,198,975.65
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,812,682.06
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	820,102.70
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	941,988.55
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,326,268.64
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	835,609.31
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	831,756.60
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,541,745.30
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,109,160.44
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,671,754.08
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,386,139.16

NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	627,018.24
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	788,585.40
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,116,680.85
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,263,763.08
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	392,116.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,507,758.77
NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	718,593.28
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,788,434.92
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	589,917.60
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,881,576.49
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,956,356.16
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,693,277.01
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,852,383.05
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,189,416.25
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,317,236.00
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,352,550.55
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,758,276.00
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,322,396.17
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,368,364.25
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,358,763.20
OBL 2.4% 10/19/28	670,000.00	663,937.84
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	490,186.80
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,234,008.03
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	997,257.35
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	117,274.99
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	798,531.36
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	407,862.84
RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,317,399.66
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	90,028.21
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,029,626.85
RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,053,616.64
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,331,491.00
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	977,766.64
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	626,061.87
RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	269,138.45
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,144,089.80
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	765,744.84
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	150,929.71
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	970,134.66
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	347,131.64
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	450,138.65
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	679,409.54
RAGB 2.9% 02/20/33	640,000.00	626,434.33

RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	218,964.68	
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	684,610.50	
RAGB 3.15% 10/20/53	270,000.00	261,975.60	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	465,066.42	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,710,551.11	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,115,701.84	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,318,594.54	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	298,696.42	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	201,753.24	
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	293,803.86	
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	181,408.20	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	581,589.76	
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	293,865.22	
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	490,060.26	
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	646,623.78	
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	457,896.15	
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	482,901.15	
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	420,662.44	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	405,370.98	
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	274,024.32	
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	518,759.04	
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	302,860.17	
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	331,041.20	
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	356,979.30	
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	499,864.92	
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	473,607.94	
RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	271,337.51	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	545,012.05	
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	455,186.56	
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	587,983.70	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,718,781.04	
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,292,166.25	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,042,183.68	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,038,973.96	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,753,488.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,223,752.56	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,383,515.75	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	997,553.76	
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,172,163.98	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,457,645.54	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,606,169.81	
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,109,483.00	

	SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,885,548.78
	SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,394,947.38
	SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,726,097.06
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,495,772.65
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,999,257.89
	SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,880,251.80
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,439,133.29
	SPGB 1.45% 10/31/27	2,210,000.00	2,057,293.42
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	301,193.64
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,410,627.00
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,408,406.75
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,801,181.40
	SPGB 1.9% 10/31/52	1,380,000.00	872,614.02
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,222,142.70
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,848,791.30
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	542,736.24
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	956,199.96
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,533,565.01
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,300,052.16
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,836,566.82
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,353,818.03
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,338,072.07
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	985,959.40
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,635,169.20
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,647,150.40
	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	672,013.91
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,195,149.00
	SPGB 3.55% 10/31/33	1,240,000.00	1,236,399.83
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,025,894.88
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,036,550.55
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,907,492.60
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,062,078.00
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,932,627.98
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,417,293.40
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,651,613.36
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,361,426.64
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,206,239.60
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,032,340.40
	ユーロ 小計	649,440,000.00	590,885,868.44 (93,519,506,397)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,128,039.19
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,242,334.38
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,768,044.00

UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,965,292.00	
UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,249,631.00	
UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,624,575.26	
UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,756,665.80	
UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	509,465.73	
UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,297,423.12	
UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,094,460.00	
UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	415,546.91	
UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	773,495.98	
UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,166,679.02	
UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,466,889.88	
UKT 1.125% 01/31/39	1,950,000.00	1,200,421.28	
UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	378,480.27	
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	836,210.90	
UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,151,482.46	
UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,150,778.72	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,461,008.00	
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	930,418.50	
UKT 1.5% 07/31/53	970,000.00	484,806.00	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	929,230.37	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	688,247.22	
UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	545,347.38	
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	342,987.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	818,314.84	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,335,266.10	
UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,001,638.56	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	899,428.00	
UKT 2.75% 09/07/24	1,440,000.00	1,405,251.64	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,240,270.20	
UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,550,348.52	
UKT 3.25% 01/31/33	2,030,000.00	1,844,563.56	
UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,651,364.32	
UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,253,972.08	
UKT 3.5% 10/22/25	690,000.00	665,288.34	
UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,275,739.80	
UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,134,833.56	
UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,385,262.00	
UKT 4.125% 01/29/27	2,800,000.00	2,728,270.71	
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,837,458.00	
UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,488,225.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,211,459.09	
UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,143,485.00	

	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,378,003.44	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,489,178.10	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,508,425.10	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,679,647.87	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,391,221.53	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,759,122.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,492,288.19	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,417,555.44	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,133,856.25	
	UKT 4% 10/22/63	560,000.00	507,471.13	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,178,013.35	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,437,770.25	
イギリスポンド 小計		94,680,000.00	75,800,952.34 (13,988,307,744)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,643,117.05	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,823,475.20	
	SGB 0.75% 11/12/29	5,260,000.00	4,643,597.37	
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,454,360.15	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,461,059.87	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,277,517.83	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,605,091.47	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,200,000.00	4,504,542.00	
スウェーデンクローナ 小計		44,280,000.00	41,412,760.94 (549,961,465)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,016,514.40	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,408,324.44	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,832,837.16	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,911,925.15	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,025,145.45	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,762,355.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,927,426.88	
	NGB 2% 04/26/28	2,630,000.00	2,410,695.86	
	NGB 3% 08/15/33	3,310,000.00	3,079,955.00	
ノルウェークローネ 小計		37,010,000.00	33,375,179.34 (457,907,460)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,574,046.11	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,236,588.66	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,330,250.76	
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,799,633.78	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,239,231.92	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,375,056.53	
	DGB 2.25% 11/15/33	930,000.00	885,794.49	
	DGB 4.5% 11/15/39	10,510,000.00	12,690,730.41	

	デンマーククローネ 小計	46,610,000.00	43,131,332.66 (916,109,505)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,933,796.12
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,306,528.00
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,128,373.75
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,790,000.00	2,060,833.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,789,125.22
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,533,676.00
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,287,570.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,874,630.10
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,172,630.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,880,319.35
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,327,538.84
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	608,610.00
	POLGB 6% 10/25/33	2,100,000.00	2,163,525.00
	POLGB 7.5% 07/25/28	910,000.00	987,531.90
	ポーランドズロチ 小計	44,550,000.00	40,054,687.78 (1,418,881,238)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,674,009.94
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,938,721.44
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,093,895.05
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,929,922.97
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,989,066.69
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	962,908.65
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,488,519.28
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,182,330.13
	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,633,325.90
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,376,396.13
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,133,677.62
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,180,000.00	932,649.82
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,036,714.21
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,846,659.33
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,569,907.41
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,362,415.35
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,047,254.59
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,622,165.41
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	972,932.67
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,359,721.30
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,092,710.14
ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,435,929.91	
ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,132,345.70	
ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,663,678.37	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,500,000.00	1,514,658.00	

	ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,765,994.38	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,389,829.91	
オーストラリアドル 小計		49,300,000.00	44,148,340.30 (4,154,800,305)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	521,739.02	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	591,253.26	
	NZGB 1.5% 05/15/31	790,000.00	614,507.88	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	277,441.93	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	813,395.54	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	483,077.10	
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	334,043.32	
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	418,067.43	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,026,655.58	
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	586,971.19	
	NZGB 4.25% 05/15/34	320,000.00	298,872.37	
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	823,518.32	
	NZGB 4.5% 05/15/30	370,000.00	359,433.29	
ニュージーランドドル 小計		8,440,000.00	7,148,976.23 (619,673,259)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	552,535.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	757,269.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	496,440.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	605,220.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	249,908.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	607,446.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	580,775.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	880,816.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	421,554.75	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	701,640.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	230,000.00	218,385.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	604,160.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	594,735.75	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	636,675.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	413,910.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	614,565.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	836,328.75	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	743,626.00	
	SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	218,790.00	
SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	893,795.44		
シンガポールドル 小計		12,310,000.00	11,628,575.99 (1,257,281,636)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,514,500.28	



	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,502,613.12
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	694,351.40
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,934,504.28
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,249,825.90
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,741,496.25
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,872,459.18
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,381,268.66
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,172,828.02
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,141,017.50
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,993,101.79
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,497,494.55
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	607,094.16
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,705,379.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,288,623.10
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,928,063.02
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,550,964.91
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,781,739.92
	MGS 4.392% 04/15/26	1,910,000.00	1,951,693.39
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,146,558.37
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	362,452.65
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	926,835.18
	MGS 4.696% 10/15/42	1,450,000.00	1,547,807.72
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,040,406.80
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,439,145.14
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,011,113.00
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,820,948.97
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,120,359.11
	マレーシアリングット 小計	46,280,000.00	46,924,645.37 (1,481,584,675)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,946,782.82
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,037,589.16
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,271,185.00
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,210,000.00	981,885.96
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,296,600.22
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,180,596.31
	ILGOV 1% 03/31/30	2,220,000.00	1,854,899.67
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,512,442.34
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	378,080.50
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,497,489.28
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,488,484.78
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,198,296.78
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,428,518.92

イスラエルシェケル 小計		23,780,000.00	22,072,851.74 (851,343,269)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,782,977.32
	CGB 2.18% 08/25/25	19,000,000.00	19,017,065.80
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,263,111.85
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,421,002.89
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,182,005.81
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,968,357.28
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,328,880.22
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,635,535.05
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,627,121.40
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,107,208.00
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,191,527.32
	CGB 2.6% 09/01/32	21,800,000.00	21,770,227.95
	CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,215,712.54
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,100,996.00
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,625,583.98
	CGB 2.68% 05/21/30	25,830,000.00	26,045,848.39
	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000.00	64,796,408.37
	CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,366,963.00
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,655,529.90
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,871,715.29
	CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,826,330.62
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,191,049.30
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,473,091.63
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,328,596.00
	CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,058,954.00
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,066,019.70
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,586,126.17
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,737,879.67
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,896,478.40
	CGB 2% 06/15/25	3,600,000.00	3,592,812.09
	CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,407,524.60
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,431,218.87
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,230,057.52
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,745,960.72
CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,765,246.90	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,223,037.98	
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,683,086.11	
CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,733,499.10	
CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	18,348,124.90	
CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,349,458.61	
CGB 3.72% 04/12/51	7,940,000.00	9,171,910.05	

	CGB 3.81% 09/14/50	18,550,000.00	21,698,606.50	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	14,077,060.66	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,922,497.72	
	オフショア人民元 小計	848,970,000.00	869,518,406.18 (17,497,405,839)	
	合計		282,874,711,571 (282,874,711,571)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 207銘柄	100.0%	48.6%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 359銘柄	100.0%	33.1%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 44銘柄	100.0%	6.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月28日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,276,947,034
コール・ローン	982,200,759
国債証券	111,801,079,157
未収利息	1,666,969,655
前払費用	182,986,632
流動資産合計	115,910,183,237
資産合計	115,910,183,237
負債の部	
流動負債	
未払解約金	42,564,212
未払利息	2,275
流動負債合計	42,566,487
負債合計	42,566,487
純資産の部	
元本等	
元本	54,247,656,525
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	61,619,960,225
元本等合計	115,867,616,750
純資産合計	115,867,616,750
負債純資産合計	115,910,183,237

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月28日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

2023年 8月28日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 8月28日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	54,247,656,525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 2.1359円 (1万口当たり純資産額) (21,359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 8月28日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月28日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

元本の移動

区分	2023年 8月28日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月30日
期首元本額	47,776,566,303円
期中追加設定元本額	12,673,187,963円
期中一部解約元本額	6,202,097,741円
期末元本額	54,247,656,525円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,626,497,641円

区分	2023年 8月28日現在
世界経済インデックスファンド	18,518,916,174円
D C新興国債券インデックス・オープン	5,768,198,475円
D C世界経済インデックスファンド	14,005,694,458円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	9,319,216円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	494,740,113円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	691,403,063円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,470,802,873円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	248,563,628円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	107,852,391円
SMT インデックスバランス・オープン	186,519,237円
SMT 世界経済インデックス・オープン	451,623,983円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	591,949,273円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	947,049,166円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,560,958円
グローバル経済コア	803,729,396円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	88,568,138円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	74,725,221円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	29,971,159円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	30,058,213円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	112,974,858円
10資産分散投資ファンド	42,833,626円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	245,654,104円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	157,244,950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）	10,128,048円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	235,564,617円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	227,691,967円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	226,537,396円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	229,306,395円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	227,038,587円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	146,802,093円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 8月28日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,893,811,121
合計	3,893,811,121

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	33,589,068.00		
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,358,485.50		
		MBONO 5.5% 03/04/27	109,000,000.00	95,440,400.00		
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	158,866,625.96		
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	53,233,787.50		
		MBONO 7.5% 05/26/33	47,000,000.00	41,810,495.00		
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	129,927,470.00		
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	161,378,040.00		
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	72,727,882.50		
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	25,248,693.00		
		MBONO 8.5% 05/31/29	105,600,000.00	101,905,056.00		
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	91,847,588.00		
		MBONO 8% 07/31/53	62,500,000.00	54,351,562.50		
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,552,621.11		
		MBONO 8% 11/07/47	96,000,000.00	84,096,960.00		
		メキシコペソ 小計		1,425,350,000.00	1,314,334,735.07 (11,523,955,523)	
	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	60,949,050.16		
		BLTN 0% 07/01/24	37,250,000.00	34,085,628.51		
		BLTN 0% 07/01/25	46,400,000.00	38,812,991.23		
		BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00	59,197,593.78		
BNTNF 10% 01/01/25		55,300,000.00	54,830,401.73			
BNTNF 10% 01/01/27		50,400,000.00	49,872,719.68			
BNTNF 10% 01/01/29		49,700,000.00	48,267,046.06			
BNTNF 10% 01/01/31		19,850,000.00	18,982,170.08			
BNTNF 10% 01/01/33		18,400,000.00	17,321,767.52			



	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,404,340.00	
ブラジルレアル 小計		433,200,000.00	383,723,708.75 (11,532,969,555)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	534,163,099.37	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,834,320,880.50	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,960,000,000.00	1,901,314,109.24	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,610,000,000.00	1,518,667,787.98	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,092,104,005.16	
	BTPCL 5% 10/01/28	820,000,000.00	793,393,165.62	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,800,000,000.00	1,898,488,355.40	
	BTPCL 6% 04/01/33	1,500,000,000.00	1,541,023,093.50	
	BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	543,141,255.58	
チリペソ 小計		14,000,000,000.00	13,656,615,752.35 (2,364,410,855)	
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	63,246,087,103.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	18,000,000,000.00	16,818,198,120.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	45,100,000,000.00	35,231,770,024.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	34,900,000,000.00	23,650,477,788.00	
コロンビアペソ 小計		163,300,000,000.00	138,946,533,035.00 (4,931,212,457)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	4,088,736.67	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	7,250,000.00	6,387,737.85	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,670,923.06	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,800,000.00	8,659,322.67	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,947,605.07	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	5,150,000.00	5,218,360.37	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	9,550,000.00	9,386,259.13	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,250,000.00	11,427,601.72	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,400,000.00	9,670,381.50	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,550,000.00	2,700,337.11	
ペルーソル 小計		70,900,000.00	69,157,265.15 (2,744,091,123)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,500,967.50	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,598,651.42	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	25,000,000.00	25,785,125.00	
ウルグアイペソ 小計		67,000,000.00	65,884,743.92 (256,206,003)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	39,691,643.20	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	41,000,000.00	42,066,000.00	
ドミニカペソ 小計		73,000,000.00	81,757,643.20 (211,441,616)	
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	20,014,863.30	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	59,613,724.00	

	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	55,322,359.30	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	22,392,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	78,385,496.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	55,102,320.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	22,711,150.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	42,052,840.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	20,500,000.00	15,416,000.00	
	CZGB 1% 06/26/26	53,800,000.00	48,494,082.60	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	71,896,075.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	78,700,000.00	71,765,743.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	73,557,921.50	
	CZGB 2% 10/13/33	74,500,000.00	60,456,750.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	20,317,000.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,861,750.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	49,495,000.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	72,622,500.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	36,700,000.00	36,660,510.80	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	83,084,400.00	
	CZGB 6% 02/26/26	63,000,000.00	65,173,500.00	
	チェココルナ 小計	1,167,300,000.00	1,058,395,985.50 (6,957,471,850)	
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	515,445,150.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	426,260,200.00	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	711,795,750.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	480,066,000.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	221,000,000.00	142,677,600.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	578,000,000.00	535,748,200.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	485,500,000.00	411,948,012.30	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	307,287,500.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	625,686,600.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	215,699,400.00	
	HGB 3% 06/26/24	292,500,000.00	278,016,862.50	
	HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	478,362,375.00	
	HGB 3% 10/27/27	822,000,000.00	693,151,500.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	232,427,000.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	263,000,000.00	231,890,782.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	570,000,000.00	474,580,221.60	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	621,795,240.00	
HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	738,014,839.90		
	ハンガリーフォロント 小計	9,911,500,000.00	8,120,853,233.30 (3,370,470,805)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,829,747.00	

	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	13,281,840.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	14,096,527.50	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	16,767,355.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,270,718.30	
	POLGB 2.5% 04/25/24	22,000,000.00	21,599,380.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	19,707,612.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	15,853,200.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,746,301.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	22,500,940.50	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,193,886.12	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	19,963,849.40	
	POLGB 6% 10/25/33	9,600,000.00	9,890,400.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	10,600,000.00	11,503,118.94	
	ポーランドズロチ 小計	265,500,000.00	240,204,875.76 (8,508,921,436)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,588,347.71	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	7,300,000.00	7,165,315.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	6,008,122.18	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	4,000,000.00	3,787,824.64	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	9,975,680.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,235,168.95	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,733,862.30	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,239,258.89	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,396,116.00	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	5,300,000.00	4,157,508.89	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,170,542.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,427,570.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	6,025,489.25	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,527,980.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,188,854.55	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	6,500,000.00	6,361,225.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,596,347.48	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,766,849.32	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	5,400,000.00	5,857,345.44	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	5,500,000.00	6,021,631.55	
ROMGB 8.75% 10/30/28	4,500,000.00	4,928,716.80		
ROMGB 8% 04/29/30	2,300,000.00	2,452,041.96		
	ルーマニアレイ 小計	139,200,000.00	131,611,797.91 (4,220,974,615)	
マレーシア リングギット	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000.00	31,483,248.32	
	MGS 3.478% 06/14/24	8,650,000.00	8,667,030.12	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,563,656.72	
	MGS 3.582% 07/15/32	13,500,000.00	13,202,456.35	

	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	19,029,208.70
	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	26,073,194.24
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,067,948.75
	MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,325,024.56
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,420,559.67
	MGS 3.899% 11/16/27	15,500,000.00	15,681,765.40
	MGS 3.9% 11/30/26	17,450,000.00	17,644,242.93
	MGS 3.906% 07/15/26	15,600,000.00	15,784,448.16
	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	28,961,170.00
	MGS 4.059% 09/30/24	15,450,000.00	15,554,083.56
	MGS 4.065% 06/15/50	16,750,000.00	15,975,588.20
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,159,621.38
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,413,648.85
	MGS 4.504% 04/30/29	14,600,000.00	15,119,453.40
	MGS 4.696% 10/15/42	8,800,000.00	9,393,591.68
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,437,748.15
	MGS 4.893% 06/08/38	12,900,000.00	14,099,650.98
	MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,454,405.96
	マレーシアリングット 小計	363,150,000.00	363,511,746.08 (11,477,410,817)
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,369,754.02
	THAIGB 0.75% 09/17/24	70,000,000.00	68,949,722.10
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	138,828,888.77
	THAIGB 1.45% 12/17/24	164,000,000.00	162,410,208.60
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	51,910,200.29
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,171,916.93
	THAIGB 1.6% 12/17/29	104,100,000.00	98,431,665.47
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	154,696,007.38
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	201,407,297.57
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,042,557.40
	THAIGB 2.65% 06/17/28	70,000,000.00	70,468,342.00
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	95,684,469.92
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	102,762,965.10
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	66,577,997.16
	THAIGB 2% 12/17/31	113,000,000.00	107,004,644.88
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	153,606,207.80
	THAIGB 3.35% 06/17/33	71,000,000.00	74,496,835.20
	THAIGB 3.39% 06/17/37	46,000,000.00	48,262,588.20
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	165,029,110.20
	THAIGB 3.45% 06/17/43	52,000,000.00	53,890,454.80
THAIGB 3.65% 06/20/31	116,500,000.00	123,915,865.75	
THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	194,440,752.00	
THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	108,991,431.22	

	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	134,523,504.15	
	タイパーツ 小計	2,676,800,000.00	2,676,873,386.91 (11,135,793,289)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,078,945.10	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	29,078,945.10 (75,299,928)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,898,301,420.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,170,227,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	60,662,681,100.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	59,000,000,000.00	57,997,875,560.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,806,849,280.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,532,252,934.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	61,460,600,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,898,507,534.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	43,500,000,000.00	43,583,302,500.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	75,108,447,185.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	50,145,080,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,990,900,800.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	16,000,000,000.00	16,555,440,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	38,800,000,000.00	39,857,994,520.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	13,500,000,000.00	13,982,625,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	41,000,000,000.00	43,415,826,600.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	20,842,483,770.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	58,700,000,000.00	62,152,381,800.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,481,618,240.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	61,000,000,000.00	63,016,050,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,479,601,360.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	55,000,000,000.00	56,423,202,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,400,954,120.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	46,200,000,000.00	49,965,452,460.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,707,570,300.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,849,263,600.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	35,600,000,000.00	36,036,100,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	49,412,954,800.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,621,630,740.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	42,322,333,980.00	
INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	26,699,919,930.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,424,800,740.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	32,021,241,490.00		
	インドネシアルピア 小計	1,146,200,000,000.00	1,187,924,470,763.00 (11,404,074,919)	
	SAGB 10.5% 12/21/26	198,400,000.00	207,367,680.00	

南アフリカ ランド	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	46,428,210.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	58,100,000.00	34,485,255.00	
	SAGB 7% 02/28/31	83,700,000.00	68,031,360.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000.00	140,666,725.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	129,700,000.00	99,596,630.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	81,967,200.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	132,086,815.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	124,741,100.00	
	SAGB 8% 01/31/30	190,600,000.00	171,177,860.00	
	SAGB 9% 01/31/40	118,300,000.00	91,008,190.00	
南アフリカランド 小計		1,461,200,000.00	1,197,557,025.00	(9,424,773,786)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,578,030.28	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,209,161.64	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,006,400.20	
	CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	21,065,213.40	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,085,041.60	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,428,946.16	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,034,222.20	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,876,919.83	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	17,995,992.24	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	5,025,249.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,000,000.00	10,100,365.00	
	CGB 2.67% 05/25/33	2,000,000.00	2,019,254.20	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,528,132.45	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,140,283.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,072,682.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,782,591.74	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,063,228.59	
	CGB 2.76% 05/15/32	4,500,000.00	4,553,129.70	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,176,353.20	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,204,380.40	
	CGB 2.8% 03/25/30	9,000,000.00	9,147,868.20	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,045,911.15	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,767,235.22	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,733,991.28	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,635,519.48	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,174,433.60	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,143,112.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,271,600.10	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,085,267.22	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,790,473.05	
CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,442,888.01		

	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,946,070.30	
	CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	4,789,454.68	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,608,382.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,626,663.93	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,305,103.05	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,157,172.00	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,676,770.60	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,752,736.50	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,198,078.20	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,093,971.32	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,866,956.96	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,325,999.60	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,862,447.76	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,818,795.40	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	19,300,647.30	
	オフショア人民元 小計	564,200,000.00	579,513,125.74 (11,661,600,580)	
	合計		111,801,079,157 (111,801,079,157)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルレアル	国債証券 10銘柄	100.0%	10.3%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.4%
ペルーソル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.5%
ウルグアイペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 21銘柄	100.0%	6.2%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.0%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.6%
ルーマニアレイ	国債証券 22銘柄	100.0%	3.8%
マレーシアリンギット	国債証券 22銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券 24銘柄	100.0%	10.0%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%

インドネシアルピア	国債証券	33銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券	11銘柄	100.0%	8.4%
オフショア人民元	国債証券	46銘柄	100.0%	10.4%

(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。



## 2【ファンドの現況】

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030】

## 【純資産額計算書】

（2023年 9月29日現在）

資産総額	2,686,120,602円
負債総額	6,708,846円
純資産総額（ - ）	2,679,411,756円
発行済口数	2,098,259,555口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2770円
（1万口当たり純資産額）	（12,770円）

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040】

## 【純資産額計算書】

（2023年 9月29日現在）

資産総額	2,066,187,048円
負債総額	1,053,827円
純資産総額（ - ）	2,065,133,221円
発行済口数	1,516,367,864口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3619円
（1万口当たり純資産額）	（13,619円）

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050】

## 【純資産額計算書】

（2023年 9月29日現在）

資産総額	788,883,352円
負債総額	2,028,389円
純資産総額（ - ）	786,854,963円
発行済口数	546,519,634口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4398円
（1万口当たり純資産額）	（14,398円）

## 【DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060】

## 【純資産額計算書】

(2023年 9月29日現在)

資産総額	783,269,804円
負債総額	312,316円
純資産総額（ - ）	782,957,488円
発行済口数	512,899,540口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5265円
（1万口当たり純資産額）	（15,265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 9月29日現在)

資産総額	576,561,406,217円
負債総額	1,590,814,436円
純資産総額（ - ）	574,970,591,781円
発行済口数	241,335,122,049口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3825円
（1万口当たり純資産額）	（23,825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 9月29日現在)

資産総額	592,310,603,348円
負債総額	2,293,832,264円
純資産総額（ - ）	590,016,771,084円
発行済口数	114,550,350,613口
1口当たり純資産額（ / ）	5.1507円
（1万口当たり純資産額）	（51,507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 9月29日現在)

資産総額	159,043,288,680円
負債総額	583,678,641円
純資産総額（ - ）	158,459,610,039円
発行済口数	41,313,395,771口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8356円
（1万口当たり純資産額）	（38,356円）

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 9月29日現在)

資産総額	649,199,030,943円
負債総額	6,436,894,364円
純資産総額（ - ）	642,762,136,579円
発行済口数	483,220,223,273口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3302円
（1万口当たり純資産額）	（13,302円）

## 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

(2023年 9月29日現在)

資産総額	69,437,012,957円
負債総額	1,654,084,134円
純資産総額（ - ）	67,782,928,823円
発行済口数	83,886,996,894口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8080円
（1万口当たり純資産額）	（8,080円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2023年 9月29日現在)

資産総額	290,241,799,376円
負債総額	1,718,625,493円
純資産総額（ - ）	288,523,173,883円

発行済口数	88,072,918,522口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2760円
（1万口当たり純資産額）	（32,760円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 純資産額計算書

（2023年 9月29日現在）

資産総額	119,022,929,839円
負債総額	3,059,620,855円
純資産総額（ - ）	115,963,308,984円
発行済口数	55,396,149,278口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0933円
（1万口当たり純資産額）	（20,933円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)名義書換等

該当事項はありません。

### (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (3)譲渡制限

該当事項はありません。

### (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

#### 受益権の譲渡

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

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

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

### 受益権の譲渡の対抗要件

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

### 受益権の再分割

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

### 償還金

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

### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2023年 9月29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年間に於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

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ 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11月28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9月29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	530	14,341,707
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	215,927
単位型公社債投資信託	51	169,297
合計	648	14,726,931

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位:百万円)	
		前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		21,675	23,067
金銭の信託		14,913	14,693
前払費用		166	198
未収委託者報酬		9,067	9,147
未収運用受託報酬		6,252	5,815
未収収益		179	176
短期差入証拠金		2,528	3,541
その他		2,363	1,566
流動資産合計		57,146	58,207
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	289	255
器具備品	1	687	560
有形固定資産合計		976	816
無形固定資産			
ソフトウェア		6,292	7,203
その他		31	40
無形固定資産合計		6,324	7,244
投資その他の資産			
投資有価証券		6,607	4,063
関係会社株式		5,636	5,636
繰延税金資産		907	1,181
その他		31	31
投資その他の資産合計		13,182	10,911
固定資産合計		20,482	18,972
資産合計		77,629	77,179

		(単位:百万円)	
		前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部			



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

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

前事業年度

当事業年度

（自 2021年4月1日  
至 2022年3月31日）（自 2022年4月1日  
至 2023年3月31日）

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

（単位：百万円）

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

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

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

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

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 6．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金

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

##### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

#### 7．収益及び費用の計上基準

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

##### （1）投資信託委託業務

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

## (2) 投資一任業務

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

## (3) 投資助言業務

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

## (4) 成功報酬

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

## 8. ヘッジ会計の会計処理

## (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

## (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

## (3) ヘッジ方針

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

## (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

## 9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

## (会計方針の変更)

## 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

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

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

## (表示方法の変更)

## (貸借対照表関係)

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

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

## (貸借対照表関係)

## 1有形固定資産の減価償却累計額

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

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

## (リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

##### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

##### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

### 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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



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

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年3月31日）

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

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

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

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

## 2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

（デリバティブ取引関係）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## （1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## （2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

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

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表  
該当事項はありません。

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

(税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	112 百万円	58 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177 "	187 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	251 "	277 "
税務上の収益認識差額	74 "	- "
税務上の費用認識差額	439	412
繰延ヘッジ損益	224 "	225 "

その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## 3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

### （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

### （収益認識関係）

#### 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

#### 3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

### （セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

#### [関連情報]

#### 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

#### 2. 地域ごとの情報

##### （1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

##### （2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

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

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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	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

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 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(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	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

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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11月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2023年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （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

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030の2023年8月28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、継続企業的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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040の2023年8月28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、継続企業的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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050の2023年8月28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、継続企業的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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2023年11月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2022年8月30日から2023年8月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060の2023年8月28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、継続企業的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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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드는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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。