

【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】	2024年1月19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】	SMT インデックスバランス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

SMT インデックスバランス・オープン

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

（６）【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2024年 1月20日から2024年 7月22日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ
ないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに
運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産
を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産
を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉と
する旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉
とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉
とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質
的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする
旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記
(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、
その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産に
よる投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定
する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場
証券投資信託をいう。

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1) 株式
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

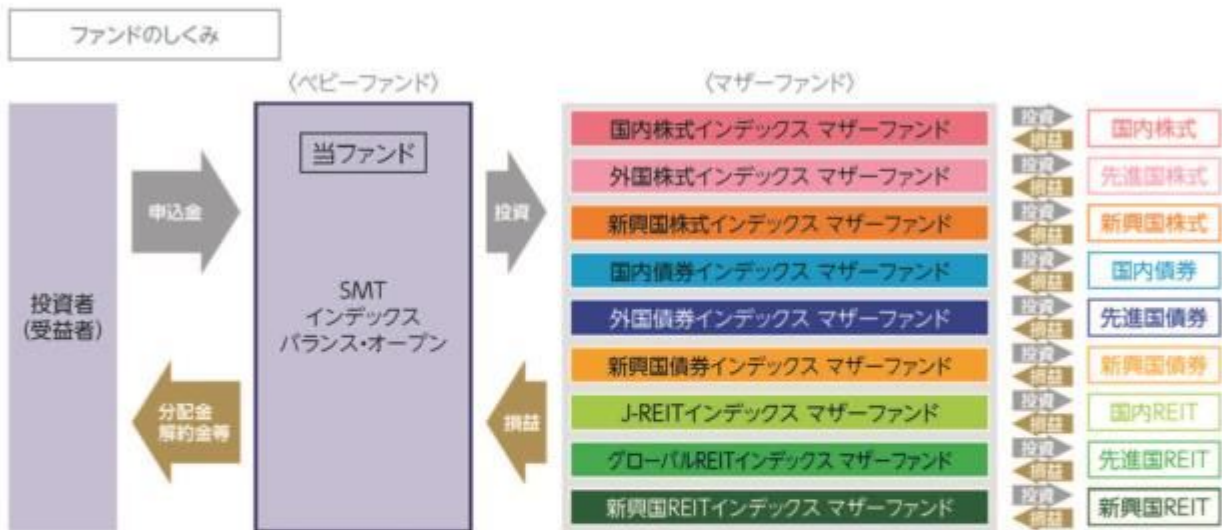
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

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 >

特色1 世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及び不動産投資信託証券(REIT)に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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



? ファミリーファンド方式とは

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

? DR(預託証券)とは

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

? REITとは

REITは Real Estate Investment Trust の略称です。
REITは、投資者から集めた資金で、不動産への投資を行い、そこから得られる賃貸料収入や不動産の売買益を原資として投資者に配当する商品です。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本資産配分比率に基づき、各資産のマザー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。

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

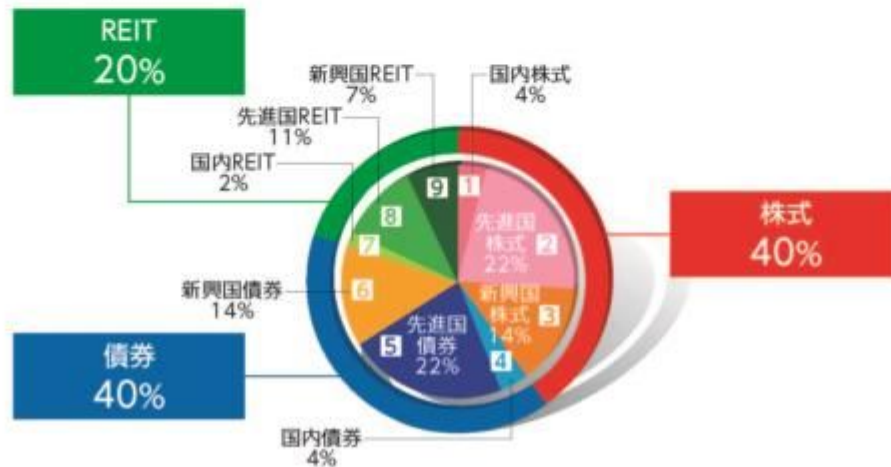
ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

特色2 株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率
(2023年11月末現在)



●市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で資産配分比率を調整します。

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数)(配当込み) ^{※1}
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) ^{※2}
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) ^{※3}
4 国内債券	NOMURA-BPI総合 ^{※4}
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) ^{※5}
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・ディバーシファイド(円換算ベース) ^{※6}
7 国内REIT	東証REIT指数(配当込み) ^{※7}
8 先進国REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース) ^{※8}
9 新興国REIT	S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース) ^{※9}

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

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

- ※1 「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に係る商標又は商標は、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に係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※2 「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 「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 「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 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド」とは、新興国の現地通貨債権市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※7 「東証REIT指数」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る商標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。
- ※8 「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。
- ※9 「S&P新興国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、新興国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P新興国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's[®]及びS&P[®]は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

特色3 世界経済全体の発展を享受します。

- 地域別の基本組入比率は、地域別(国内、先進国及び新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定するものとします。また、基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
 - 地域別の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



(出所) IMF「世界経済見通し2022年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。

※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※当ファンドの地域別構成比は、2023年11月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

分配方針

- 年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 投資信託証券(REIT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。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2014年11月28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11月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」及び「新興国REITインデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。
- ロ．株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。
- ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ホ．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。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 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の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

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

13号及び第14号の証券(「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

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

(参考) マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し

得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。)への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、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。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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。

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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ならびに委託会社が適当

と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。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、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に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ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。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、ならびに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率

は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

「新興国REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場しているREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数（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。

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

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

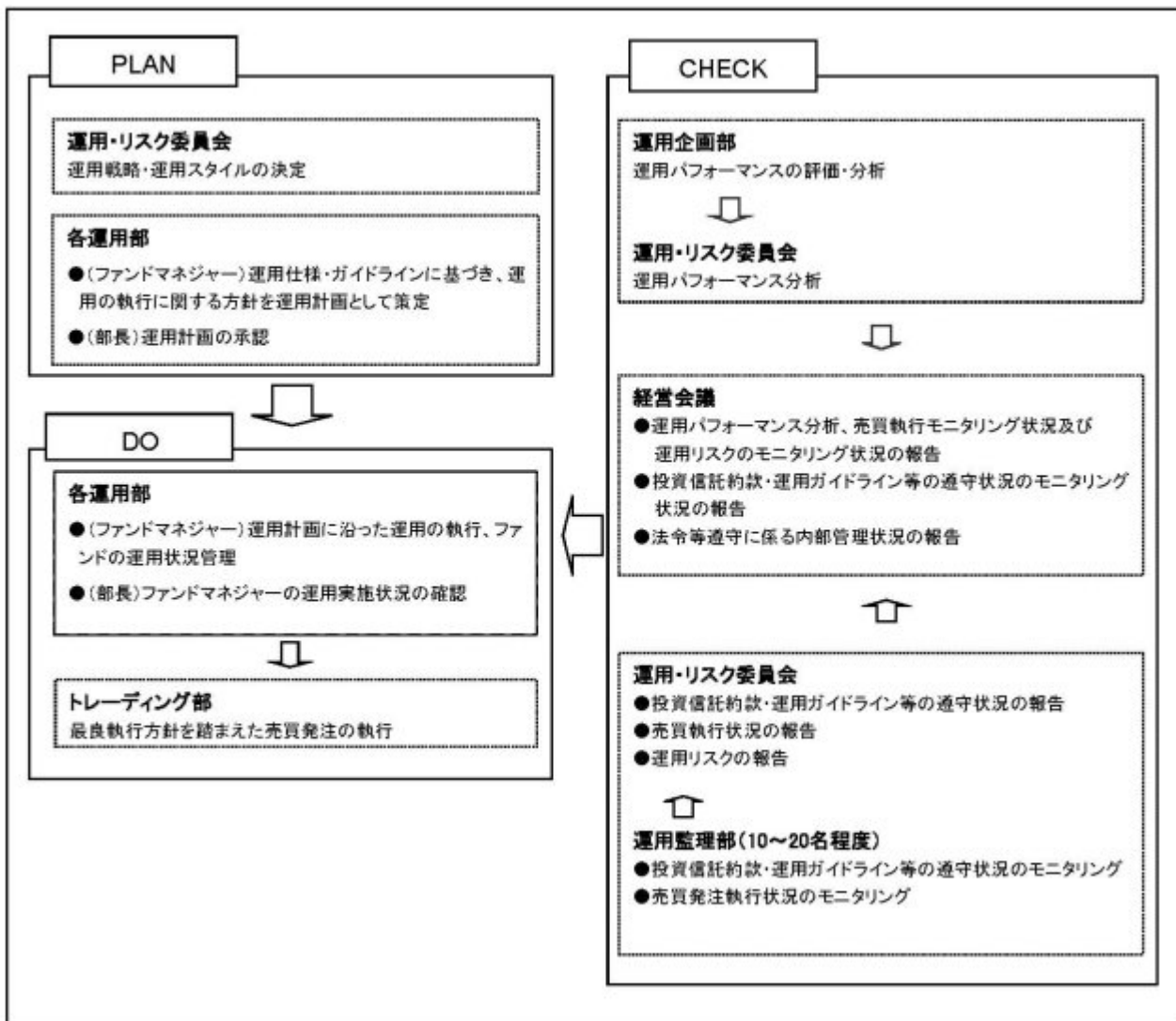
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- ・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式等への投資割合

株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の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、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指

図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとし
ます。（以下同じ。）

- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の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、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の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、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

のとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

カ．資金の借入れ

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

の翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

リートの価格変動リスク

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

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。

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>

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

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

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- *2018年12月～2023年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く測る指数として、投資対象としての可能性を有するマーケット・セクター・マクロ、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、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利、ノウハウ及び同指数に係る権利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、配当利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 Emerging Markets インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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、配当利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、野村フィナンシャルグループの野村フィナンシャルコンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募定期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ナンシャルグループの野村フィナンシャルコンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィナンシャルグループの野村フィナンシャル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にサービスに限り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、本ファンドのスパンサーではなく、本ファンドの推薦、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何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Emerging Markets Bond Index (配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が低いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.55%（税抜 0.5%）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 0.22% (税抜 0.2%)	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 0.275% (税抜 0.25%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

（4）【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息

（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年1月1日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率（1+2）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.63%	0.54%	0.09%

※対象期間は2023年4月21日～2023年10月20日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した値（年率）です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2023年11月30日現在の状況について記載してあります。

【SMT インデックスバランス・オープン】

(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	2,743,406,731	99.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		24,879,187	0.90
合計(純資産総額)		2,768,285,918	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	122,697,858	5.1177	627,939,488	5.3682	658,666,641	23.79
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	174,308,582	3.2527	566,980,262	3.3866	590,313,443	21.32
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	180,963,283	2.0827	376,897,967	2.1854	395,477,158	14.29
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	94,066,737	3.7906	356,573,946	3.9304	369,719,903	13.36
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	109,789,538	2.4119	264,807,502	2.5830	283,586,376	10.24
日本	親投資信託受益証券	新興国REITインデックス マザーファンド	225,420,520	0.7783	175,446,838	0.8007	180,494,210	6.52
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	49,229,341	2.3129	113,863,935	2.4363	119,937,443	4.33
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	71,020,006	1.3187	93,654,504	1.3366	94,925,340	3.43
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	23,614,096	2.0907	49,370,140	2.1295	50,286,217	1.82

(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	99.10
合計	99.10

(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	(2015年 4月20日)	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末	(2015年10月20日)	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末	(2016年 4月20日)	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末	(2016年10月20日)	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末	(2017年 4月20日)	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末	(2017年10月20日)	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
第7期計算期間末	(2018年 4月20日)	3,051,290,712	3,051,290,712	10,234	10,234
第8期計算期間末	(2018年10月22日)	2,916,459,886	2,916,459,886	10,043	10,043
第9期計算期間末	(2019年 4月22日)	2,897,788,604	2,897,788,604	10,631	10,631
第10期計算期間末	(2019年10月21日)	2,862,769,922	2,862,769,922	10,703	10,703
第11期計算期間末	(2020年 4月20日)	2,311,876,858	2,311,876,858	9,578	9,578
第12期計算期間末	(2020年10月20日)	2,413,136,341	2,413,136,341	10,586	10,586
第13期計算期間末	(2021年 4月20日)	2,520,767,080	2,520,767,080	12,311	12,311
第14期計算期間末	(2021年10月20日)	2,749,895,621	2,749,895,621	13,320	13,320
第15期計算期間末	(2022年 4月20日)	2,792,857,082	2,792,857,082	13,960	13,960
第16期計算期間末	(2022年10月20日)	2,684,376,098	2,684,376,098	13,327	13,327
第17期計算期間末	(2023年 4月20日)	2,616,683,538	2,616,683,538	13,549	13,549
第18期計算期間末	(2023年10月20日)	2,682,687,407	2,682,687,407	14,410	14,410
	2022年11月末日	2,697,753,836		13,446	
	12月末日	2,493,554,796		12,812	
	2023年 1月末日	2,580,665,079		13,236	
	2月末日	2,611,372,150		13,379	
	3月末日	2,587,146,198		13,307	
	4月末日	2,591,296,236		13,475	
	5月末日	2,651,506,899		13,850	
	6月末日	2,782,000,634		14,649	
	7月末日	2,793,883,380		14,731	
	8月末日	2,835,137,451		14,913	
	9月末日	2,765,915,672		14,576	
	10月末日	2,657,343,587		14,255	
	11月末日	2,768,285,918		15,041	

【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	2014年11月28日～2015年 4月20日	0
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	0

第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	0
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	0
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	0
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	0
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	0
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	0
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	0
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	0
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	0
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	0
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	0
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	0
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0.1
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	5.0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	5.1
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	3.3
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	7.0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	11.2
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	1.5
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	1.9
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	5.9
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0.7
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	10.5
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	10.5
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	16.3
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	8.2
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	4.8
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	4.5
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	1.7
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	6.4

(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	2014年11月28日～2015年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269

第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	473,012,411	582,449,995	2,981,411,595
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	199,195,642	276,588,300	2,904,018,937
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	166,800,463	345,148,199	2,725,671,201
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	156,918,897	207,929,245	2,674,660,853
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	163,015,795	423,953,521	2,413,723,127
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	126,592,041	260,782,440	2,279,532,728
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	92,056,120	324,043,645	2,047,545,203
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	106,905,068	90,001,351	2,064,448,920
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	85,522,955	149,318,352	2,000,653,523
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	91,167,976	77,540,998	2,014,280,501
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	68,352,579	151,322,378	1,931,310,702
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	64,015,814	133,663,352	1,861,663,164

(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	585,530,811,600	98.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,557,284,416	1.27
合計(純資産総額)		593,088,096,016	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	7,436,880,000	1.25

(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	9,523,200	1,939.46	18,469,906,255	2,794.50	26,612,582,400	4.49
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,226,800	13,265.89	16,274,598,820	12,820.00	15,727,576,000	2.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,697,400	932.95	9,980,187,472	1,255.00	13,425,237,000	2.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	173,500	68,494.40	11,883,778,534	63,350.00	10,991,225,000	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	51,740,600	162.87	8,426,998,967	173.10	8,956,297,860	1.51
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	367,100	19,732.85	7,243,931,742	24,025.00	8,819,577,500	1.49
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,214,500	5,672.66	6,889,457,497	7,258.00	8,814,841,000	1.49
日本	株式	日立製作所	電気機器	842,300	8,151.34	6,865,873,682	10,285.00	8,663,055,500	1.46
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,212,000	6,004.29	7,277,206,437	6,886.00	8,345,832,000	1.41
日本	株式	信越化学工業	化学	1,575,300	4,412.24	6,950,614,790	5,212.00	8,210,463,600	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	1,095,000	5,917.03	6,479,157,439	6,912.00	7,568,640,000	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	1,382,600	4,700.59	6,499,042,689	5,392.00	7,454,979,200	1.26
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,320,000	4,444.98	5,867,375,447	5,505.00	7,266,600,000	1.23
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,233,500	4,989.42	6,154,457,475	5,738.00	7,077,823,000	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,539,400	4,534.95	6,981,111,922	4,165.00	6,411,601,000	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,229,400	1,345.49	5,690,642,880	1,509.00	6,382,164,600	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,344,100	4,357.71	5,857,204,434	4,625.00	6,216,462,500	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,688,400	3,114.96	5,259,311,192	3,648.00	6,159,283,200	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	1,515,300	4,536.70	6,874,470,520	4,000.00	6,061,200,000	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,305,600	2,082.05	4,800,394,067	2,512.00	5,791,667,200	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	344,500	17,133.38	5,902,452,381	16,665.00	5,741,092,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	858,100	5,563.29	4,773,864,377	6,020.00	5,165,762,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,798,400	1,513.01	4,234,018,246	1,798.50	5,032,922,400	0.85
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	943,600	5,370.07	5,067,204,414	5,025.00	4,741,590,000	0.80
日本	株式	ダイキン工業	機械	209,100	26,724.02	5,587,993,967	22,155.00	4,632,610,500	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,578,100	2,750.94	4,341,264,707	2,883.50	4,550,451,350	0.77
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,037,700	3,086.87	3,203,247,397	3,801.00	3,944,297,700	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,949,600	1,823.38	3,554,876,734	2,009.00	3,916,746,400	0.66
日本	株式	S M C	機械	52,400	74,502.10	3,903,910,219	74,450.00	3,901,180,000	0.66
日本	株式	丸紅	卸売業	1,529,900	2,116.76	3,238,433,557	2,307.00	3,529,479,300	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	0.08
		鉱業	0.37
		建設業	2.05
		食料品	3.39
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.17

化学	5.90
医薬品	4.69
石油・石炭製品	0.47
ゴム製品	0.71
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.97
非鉄金属	0.68
金属製品	0.52
機械	5.15
電気機器	17.08
輸送用機器	8.56
精密機器	2.30
その他製品	2.27
電気・ガス業	1.36
陸運業	2.74
海運業	0.74
空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	7.59
卸売業	6.93
小売業	4.22
銀行業	7.08
証券、商品先物取引業	0.78
保険業	2.41
その他金融業	1.14
不動産業	1.93
サービス業	4.75
小計	98.73
合計	98.73

(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	313円		7,152,618,900	7,436,880,000	1.25

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	546,867,841,380	84.47
地方債証券	日本	32,698,410,363	5.05
特殊債券	日本	36,722,092,656	5.67
	国際機関	299,817,000	0.05
	小計	37,021,909,656	5.72
社債券	日本	27,672,805,000	4.27
	フランス	1,393,299,000	0.22
	韓国	99,524,000	0.02
	小計	29,165,628,000	4.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,649,604,018	0.25
合計(純資産総額)		647,403,393,417	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	99.59	6,642,986,500	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,010,000,000	100.15	6,019,494,300	99.87	6,002,307,200	0.005	2026/6/20	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	100.09	5,905,723,000	0.100	2026/9/20	0.91
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	99.98	5,809,007,400	99.57	5,785,307,500	0.005	2027/6/20	0.89
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.98	5,749,022,500	0.100	2027/3/20	0.89
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,740,000,000	100.08	5,744,592,000	99.75	5,725,994,400	0.005	2026/12/20	0.88
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,680,000,000	100.05	5,683,361,000	99.83	5,670,457,600	0.005	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,550,000,000	98.02	5,440,214,200	96.65	5,364,352,500	0.200	2032/9/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,320,000,000	98.19	5,223,724,000	97.16	5,168,912,000	0.100	2031/6/20	0.80
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,150,000,000	100.32	5,166,798,000	100.17	5,158,755,000	0.100	2025/6/20	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	99.71	5,145,448,800	0.100	2027/12/20	0.79
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	100.37	5,138,944,000	100.17	5,128,755,200	0.100	2025/9/20	0.79
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,090,000,000	100.30	5,105,270,000	99.82	5,081,296,100	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.56	5,048,312,800	0.300	2025/12/20	0.78
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,040,000,000	100.12	5,046,399,600	99.91	5,035,917,600	0.005	2026/3/20	0.78

日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,060,000,000	98.53	4,985,618,000	97.18	4,917,459,800	0.200	2032/3/20	0.76
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	5,077,000,000	97.88	4,969,367,600	96.60	4,904,585,080	0.100	2031/12/20	0.76
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,050,000,000	98.02	4,950,010,000	96.85	4,890,925,000	0.100	2031/9/20	0.76
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,980,000,000	98.37	4,898,853,100	96.94	4,827,761,400	0.200	2032/6/20	0.75
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	4,930,000,000	97.58	4,810,730,100	97.70	4,816,955,100	0.400	2033/6/20	0.74
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	99.45	4,808,842,650	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	4,800,000,000	100.39	4,818,720,000	100.15	4,807,344,000	0.100	2025/12/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債（10年）	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	98.81	4,802,360,400	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	100.13	4,766,521,200	0.100	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,860,000,000	98.68	4,795,891,000	97.94	4,760,272,800	0.100	2030/9/20	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	97.42	4,725,015,500	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	97.67	4,698,119,400	0.100	2030/12/20	0.73
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	4,745,000,000	98.91	4,693,345,850	98.21	4,660,064,500	0.100	2030/6/20	0.72
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	4,660,000,000	99.71	4,646,486,000	99.06	4,616,196,000	0.100	2029/3/20	0.71
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	99.64	4,643,224,000	98.93	4,610,371,000	0.100	2029/6/20	0.71

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.47
地方債証券	5.05
特殊債券	5.72
社債券	4.51
合計	99.75

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	427,826,050,384	68.43
	イギリス	24,535,845,183	3.92
	カナダ	20,598,229,572	3.29

	スイス	19,335,080,055	3.09
	フランス	19,213,288,078	3.07
	ドイツ	14,947,460,475	2.39
	オランダ	11,659,013,675	1.86
	オーストラリア	11,327,812,044	1.81
	アイルランド	11,123,914,897	1.78
	デンマーク	5,873,700,448	0.94
	スウェーデン	5,338,030,291	0.85
	スペイン	4,726,112,078	0.76
	イタリア	3,387,217,164	0.54
	香港	2,876,584,176	0.46
	シンガポール	1,916,162,023	0.31
	フィンランド	1,881,271,096	0.30
	ジャージー	1,624,023,183	0.26
	ベルギー	1,348,366,625	0.22
	イスラエル	1,171,991,204	0.19
	ノルウェー	1,170,267,622	0.19
	バミューダ	922,845,928	0.15
	キュラソー	841,326,685	0.13
	ケイマン	795,355,354	0.13
	ニュージーランド	437,882,141	0.07
	オーストリア	348,372,821	0.06
	ルクセンブルク	345,322,884	0.06
	ポルトガル	345,295,199	0.06
	リベリア	266,601,960	0.04
	パナマ	157,465,952	0.03
	マン島	74,201,499	0.01
	小計	596,415,090,696	95.39
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	110,452,209	0.02
	香港	49,850,640	0.01
	小計	160,302,849	0.03
投資証券	アメリカ	10,247,985,758	1.64
	オーストラリア	723,567,687	0.12
	フランス	247,809,948	0.04
	シンガポール	242,107,133	0.04
	イギリス	185,875,117	0.03
	香港	122,317,004	0.02
	カナダ	53,446,330	0.01
	ベルギー	53,228,088	0.01
	小計	11,876,337,065	1.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,759,607,956	2.68

合計(純資産総額)	625,211,338,566	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	12,237,152,379	1.96
	買建	カナダ	550,786,735	0.09
	買建	ドイツ	2,254,176,226	0.36
	買建	イギリス	876,168,430	0.14
	買建	オーストラリア	653,041,685	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		547,796,988	0.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,205,677	25,773.89	31,074,996,401	27,850.64	33,578,883,197	5.37
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	541,466	48,933.87	26,496,027,871	55,717.46	30,169,115,340	4.83
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	707,853	17,680.11	12,514,925,712	21,519.28	15,232,488,605	2.44
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	189,337	57,414.87	10,870,761,095	70,799.49	13,404,964,553	2.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	455,405	18,326.41	8,345,940,818	19,852.97	9,041,146,038	1.45
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	169,572	38,656.83	6,555,116,319	48,856.65	8,284,720,532	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	405,242	18,439.83	7,472,596,280	20,060.34	8,129,295,544	1.30
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	218,306	28,608.33	6,245,371,237	35,905.66	7,838,423,151	1.25
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	71,368	70,969.75	5,064,969,394	78,679.50	5,615,199,170	0.90

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	61,851	63,218.72	3,910,141,157	87,044.85	5,383,811,030	0.86
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	98,928	47,235.98	4,672,961,275	52,752.53	5,218,703,109	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	20,153.74	4,514,579,224	22,695.84	5,084,027,568	0.81
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	33,885	116,488.25	3,947,204,355	138,367.86	4,688,595,211	0.75
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	309,867	15,448.15	4,786,874,551	15,051.14	4,663,852,776	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,044	33,110.86	4,107,203,650	37,389.60	4,637,956,299	0.74
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	184,567	22,678.67	4,185,734,718	22,370.81	4,128,914,710	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	180,673	21,410.15	3,868,237,273	22,226.68	4,015,762,600	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	55,023.25	3,569,358,343	60,272.22	3,909,859,391	0.63
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	249,398	12,351.08	3,080,335,999	14,932.40	3,724,111,693	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	43,015.87	3,315,104,781	45,741.71	3,525,176,472	0.56
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	204,668	18,829.10	3,853,714,764	16,709.35	3,419,869,819	0.55
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,939	61,442.58	2,146,742,627	90,799.54	3,172,445,383	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	30,700	109,695.43	3,367,649,821	101,622.09	3,119,798,224	0.50
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	139,075	22,675.66	3,153,617,469	21,164.84	2,943,500,638	0.47
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	33,969	74,779.06	2,540,170,210	86,456.57	2,936,843,233	0.47
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	194,506	16,318.22	3,173,992,577	14,873.18	2,892,924,519	0.46
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	135,241	20,271.73	2,741,570,043	20,369.19	2,754,750,301	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	314,924	8,842.74	2,784,793,360	8,563.88	2,696,973,266	0.43
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	113,530	21,600.25	2,452,276,473	22,954.68	2,606,045,456	0.42
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	105,521	26,899.21	2,838,432,069	24,584.22	2,594,151,605	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
----	-------	----	----------

株式	外国	エネルギー	4.80
		素材	3.90
		資本財	6.50
		商業・専門サービス	1.55
		運輸	1.72
		自動車・自動車部品	2.03
		耐久消費財・アパレル	1.52
		消費者サービス	2.03
		メディア・娯楽	5.88
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.48
		生活必需品流通・小売り	1.64
		食品・飲料・タバコ	3.53
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		ヘルスケア機器・サービス	4.29
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.74
		銀行	5.18
		金融サービス	6.48
		保険	3.09
		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	10.17
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.77
		電気通信サービス	1.18
		公益事業	2.66
半導体・半導体製造装置	6.19		
不動産管理・開発	0.33		
	小計	95.39	
新株予約権証券			
投資信託受益証券		0.03	
投資証券		1.90	
合計		97.32	

(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	365	アメリカドル	79,245,385.75	11,654,618,882	83,206,312.5	12,237,152,379	1.96
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	21	カナダドル	4,942,688.5	534,848,322	5,089,980	550,786,735	0.09

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	36	スイスフラン	3,875,732	653,293,386	3,890,520	655,786,051	0.10
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	226	ユーロ	9,414,993.2	1,520,615,551	9,896,540	1,598,390,175	0.26
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	38	オーストラリアドル	6,620,866	645,203,392	6,701,300	653,041,685	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	63	イギリス債券	4,746,086.25	886,758,755	4,689,405	876,168,430	0.14

(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	2,500,000.00	367,225,000	367,615,500	0.06
	ユーロ	買建	660,000.00	106,543,140	106,545,648	0.02
	デンマーククローネ	買建	3,400,000.00	73,746,000	73,635,840	0.01

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

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

外国債券インデックス 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	140,805,199,053	46.68
	フランス	25,065,649,480	8.31
	イタリア	22,376,931,151	7.42
	中国	21,128,113,531	7.00
	ドイツ	19,133,612,684	6.34
	イギリス	15,053,702,062	4.99
	スペイン	14,794,292,797	4.90
	カナダ	5,840,694,005	1.94
	ベルギー	5,232,080,237	1.73
	オランダ	4,498,199,276	1.49
	オーストラリア	4,360,754,509	1.45
	オーストリア	3,516,646,524	1.17
	メキシコ	2,676,592,983	0.89
	アイルランド	1,730,735,646	0.57
	フィンランド	1,555,892,322	0.52
	ポーランド	1,520,215,475	0.50
	マレーシア	1,517,130,972	0.50
	シンガポール	1,275,147,730	0.42
デンマーク	949,918,254	0.31	

	イスラエル	920,156,424	0.31
	ニュージーランド	692,346,315	0.23
	スウェーデン	612,922,832	0.20
	ノルウェー	522,064,787	0.17
	小計	295,778,999,049	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,883,926,976	1.95
合計(純資産総額)		301,662,926,025	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	1,241,417,893	0.41
	買建	ドイツ	1,204,614,259	0.40

(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		2,802,308,961	0.93

(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	14,901.21	2,086,170,353	14,526.60	2,033,725,334	4.125	2032/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,505.43	1,742,201,514	13,069.69	1,685,990,956	2.750	2032/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,801.31	1,613,373,498	13,781.78	1,611,090,113	2.375	2027/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,955.15	1,562,977,161	13,833.77	1,549,382,451	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,156.10	1,529,238,081	11,857.23	1,491,639,725	1.375	2031/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,574.65	1,461,990,674	13,732.66	1,479,007,617	1.625	2026/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,212.98	1,449,724,467	14,312.61	1,459,886,327	3.125	2025/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/24	10,150,000	14,153.76	1,436,607,045	14,303.22	1,451,777,074	2.250	2024/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,624.75	1,479,621,060	12,278.33	1,439,020,775	1.875	2032/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,989.78	1,407,372,295	13,869.10	1,395,231,771	2.875	2028/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,768.18	1,406,298,131	11,598.70	1,386,045,840	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	14,031.36	1,290,885,606	14,561.07	1,339,619,259	4.125	2030/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,668.31	1,380,500,131	13,242.33	1,337,475,554	2.875	2032/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,954.89	1,332,970,805	11,755.54	1,310,743,428	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	14,085.72	1,267,714,905	14,215.23	1,279,371,122	2.875	2025/11/30	0.42

アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	13,306.96	1,264,161,444	13,458.34	1,278,542,422	0.750	2026/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,991.75	1,231,274,639	14,179.15	1,247,765,682	1.500	2024/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	8,850,000	14,045.93	1,243,065,049	14,097.46	1,247,625,548	3.125	2027/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,637.96	1,213,244,778	12,698.57	1,219,063,230	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,804.56	1,216,434,064	12,783.88	1,214,469,301	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	14,048.63	1,188,514,268	14,187.08	1,200,227,357	2.000	2025/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,824.86	1,175,113,713	14,019.04	1,191,618,881	1.125	2025/2/28	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,496.69	1,241,642,729	10,936.60	1,181,153,634	2.875	2052/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	14,110.38	1,185,272,743	13,957.28	1,172,412,169	3.125	2028/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,579.61	1,185,322,665	14,380.97	1,169,173,320	3.875	2029/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,837.26	1,155,353,453	12,869.77	1,158,279,652	1.250	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	13,761.19	1,131,170,095	13,833.48	1,137,112,438	2.875	2028/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	8,000,000	13,865.94	1,109,275,475	14,092.43	1,127,394,558	1.000	2024/12/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,570.94	1,085,675,340	13,799.01	1,103,921,209	0.375	2025/4/30	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	8,480,000	12,946.18	1,097,836,188	12,953.36	1,098,445,149	1.250	2028/3/31	0.36

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.05
合計	98.05

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

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	32	アメリカドル	3,422,660	503,370,606	3,430,500.16	504,523,658	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	22	アメリカドル	2,418,358.44	355,667,975	2,426,875	356,920,506	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	22	アメリカドル	2,564,288.12	377,129,854	2,583,625	379,973,729	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	14	ユーロ	1,472,434.4	237,812,880	1,475,740	238,346,767	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	17	ユーロ	1,986,165.7	320,785,622	2,001,410	323,247,729	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	30	ユーロ	3,927,853	634,387,538	3,981,300	643,019,763	0.21

(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	9,470,000.00	1,407,874,372	1,389,373,057	0.46

カナダドル	買建	1,030,000.00	111,995,649	111,216,516	0.04
ユーロ	買建	5,780,000.00	938,575,157	931,853,334	0.31
イギリスポンド	買建	820,000.00	152,533,196	152,856,774	0.05
オフショア人民元	買建	10,550,000.00	218,357,960	217,009,280	0.07

(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	25,660,512,416	15.47
	インド	24,708,524,712	14.89
	台湾	24,215,337,549	14.60
	韓国	19,817,181,627	11.95
	中国	16,356,680,401	9.86
	ブラジル	8,457,468,608	5.10
	サウジアラビア	6,335,891,849	3.82
	南アフリカ	4,525,599,465	2.73
	メキシコ	3,829,563,472	2.31
	インドネシア	2,932,612,365	1.77
	タイ	2,797,680,858	1.69
	マレーシア	2,148,946,737	1.30
	アラブ首長国連邦	2,065,920,442	1.25
	香港	1,474,834,345	0.89
	カタール	1,424,578,182	0.86
	ポーランド	1,360,217,285	0.82
	クウェート	1,201,517,754	0.72
	トルコ	1,072,253,665	0.65
	フィリピン	974,100,326	0.59
	チリ	746,474,201	0.45
	ギリシャ	731,045,327	0.44
	バミューダ	615,315,710	0.37
	アメリカ	586,477,176	0.35
	ハンガリー	403,671,052	0.24
	チェコ	262,701,900	0.16
	ルクセンブルク	210,857,796	0.13
	イギリス	190,535,681	0.11
	コロンビア	147,850,850	0.09
	エジプト	83,162,202	0.05
	シンガポール	24,997,854	0.02
ペルー	23,878,094	0.01	

	オランダ	19,148,283	0.01
	ロシア	126	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	155,405,538,310	93.68
投資信託受益証券	ブラジル	379,096,117	0.23
	メキシコ	120,187,271	0.07
	小計	499,283,388	0.30
投資証券	メキシコ	91,040,671	0.05
	南アフリカ	39,872,953	0.02
	小計	130,913,624	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,851,144,557	5.94
合計(純資産総額)		165,886,879,879	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,857,991,797	5.94

(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		326,908,637	0.20
	売建		2,507,247	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	2,624.36	10,199,288,500	2,704.45	10,510,577,377	6.34
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,059,100	5,780.11	6,121,716,619	5,972.28	6,325,241,748	3.81
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	8,021.23	6,019,925,094	8,295.07	6,225,441,740	3.75

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	1,547.70	4,030,207,851	1,369.66	3,566,599,036	2.15
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	481,342	4,112.95	1,979,738,948	4,272.88	2,056,721,418	1.24
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	15,932.09	1,505,359,749	20,844.23	1,969,488,020	1.19
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,447.76	1,303,431,032	2,597.19	1,383,002,741	0.83
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	806,150	2,166.60	1,746,604,590	1,704.07	1,373,742,480	0.83
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	812,223	1,668.66	1,355,324,844	1,672.04	1,358,071,782	0.82
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	14,604.80	1,276,021,376	14,878.64	1,299,946,777	0.78
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	84.02	1,277,337,403	84.40	1,283,065,373	0.77
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,647.21	1,221,438,698	2,775.46	1,280,613,428	0.77
ブラジル	株式	VALE SA	素材	525,387	2,111.29	1,109,247,100	2,200.57	1,156,154,385	0.70
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	4,263.99	1,031,051,773	4,466.59	1,080,040,973	0.65
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	3,330.91	1,044,673,931	3,330.91	1,044,673,931	0.63
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	461.26	894,047,204	480.58	931,489,426	0.56
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	2,780.31	855,036,140	2,972.73	914,212,370	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	143,181	5,959.88	853,342,295	6,253.31	895,356,325	0.54
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	6,492.28	863,649,861	6,594.97	877,310,404	0.53
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	25,352.28	775,551,643	26,922.59	823,589,119	0.50
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	1,045.01	760,810,374	1,055.49	768,444,652	0.46
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	351,450	1,972.54	693,251,995	2,168.48	762,113,702	0.46
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	1,923.56	729,244,271	2,008.34	761,385,302	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	8,689,300	86.40	750,755,520	85.44	742,413,792	0.45
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	876.03	683,554,440	932.06	727,270,131	0.44
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,058,000	715.92	757,443,360	673.53	712,594,740	0.43
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,056,515	69.89	702,914,195	70.08	704,808,842	0.42
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,404,200	311.23	748,275,514	291.64	701,168,581	0.42
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	359,795	1,819.15	654,524,672	1,887.51	679,117,380	0.41
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	169,000	4,634.64	783,254,160	3,990.31	674,362,728	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.81
		素材	7.25
		資本財	4.26
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	1.86
		自動車・自動車部品	3.52
		耐久消費財・アパレル	1.19
		消費者サービス	2.23
		メディア・娯楽	6.36
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.40
		生活必需品流通・小売り	1.49
		食品・飲料・タバコ	3.40
		家庭用品・パーソナル用品	0.72
		ヘルスケア機器・サービス	1.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.68
		銀行	15.61
		金融サービス	2.51
		保険	2.48
		ソフトウェア・サービス	2.38
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.66
電気通信サービス	2.59		
公益事業	2.44		
半導体・半導体製造装置	9.34		
不動産管理・開発	1.47		
	小計	93.68	
投資信託受益証券			0.30
投資証券			0.08
合計			94.06

(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	1,361	アメリカドル	65,224,240	9,592,528,976	67,029,250	9,857,991,797	5.94

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,967,073.19	288,958,597	289,250,637	0.17
	香港ドル	買建	2,000,000.00	37,666,000	37,658,000	0.02
	ブラジルリアル	売建	83,685.94	2,523,097	2,507,247	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	12,547,779,295	10.02
	インドネシア	12,435,166,271	9.93
	ブラジル	12,325,629,622	9.84
	タイ	12,321,080,718	9.84
	マレーシア	12,132,543,903	9.69
	中国	12,016,195,235	9.59
	南アフリカ	10,232,558,818	8.17
	ポーランド	9,369,371,505	7.48
	チェコ	7,724,523,773	6.17
	コロンビア	5,503,114,440	4.39
	ルーマニア	4,605,611,475	3.68
	ハンガリー	3,973,702,840	3.17
	ペルー	2,801,884,772	2.24
	チリ	2,428,209,648	1.94
	ウルグアイ	243,289,500	0.19
	ドミニカ共和国	179,185,658	0.14
	フィリピン	74,942,730	0.06
	小計	120,914,790,203	96.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,326,253,528	3.45
合計(純資産総額)		125,241,043,731	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.50	2,291,300,792	3.47	2,265,951,844	9.850	2027/6/28	1.81

ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,408.73	1,842,680,859	2,447.04	1,871,987,266	0.000	2026/1/1	1.49
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,287.28	1,784,084,251	2,334.36	1,820,803,681	0.000	2026/7/1	1.45
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	207,400,000	816.83	1,694,109,050	822.44	1,705,749,893	10.500	2026/12/21	1.36
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000	2,963.52	1,638,830,426	2,979.12	1,647,458,156	10.000	2025/1/1	1.32
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	54,900,000	2,941.26	1,614,754,664	2,975.31	1,633,446,048	10.000	2027/1/1	1.30
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	49,700,000	2,870.53	1,426,653,674	2,932.40	1,457,405,266	10.000	2029/1/1	1.16
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	200,100,000	702.99	1,406,695,190	717.54	1,435,815,299	8.000	2030/1/31	1.15
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	763.62	1,344,738,511	781.00	1,375,342,305	7.750	2031/5/29	1.10
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	772.30	1,353,857,216	781.70	1,370,335,417	5.750	2026/3/5	1.09
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	45,100,000,000	2.81	1,271,045,481	2.89	1,307,694,592	7.250	2034/10/18	1.04
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	41,300,000	3,166.47	1,307,754,641	3,159.26	1,304,777,090	3.885	2029/8/15	1.04
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	38,200,000	3,147.82	1,202,470,666	3,158.18	1,206,427,182	3.733	2028/6/15	0.96
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	45,300,000	2,538.77	1,150,066,014	2,567.85	1,163,240,028	0.000	2025/7/1	0.93
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	809.72	1,130,374,725	825.11	1,151,855,207	8.500	2029/5/31	0.92
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	45,110,000,000	2.44	1,102,092,312	2.52	1,139,557,851	7.250	2050/10/26	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000	660.26	1,092,736,092	676.47	1,119,564,056	8.250	2032/3/31	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	789.64	1,097,610,040	801.83	1,114,550,219	7.500	2027/6/3	0.89
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	128,400,000	830.27	1,066,076,919	834.36	1,071,331,034	8.000	2024/9/5	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	569.04	1,033,957,491	583.33	1,059,916,970	8.750	2048/2/28	0.85
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	37,250,000	2,799.66	1,042,876,390	2,822.79	1,051,490,637	0.000	2024/7/1	0.84
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.93	1,019,188,410	0.93	1,021,181,760	5.500	2026/4/15	0.82
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	639.77	966,060,250	656.33	991,071,135	8.875	2035/2/28	0.79
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,188.58	915,123,990	3,184.60	913,981,386	3.955	2025/9/15	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000	747.05	896,463,465	758.07	909,687,821	5.500	2027/3/4	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000	705.88	871,769,439	723.80	893,904,743	7.750	2042/11/13	0.71
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	595.65	867,873,707	612.37	892,235,475	8.500	2037/1/31	0.71
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000	0.97	880,963,296	0.98	887,639,040	7.000	2033/2/15	0.71
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	3,248.86	847,954,829	3,255.36	849,650,306	2.750	2029/10/25	0.68
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	416.43	845,769,520	417.58	848,122,930	2.125	2026/12/17	0.68

(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	96.55
合計	96.55

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	115,571,321,500	97.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,428,882,928	2.88
合計(純資産総額)		119,000,204,428	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,416,020,500	2.87

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	12,825	608,156.9	7,799,612,242	621,000	7,964,325,000	6.69
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,293	563,283.68	6,361,162,598	575,000	6,493,475,000	5.46
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,551	166,873.63	5,932,524,420	169,800	6,036,559,800	5.07
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,151	275,268.15	5,271,660,340	280,400	5,369,940,400	4.51
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	31,638	161,388.52	5,106,009,995	169,500	5,362,641,000	4.51
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	52,696	98,029.84	5,165,780,448	98,500	5,190,556,000	4.36
日本	投資証券	G L P 投資法人	37,136	136,655.96	5,074,855,730	139,700	5,187,899,200	4.36
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	16,572	271,941.56	4,506,615,532	263,800	4,371,693,600	3.67
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,905	170,925.2	3,744,116,506	174,400	3,820,232,000	3.21
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,592	149,862.71	3,685,423,764	145,000	3,565,840,000	3.00
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,786	325,154.73	3,507,118,917	325,000	3,505,450,000	2.95
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	53,229	56,979.14	3,032,942,643	60,000	3,193,740,000	2.68
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	33,035	78,236.06	2,584,528,242	84,700	2,798,064,500	2.35
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,518	347,643.84	2,613,586,389	371,000	2,789,178,000	2.34
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	36,802	66,703.37	2,454,817,422	69,400	2,554,058,800	2.15
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	5,768	400,228.75	2,308,519,430	406,500	2,344,692,000	1.97

日本	投資証券	産業ファンド投資法人	16,774	136,220.61	2,284,964,512	138,000	2,314,812,000	1.95
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,796	608,161.83	2,308,582,306	608,000	2,307,968,000	1.94
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,053	149,987.52	2,107,774,618	157,600	2,214,752,800	1.86
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,573	467,688.77	2,138,740,745	467,000	2,135,591,000	1.79
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,042	284,832.01	2,005,787,014	288,500	2,031,617,000	1.71
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,486	142,898.24	1,927,125,664	143,800	1,939,286,800	1.63
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,079	452,536.47	1,845,896,261	453,500	1,849,826,500	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,928	139,028.58	1,797,361,482	140,600	1,817,676,800	1.53
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,189	109,078.7	1,765,875,074	109,300	1,769,457,700	1.49
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,406	317,996.59	1,719,089,565	318,000	1,719,108,000	1.44
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,286	150,929.04	1,552,456,105	155,100	1,595,358,600	1.34
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	21,191	73,217.31	1,551,548,016	73,700	1,561,776,700	1.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,277	652,538.26	1,485,829,618	677,000	1,541,529,000	1.30
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,796	377,580.34	1,433,294,970	383,000	1,453,868,000	1.22

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.12
合計	97.12

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,851	円	3,347,161,460	3,416,020,500	2.87

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	84,723,670,662	77.46
	オーストラリア	7,285,475,179	6.66
	イギリス	5,317,915,206	4.86
	シンガポール	3,914,955,714	3.58
	フランス	1,976,760,678	1.81
	カナダ	1,640,020,852	1.50

	ベルギー	1,254,474,944	1.15
	香港	1,241,482,934	1.14
	スペイン	497,595,122	0.45
	ニュージーランド	326,913,403	0.30
	韓国	212,420,917	0.19
	オランダ	207,609,718	0.19
	ガーンジー	200,803,144	0.18
	イスラエル	131,460,769	0.12
	ドイツ	39,261,466	0.04
	アイルランド	32,899,587	0.03
	イタリア	11,924,469	0.01
	小計	109,015,644,764	99.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		364,023,145	0.33
合計(純資産総額)		109,379,667,909	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		77,558,735	0.07

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	549,274	15,189.38	8,343,136,783	16,624.79	9,131,566,440	8.35
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	55,617	111,333.46	6,192,033,084	118,878.15	6,611,646,163	6.04
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	329,696	12,448.00	4,104,057,391	12,971.57	4,276,676,062	3.91
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	179,842	18,767.60	3,375,203,204	20,325.07	3,655,301,958	3.34
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	94,016	36,268.93	3,409,859,977	37,929.35	3,565,966,052	3.26
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	194,379	16,735.09	3,252,951,090	18,054.31	3,509,379,346	3.21
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	421,049	7,378.50	3,106,710,846	7,893.24	3,323,443,714	3.04
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	602,621	4,134.13	2,491,318,195	4,356.21	2,625,145,675	2.40
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	125,689	17,368.96	2,183,088,094	19,049.97	2,394,372,572	2.19
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,017,749	2,190.67	2,229,558,308	2,272.53	2,312,869,206	2.11
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	84,474	24,468.03	2,066,912,864	25,123.96	2,122,322,081	1.94
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	205,257	7,899.12	1,621,351,665	8,321.22	1,707,988,777	1.56
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	342,404	4,590.05	1,571,653,089	4,847.42	1,659,778,463	1.52
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	173,734	8,658.01	1,504,190,866	9,306.58	1,616,871,038	1.48
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	239,543	6,188.70	1,482,461,106	6,678.44	1,599,775,637	1.46

アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	92,352	13,909.88	1,284,605,293	16,032.10	1,480,596,564	1.35
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	73,816	16,823.33	1,241,831,466	18,824.95	1,389,583,247	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	69,921	17,616.04	1,231,731,455	18,216.09	1,273,687,243	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,070	30,527.31	1,162,175,068	31,212.66	1,188,266,198	1.09
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	127,017	7,982.95	1,013,971,580	9,146.28	1,161,733,466	1.06
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	110,558	9,558.07	1,056,722,131	10,308.13	1,139,646,933	1.04
イギリス	投資証券	SEGO PLC	732,700	1,452.86	1,064,516,266	1,532.83	1,123,108,468	1.03
香港	投資証券	LINK REIT	1,519,800	744.36	1,131,291,094	732.87	1,113,824,945	1.02
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	422,565	2,389.88	1,009,882,812	2,564.90	1,083,837,307	0.99
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,899	6,616.67	1,031,533,686	6,747.57	1,051,939,665	0.96
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	368,258	2,603.13	958,626,762	2,797.27	1,030,117,571	0.94
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	188,879	5,070.97	957,800,423	5,263.63	994,190,172	0.91
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	98,033	8,737.42	856,556,348	9,040.39	886,256,837	0.81
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	123,217	6,550.49	807,132,688	7,160.83	882,337,013	0.81
アメリカ	投資証券	UDR INC	180,055	4,704.76	847,117,236	4,895.96	881,542,132	0.81

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.67
合計	99.67

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	230,000.00	33,784,700	33,820,626	0.03
	ユーロ	売建	120,000.00	19,401,840	19,378,884	0.02
	オーストラリアドル	売建	250,000.00	24,446,000	24,359,225	0.02

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

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

新興国REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	メキシコ	154,174,889	30.03
	南アフリカ	113,114,188	22.03
	インド	65,957,346	12.85
	トルコ	43,390,525	8.45
	タイ	39,707,604	7.73
	マレーシア	35,668,374	6.95

	サウジアラビア	26,962,222	5.25
	フィリピン	16,086,514	3.13
	香港	4,620,698	0.90
	小計	499,682,360	97.32
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		13,779,130	2.68
合計（純資産総額）		513,461,490	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （%）
為替予約取引	売建		1,489,923	0.29

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （%）
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	309,200	246.97	76,365,477	232.42	71,865,651	14.00
インド	投資証券	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	71,839	544.34	39,104,970	565.02	40,590,859	7.91
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	64,800	553.69	35,879,736	598.29	38,769,527	7.55
南アフリカ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	375,593	75.90	28,511,077	83.28	31,282,578	6.09
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,700	256.08	21,946,395	263.06	22,544,469	4.39
南アフリカ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	784,627	27.23	21,372,847	26.76	21,003,288	4.09
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	80,200	242.72	19,466,330	261.78	20,995,242	4.09
インド	投資証券	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,792	568.88	14,103,871	564.45	13,993,988	2.73
インド	投資証券	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	26,651	423.03	11,274,301	426.71	11,372,499	2.21
マレーシア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	223,000	46.75	10,426,557	48.65	10,849,256	2.11
南アフリカ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	32,432	298.92	9,694,833	318.08	10,316,035	2.01
マレーシア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	176,500	57.18	10,092,474	57.81	10,203,993	1.99
南アフリカ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	96,165	100.16	9,632,463	105.81	10,175,988	1.98
マレーシア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	183,000	54.33	9,943,835	54.02	9,886,022	1.93
タイ	投資証券	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	174,000	49.37	8,591,076	55.28	9,619,068	1.87
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	185,500	41.56	7,710,678	45.99	8,532,629	1.66
南アフリカ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	39,395	225.84	8,897,144	203.62	8,021,964	1.56
南アフリカ	投資証券	EQUITES PROPERTY FUND LTD	85,527	97.49	8,338,626	93.33	7,982,791	1.55
タイ	投資証券	WIHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	181,300	40.09	7,268,317	41.77	7,574,351	1.48
トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	191,362	36.55	6,995,039	37.62	7,199,345	1.40

タイ	投資証券	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600	40.93	6,737,736	42.62	7,015,581	1.37
トルコ	投資証券	PEKER GAYRIMENKUL YATIRIM OR	39,500	144.89	5,723,313	162.38	6,414,127	1.25
トルコ	投資証券	IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	51,071	112.96	5,769,311	108.59	5,546,016	1.08
南アフリカ	投資証券	ATTACQ LTD	81,466	66.72	5,435,818	67.35	5,486,979	1.07
フィリピン	投資証券	AREIT INC	72,520	89.75	6,509,097	74.88	5,430,667	1.06
フィリピン	投資証券	RL COMMERCIAL REIT INC	431,700	12.74	5,502,621	12.16	5,250,417	1.02
南アフリカ	投資証券	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	48,877	94.82	4,634,909	97.57	4,769,198	0.93
マレーシア	投資証券	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	122,700	37.91	4,651,577	38.54	4,729,103	0.92
サウジアラビア	投資証券	AL RAJHI REIT	13,464	327.11	4,404,332	341.25	4,594,675	0.89
南アフリカ	投資証券	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	275,044	15.15	4,167,054	16.32	4,490,918	0.87

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.32
合計	97.32

(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	南アフリカランド	売建	190,000.00	1,489,220	1,489,923	0.29

(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：2014年11月28日
作成基準日：2023年11月30日



SMT インテックスシリーズ

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	15,041円
純資産総額	27.68億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2021年10月	0円
2022年4月	0円
2022年10月	0円
2023年4月	0円
2023年10月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質収比率
外国株式インデックス マザーファンド	23.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア/ハードウェア	-	-	1.3%
		MICROSOFT CORP.	アメリカ	株式	ソフトウェア/サービス	-	-	1.1%
外国債券インデックス マザーファンド	21.3%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.1%
		T 2.75% 08/15/32	アメリカ	国債	-	2.750%	2032/08/15	0.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	14.3%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
		BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	国債	-	0.000%	2026/01/01	0.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	13.4%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.8%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア・娯楽	-	-	0.5%
グローバルREITインデックス マザーファンド	10.2%	PROLOGIS INC.	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.9%
		EQUINIX INC.	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.6%
新興国REITインデックス マザーファンド	6.5%	FERRA LIND ADMINISTRACION SA	メキシコ	投資証券	-	-	-	0.9%
		EMBASSY OFFICE PARKS REIT	インド	投資証券	-	-	-	0.5%
国内株式インデックス マザーファンド	4.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券インデックス マザーファンド	3.4%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.0%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.0%
J-REITインデックス マザーファンド	1.8%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%
		ジャパソリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2014年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2014年11月28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4月21日から10月20日まで及び10月21日から翌年4月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2014年11月28日から2015年4月20日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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送します。

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

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

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いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続に従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

て取得申込者とします。)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)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18期計算期間(2023年4月21日から2023年10月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【SMT インデックスバランス・オープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2023年 4月20日現在)	第18期 (2023年10月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	31,632,733	28,136,445
親投資信託受益証券	2,590,996,845	2,655,724,348
未収入金	12,500,000	10,200,000
流動資産合計	2,635,129,578	2,694,060,793
資産合計	2,635,129,578	2,694,060,793
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,222,947	3,790,227
未払受託者報酬	715,176	750,817
未払委託者報酬	6,436,456	6,757,314
未払利息	10	12
その他未払費用	71,451	75,016
流動負債合計	18,446,040	11,373,386
負債合計	18,446,040	11,373,386
純資産の部		
元本等		
元本	1,931,310,702	1,861,663,164
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	685,372,836	821,024,243
(分配準備積立金)	747,035,318	737,384,869
元本等合計	2,616,683,538	2,682,687,407
純資産合計	2,616,683,538	2,682,687,407
負債純資産合計	2,635,129,578	2,694,060,793

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第17期		第18期	
	自	2022年10月21日	自	2023年 4月21日
	至	2023年 4月20日	至	2023年10月20日
営業収益				
受取利息		68		70
有価証券売買等損益		47,669,829		172,487,503
営業収益合計		47,669,897		172,487,573
営業費用				
支払利息		6,435		9,052
受託者報酬		715,176		750,817
委託者報酬		6,436,456		6,757,314
その他費用		71,451		75,016
営業費用合計		7,229,518		7,592,199
営業利益又は営業損失（ ）		40,440,379		164,895,374
経常利益又は経常損失（ ）		40,440,379		164,895,374
当期純利益又は当期純損失（ ）		40,440,379		164,895,374
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（ ）		2,647,714		9,687,083
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		670,095,597		685,372,836
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,351,668		27,880,833
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		22,351,668		27,880,833
剰余金減少額又は欠損金増加額		50,162,522		47,437,717
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		50,162,522		47,437,717
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		685,372,836		821,024,243

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第17期 (2023年 4月20日現在)	第18期 (2023年10月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,931,310,702口	1,861,663,164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) 1.3549円 (13,549円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4410円 (14,410円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第17期 自 2022年10月21日 至 2023年 4月20日			第18期 自 2023年 4月21日 至 2023年10月20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	32,690,923円	費用控除後の配当等収益額	A	40,992,656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	- 円
収益調整金額	C	270,977,407円	収益調整金額	C	285,179,970円
分配準備積立金額	D	714,344,395円	分配準備積立金額	D	696,392,213円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,018,012,725円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,022,564,839円
当ファンドの期末残存口数	F	1,931,310,702口	当ファンドの期末残存口数	F	1,861,663,164口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,271円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,492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18期 自 2023年 4月21日 至 2023年10月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、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18期 (2023年10月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第17期 自 2022年10月21日 至 2023年 4月20日	第18期 自 2023年 4月21日 至 2023年10月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,014,280,501円	1,931,310,702円
期中追加設定元本額	68,352,579円	64,015,814円
期中一部解約元本額	151,322,378円	133,663,352円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第17期 (2023年 4月20日現在)	第18期 (2023年10月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	52,720,157	165,802,424
合計	52,720,157	165,802,424

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	23,926,149	50,024,792	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	111,131,449	268,060,168	
	新興国株式インデックス マザーファンド	95,185,665	360,839,337	
	国内株式インデックス マザーファンド	49,756,098	115,085,854	
	外国株式インデックス マザーファンド	123,994,965	634,606,230	
	国内債券インデックス マザーファンド	71,975,997	94,929,142	
	外国債券インデックス マザーファンド	176,326,719	573,537,918	
	新興国債券インデックス マザーファンド	182,946,149	381,021,944	
	新興国REITインデックス マザーファンド	228,155,380	177,618,963	
合計		1,063,398,571	2,655,724,348	

(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10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,953,991,024
株式	552,571,458,840
派生商品評価勘定	2,006,700
未収入金	7,490,000
未収配当金	5,298,901,266
前払金	237,378,100
差入委託証拠金	232,475,000
流動資産合計	561,303,700,930
資産合計	561,303,700,930
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	239,456,300
未払解約金	70,559,724
未払利息	1,308
その他未払費用	176
流動負債合計	310,017,508
負債合計	310,017,508
純資産の部	
元本等	
元本	242,540,893,459
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	318,452,789,963
元本等合計	560,993,683,422
純資産合計	560,993,683,422
負債純資産合計	561,303,700,930

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2023年10月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,540,893,459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 2.3130円 (1万口当たり純資産額) (23,130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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2023年10月20日現在
期首	2023年 4月21日
期首元本額	258,103,078,064円
期中追加設定元本額	11,660,892,534円
期中一部解約元本額	27,223,077,139円
期末元本額	242,540,893,459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）	314,584,840円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,485,955,415円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,152,969円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,146,332,980円
世界経済インデックスファンド	5,089,171,293円
日本株式インデックス・オープン	2,993,715,711円
DCマイセクション25	5,418,039,395円
DCマイセクション50	17,375,988,692円
DCマイセクション75	18,560,819,405円
DC日本株式インデックス・オープン	6,050,616,222円
DCマイセクションS25	3,160,582,839円
DCマイセクションS50	9,485,823,357円
DCマイセクションS75	8,111,245,616円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,136,151,589円
DCターゲット・イヤーフンド2025	91,585,117円
DCターゲット・イヤーフンド2035	615,787,630円
DCターゲット・イヤーフンド2045	482,243,967円
DC世界経済インデックスファンド	3,753,850,982円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	895,059,473円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,789,509円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,017,403円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	14,276,826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）	156,785,770円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,043,492円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,358,838円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	70,516,841円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,579,511円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	46,691,759円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	531,085,139円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	325,131,870円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,179,700,366円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	29,343,477円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,687,773円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	340,592,161円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	188,895,125円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	252,340,789円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	20,328,385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）	420,188,230円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,536,242,081円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,881,716,620円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,653,328,250円
分散投資コア戦略ファンドA	1,868,498,313円
分散投資コア戦略ファンドS	6,163,116,493円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	585,192,776円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	404,697,520円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,171,089,468円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	201,566,527円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,711,834円
SMT インデックスバランス・オープン	49,756,098円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	19,130,032,401円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	274,541,578円
SMT 世界経済インデックス・オープン	51,370,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	212,086,642円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,709,487円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,855,151円

区分	2023年10月20日現在
グローバル経済コア	216,917,123円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,609,608円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,248,153,408円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	27,362,412円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	964,175,269円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	237,451,996円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	51,611,599円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	49,159,540円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,935,476円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,019,113円
10資産分散投資ファンド	92,799,158円
グローバル10資産バランスファンド	1,466,922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）	42,401,146,940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）	500,600,878円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	302,164,469円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,644,734円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	508,372,897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）	46,400,687,435円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,370,031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）	207,818,174円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	22,749,046,266
合計	22,749,046,266

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,373,048,100	-	7,135,670,000	237,378,100
合計		7,373,048,100	-	7,135,670,000	237,378,100

(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	9,200	3,750.00	34,500,000	
ニッスイ	242,500	693.00	168,052,500	

マルハニチロ	36,000	2,454.50	88,362,000
雪国まいたけ	20,600	884.00	18,210,400
カネコ種苗	7,400	1,394.00	10,315,600
サカタのタネ	27,600	4,095.00	113,022,000
ホクト	21,600	1,789.00	38,642,400
ホクリヨウ	2,300	1,044.00	2,401,200
住石ホールディングス	25,100	503.00	12,625,300
日鉄鉱業	9,700	4,675.00	45,347,500
三井松島ホールディングス	11,000	2,601.00	28,611,000
I N P E X	896,800	2,230.00	1,999,864,000
石油資源開発	28,100	5,360.00	150,616,000
K & O エナジーグループ	11,000	2,427.00	26,697,000
ショーボンドホールディングス	33,000	5,683.00	187,539,000
ミライト・ワン	80,200	1,937.00	155,347,400
タマホーム	15,200	3,245.00	49,324,000
サンヨーホームズ	2,000	717.00	1,434,000
日本アクア	6,700	933.00	6,251,100
ファーストコーポレーション	4,100	750.00	3,075,000
ベステラ	3,500	1,004.00	3,514,000
キャンディル	2,900	554.00	1,606,600
ダイセキ環境ソリューション	3,300	948.00	3,128,400
第一カッター興業	6,200	1,221.00	7,570,200
安藤・間	140,500	1,137.00	159,748,500
東急建設	69,000	736.00	50,784,000
コムシスホールディングス	77,400	3,033.00	234,754,200
ビーアールホールディングス	38,500	364.00	14,014,000
高松コンストラクショングループ	15,800	2,774.00	43,829,200
東建コーポレーション	7,000	7,810.00	54,670,000
ソネック	1,700	953.00	1,620,100
ヤマウラ	12,300	1,212.00	14,907,600
オリエンタル白石	87,200	326.00	28,427,200
大成建設	158,700	4,920.00	780,804,000
大林組	606,600	1,253.50	760,373,100
清水建設	481,000	1,032.50	496,632,500
飛島建設	18,700	1,261.00	23,580,700
長谷工コーポレーション	175,100	1,849.00	323,759,900
松井建設	15,800	758.00	11,976,400
銭高組	1,400	3,680.00	5,152,000
鹿島建設	376,100	2,370.00	891,357,000
不動テトラ	11,700	2,010.00	23,517,000
大末建設	4,100	1,444.00	5,920,400
鉄建建設	12,200	1,999.00	24,387,800

西松建設	28,800	3,516.00	101,260,800
三井住友建設	136,800	387.00	52,941,600
大豊建設	7,000	3,910.00	27,370,000
佐田建設	7,200	594.00	4,276,800
ナカノフドー建設	8,000	390.00	3,120,000
奥村組	27,500	4,400.00	121,000,000
東鉄工業	23,300	2,893.00	67,406,900
イチケン	2,500	2,033.00	5,082,500
富士ピー・エス	5,100	450.00	2,295,000
浅沼組	13,600	3,585.00	48,756,000
戸田建設	208,700	799.40	166,834,780
熊谷組	28,400	3,625.00	102,950,000
北野建設	2,100	3,000.00	6,300,000
植木組	3,200	1,416.00	4,531,200
矢作建設工業	23,100	1,253.00	28,944,300
ピーエス三菱	21,500	800.00	17,200,000
日本ハウスホールディングス	36,200	367.00	13,285,400
新日本建設	23,800	1,194.00	28,417,200
東亜道路工業	6,800	5,360.00	36,448,000
日本道路	17,100	1,852.00	31,669,200
東亜建設工業	14,500	3,610.00	52,345,000
日本国土開発	48,200	590.00	28,438,000
若築建設	7,500	2,933.00	21,997,500
東洋建設	54,900	1,227.00	67,362,300
五洋建設	240,500	841.90	202,476,950
世紀東急工業	21,800	1,573.00	34,291,400
福田組	6,400	4,810.00	30,784,000
住友林業	146,600	3,492.00	511,927,200
日本基礎技術	6,800	452.00	3,073,600
巴コーポレーション	12,700	580.00	7,366,000
大和ハウス工業	469,000	3,982.00	1,867,558,000
ライト工業	31,400	1,923.00	60,382,200
積水ハウス	514,300	2,866.00	1,473,983,800
日特建設	16,200	1,044.00	16,912,800
北陸電気工事	11,600	979.00	11,356,400
ユアテック	37,400	940.00	35,156,000
日本リーテック	14,900	1,248.00	18,595,200
四電工	7,100	2,891.00	20,526,100
中電工	26,300	2,372.00	62,383,600
関電工	92,900	1,320.00	122,628,000
きんでん	119,400	2,101.00	250,859,400
東京エネシス	16,900	963.00	16,274,700

トーエネック	5,600	4,110.00	23,016,000
住友電設	16,100	2,711.00	43,647,100
日本電設工業	27,900	2,025.00	56,497,500
エクシオグループ	78,100	2,995.00	233,909,500
新日本空調	9,400	2,362.00	22,202,800
九電工	41,200	4,439.00	182,886,800
三機工業	37,500	1,650.00	61,875,000
日揮ホールディングス	167,800	1,835.00	307,913,000
中外炉工業	5,500	2,131.00	11,720,500
ヤマト	9,400	895.00	8,413,000
太平電業	10,500	3,980.00	41,790,000
高砂熱学工業	40,900	2,802.00	114,601,800
三晃金属工業	1,400	4,140.00	5,796,000
朝日工業社	7,000	2,405.00	16,835,000
明星工業	29,200	1,009.00	29,462,800
大気社	19,500	4,445.00	86,677,500
ダイダン	22,300	1,448.00	32,290,400
日比谷総合設備	13,800	2,226.00	30,718,800
フィル・カンパニー	2,600	579.00	1,505,400
テスホールディングス	36,500	478.00	17,447,000
インフロニア・ホールディングス	177,700	1,541.50	273,924,550
東洋エンジニアリング	22,400	585.00	13,104,000
レイズネクスト	24,500	1,450.00	35,525,000
ニッポン	45,900	2,145.00	98,455,500
日清製粉グループ本社	157,500	1,810.50	285,153,750
日東富士製粉	3,000	4,760.00	14,280,000
昭和産業	14,800	2,955.00	43,734,000
鳥越製粉	10,100	682.00	6,888,200
中部飼料	23,600	1,074.00	25,346,400
フィード・ワン	24,900	755.00	18,799,500
東洋精糖	2,100	1,838.00	3,859,800
日本甜菜製糖	9,900	1,859.00	18,404,100
D M三井製糖ホールディングス	16,900	2,902.00	49,043,800
塩水港精糖	13,600	238.00	3,236,800
ウェルネオシュガー	8,800	2,014.00	17,723,200
森永製菓	30,400	5,172.00	157,228,800
中村屋	4,300	3,070.00	13,201,000
江崎グリコ	48,700	4,168.00	202,981,600
名糖産業	6,700	1,603.00	10,740,100
井村屋グループ	9,300	2,276.00	21,166,800
不二家	11,700	2,467.00	28,863,900
山崎製パン	114,000	2,690.00	306,660,000

第一屋製パン	2,200	473.00	1,040,600
モロゾフ	5,500	3,685.00	20,267,500
亀田製菓	10,800	3,955.00	42,714,000
寿スピリッツ	90,600	2,053.00	186,001,800
カルビー	78,000	2,696.00	210,288,000
森永乳業	30,900	5,460.00	168,714,000
六甲バター	12,500	1,360.00	17,000,000
ヤクルト本社	243,400	3,540.00	861,636,000
明治ホールディングス	208,800	3,688.00	770,054,400
雪印メグミルク	41,200	2,259.00	93,070,800
プリマハム	22,900	2,267.00	51,914,300
日本ハム	66,600	4,273.00	284,581,800
林兼産業	3,500	534.00	1,869,000
丸大食品	17,100	1,617.00	27,650,700
S Foods	18,800	3,115.00	58,562,000
柿安本店	6,600	2,442.00	16,117,200
伊藤ハム米久ホールディングス	26,000	4,020.00	104,520,000
サッポロホールディングス	56,100	5,057.00	283,697,700
アサヒグループホールディングス	393,500	5,281.00	2,078,073,500
キリンホールディングス	709,300	2,071.50	1,469,314,950
宝ホールディングス	116,200	1,216.50	141,357,300
オエノンホールディングス	50,900	382.00	19,443,800
養命酒製造	5,600	1,833.00	10,264,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,400	1,887.00	251,725,800
ライフドリンク カンパニー	3,100	3,325.00	10,307,500
サントリー食品インターナショナル	119,900	4,378.00	524,922,200
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,480.00	52,608,000
伊藤園	57,700	4,839.00	279,210,300
キーコーヒー	19,100	2,014.00	38,467,400
ユニカフェ	3,800	943.00	3,583,400
ジャパンフーズ	1,800	1,093.00	1,967,400
日清オイリオグループ	24,000	4,000.00	96,000,000
不二製油グループ本社	39,600	2,233.00	88,426,800
かどや製油	1,400	3,450.00	4,830,000
J - オイルミルズ	17,300	1,706.00	29,513,800
キッコーマン	112,900	8,228.00	928,941,200
味の素	411,200	5,565.00	2,288,328,000
ブルドックソース	9,000	2,039.00	18,351,000
キューピー	91,500	2,556.00	233,874,000
ハウス食品グループ本社	52,100	3,120.00	162,552,000
カゴメ	73,200	3,077.00	225,236,400
焼津水産化学工業	4,400	1,191.00	5,240,400

アリアケジャパン	14,900	4,624.00	68,897,600
ピエトロ	1,600	1,802.00	2,883,200
エバラ食品工業	4,600	2,872.00	13,211,200
やまみ	1,100	2,197.00	2,416,700
ニチレイ	78,000	3,214.00	250,692,000
東洋水産	86,100	5,980.00	514,878,000
イトアンドホールディングス	7,700	1,957.00	15,068,900
大冷	1,400	1,912.00	2,676,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,007.00	10,875,600
日清食品ホールディングス	59,900	12,240.00	733,176,000
永谷園ホールディングス	8,400	2,189.00	18,387,600
一正蒲鉾	4,900	738.00	3,616,200
フジッコ	17,500	1,893.00	33,127,500
ロック・フィールド	19,100	1,522.00	29,070,200
日本たばこ産業	1,034,800	3,423.00	3,542,120,400
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,491.00	17,444,700
わらべや日洋ホールディングス	12,500	3,015.00	37,687,500
なとり	10,700	1,971.00	21,089,700
イフジ産業	1,900	1,613.00	3,064,700
ファーマフーズ	24,400	1,400.00	34,160,000
ユーグレナ	106,000	729.00	77,274,000
紀文食品	13,300	1,111.00	14,776,300
ピクルスホールディングス	10,000	1,139.00	11,390,000
ミヨシ油脂	4,400	1,232.00	5,420,800
理研ビタミン	14,700	2,190.00	32,193,000
片倉工業	16,200	1,747.00	28,301,400
ゲンゼ	12,400	4,530.00	56,172,000
東洋紡	75,400	1,011.50	76,267,100
ユニチカ	54,900	188.00	10,321,200
富士紡ホールディングス	7,000	3,520.00	24,640,000
倉敷紡績	13,100	2,291.00	30,012,100
シキボウ	6,400	1,071.00	6,854,400
日本毛織	46,100	1,388.00	63,986,800
トーア紡コーポレーション	4,500	438.00	1,971,000
帝国繊維	19,800	1,834.00	36,313,200
帝人	166,800	1,372.00	228,849,600
東レ	1,161,300	726.30	843,452,190
住江織物	2,500	2,079.00	5,197,500
日本フェルト	7,600	415.00	3,154,000
イチカワ	1,800	1,505.00	2,709,000
日東製網	1,200	1,410.00	1,692,000
アツギ	7,100	420.00	2,982,000

ダイニック	3,000	777.00	2,331,000
セーレン	33,700	2,140.00	72,118,000
ソトー	3,800	724.00	2,751,200
東海染工	1,300	979.00	1,272,700
小松マテーレ	25,300	720.00	18,216,000
ワコールホールディングス	31,600	3,442.00	108,767,200
ホギメディカル	23,300	3,230.00	75,259,000
T S Iホールディングス	58,500	767.00	44,869,500
マツオカコーポレーション	3,200	1,643.00	5,257,600
ワールド	22,300	1,532.00	34,163,600
三陽商会	4,400	2,584.00	11,369,600
ナイガイ	4,400	284.00	1,249,600
オンワードホールディングス	112,600	472.00	53,147,200
ルックホールディングス	3,700	1,975.00	7,307,500
ゴールドウイン	30,700	9,851.00	302,425,700
デサント	29,900	4,305.00	128,719,500
キング	5,300	654.00	3,466,200
ヤマトインターナショナル	9,600	300.00	2,880,000
特種東海製紙	7,700	3,450.00	26,565,000
王子ホールディングス	721,600	618.20	446,093,120
日本製紙	90,200	1,288.00	116,177,600
三菱製紙	13,900	568.00	7,895,200
北越コーポレーション	109,500	1,037.00	113,551,500
中越パルプ工業	4,700	1,317.00	6,189,900
大王製紙	76,500	1,197.00	91,570,500
阿波製紙	2,800	475.00	1,330,000
レンゴー	157,800	992.70	156,648,060
トモク	10,000	2,246.00	22,460,000
ザ・パック	12,900	3,240.00	41,796,000
北の達人コーポレーション	73,000	197.00	14,381,000
クラレ	252,400	1,701.50	429,458,600
旭化成	1,081,800	924.70	1,000,340,460
共和レザー	6,700	609.00	4,080,300
巴川製紙所	3,600	650.00	2,340,000
レゾナック・ホールディングス	167,400	2,457.50	411,385,500
住友化学	1,285,100	402.20	516,867,220
住友精化	7,200	4,440.00	31,968,000
日産化学	81,500	6,359.00	518,258,500
ラサ工業	6,700	1,988.00	13,319,600
クレハ	13,900	9,160.00	127,324,000
多木化学	6,700	3,390.00	22,713,000
テイカ	11,600	1,605.00	18,618,000

石原産業	31,300	1,435.00	44,915,500
片倉コープアグリ	2,400	1,086.00	2,606,400
日本曹達	18,600	5,420.00	100,812,000
東ソー	231,300	1,788.50	413,680,050
トクヤマ	55,900	2,251.50	125,858,850
セントラル硝子	27,800	2,918.00	81,120,400
東亜合成	86,900	1,338.50	116,315,650
大阪ソーダ	10,400	8,310.00	86,424,000
関東電化工業	33,500	810.00	27,135,000
デンカ	63,000	2,716.00	171,108,000
信越化学工業	1,440,000	4,297.00	6,187,680,000
日本カーバイド工業	4,400	1,740.00	7,656,000
堺化学工業	13,200	2,041.00	26,941,200
第一稀元素化学工業	15,800	937.00	14,804,600
エア・ウォーター	163,400	1,845.50	301,554,700
日本酸素ホールディングス	168,100	3,697.00	621,465,700
日本化学工業	5,800	1,920.00	11,136,000
東邦アセチレン	2,400	1,629.00	3,909,600
日本パーカラライジング	85,800	1,094.00	93,865,200
高压ガス工業	25,200	768.00	19,353,600
チタン工業	1,400	1,394.00	1,951,600
四国化成ホールディングス	22,200	1,703.00	37,806,600
戸田工業	3,900	1,760.00	6,864,000
ステラ ケミファ	10,300	3,195.00	32,908,500
保土谷化学工業	4,900	2,989.00	14,646,100
日本触媒	26,400	5,445.00	143,748,000
大日精化工業	12,000	2,166.00	25,992,000
カネカ	39,600	3,740.00	148,104,000
三菱瓦斯化学	129,400	2,019.50	261,323,300
三井化学	142,800	3,656.00	522,076,800
J S R	161,700	4,010.00	648,417,000
東京応化工業	27,600	8,603.00	237,442,800
大阪有機化学工業	14,500	2,579.00	37,395,500
三菱ケミカルグループ	1,169,000	855.20	999,728,800
K Hネオケム	26,400	2,226.00	58,766,400
ダイセル	241,200	1,226.50	295,831,800
住友ベークライト	25,700	6,659.00	171,136,300
積水化学工業	351,200	2,019.50	709,248,400
日本ゼオン	103,900	1,507.00	156,577,300
アイカ工業	43,700	3,276.00	143,161,200
U B E	89,300	2,287.50	204,273,750
積水樹脂	24,000	2,423.00	58,152,000

タキロンシーアイ	37,900	564.00	21,375,600
旭有機材	11,500	3,595.00	41,342,500
ニチバン	10,700	1,803.00	19,292,100
リケンテクノス	37,300	719.00	26,818,700
大倉工業	8,000	2,600.00	20,800,000
積水化成成品工業	24,300	439.00	10,667,700
群栄化学工業	4,100	3,165.00	12,976,500
タイガースポリマー	5,300	626.00	3,317,800
ミライアル	3,500	1,388.00	4,858,000
ダイキアクシス	4,800	721.00	3,460,800
ダイキョーニシカワ	38,200	762.00	29,108,400
竹本容器	4,400	790.00	3,476,000
森六ホールディングス	8,800	2,292.00	20,169,600
恵和	12,500	1,357.00	16,962,500
日本化薬	132,300	1,263.50	167,161,050
カーリットホールディングス	15,600	955.00	14,898,000
日本精化	9,800	2,649.00	25,960,200
扶桑化学工業	16,100	4,085.00	65,768,500
トリケミカル研究所	23,100	3,325.00	76,807,500
A D E K A	60,400	2,652.00	160,180,800
日油	53,600	6,006.00	321,921,600
新日本理化	15,900	211.00	3,354,900
ハリマ化成グループ	8,100	800.00	6,480,000
花王	391,700	5,444.00	2,132,414,800
第一工業製薬	6,200	1,663.00	10,310,600
石原ケミカル	7,900	1,599.00	12,632,100
日華化学	4,600	904.00	4,158,400
ニイタカ	2,100	2,106.00	4,422,600
三洋化成工業	10,700	3,940.00	42,158,000
有機合成薬品工業	8,500	287.00	2,439,500
大日本塗料	21,100	939.00	19,812,900
日本ペイントホールディングス	919,800	965.50	888,066,900
関西ペイント	138,900	2,177.50	302,454,750
神東塗料	9,600	126.00	1,209,600
中国塗料	28,500	1,317.00	37,534,500
日本特殊塗料	7,300	1,211.00	8,840,300
藤倉化成	23,300	438.00	10,205,400
太陽ホールディングス	26,300	2,460.00	64,698,000
D I C	67,700	2,385.50	161,498,350
サカタインクス	38,500	1,222.00	47,047,000
東洋インキ S C ホールディングス	37,700	2,464.00	92,892,800
T & K T O K A	15,500	1,422.00	22,041,000

富士フィルムホールディングス	332,800	8,470.00	2,818,816,000
資生堂	362,200	4,711.00	1,706,324,200
ライオン	227,000	1,418.00	321,886,000
高砂香料工業	11,700	3,055.00	35,743,500
マンダム	37,500	1,350.00	50,625,000
ミルボン	23,600	4,001.00	94,423,600
ファンケル	75,900	2,224.00	168,801,600
コーセー	35,300	10,015.00	353,529,500
コタ	16,000	1,625.00	26,000,000
シーボン	1,500	1,513.00	2,269,500
ポーラ・オルビスホールディングス	88,900	1,664.50	147,974,050
ノエビアホールディングス	15,500	5,200.00	80,600,000
アジュバンホールディングス	2,800	920.00	2,576,000
新日本製薬	9,900	1,474.00	14,592,600
アクシージア	8,800	964.00	8,483,200
エステー	13,400	1,497.00	20,059,800
アグロ カネショウ	6,900	1,313.00	9,059,700
コニシ	29,000	2,179.00	63,191,000
長谷川香料	33,100	3,070.00	101,617,000
小林製薬	50,500	6,165.00	311,332,500
荒川化学工業	14,700	1,010.00	14,847,000
メック	14,300	3,580.00	51,194,000
日本高純度化学	4,300	2,470.00	10,621,000
タカラバイオ	46,700	1,287.00	60,102,900
J C U	19,400	3,165.00	61,401,000
新田ゼラチン	7,100	676.00	4,799,600
O A T アグリオ	4,300	1,830.00	7,869,000
デクセリアルズ	47,400	3,740.00	177,276,000
アース製薬	15,800	4,985.00	78,763,000
北興化学工業	17,500	913.00	15,977,500
大成ラミック	5,500	3,020.00	16,610,000
クミアイ化学工業	68,900	1,149.00	79,166,100
日本農薬	31,800	650.00	20,670,000
アキレス	10,900	1,503.00	16,382,700
有沢製作所	28,200	1,072.00	30,230,400
日東電工	125,900	9,414.00	1,185,222,600
レック	24,700	990.00	24,453,000
三光合成	21,800	540.00	11,772,000
きもと	17,000	183.00	3,111,000
藤森工業	13,700	3,785.00	51,854,500
前澤化成工業	11,200	1,493.00	16,721,600
未来工業	6,200	3,760.00	23,312,000

ウェーブロックホールディングス	3,500	626.00	2,191,000
J S P	12,200	1,896.00	23,131,200
エフピコ	32,800	2,577.50	84,542,000
天馬	14,200	2,451.00	34,804,200
信越ポリマー	32,100	1,317.00	42,275,700
東リ	25,900	343.00	8,883,700
ニフコ	62,600	3,729.00	233,435,400
バルカー	14,500	3,985.00	57,782,500
ユニ・チャーム	361,400	5,053.00	1,826,154,200
ショーエイコーポレーション	3,400	590.00	2,006,000
協和キリン	209,500	2,374.00	497,353,000
武田薬品工業	1,535,000	4,352.00	6,680,320,000
アステラス製薬	1,638,500	1,882.00	3,083,657,000
住友ファーマ	128,700	480.00	61,776,000
塩野義製薬	218,700	6,993.00	1,529,369,100
わかもと製薬	10,800	211.00	2,278,800
日本新薬	40,900	5,510.00	225,359,000
中外製薬	542,900	4,548.00	2,469,109,200
科研製薬	29,700	3,344.00	99,316,800
エーザイ	211,000	8,085.00	1,705,935,000
ロート製薬	168,000	3,395.00	570,360,000
小野薬品工業	334,600	2,631.50	880,499,900
久光製薬	38,600	4,806.00	185,511,600
持田製薬	19,900	3,310.00	65,869,000
参天製薬	316,100	1,294.50	409,191,450
扶桑薬品工業	5,500	1,930.00	10,615,000
日本ケミファ	1,200	1,802.00	2,162,400
ツムラ	54,600	2,621.00	143,106,600
キッセイ薬品工業	25,500	3,210.00	81,855,000
生化学工業	33,100	769.00	25,453,900
栄研化学	28,200	1,463.00	41,256,600
鳥居薬品	9,300	3,850.00	35,805,000
J C R ファーマ	58,700	1,115.50	65,479,850
東和薬品	26,700	2,681.00	71,582,700
富士製薬工業	12,800	1,152.00	14,745,600
ゼリア新薬工業	24,000	2,008.00	48,192,000
そーせいグループ	55,900	1,344.00	75,129,600
第一三共	1,511,000	4,095.00	6,187,545,000
杏林製薬	37,600	1,785.00	67,116,000
大幸薬品	35,400	328.00	11,611,200
ダイト	13,300	1,917.00	25,496,100
大塚ホールディングス	360,800	4,980.00	1,796,784,000

大正製薬ホールディングス	38,500	5,926.00	228,151,000
ペプチドリーム	84,100	1,256.00	105,629,600
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,717.00	30,562,600
サワイグループホールディングス	39,700	4,575.00	181,627,500
日本コークス工業	156,400	109.00	17,047,600
ニチレキ	20,500	2,038.00	41,779,000
ユシロ化学工業	9,000	1,494.00	13,446,000
ビーピー・カストロール	4,500	902.00	4,059,000
富士石油	35,400	326.00	11,540,400
MORESCO	3,800	1,196.00	4,544,800
出光興産	192,600	3,332.00	641,743,200
ENEOSホールディングス	2,942,100	565.00	1,662,286,500
コスモエネルギーホールディングス	68,600	5,324.00	365,226,400
横浜ゴム	87,700	2,849.50	249,901,150
TOYO TIRE	99,700	2,225.00	221,832,500
ブリヂストン	507,700	5,808.00	2,948,721,600
住友ゴム工業	170,100	1,490.00	253,449,000
藤倉コンポジット	8,200	1,140.00	9,348,000
オカモト	9,400	5,040.00	47,376,000
フコク	9,100	1,461.00	13,295,100
ニッタ	17,600	3,390.00	59,664,000
住友理工	33,600	1,017.00	34,171,200
三ツ星ベルト	25,300	4,450.00	112,585,000
バンドー化学	25,700	1,514.00	38,909,800
日東紡績	19,600	3,550.00	69,580,000
AGC	161,800	5,169.00	836,344,200
日本板硝子	88,500	685.00	60,622,500
石塚硝子	1,900	2,521.00	4,789,900
日本山村硝子	4,500	1,590.00	7,155,000
日本電気硝子	70,900	2,770.00	196,393,000
オハラ	8,400	1,329.00	11,163,600
住友大阪セメント	24,500	3,501.00	85,774,500
太平洋セメント	110,500	2,514.50	277,852,250
日本ヒューム	15,400	866.00	13,336,400
日本コンクリート工業	34,300	300.00	10,290,000
三谷セキサン	7,300	4,365.00	31,864,500
アジアパイルホールディングス	27,400	679.00	18,604,600
東海カーボン	160,200	1,134.00	181,666,800
日本カーボン	9,200	4,430.00	40,756,000
東洋炭素	12,300	5,200.00	63,960,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,700	5,830.00	50,721,000
TOTO	114,500	3,674.00	420,673,000

日本碍子	201,800	1,774.00	357,993,200
日本特殊陶業	132,100	3,184.00	420,606,400
M A R U W A	6,400	22,490.00	143,936,000
品川リフラクトリーズ	24,500	1,445.00	35,402,500
黒崎播磨	3,600	9,230.00	33,228,000
ヨータイ	9,500	1,429.00	13,575,500
東京窯業	11,200	330.00	3,696,000
ニッカトー	5,500	596.00	3,278,000
フジインコーポレーテッド	41,500	2,920.00	121,180,000
クニミネ工業	3,600	997.00	3,589,200
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,103.00	2,536,900
ニチアス	43,900	3,020.00	132,578,000
ニチハ	21,800	2,940.00	64,092,000
日本製鉄	799,000	3,219.00	2,571,981,000
神戸製鋼所	358,900	1,788.00	641,713,200
中山製鋼所	36,800	848.00	31,206,400
合同製鐵	8,900	4,195.00	37,335,500
J F E ホールディングス	496,300	2,069.50	1,027,092,850
東京製鐵	50,200	1,637.00	82,177,400
共英製鋼	20,300	1,854.00	37,636,200
大和工業	29,400	6,969.00	204,888,600
東京鐵鋼	8,500	3,275.00	27,837,500
大阪製鐵	8,200	1,690.00	13,858,000
淀川製鋼所	20,300	3,525.00	71,557,500
中部鋼鈹	14,700	2,051.00	30,149,700
丸一鋼管	54,300	3,649.00	198,140,700
モリ工業	2,700	4,010.00	10,827,000
大同特殊鋼	22,500	5,895.00	132,637,500
日本高周波鋼業	4,100	601.00	2,464,100
日本冶金工業	13,000	4,145.00	53,885,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,646.00	46,569,600
愛知製鋼	10,300	3,745.00	38,573,500
日本金属	2,600	854.00	2,220,400
大平洋金属	12,700	1,283.00	16,294,100
新日本電工	88,900	288.00	25,603,200
栗本鐵工所	8,500	2,816.00	23,936,000
虹技	1,500	1,391.00	2,086,500
三菱製鋼	11,200	1,385.00	15,512,000
日亜鋼業	12,200	286.00	3,489,200
日本精線	2,400	4,805.00	11,532,000
エンビプロ・ホールディングス	8,200	627.00	5,141,400
シンニッタン	13,000	241.00	3,133,000

新家工業	2,600	3,060.00	7,956,000
大紀アルミニウム工業所	25,500	1,214.00	30,957,000
日本軽金属ホールディングス	48,200	1,583.00	76,300,600
三井金属鉱業	51,900	3,762.00	195,247,800
東邦亜鉛	10,600	1,608.00	17,044,800
三菱マテリアル	119,100	2,325.00	276,907,500
住友金属鉱山	206,900	4,138.00	856,152,200
D O W Aホールディングス	40,100	4,500.00	180,450,000
古河機械金属	26,200	1,907.00	49,963,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	3,120.00	81,744,000
東邦チタニウム	32,300	1,818.00	58,721,400
U A C J	25,000	3,000.00	75,000,000
C Kサンエツ	4,300	3,550.00	15,265,000
古河電気工業	59,400	2,245.50	133,382,700
住友電気工業	616,200	1,606.00	989,617,200
フジクラ	191,400	1,135.50	217,334,700
S W C C	20,000	1,998.00	39,960,000
タツタ電線	36,400	694.00	25,261,600
カナレ電気	2,100	1,409.00	2,958,900
平河ヒューテック	10,300	1,455.00	14,986,500
リョービ	19,000	2,682.00	50,958,000
アーレスティ	13,200	682.00	9,002,400
A R Eホールディングス	72,200	1,880.00	135,736,000
稲葉製作所	9,300	1,477.00	13,736,100
宮地エンジニアリンググループ	9,800	3,060.00	29,988,000
トーカロ	47,500	1,370.00	65,075,000
アルファC o	4,400	1,373.00	6,041,200
S U M C O	317,100	1,953.50	619,454,850
川田テクノロジーズ	4,200	6,340.00	26,628,000
R S Technologies	11,900	2,645.00	31,475,500
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,240.00	3,584,000
信和	6,600	746.00	4,923,600
東洋製罐グループホールディングス	106,400	2,460.50	261,797,200
ホッカンホールディングス	9,600	1,525.00	14,640,000
コロナ	10,000	915.00	9,150,000
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,657.00	59,251,100
駒井ハルテック	1,900	2,162.00	4,107,800
高田機工	1,000	3,105.00	3,105,000
三和ホールディングス	164,300	2,028.00	333,200,400
文化シャッター	51,400	1,130.00	58,082,000
三協立山	20,400	775.00	15,810,000
アルインコ	13,600	1,043.00	14,184,800

東洋シャッター	2,700	630.00	1,701,000	
LIXIL	260,000	1,616.50	420,290,000	
日本フィルコン	7,700	470.00	3,619,000	
ノーリツ	29,600	1,565.00	46,324,000	
長府製作所	17,700	2,105.00	37,258,500	
リンナイ	97,000	2,688.00	260,736,000	
ダイニチ工業	5,900	717.00	4,230,300	
日東精工	25,900	573.00	14,840,700	
三洋工業	1,400	2,041.00	2,857,400	
岡部	31,900	718.00	22,904,200	
ジーテクト	19,900	1,738.00	34,586,200	
東プレ	31,400	1,603.00	50,334,200	
高周波熱錬	27,500	1,012.00	27,830,000	
東京製綱	10,500	1,382.00	14,511,000	
サンコール	10,600	491.00	5,204,600	
モリテック スチール	8,800	286.00	2,516,800	
パイオラックス	24,600	2,147.00	52,816,200	
エイチワン	18,400	789.00	14,517,600	
日本発條	157,800	1,049.50	165,611,100	
中央発條	13,200	715.00	9,438,000	
アドバネクス	1,500	968.00	1,452,000	
立川ブラインド工業	8,100	1,363.00	11,040,300	
三益半導体工業	13,800	2,594.00	35,797,200	
日本ドライケミカル	2,800	2,096.00	5,868,800	
日本製鋼所	48,100	2,539.50	122,149,950	
三浦工業	73,000	2,953.00	215,569,000	
タクマ	53,700	1,467.00	78,777,900	
ツガミ	38,900	1,115.00	43,373,500	
オークマ	17,500	6,502.00	113,785,000	
芝浦機械	17,500	3,890.00	68,075,000	
アマダ	278,800	1,470.50	409,975,400	
アイダエンジニアリング	36,000	925.00	33,300,000	
TAKISAWA	3,100	2,597.00	8,050,700	
FUJI	75,900	2,355.50	178,782,450	
牧野フライス製作所	19,300	6,200.00	119,660,000	
オーエスジー	77,000	1,716.00	132,132,000	
ダイジェット工業	1,300	883.00	1,147,900	
旭ダイヤモンド工業	48,900	813.00	39,755,700	
DMG森精機	105,900	2,467.50	261,308,250	
ソディック	42,600	764.00	32,546,400	
ディスコ	84,100	28,000.00	2,354,800,000	
日東工器	8,500	1,926.00	16,371,000	

日進工具	14,600	1,078.00	15,738,800
パンチ工業	10,700	415.00	4,440,500
富士ダイス	5,500	644.00	3,542,000
豊和工業	6,500	763.00	4,959,500
リケンNPR	17,700	1,735.00	30,709,500
東洋機械金属	8,100	677.00	5,483,700
エンシュウ	2,600	755.00	1,963,000
島精機製作所	27,800	1,623.00	45,119,400
オプトラン	28,700	1,829.00	52,492,300
NCホールディングス	2,400	1,655.00	3,972,000
イワキポンプ	11,700	1,894.00	22,159,800
フリー	18,300	1,427.00	26,114,100
ヤマシンフィルタ	41,800	304.00	12,707,200
日阪製作所	17,000	956.00	16,252,000
やまびこ	28,600	1,387.00	39,668,200
野村マイクロ・サイエンス	5,900	5,800.00	34,220,000
平田機工	8,400	7,000.00	58,800,000
PEGASUS	19,400	610.00	11,834,000
マルマエ	7,600	1,409.00	10,708,400
タツモ	10,600	2,956.00	31,333,600
ナプテスコ	109,700	2,692.00	295,312,400
三井海洋開発	22,100	1,689.00	37,326,900
レオン自動機	18,400	1,320.00	24,288,000
SMC	56,600	70,110.00	3,968,226,000
ホソカワミクロン	11,200	4,140.00	46,368,000
ユニオンツール	7,700	3,730.00	28,721,000
瑞光	12,600	1,152.00	14,515,200
オイレス工業	24,400	1,927.00	47,018,800
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,525.00	31,675,000
サトーホールディングス	24,900	2,044.00	50,895,600
技研製作所	16,400	1,933.00	31,701,200
日本エアテック	8,200	1,317.00	10,799,400
カワタ	3,400	1,030.00	3,502,000
日精樹脂工業	13,100	1,029.00	13,479,900
オカダアイヨン	3,600	1,936.00	6,969,600
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,484.00	12,171,600
小松製作所	818,500	3,810.00	3,118,485,000
住友重機械工業	103,400	3,533.00	365,312,200
日立建機	69,600	4,089.00	284,594,400
日工	26,000	659.00	17,134,000
巴工業	6,800	2,808.00	19,094,400
井関農機	16,400	1,098.00	18,007,200

T O W A	17,800	5,370.00	95,586,000
丸山製作所	2,000	2,056.00	4,112,000
北川鉄工所	6,900	1,445.00	9,970,500
ローツェ	9,100	12,020.00	109,382,000
タカキタ	3,400	451.00	1,533,400
クボタ	916,700	2,018.00	1,849,900,600
荏原実業	9,200	2,619.00	24,094,800
三菱化工機	5,700	2,695.00	15,361,500
月島ホールディングス	23,700	1,253.00	29,696,100
帝国電機製作所	12,300	2,446.00	30,085,800
新東工業	35,400	1,041.00	36,851,400
澁谷工業	16,400	2,450.00	40,180,000
アイチ コーポレーション	24,400	921.00	22,472,400
小森コーポレーション	40,600	1,039.00	42,183,400
鶴見製作所	13,400	3,160.00	42,344,000
日本ギア工業	4,100	378.00	1,549,800
酒井重工業	1,900	5,280.00	10,032,000
荏原製作所	71,700	6,556.00	470,065,200
石井鐵工所	1,400	2,944.00	4,121,600
西島製作所	15,100	1,794.00	27,089,400
北越工業	17,600	1,876.00	33,017,600
ダイキン工業	208,500	22,015.00	4,590,127,500
オルガノ	24,000	3,935.00	94,440,000
トーヨーカネツ	6,700	3,325.00	22,277,500
栗田工業	97,700	4,332.00	423,236,400
椿本チエイン	24,800	3,840.00	95,232,000
大同工業	4,800	738.00	3,542,400
木村化工機	13,500	700.00	9,450,000
アネスト岩田	29,800	1,114.00	33,197,200
ダイフク	270,300	2,573.00	695,481,900
サムコ	4,700	4,250.00	19,975,000
加藤製作所	5,600	1,185.00	6,636,000
油研工業	1,800	2,216.00	3,988,800
タダノ	100,600	1,156.00	116,293,600
フジテック	61,300	3,235.00	198,305,500
C K D	48,300	2,038.00	98,435,400
平和	58,100	2,115.00	122,881,500
理想科学工業	14,000	2,357.00	32,998,000
S A N K Y O	34,300	6,260.00	214,718,000
日本金銭機械	19,300	965.00	18,624,500
マースグループホールディングス	10,300	2,524.00	25,997,200
フクシマガリレイ	12,900	4,870.00	62,823,000

オーイズミ	4,500	373.00	1,678,500
ダイコク電機	9,600	4,350.00	41,760,000
竹内製作所	31,700	4,580.00	145,186,000
アマノ	49,600	3,156.00	156,537,600
JUKI	27,200	594.00	16,156,800
ジャノメ	17,800	690.00	12,282,000
マックス	21,500	2,534.00	54,481,000
グローリー	42,000	2,780.00	116,760,000
新晃工業	17,600	2,153.00	37,892,800
大和冷機工業	26,800	1,322.00	35,429,600
セガサミーホールディングス	140,400	2,405.00	337,662,000
T P R	20,000	1,738.00	34,760,000
ツバキ・ナカシマ	35,100	716.00	25,131,600
ホシザキ	103,100	4,825.00	497,457,500
大豊工業	15,200	802.00	12,190,400
日本精工	291,100	821.20	239,051,320
N T N	344,400	270.30	93,091,320
ジェイテクト	155,500	1,259.50	195,852,250
不二越	12,900	3,755.00	48,439,500
日本トムソン	42,900	549.00	23,552,100
T H K	100,800	2,730.50	275,234,400
ユーシン精機	13,900	666.00	9,257,400
前澤給装工業	12,300	1,266.00	15,571,800
イーグル工業	19,300	1,648.00	31,806,400
前澤工業	6,700	885.00	5,929,500
日本ピラー工業	16,200	3,795.00	61,479,000
キッツ	58,500	1,015.00	59,377,500
マキタ	217,300	3,616.00	785,756,800
三井E & S	86,500	432.00	37,368,000
日立造船	143,200	793.00	113,557,600
三菱重工業	305,500	7,914.00	2,417,727,000
I H I	110,100	2,821.00	310,592,100
スター精密	32,900	1,843.00	60,634,700
日清紡ホールディングス	131,300	1,089.00	142,985,700
イビデン	100,300	7,414.00	743,624,200
コニカミノルタ	390,900	450.20	175,983,180
ブラザー工業	233,500	2,365.00	552,227,500
ミネベアミツミ	304,000	2,352.00	715,008,000
日立製作所	849,400	8,750.00	7,432,250,000
三菱電機	1,805,200	1,765.00	3,186,178,000
富士電機	106,200	6,237.00	662,369,400
東洋電機製造	3,800	942.00	3,579,600

安川電機	207,000	5,155.00	1,067,085,000
シンフォニアテクノロジー	19,300	1,540.00	29,722,000
明電舎	26,500	2,052.00	54,378,000
オリジン	2,600	1,269.00	3,299,400
山洋電気	7,600	6,190.00	47,044,000
デンヨー	13,300	2,117.00	28,156,100
P H C ホールディングス	24,700	1,443.00	35,642,100
ソシオネクスト	25,300	14,830.00	375,199,000
東芝テック	26,100	3,165.00	82,606,500
芝浦メカトロニクス	9,100	7,010.00	63,791,000
マブチモーター	43,500	4,355.00	189,442,500
ニデック	425,000	6,699.00	2,847,075,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,600	452.00	6,147,200
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,005.00	16,842,000
東光高岳	10,700	1,921.00	20,554,700
ダブル・スコープ	50,000	986.00	49,300,000
ダイヘン	15,800	4,700.00	74,260,000
ヤーマン	30,500	1,018.00	31,049,000
J V C ケンウッド	159,600	626.00	99,909,600
ミマキエンジニアリング	17,000	748.00	12,716,000
I - P E X	12,300	1,525.00	18,757,500
大崎電気工業	41,400	635.00	26,289,000
オムロン	160,100	6,210.00	994,221,000
日東工業	23,500	3,455.00	81,192,500
I D E C	25,800	2,792.00	72,033,600
正興電機製作所	4,200	1,143.00	4,800,600
不二電機工業	2,600	1,094.00	2,844,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,500	2,440.00	140,300,000
サクサホールディングス	2,400	2,317.00	5,560,800
メルコホールディングス	4,500	3,335.00	15,007,500
テクノメディカ	4,400	2,222.00	9,776,800
日本電気	247,000	7,636.00	1,886,092,000
富士通	174,000	17,020.00	2,961,480,000
沖電気工業	79,000	945.00	74,655,000
岩崎通信機	5,100	789.00	4,023,900
電気興業	7,000	2,455.00	17,185,000
サンケン電気	16,200	8,030.00	130,086,000
ナカヨ	1,900	1,218.00	2,314,200
アイホン	10,600	2,986.00	31,651,600
ルネサスエレクトロニクス	1,140,100	2,249.00	2,564,084,900
セイコーエプソン	224,100	2,309.00	517,446,900
ワコム	133,400	559.00	74,570,600

アルバック	41,500	5,483.00	227,544,500
アクセル	4,600	1,827.00	8,404,200
E I Z O	12,800	4,860.00	62,208,000
日本信号	39,800	914.00	36,377,200
京三製作所	36,600	484.00	17,714,400
能美防災	23,800	1,772.00	42,173,600
ホーチキ	13,300	1,632.00	21,705,600
星和電機	5,900	484.00	2,855,600
エレコム	42,000	1,735.00	72,870,000
パナソニック ホールディングス	2,063,100	1,487.50	3,068,861,250
シャープ	210,300	934.40	196,504,320
アンリツ	123,000	997.10	122,643,300
富士通ゼネラル	49,500	2,655.50	131,447,250
ソニーグループ	1,223,400	12,555.00	15,359,787,000
T D K	276,600	5,606.00	1,550,619,600
帝国通信工業	8,000	1,828.00	14,624,000
タムラ製作所	74,900	500.00	37,450,000
アルプスアルパイン	156,300	1,236.50	193,264,950
池上通信機	3,700	847.00	3,133,900
日本電波工業	21,200	1,216.00	25,779,200
鈴木	9,600	1,131.00	10,857,600
メイコー	19,200	3,225.00	61,920,000
日本トリム	4,000	2,915.00	11,660,000
ローランド ディー . ジー .	9,700	3,300.00	32,010,000
フォスター電機	16,200	948.00	15,357,600
S M K	4,200	2,344.00	9,844,800
ヨコオ	14,100	1,350.00	19,035,000
ホシデン	40,800	1,750.00	71,400,000
ヒロセ電機	28,100	17,820.00	500,742,000
日本航空電子工業	35,800	2,876.00	102,960,800
T O A	19,900	1,057.00	21,034,300
マクセル	35,600	1,605.00	57,138,000
古野電気	22,900	1,585.00	36,296,500
スミダコーポレーション	23,600	1,321.00	31,175,600
アイコム	6,700	3,495.00	23,416,500
リオン	7,300	2,375.00	17,337,500
横河電機	191,100	2,711.50	518,167,650
新電元工業	6,700	2,961.00	19,838,700
アズビル	120,800	4,492.00	542,633,600
東亜ディーケーケー	5,800	859.00	4,982,200
日本光電工業	80,000	3,571.00	285,680,000
チノー	7,200	2,046.00	14,731,200

共和電業	10,800	375.00	4,050,000
日本電子材料	11,400	1,409.00	16,062,600
堀場製作所	33,000	7,790.00	257,070,000
アドバンテスト	545,100	4,259.00	2,321,580,900
小野測器	5,500	434.00	2,387,000
エスベック	14,000	2,209.00	30,926,000
キーエンス	173,000	54,630.00	9,450,990,000
日置電機	8,200	6,740.00	55,268,000
シスメックス	149,300	7,056.00	1,053,460,800
日本マイクロニクス	31,200	2,349.00	73,288,800
メガチップス	14,200	4,115.00	58,433,000
O B A R A G R O U P	9,500	3,685.00	35,007,500
澤藤電機	1,600	1,247.00	1,995,200
原田工業	5,500	811.00	4,460,500
コーセル	21,100	1,155.00	24,370,500
イリソ電子工業	16,000	3,755.00	60,080,000
オブテックスグループ	31,900	1,669.00	53,241,100
千代田インテグレ	6,900	2,806.00	19,361,400
レーザーテック	79,300	26,500.00	2,101,450,000
スタンレー電気	121,900	2,388.00	291,097,200
ウシオ電機	88,000	1,935.50	170,324,000
岡谷電機産業	10,100	290.00	2,929,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	379.00	4,358,500
エノモト	3,100	1,650.00	5,115,000
日本セラミック	15,200	2,690.00	40,888,000
遠藤照明	5,400	1,191.00	6,431,400
古河電池	13,100	923.00	12,091,300
双信電機	5,700	337.00	1,920,900
山一電機	14,300	1,737.00	24,839,100
図研	15,100	3,620.00	54,662,000
日本電子	43,400	4,841.00	210,099,400
カシオ計算機	128,800	1,184.50	152,563,600
ファナック	843,300	3,823.00	3,223,935,900
日本シイエムケイ	37,200	668.00	24,849,600
エンプラス	5,100	9,620.00	49,062,000
大真空	21,500	738.00	15,867,000
ローム	319,900	2,724.50	871,567,550
浜松ホトニクス	138,800	5,921.00	821,834,800
三井ハイテック	17,900	6,730.00	120,467,000
新光電気工業	61,300	5,476.00	335,678,800
京セラ	268,700	7,324.00	1,967,958,800
太陽誘電	84,300	3,472.00	292,689,600

村田製作所	1,573,600	2,632.00	4,141,715,200
双葉電子工業	33,600	507.00	17,035,200
北陸電気工業	4,600	1,309.00	6,021,400
ニチコン	35,600	1,274.00	45,354,400
日本ケミコン	17,300	1,295.00	22,403,500
K O A	26,400	1,661.00	43,850,400
市光工業	31,800	529.00	16,822,200
小糸製作所	208,100	2,219.50	461,877,950
ミツバ	32,400	682.00	22,096,800
S C R E E Nホールディングス	59,100	7,243.00	428,061,300
キャノン電子	19,300	1,819.00	35,106,700
キャノン	862,600	3,695.00	3,187,307,000
リコー	433,600	1,226.50	531,810,400
象印マホービン	48,400	1,516.00	73,374,400
M U T O Hホールディングス	1,700	1,957.00	3,326,900
東京エレクトロン	366,000	20,085.00	7,351,110,000
イノテック	11,700	1,590.00	18,603,000
トヨタ紡織	72,900	2,549.00	185,822,100
芦森工業	2,200	2,022.00	4,448,400
ユニプレス	31,100	1,048.00	32,592,800
豊田自動織機	126,400	11,140.00	1,408,096,000
モリタホールディングス	30,400	1,554.00	47,241,600
三櫻工業	26,500	878.00	23,267,000
デンソー	1,426,900	2,312.50	3,299,706,250
東海理化電機製作所	48,800	2,204.00	107,555,200
川崎重工業	130,300	3,433.00	447,319,900
名村造船所	29,600	816.00	24,153,600
日本車輛製造	6,600	2,008.00	13,252,800
三菱ロジスネクスト	27,600	1,214.00	33,506,400
近畿車輛	1,600	1,972.00	3,155,200
日産自動車	2,456,700	600.90	1,476,231,030
いすゞ自動車	502,800	1,771.00	890,458,800
トヨタ自動車	9,496,200	2,617.00	24,851,555,400
日野自動車	223,000	531.40	118,502,200
三菱自動車工業	674,700	524.40	353,812,680
エフテック	8,100	710.00	5,751,000
レシップホールディングス	4,500	500.00	2,250,000
G M B	2,300	1,804.00	4,149,200
ファルテック	2,000	557.00	1,114,000
武蔵精密工業	42,300	1,462.00	61,842,600
日産車体	30,500	808.00	24,644,000
新明和工業	54,300	1,211.00	65,757,300

極東開発工業	28,600	1,767.00	50,536,200
トピー工業	14,100	2,367.00	33,374,700
ティラド	4,400	2,073.00	9,121,200
曙ブレーキ工業	105,500	126.00	13,293,000
タチエス	27,400	1,609.00	44,086,600
N O K	67,200	1,887.00	126,806,400
フタバ産業	46,500	696.00	32,364,000
カヤバ	16,700	4,375.00	73,062,500
大同メタル工業	34,000	513.00	17,442,000
プレス工業	77,400	642.00	49,690,800
ミクニ	13,400	438.00	5,869,200
太平洋工業	39,700	1,353.00	53,714,100
アイシン	133,400	5,386.00	718,492,400
マツダ	572,000	1,513.50	865,722,000
今仙電機製作所	7,400	587.00	4,343,800
本田技研工業	4,217,400	1,632.00	6,882,796,800
スズキ	317,600	5,788.00	1,838,268,800
S U B A R U	547,200	2,683.50	1,468,411,200
安永	5,100	737.00	3,758,700
ヤマハ発動機	249,100	3,778.00	941,099,800
T B K	11,700	389.00	4,551,300
エクセディ	28,300	2,486.00	70,353,800
豊田合成	50,500	2,953.00	149,126,500
愛三工業	28,700	1,160.00	33,292,000
盟和産業	1,700	989.00	1,681,300
日本プラスト	9,300	436.00	4,054,800
ヨロズ	16,300	890.00	14,507,000
エフ・シー・シー	30,700	1,768.00	54,277,600
シマノ	70,200	20,570.00	1,444,014,000
テイ・エス テック	79,200	1,663.50	131,749,200
ジャムコ	6,300	1,484.00	9,349,200
テルモ	531,900	3,869.00	2,057,921,100
クリエートメディック	3,800	908.00	3,450,400
日機装	40,300	927.00	37,358,100
日本エム・ディ・エム	10,300	714.00	7,354,200
島津製作所	210,600	3,701.00	779,430,600
J M S	16,000	526.00	8,416,000
長野計器	12,600	2,304.00	29,030,400
ブイ・テクノロジー	8,500	1,964.00	16,694,000
東京計器	13,300	1,474.00	19,604,200
愛知時計電機	6,700	1,920.00	12,864,000
インターアクション	8,200	1,026.00	8,413,200

オーバル	10,200	425.00	4,335,000
東京精密	38,100	7,080.00	269,748,000
マニー	69,200	2,058.00	142,413,600
ニコン	250,100	1,490.00	372,649,000
トプコン	91,000	1,705.00	155,155,000
オリンパス	1,064,500	1,965.50	2,092,274,750
理研計器	10,700	6,110.00	65,377,000
タムロン	10,600	4,275.00	45,315,000
H O Y A	366,400	14,615.00	5,354,936,000
シード	5,900	771.00	4,548,900
ノーリツ鋼機	16,400	3,185.00	52,234,000
A & D ホロンホールディングス	25,200	1,555.00	39,186,000
朝日インテック	193,200	2,550.00	492,660,000
シチズン時計	159,100	881.00	140,167,100
リズム	3,600	2,500.00	9,000,000
大研医器	8,700	529.00	4,602,300
メニコン	59,400	1,710.00	101,574,000
シンシア	1,400	522.00	730,800
松風	7,800	2,211.00	17,245,800
セイコーグループ	26,800	2,351.00	63,006,800
ニプロ	144,200	1,085.00	156,457,000
K Y O R I T S U	17,200	169.00	2,906,800
中本パックス	3,500	1,628.00	5,698,000
スノーピーク	24,700	1,021.00	25,218,700
パラマウントベッドホールディングス	39,900	2,369.00	94,523,100
トランザクション	11,400	1,958.00	22,321,200
粧美堂	3,100	460.00	1,426,000
ニホンフラッシュ	16,200	862.00	13,964,400
前田工織	14,600	2,891.00	42,208,600
永大産業	12,300	215.00	2,644,500
アートネイチャー	17,800	814.00	14,489,200
バンダイナムコホールディングス	473,800	3,107.00	1,472,096,600
アイフィスジャパン	3,200	602.00	1,926,400
S H O E I	39,100	2,089.00	81,679,900
フランスベッドホールディングス	19,900	1,184.00	23,561,600
パイロットコーポレーション	24,300	5,164.00	125,485,200
萩原工業	11,600	1,721.00	19,963,600
フジシールインターナショナル	35,000	1,678.00	58,730,000
タカラトミー	78,700	2,015.00	158,580,500
広済堂ホールディングス	7,800	2,743.00	21,395,400
エステールホールディングス	2,700	625.00	1,687,500
タカノ	4,300	811.00	3,487,300

プロネクサス	14,300	1,176.00	16,816,800
ホクシン	8,800	122.00	1,073,600
ウッドワン	3,800	1,059.00	4,024,200
TOPPANホールディングス	212,600	3,302.00	702,005,200
大日本印刷	189,000	3,870.00	731,430,000
共同印刷	4,900	2,996.00	14,680,400
NISSHA	29,600	1,593.00	47,152,800
光村印刷	1,000	1,281.00	1,281,000
TAKARA & COMPANY	11,100	2,271.00	25,208,100
アシックス	147,400	4,646.00	684,820,400
ツツミ	3,000	2,428.00	7,284,000
ローランド	12,700	4,185.00	53,149,500
小松ウオール工業	6,300	2,882.00	18,156,600
ヤマハ	109,000	3,945.00	430,005,000
河合楽器製作所	4,700	3,980.00	18,706,000
クリナップ	19,400	688.00	13,347,200
ピジョン	110,100	1,607.00	176,930,700
キングジム	15,300	890.00	13,617,000
リンテック	34,700	2,525.00	87,617,500
イトーキ	35,400	1,414.00	50,055,600
任天堂	1,091,900	6,101.00	6,661,681,900
三菱鉛筆	24,600	1,853.00	45,583,800
タカラスタANDARD	31,900	1,800.00	57,420,000
コクヨ	74,700	2,346.00	175,246,200
ナカバヤシ	18,600	509.00	9,467,400
グローブライド	14,000	1,891.00	26,474,000
オカムラ	52,100	2,134.00	111,181,400
美津濃	17,200	4,425.00	76,110,000
東京電力ホールディングス	1,559,000	636.20	991,835,800
中部電力	637,300	1,795.00	1,143,953,500
関西電力	667,800	1,943.00	1,297,535,400
中国電力	275,400	921.30	253,726,020
北陸電力	163,200	761.90	124,342,080
東北電力	422,800	940.70	397,727,960
四国電力	147,600	1,020.00	150,552,000
九州電力	398,700	953.30	380,080,710
北海道電力	167,100	633.90	105,924,690
沖縄電力	40,500	1,066.00	43,173,000
電源開発	130,200	2,319.50	301,998,900
エフオン	11,200	459.00	5,140,800
イーレックス	30,700	722.00	22,165,400
レノバ	46,100	1,082.00	49,880,200

東京瓦斯	365,600	3,402.00	1,243,771,200
大阪瓦斯	350,300	2,466.00	863,839,800
東邦瓦斯	68,100	2,590.00	176,379,000
北海道瓦斯	10,300	2,286.00	23,545,800
広島ガス	36,500	389.00	14,198,500
西部ガスホールディングス	16,200	1,950.00	31,590,000
静岡ガス	36,300	1,009.00	36,626,700
メタウォーター	20,700	1,836.00	38,005,200
SBSホールディングス	15,400	2,583.00	39,778,200
東武鉄道	190,000	3,520.00	668,800,000
相鉄ホールディングス	57,100	2,680.00	153,028,000
東急	484,900	1,645.00	797,660,500
京浜急行電鉄	196,200	1,243.50	243,974,700
小田急電鉄	262,100	2,066.00	541,498,600
京王電鉄	91,500	4,374.00	400,221,000
京成電鉄	111,500	5,541.00	617,821,500
富士急行	21,300	4,065.00	86,584,500
東日本旅客鉄道	293,300	7,739.00	2,269,848,700
西日本旅客鉄道	220,900	5,635.00	1,244,771,500
東海旅客鉄道	666,100	3,335.00	2,221,443,500
西武ホールディングス	209,200	1,427.00	298,528,400
鴻池運輸	29,500	1,904.00	56,168,000
西日本鉄道	46,200	2,391.50	110,487,300
ハマキョウレックス	13,500	3,775.00	50,962,500
サカイ引越センター	16,400	2,515.00	41,246,000
近鉄グループホールディングス	172,600	4,144.00	715,254,400
阪急阪神ホールディングス	230,200	4,637.00	1,067,437,400
南海電気鉄道	82,500	2,810.50	231,866,250
京阪ホールディングス	95,200	3,572.00	340,054,400
神戸電鉄	4,700	2,805.00	13,183,500
名古屋鉄道	190,800	2,077.00	396,291,600
山陽電気鉄道	13,000	2,066.00	26,858,000
アルプス物流	13,800	1,640.00	22,632,000
ヤマトホールディングス	221,100	2,381.00	526,439,100
山九	43,900	5,090.00	223,451,000
丸運	5,600	243.00	1,360,800
丸全昭和運輸	10,700	3,760.00	40,232,000
センコーグループホールディングス	91,400	1,028.00	93,959,200
トナミホールディングス	3,800	4,345.00	16,511,000
ニッコンホールディングス	55,300	3,239.00	179,116,700
日本石油輸送	1,200	2,735.00	3,282,000
福山通運	13,100	4,055.00	53,120,500

セイノーホールディングス	97,100	2,129.50	206,774,450
エスライングループ本社	3,200	875.00	2,800,000
神奈川中央交通	4,900	3,015.00	14,773,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,700	2,034.00	84,817,800
C & F ロジホールディングス	16,600	1,372.00	22,775,200
九州旅客鉄道	122,100	3,021.00	368,864,100
S Gホールディングス	331,300	1,905.00	631,126,500
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,600	7,580.00	444,188,000
日本郵船	462,200	3,863.00	1,785,478,600
商船三井	304,700	4,088.00	1,245,613,600
川崎汽船	129,900	5,225.00	678,727,500
N S ユナイテッド海運	9,600	4,255.00	40,848,000
飯野海運	64,600	1,035.00	66,861,000
共栄タンカー	3,600	832.00	2,995,200
乾汽船	23,000	1,221.00	28,083,000
日本航空	424,100	2,657.00	1,126,833,700
A N Aホールディングス	469,800	2,871.50	1,349,030,700
パスコ	2,200	1,582.00	3,480,400
トランコム	5,000	7,140.00	35,700,000
日新	13,100	2,559.00	33,522,900
三菱倉庫	37,100	3,879.00	143,910,900
三井倉庫ホールディングス	16,100	4,220.00	67,942,000
住友倉庫	46,600	2,385.00	111,141,000
澁澤倉庫	6,900	2,968.00	20,479,200
東陽倉庫	3,000	1,415.00	4,245,000
日本トランスシティ	34,700	651.00	22,589,700
ケイヒン	2,000	1,862.00	3,724,000
中央倉庫	8,300	1,065.00	8,839,500
川西倉庫	1,900	1,033.00	1,962,700
安田倉庫	11,800	1,082.00	12,767,600
ファイズホールディングス	2,100	1,031.00	2,165,100
東洋埠頭	3,300	1,391.00	4,590,300
上組	82,800	3,054.00	252,871,200
サンリツ	2,600	719.00	1,869,400
キムラユニティー	5,500	1,216.00	6,688,000
キューソー流通システム	5,900	940.00	5,546,000
東海運	6,700	283.00	1,896,100
エーアイティー	10,800	1,626.00	17,560,800
内外トランスライン	6,900	2,398.00	16,546,200
日本コンセプト	6,300	1,727.00	10,880,100
N E C ネットズエスアイ	58,000	1,977.00	114,666,000
クロスキャット	9,900	1,004.00	9,939,600

システナ	291,700	253.00	73,800,100
デジタルアーツ	11,000	4,250.00	46,750,000
日鉄ソリューションズ	29,600	4,090.00	121,064,000
キューブシステム	10,300	1,067.00	10,990,100
コア	7,700	1,665.00	12,820,500
手間いらず	2,900	2,138.00	6,200,200
ラクーンホールディングス	14,400	683.00	9,835,200
ソリトンシステムズ	9,000	1,109.00	9,981,000
ソフトクリエイイトホールディングス	14,300	1,740.00	24,882,000
T I S	189,700	3,142.00	596,037,400
テクミラホールディングス	5,400	400.00	2,160,000
グリー	46,600	561.00	26,142,600
G M Oペパボ	2,300	1,212.00	2,787,600
コーエーテクモホールディングス	108,700	2,026.50	220,280,550
三菱総合研究所	8,500	4,810.00	40,885,000
電算	1,400	1,571.00	2,199,400
A G S	4,900	675.00	3,307,500
ファインデックス	13,800	884.00	12,199,200
ブレインパッド	13,000	818.00	10,634,000
K L a b	31,900	270.00	8,613,000
ポールトゥウィンホールディングス	29,700	477.00	14,166,900
ネクソン	387,300	2,500.00	968,250,000
アイスタイル	51,500	433.00	22,299,500
エムアップホールディングス	21,300	1,147.00	24,431,100
エイチーム	10,300	555.00	5,716,500
エニグモ	22,200	324.00	7,192,800
テクノスジャパン	9,500	723.00	6,868,500
コロブラ	67,300	581.00	39,101,300
ブロードリーフ	94,600	518.00	49,002,800
クロス・マーケティンググループ	7,000	644.00	4,508,000
デジタルハーツホールディングス	10,900	912.00	9,940,800
システム情報	13,800	928.00	12,806,400
メディアドゥ	6,900	1,197.00	8,259,300
じげん	50,600	506.00	25,603,600
ブイキューブ	20,900	349.00	7,294,100
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	490.00	1,372,000
サイバーリンクス	4,500	719.00	3,235,500
フィックスターズ	19,600	1,000.00	19,600,000
C A R T A H O L D I N G S	8,200	1,182.00	9,692,400
オブティム	14,300	806.00	11,525,800
セレス	7,000	911.00	6,377,000
S H I F T	11,500	26,420.00	303,830,000

ティーガイア	18,200	1,745.00	31,759,000
セック	1,600	3,635.00	5,816,000
テクマトリックス	31,700	1,487.00	47,137,900
プロシップ	7,600	1,299.00	9,872,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,200	2,303.50	104,118,200
GMOペイメントゲートウェイ	34,700	6,281.00	217,950,700
ザッパラス	3,300	435.00	1,435,500
システムリサーチ	5,400	3,175.00	17,145,000
インターネットイニシアティブ	94,800	2,452.00	232,449,600
さくらインターネット	19,500	1,119.00	21,820,500
ヴィンクス	2,800	1,190.00	3,332,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,503.00	13,265,900
SRAホールディングス	8,900	3,375.00	30,037,500
システムインテグレータ	3,500	404.00	1,414,000
朝日ネット	18,700	603.00	11,276,100
eBASE	24,500	652.00	15,974,000
アバントグループ	21,900	1,208.00	26,455,200
アドソル日進	7,300	1,563.00	11,409,900
ODKソリューションズ	2,600	547.00	1,422,200
フリービット	9,100	1,041.00	9,473,100
コムチュア	23,000	2,128.00	48,944,000
サイバーコム	1,900	1,220.00	2,318,000
アステリア	13,600	668.00	9,084,800
アイル	8,100	3,610.00	29,241,000
マークラインズ	9,400	2,803.00	26,348,200
メディカル・データ・ビジョン	20,800	687.00	14,289,600
gumi	25,700	451.00	11,590,700
ショーケース	2,800	319.00	893,200
モバイルファクトリー	2,500	802.00	2,005,000
テラスカイ	7,500	1,523.00	11,422,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,606.00	16,060,000
PCIホールディングス	4,400	1,009.00	4,439,600
アイビーシー	1,800	508.00	914,400
ネオジャパン	5,800	954.00	5,533,200
PR TIMES	4,400	1,619.00	7,123,600
ラクス	82,100	1,800.50	147,821,050
ランドコンピュータ	2,800	1,314.00	3,679,200
ダブルスタンダード	7,000	1,431.00	10,017,000
オープンドア	12,200	766.00	9,345,200
アカツキ	8,200	2,054.00	16,842,800
ベネフィットジャパン	700	1,186.00	830,200
Ubicomホールディングス	5,400	1,066.00	5,756,400

カナミックネットワーク	18,700	453.00	8,471,100
ノムラシステムコーポレーション	12,900	109.00	1,406,100
チェンジホールディングス	42,500	1,507.00	64,047,500
シンクロ・フード	7,400	546.00	4,040,400
オークネット	7,500	1,699.00	12,742,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	761.00	1,750,300
セグエグループ	3,700	972.00	3,596,400
エイトレッド	1,800	1,319.00	2,374,200
マクロミル	34,100	667.00	22,744,700
ビーグリー	2,500	1,073.00	2,682,500
オロ	6,300	2,017.00	12,707,100
ユーザーローカル	6,300	1,571.00	9,897,300
テモナ	2,800	254.00	711,200
ニーズウェル	6,400	626.00	4,006,400
マネーフォワード	38,600	3,772.00	145,599,200
サインポスト	4,500	488.00	2,196,000
Sun Asterisk	12,300	1,141.00	14,034,300
プラスアルファ・コンサルティング	10,200	2,494.00	25,438,800
電算システムホールディングス	7,700	2,722.00	20,959,400
Appier Group	59,200	1,375.00	81,400,000
ソルクシーズ	9,400	408.00	3,835,200
フェイス	3,300	487.00	1,607,100
プロトコーポレーション	21,700	1,111.00	24,108,700
ハイマックス	5,400	1,390.00	7,506,000
野村総合研究所	345,500	3,739.00	1,291,824,500
サイバネットシステム	13,900	776.00	10,786,400
CEホールディングス	6,000	514.00	3,084,000
日本システム技術	4,800	2,174.00	10,435,200
インタージホールディングス	19,600	1,767.00	34,633,200
東邦システムサイエンス	4,900	1,258.00	6,164,200
ソースネクスト	88,400	175.00	15,470,000
インフォコム	22,400	2,607.00	58,396,800
シンプレクス・ホールディングス	29,800	2,646.00	78,850,800
HEROZ	5,900	1,366.00	8,059,400
ラクスル	41,800	1,138.00	47,568,400
メルカリ	105,100	3,054.00	320,975,400
I P S	5,600	2,420.00	13,552,000
F I G	13,500	340.00	4,590,000
システムサポート	6,700	1,883.00	12,616,100
イーソル	12,500	698.00	8,725,000
東海ソフト	1,700	1,113.00	1,892,100
ウイングアーク1st	17,900	2,746.00	49,153,400

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,210.00	5,687,000
サーバーワークス	3,500	3,520.00	12,320,000
東名	900	1,884.00	1,695,600
ヴィッツ	1,200	890.00	1,068,000
トピラシステムズ	3,300	878.00	2,897,400
S a n s a n	56,900	1,102.00	62,703,800
L i n k - U	2,800	721.00	2,018,800
ギフトィ	15,200	1,265.00	19,228,000
メドレー	23,300	4,230.00	98,559,000
ベース	5,900	4,130.00	24,367,000
J M D C	28,700	4,870.00	139,769,000
フォーカスシステムズ	12,700	967.00	12,280,900
クレスコ	13,400	1,628.00	21,815,200
フジ・メディア・ホールディングス	166,600	1,510.00	251,566,000
オービック	58,000	22,290.00	1,292,820,000
ジャストシステム	24,900	2,728.50	67,939,650
T D C ソフト	14,600	1,528.00	22,308,800
L I N E ヤフー	2,468,900	382.30	943,860,470
トレンドマイクロ	82,000	5,597.00	458,954,000
I D ホールディングス	11,700	1,445.00	16,906,500
日本オラクル	33,200	10,575.00	351,090,000
アルファシステムズ	5,500	2,789.00	15,339,500
フューチャー	37,000	1,446.00	53,502,000
C A C H o l d i n g s	10,000	1,757.00	17,570,000
S B テクノロジー	7,400	2,117.00	15,665,800
トーセ	3,400	713.00	2,424,200
オービックビジネスコンサルタント	34,100	6,060.00	206,646,000
アイティフォー	22,900	1,067.00	24,434,300
東計電算	2,400	6,140.00	14,736,000
エクスネット	1,600	1,046.00	1,673,600
大塚商会	86,000	5,952.00	511,872,000
サイボウズ	23,900	1,701.00	40,653,900
電通国際情報サービス	21,100	5,210.00	109,931,000
A C C E S S	20,600	733.00	15,099,800
デジタルガレージ	30,800	2,809.00	86,517,200
E M システムズ	29,000	713.00	20,677,000
ウェザーニューズ	5,400	5,820.00	31,428,000
C I J	28,900	534.00	15,432,600
ビジネスエンジニアリング	2,500	3,345.00	8,362,500
日本エンタープライズ	12,200	121.00	1,476,200
WOWOW	13,100	1,090.00	14,279,000
スカラ	16,100	753.00	12,123,300

インテリジェント ウェイブ	6,200	903.00	5,598,600	
ANYCOLOR	6,100	3,420.00	20,862,000	
IMAGICA GROUP	14,500	576.00	8,352,000	
ネットワンシステムズ	64,600	2,663.50	172,062,100	
システムソフト	60,800	66.00	4,012,800	
アルゴグラフィックス	15,900	3,135.00	49,846,500	
マーベラス	28,200	685.00	19,317,000	
エイベックス	29,500	1,328.00	39,176,000	
BIPROGY	63,800	3,669.00	234,082,200	
都築電気	9,200	2,195.00	20,194,000	
TBSホールディングス	88,800	2,400.00	213,120,000	
日本テレビホールディングス	153,600	1,471.50	226,022,400	
朝日放送グループホールディングス	16,300	664.00	10,823,200	
テレビ朝日ホールディングス	42,100	1,621.00	68,244,100	
スカパーJ SATホールディングス	153,900	704.00	108,345,600	
テレビ東京ホールディングス	12,500	2,883.00	36,037,500	
日本BS放送	4,200	887.00	3,725,400	
ビジョン	26,100	1,280.00	33,408,000	
スマートバリュー	2,900	373.00	1,081,700	
USEN-NEXT HOLDINGS	19,400	3,450.00	66,930,000	
ワイヤレスゲート	5,200	188.00	977,600	
日本通信	160,200	204.00	32,680,800	
クロップス	1,900	941.00	1,787,900	
日本電信電話	55,562,800	173.60	9,645,702,080	
KDDI	1,340,300	4,452.00	5,967,015,600	
ソフトバンク	2,789,200	1,673.50	4,667,726,200	
光通信	20,400	21,335.00	435,234,000	
エムティーアイ	11,900	577.00	6,866,300	
GMOインターネットグループ	64,100	2,182.50	139,898,250	
ファイバーゲート	9,400	1,121.00	10,537,400	
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	243.00	680,400	
KADOKAWA	91,700	2,995.50	274,687,350	
学研ホールディングス	28,900	825.00	23,842,500	
ゼンリン	29,700	927.00	27,531,900	
昭文社ホールディングス	5,000	346.00	1,730,000	
インプレスホールディングス	10,300	172.00	1,771,600	
アイネット	10,500	1,705.00	17,902,500	
松竹	9,900	9,048.00	89,575,200	
東宝	108,600	4,866.00	528,447,600	
東映	4,800	17,950.00	86,160,000	
NTTデータグループ	544,200	1,768.00	962,145,600	
ピー・シー・エー	10,000	1,163.00	11,630,000	

ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,029.00	15,014,600	
D T S	36,900	3,235.00	119,371,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	87,200	5,048.00	440,185,600	
シーイーシー	24,300	1,530.00	37,179,000	
カブコン	172,400	5,288.00	911,651,200	
アイ・エス・ビー	8,900	1,319.00	11,739,100	
ジャステック	10,700	1,502.00	16,071,400	
S C S K	141,600	2,466.00	349,185,600	
N S W	6,800	2,704.00	18,387,200	
アイネス	12,200	1,588.00	19,373,600	
T K C	27,700	3,500.00	96,950,000	
富士ソフト	34,900	5,410.00	188,809,000	
N S D	61,900	2,772.00	171,586,800	
コナミグループ	74,200	8,116.00	602,207,200	
福井コンピュータホールディングス	12,100	2,570.00	31,097,000	
J B C Cホールディングス	12,700	2,832.00	35,966,400	
ミロク情報サービス	15,800	1,560.00	24,648,000	
ソフトバンクグループ	855,600	6,255.00	5,351,778,000	
高千穂交易	4,400	3,190.00	14,036,000	
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,862.00	3,351,600	
伊藤忠食品	4,100	6,600.00	27,060,000	
エレマテック	16,400	1,755.00	28,782,000	
あらた	14,000	5,390.00	75,460,000	
トーメンデバイス	2,600	4,875.00	12,675,000	
東京エレクトロン デバイス	20,300	4,130.00	83,839,000	
円谷フィールズホールディングス	31,400	1,558.00	48,921,200	
双日	182,400	3,109.00	567,081,600	
アルフレッサ ホールディングス	183,700	2,381.50	437,481,550	
横浜冷凍	49,900	1,154.00	57,584,600	
ラサ商事	5,600	1,668.00	9,340,800	
アルコニックス	24,100	1,340.00	32,294,000	
神戸物産	141,600	3,768.00	533,548,800	
ハイパー	2,800	325.00	910,000	
あい ホールディングス	29,300	2,323.00	68,063,900	
ディーブイエックス	3,400	1,059.00	3,600,600	
ダイワボウホールディングス	74,800	2,790.00	208,692,000	
マクニカホールディングス	43,300	7,190.00	311,327,000	
ラクト・ジャパン	7,100	1,843.00	13,085,300	
グリムス	7,700	1,997.00	15,376,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,800	987.00	22,503,600	
八洲電機	14,800	1,252.00	18,529,600	
メディアスホールディングス	11,700	723.00	8,459,100	

レスターホールディングス	17,500	2,480.00	43,400,000
ジオリーブグループ	2,800	1,180.00	3,304,000
大光	5,200	677.00	3,520,400
OCHIホールディングス	2,800	1,387.00	3,883,600
TOKAIホールディングス	90,400	941.00	85,066,400
黒谷	3,400	589.00	2,002,600
Cominix	2,400	818.00	1,963,200
三洋貿易	20,700	1,295.00	26,806,500
ビューティガレージ	2,900	4,350.00	12,615,000
ウイン・パートナーズ	13,300	1,084.00	14,417,200
ミタチ産業	3,100	1,018.00	3,155,800
シップヘルスケアホールディングス	65,800	2,150.00	141,470,000
明治電機工業	6,800	1,380.00	9,384,000
デリカフーズホールディングス	4,800	619.00	2,971,200
スターティアホールディングス	2,400	1,516.00	3,638,400
コメダホールディングス	44,900	2,667.00	119,748,300
ピーバンドットコム	1,800	402.00	723,600
アセンテック	6,200	493.00	3,056,600
富士興産	2,700	1,751.00	4,727,700
協栄産業	1,100	2,415.00	2,656,500
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,749.00	47,007,900
ヤマエグループホールディングス	10,400	3,195.00	33,228,000
小野建	18,000	1,662.00	29,916,000
南陽	2,300	2,095.00	4,818,500
佐島電機	7,700	1,905.00	14,668,500
エコートレーディング	2,400	1,402.00	3,364,800
伯東	10,500	5,070.00	53,235,000
コンドーテック	14,100	1,113.00	15,693,300
中山福	6,600	354.00	2,336,400
ナガイレーベン	23,100	2,061.00	47,609,100
三菱食品	16,900	3,920.00	66,248,000
松田産業	13,900	2,505.00	34,819,500
第一興商	70,800	2,252.00	159,441,600
メディバルホールディングス	175,000	2,485.00	434,875,000
SPK	8,100	1,825.00	14,782,500
萩原電気ホールディングス	7,600	4,255.00	32,338,000
アズワン	26,100	4,694.00	122,513,400
スズデン	6,400	2,146.00	13,734,400
尾家産業	2,900	1,934.00	5,608,600
シモジマ	12,600	1,124.00	14,162,400
ドウシシャ	19,400	2,170.00	42,098,000
小津産業	2,700	1,588.00	4,287,600

高速	9,500	2,059.00	19,560,500
たけびし	7,000	1,821.00	12,747,000
リックス	2,500	3,040.00	7,600,000
丸文	16,400	1,138.00	18,663,200
ハピネット	15,600	2,417.00	37,705,200
橋本総業ホールディングス	7,300	1,175.00	8,577,500
日本ライフライン	53,700	1,110.00	59,607,000
タカショー	16,000	604.00	9,664,000
I D O M	55,400	857.00	47,477,800
進和	11,200	2,440.00	27,328,000
エスケイジャパン	3,000	761.00	2,283,000
ダイトロン	7,200	2,940.00	21,168,000
シークス	26,100	1,445.00	37,714,500
田中商事	3,500	677.00	2,369,500
オーハシテクニカ	8,900	1,631.00	14,515,900
白銅	6,600	2,176.00	14,361,600
ダイコー通産	1,300	1,108.00	1,440,400
伊藤忠商事	1,127,500	5,312.00	5,989,280,000
丸紅	1,416,400	2,215.50	3,138,034,200
高島	7,700	904.00	6,960,800
長瀬産業	83,900	2,305.00	193,389,500
蝶理	9,800	2,919.00	28,606,200
豊田通商	160,300	8,061.00	1,292,178,300
三共生興	25,400	810.00	20,574,000
兼松	71,000	1,940.00	137,740,000
ツカモトコーポレーション	1,700	1,268.00	2,155,600
三井物産	1,280,000	5,518.00	7,063,040,000
日本紙パルプ商事	9,700	4,615.00	44,765,500
カメイ	19,500	1,420.00	27,690,000
東都水産	600	6,390.00	3,834,000
O U G ホールディングス	1,800	2,340.00	4,212,000
スターゼン	13,900	2,472.00	34,360,800
山善	49,300	1,193.00	58,814,900
椿本興業	2,900	4,720.00	13,688,000
住友商事	1,107,200	2,951.00	3,267,347,200
内田洋行	7,400	6,820.00	50,468,000
三菱商事	1,115,600	6,947.00	7,750,073,200
第一実業	19,400	1,887.00	36,607,800
キャノンマーケティングジャパン	42,400	3,863.00	163,791,200
西華産業	7,200	2,149.00	15,472,800
佐藤商事	12,700	1,455.00	18,478,500
菱洋エレクトロ	15,600	3,470.00	54,132,000

東京産業	16,700	819.00	13,677,300
ユアサ商事	15,700	4,080.00	64,056,000
神鋼商事	4,600	5,440.00	25,024,000
トルク	6,600	283.00	1,867,800
阪和興業	32,900	4,410.00	145,089,000
正栄食品工業	12,200	4,360.00	53,192,000
カナデン	12,200	1,473.00	17,970,600
RYODEN	14,800	2,336.00	34,572,800
岩谷産業	41,700	7,216.00	300,907,200
ナイス	3,300	1,427.00	4,709,100
ニチモウ	1,600	3,850.00	6,160,000
極東貿易	10,900	1,773.00	19,325,700
アステナホールディングス	34,400	528.00	18,163,200
三愛オブリ	48,400	1,604.00	77,633,600
稲畑産業	36,200	3,070.00	111,134,000
G S I クレオス	10,600	2,018.00	21,390,800
明和産業	24,400	641.00	15,640,400
クワザワホールディングス	4,000	529.00	2,116,000
ワキタ	33,700	1,518.00	51,156,600
東邦ホールディングス	45,600	3,253.00	148,336,800
サンゲツ	46,000	2,860.00	131,560,000
ミツウロコグループホールディングス	23,400	1,287.00	30,115,800
シナネンホールディングス	5,900	3,915.00	23,098,500
伊藤忠エネクス	45,400	1,510.00	68,554,000
サンリオ	51,800	6,431.00	333,125,800
サンワテクノス	9,400	2,106.00	19,796,400
リョーサン	19,400	4,620.00	89,628,000
新光商事	24,600	1,160.00	28,536,000
トーヨー	7,800	2,810.00	21,918,000
三信電気	7,400	2,116.00	15,658,400
東陽テクニカ	18,600	1,277.00	23,752,200
モスフードサービス	26,900	3,225.00	86,752,500
加賀電子	14,900	6,120.00	91,188,000
ソーダニッカ	8,900	992.00	8,828,800
立花エレクトック	13,400	2,619.00	35,094,600
フォーバル	7,200	1,109.00	7,984,800
PALTAC	28,800	4,522.00	130,233,600
三谷産業	32,100	319.00	10,239,900
西本Wismettacホールディングス	4,600	5,220.00	24,012,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,944.00	1,944,000
コーア商事ホールディングス	10,300	722.00	7,436,600
KPPグループホールディングス	42,700	623.00	26,602,100

ヤマタネ	8,100	2,145.00	17,374,500
丸紅建材リース	1,100	2,520.00	2,772,000
泉州電業	9,200	3,275.00	30,130,000
トラスコ中山	38,400	2,315.00	88,896,000
オートバックスセブン	63,700	1,508.50	96,091,450
モリト	13,100	1,302.00	17,056,200
加藤産業	22,600	3,990.00	90,174,000
北恵	3,100	959.00	2,972,900
イエローハット	32,300	1,795.00	57,978,500
J Kホールディングス	14,100	939.00	13,239,900
日伝	10,800	2,582.00	27,885,600
北沢産業	6,600	266.00	1,755,600
杉本商事	8,100	2,143.00	17,358,300
因幡電機産業	47,400	3,175.00	150,495,000
東テク	6,100	4,940.00	30,134,000
ミスミグループ本社	276,200	2,333.00	644,374,600
アルテック	6,600	259.00	1,709,400
タキヒヨー	3,000	995.00	2,985,000
蔵王産業	2,000	2,468.00	4,936,000
スズケン	53,600	4,580.00	245,488,000
ジェコス	11,000	930.00	10,230,000
グローセル	14,700	469.00	6,894,300
ローソン	45,400	6,935.00	314,849,000
サンエー	14,100	4,775.00	67,327,500
カワチ薬品	14,500	2,447.00	35,481,500
エービーシー・マート	80,300	2,332.00	187,259,600
ハードオフコーポレーション	5,200	1,433.00	7,451,600
アスクル	38,100	2,014.00	76,733,400
ゲオホールディングス	18,200	2,115.00	38,493,000
アダストリア	22,200	3,050.00	67,710,000
くら寿司	21,600	3,255.00	70,308,000
キャンドゥ	6,700	2,467.00	16,528,900
I Kホールディングス	5,200	364.00	1,892,800
パルグループホールディングス	36,200	1,709.00	61,865,800
エディオン	72,800	1,474.00	107,307,200
サーラコーポレーション	39,100	721.00	28,191,100
ワッツ	6,800	555.00	3,774,000
ハローズ	8,400	4,005.00	33,642,000
あみやき亭	4,600	3,515.00	16,169,000
大黒天物産	5,700	6,330.00	36,081,000
ハニーズホールディングス	14,800	1,495.00	22,126,000
ファーマライズホールディングス	3,400	644.00	2,189,600

アルペン	15,400	1,923.00	29,614,200
ハブ	4,600	709.00	3,261,400
クオールホールディングス	25,400	1,685.00	42,799,000
ジーンズホールディングス	11,000	3,890.00	42,790,000
ビックカメラ	97,800	1,084.00	106,015,200
D C Mホールディングス	106,800	1,199.00	128,053,200
MonotaRO	259,700	1,215.50	315,665,350
東京一番フーズ	3,800	502.00	1,907,600
きちりホールディングス	2,900	896.00	2,598,400
J.フロント リテイリング	227,800	1,385.00	315,503,000
ドトール・日レスホールディングス	32,700	2,114.00	69,127,800
マツキヨココカラ&カンパニー	333,000	2,560.00	852,480,000
ブロンコピリー	10,900	2,977.00	32,449,300
Z O Z O	121,100	2,792.00	338,111,200
トレジャー・ファクトリー	8,000	1,120.00	8,960,000
物語コーポレーション	30,700	3,605.00	110,673,500
三越伊勢丹ホールディングス	308,400	1,632.00	503,308,800
Hamee	6,900	909.00	6,272,100
マーケットエンタープライズ	1,600	1,357.00	2,171,200
ウエルシアホールディングス	95,100	2,373.50	225,719,850
クリエイティブSDホールディングス	30,400	3,230.00	98,192,000
丸善C H Iホールディングス	15,800	324.00	5,119,200
ミサワ	3,000	612.00	1,836,000
ティーライフ	2,000	1,359.00	2,718,000
チムニー	3,800	1,371.00	5,209,800
シュッピン	14,000	1,003.00	14,042,000
オイシックス・ラ・大地	25,000	1,143.00	28,575,000
ネクステージ	42,000	2,110.00	88,620,000
ジョイフル本田	53,500	1,754.00	93,839,000
鳥貴族ホールディングス	6,900	2,861.00	19,740,900
ホットランド	14,300	1,898.00	27,141,400
すかいらーくホールディングス	250,400	2,095.00	524,588,000
S F Pホールディングス	10,000	2,133.00	21,330,000
綿半ホールディングス	14,500	1,299.00	18,835,500
ヨシックスホールディングス	2,600	2,658.00	6,910,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	60,100	1,043.00	62,684,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	682.00	6,138,000
B E E N O S	8,000	1,463.00	11,704,000
あさひ	15,700	1,252.00	19,656,400
日本調剤	12,800	1,380.00	17,664,000
コスモス薬品	18,100	14,265.00	258,196,500
トーエル	6,100	739.00	4,507,900

セブン&アイ・ホールディングス	630,600	5,227.00	3,296,146,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,600	984.00	135,398,400
ツルハホールディングス	38,500	10,530.00	405,405,000
サンマルクホールディングス	15,000	1,859.00	27,885,000
フェリシモ	3,200	936.00	2,995,200
トリドールホールディングス	45,700	3,450.00	157,665,000
TOKYO BASE	20,500	290.00	5,945,000
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,186.00	2,846,400
JMホールディングス	14,100	1,934.00	27,269,400
サツドラホールディングス	6,200	758.00	4,699,600
アレンザホールディングス	14,200	991.00	14,072,200
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,662.00	8,642,400
パロックジャパンリミテッド	12,500	781.00	9,762,500
クスリのアオキホールディングス	16,400	9,265.00	151,946,000
力の源ホールディングス	7,000	1,819.00	12,733,000
FOOD & LIFE COMPANIES	97,800	2,486.50	243,179,700
メディカルシステムネットワーク	17,100	429.00	7,335,900
はるやまホールディングス	6,100	515.00	3,141,500
ノジマ	60,100	1,306.00	78,490,600
カッパ・クリエイト	28,800	1,543.00	44,438,400
ライトオン	9,200	439.00	4,038,800
良品計画	200,000	2,001.00	400,200,000
パリミキホールディングス	16,500	340.00	5,610,000
アドヴァングループ	17,900	1,014.00	18,150,600
アルビス	6,200	2,391.00	14,824,200
コナカ	13,300	381.00	5,067,300
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,604.00	2,887,200
G - 7ホールディングス	23,200	1,181.00	27,399,200
イオン北海道	27,200	865.00	23,528,000
コジマ	31,000	633.00	19,623,000
ヒマラヤ	4,400	920.00	4,048,000
コーナン商事	24,800	3,935.00	97,588,000
エコス	7,000	2,095.00	14,665,000
ワタミ	22,100	1,116.00	24,663,600
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	369,500	2,825.50	1,044,022,250
西松屋チェーン	40,800	1,863.00	76,010,400
ゼンショーホールディングス	100,200	7,032.00	704,606,400
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,091.00	12,982,900
ハークスレイ	5,000	697.00	3,485,000
サイゼリヤ	27,100	5,690.00	154,199,000

VTホールディングス	70,500	503.00	35,461,500
魚力	5,900	2,146.00	12,661,400
フジ・コーポレーション	9,300	1,681.00	15,633,300
ユナイテッドアローズ	19,800	1,879.00	37,204,200
ハイデイ日高	27,300	2,577.00	70,352,100
YU-WA Creation Holdings	10,200	164.00	1,672,800
コロワイド	84,300	2,255.50	190,138,650
壱番屋	14,500	5,200.00	75,400,000
PLANT	3,500	805.00	2,817,500
スギホールディングス	36,900	5,667.00	209,112,300
薬王堂ホールディングス	10,400	2,682.00	27,892,800
スクロール	27,700	1,062.00	29,417,400
ヨンドシーホールディングス	16,000	1,893.00	30,288,000
木曽路	27,900	2,520.00	70,308,000
SRSホールディングス	30,700	1,023.00	31,406,100
千趣会	34,900	400.00	13,960,000
リテールパートナーズ	27,400	1,705.00	46,717,000
ケーヨー	29,600	1,297.00	38,391,200
上新電機	16,500	2,327.00	38,395,500
日本瓦斯	97,200	2,201.50	213,985,800
ロイヤルホールディングス	32,200	2,434.00	78,374,800
いなげや	17,900	1,591.00	28,478,900
チヨダ	18,000	828.00	14,904,000
ライフコーポレーション	16,000	3,550.00	56,800,000
リンガーハット	23,600	2,281.00	53,831,600
MrMaxHD	26,400	610.00	16,104,000
AOKIホールディングス	34,100	969.00	33,042,900
オークワ	29,400	825.00	24,255,000
コメリ	28,300	3,090.00	87,447,000
青山商事	39,400	1,417.00	55,829,800
しまむら	21,500	14,675.00	315,512,500
はせがわ	7,300	332.00	2,423,600
高島屋	138,000	1,972.50	272,205,000
松屋	31,200	906.00	28,267,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	89,200	1,591.00	141,917,200
近鉄百貨店	8,000	2,787.00	22,296,000
丸井グループ	135,000	2,352.00	317,520,000
アクシアル リテイリング	12,600	3,730.00	46,998,000
イオン	620,300	3,059.00	1,897,497,700
イズミ	27,800	3,803.00	105,723,400
平和堂	30,600	2,411.00	73,776,600
フジ	28,200	1,823.00	51,408,600

ヤオコー	20,700	7,489.00	155,022,300
ゼビオホールディングス	25,300	952.00	24,085,600
ケーズホールディングス	129,700	1,383.00	179,375,100
Olympicグループ	5,500	499.00	2,744,500
日産東京販売ホールディングス	16,600	454.00	7,536,400
シルバーライフ	4,000	1,040.00	4,160,000
Genky DrugStores	8,100	5,180.00	41,958,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,108.00	2,659,200
ブックオフグループホールディングス	8,400	1,035.00	8,694,000
ギフトホールディングス	8,000	2,106.00	16,848,000
アインホールディングス	25,300	4,072.00	103,021,600
元気寿司	5,300	5,120.00	27,136,000
ヤマダホールディングス	751,300	461.40	346,649,820
アークランズ	55,100	1,527.00	84,137,700
ニトリホールディングス	74,000	15,615.00	1,155,510,000
グルメ杵屋	15,300	1,055.00	16,141,500
愛眼	9,000	171.00	1,539,000
ケーユーホールディングス	11,100	1,108.00	12,298,800
吉野家ホールディングス	71,800	3,160.00	226,888,000
松屋フーズホールディングス	8,800	4,115.00	36,212,000
サガミホールディングス	29,800	1,306.00	38,918,800
関西フードマーケット	16,900	1,354.00	22,882,600
王将フードサービス	12,100	6,900.00	83,490,000
ミニストップ	13,400	1,487.00	19,925,800
アークス	33,700	2,772.00	93,416,400
パローホールディングス	35,100	2,193.00	76,974,300
ベルク	9,200	6,910.00	63,572,000
大庄	7,000	1,187.00	8,309,000
ファーストリテイリング	82,300	33,840.00	2,785,032,000
サンドラッグ	69,600	3,955.00	275,268,000
サックスパーホールディングス	17,900	838.00	15,000,200
ヤマザワ	2,600	1,251.00	3,252,600
やまや	2,700	2,874.00	7,759,800
ベルーナ	44,800	630.00	28,224,000
いよぎんホールディングス	202,700	1,066.50	216,179,550
しずおかフィナンシャルグループ	378,400	1,236.00	467,702,400
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,400	1,155.00	165,627,000
楽天銀行	59,200	2,390.00	141,488,000
京都フィナンシャルグループ	54,000	8,461.00	456,894,000
島根銀行	3,900	519.00	2,024,100
じもとホールディングス	10,000	407.00	4,070,000
めぶきフィナンシャルグループ	845,200	425.90	359,970,680

東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	4,435.00	96,683,000
九州フィナンシャルグループ	299,700	886.00	265,534,200
ゆうちょ銀行	467,900	1,334.00	624,178,600
富山第一銀行	54,100	934.00	50,529,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	913,900	689.00	629,677,100
西日本フィナンシャルホールディングス	105,700	1,728.00	182,649,600
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,853.00	28,165,600
第四北越フィナンシャルグループ	26,700	3,790.00	101,193,000
ひろぎんホールディングス	222,200	942.70	209,467,940
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,425.00	37,830,000
十六フィナンシャルグループ	22,100	3,805.00	84,090,500
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	5,150.00	92,185,000
プロクレアホールディングス	20,900	1,884.00	39,375,600
あいちフィナンシャルグループ	23,800	2,367.00	56,334,600
あおぞら銀行	107,100	2,858.50	306,145,350
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,667,100	1,235.00	13,173,868,500
りそなホールディングス	2,138,900	807.40	1,726,947,860
三井住友トラスト・ホールディングス	305,100	5,603.00	1,709,475,300
三井住友フィナンシャルグループ	1,210,500	7,190.00	8,703,495,000
千葉銀行	474,700	1,103.00	523,594,100
群馬銀行	330,500	693.90	229,333,950
武蔵野銀行	21,900	2,726.00	59,699,400
千葉興業銀行	26,600	903.00	24,019,800
筑波銀行	74,700	281.00	20,990,700
七十七銀行	54,500	3,220.00	175,490,000
秋田銀行	11,400	2,003.00	22,834,200
山形銀行	18,900	1,132.00	21,394,800
岩手銀行	11,700	2,661.00	31,133,700
東邦銀行	134,700	277.00	37,311,900
東北銀行	5,500	1,131.00	6,220,500
ふくおかフィナンシャルグループ	136,000	3,742.00	508,912,000
スルガ銀行	150,100	628.00	94,262,800
八十二銀行	359,800	821.00	295,395,800
山梨中央銀行	17,500	1,765.00	30,887,500
大垣共立銀行	32,500	1,979.00	64,317,500
福井銀行	15,200	1,548.00	23,529,600
清水銀行	6,800	1,611.00	10,954,800
富山銀行	1,700	1,750.00	2,975,000
滋賀銀行	28,300	3,730.00	105,559,000
南都銀行	25,600	2,616.00	66,969,600
百五銀行	160,200	536.00	85,867,200
紀陽銀行	60,900	1,485.00	90,436,500

ほくほくフィナンシャルグループ	108,300	1,652.00	178,911,600
山陰合同銀行	106,600	992.00	105,747,200
鳥取銀行	3,600	1,334.00	4,802,400
百十四銀行	15,500	2,710.00	42,005,000
四国銀行	27,100	1,029.00	27,885,900
阿波銀行	23,900	2,357.00	56,332,300
大分銀行	10,200	2,733.00	27,876,600
宮崎銀行	11,100	2,717.00	30,158,700
佐賀銀行	10,000	1,972.00	19,720,000
琉球銀行	39,000	1,183.00	46,137,000
セブン銀行	610,200	293.80	179,276,760
みずほフィナンシャルグループ	2,463,300	2,546.00	6,271,561,800
高知銀行	3,900	1,019.00	3,974,100
山口フィナンシャルグループ	167,000	1,292.50	215,847,500
名古屋銀行	11,200	5,350.00	59,920,000
北洋銀行	258,100	361.00	93,174,100
大光銀行	3,400	1,482.00	5,038,800
愛媛銀行	22,900	1,058.00	24,228,200
トマト銀行	3,700	1,165.00	4,310,500
京葉銀行	78,000	661.00	51,558,000
栃木銀行	78,000	325.00	25,350,000
北日本銀行	6,000	2,238.00	13,428,000
東和銀行	31,300	659.00	20,626,700
福島銀行	12,000	247.00	2,964,000
大東銀行	4,400	757.00	3,330,800
トモニホールディングス	137,700	474.00	65,269,800
フィデアホールディングス	17,600	1,584.00	27,878,400
池田泉州ホールディングス	218,100	329.00	71,754,900
F P G	57,700	1,273.00	73,452,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,680.00	23,520,000
マーキュリアホールディングス	6,000	737.00	4,422,000
S B I ホールディングス	248,300	3,121.00	774,944,300
ジャフコ グループ	57,000	1,547.00	88,179,000
大和証券グループ本社	1,218,100	851.30	1,036,968,530
野村ホールディングス	3,069,200	581.50	1,784,739,800
岡三証券グループ	149,800	705.00	105,609,000
丸三証券	56,900	803.00	45,690,700
東洋証券	57,000	324.00	18,468,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,700	497.00	92,292,900
光世証券	2,900	580.00	1,682,000
水戸証券	46,100	452.00	20,837,200
いちよし証券	31,500	718.00	22,617,000

松井証券	100,800	754.00	76,003,200
マネックスグループ	183,800	638.00	117,264,400
極東証券	21,400	1,000.00	21,400,000
岩井コスモホールディングス	19,500	1,733.00	33,793,500
アイザワ証券グループ	24,700	1,140.00	28,158,000
マネーパートナーズグループ	12,400	295.00	3,658,000
スパークス・グループ	19,100	1,428.00	27,274,800
かんぽ生命保険	198,300	2,717.00	538,781,100
S O M P Oホールディングス	292,300	6,370.00	1,861,951,000
アニコム ホールディングス	57,800	556.00	32,136,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	346,600	5,427.00	1,880,998,200
第一生命ホールディングス	832,100	3,089.00	2,570,356,900
東京海上ホールディングス	1,683,600	3,353.00	5,645,110,800
T & Dホールディングス	457,100	2,543.50	1,162,633,850
アドバンスクリエイト	9,800	962.00	9,427,600
全国保証	44,600	4,888.00	218,004,800
あんしん保証	6,600	276.00	1,821,600
イントラスト	4,700	846.00	3,976,200
日本モーゲージサービス	6,800	530.00	3,604,000
C a s a	4,700	821.00	3,858,700
アルヒ	21,300	823.00	17,529,900
プレミアグループ	28,900	1,398.00	40,402,200
ネットプロテクションズホールディングス	57,300	275.00	15,757,500
クレディセゾン	108,100	2,253.50	243,603,350
芙蓉総合リース	15,700	11,690.00	183,533,000
みずほリース	25,400	4,715.00	119,761,000
東京センチュリー	31,900	5,831.00	186,008,900
日本証券金融	62,800	1,481.00	93,006,800
アイフル	282,900	386.00	109,199,400
リコーリース	16,200	4,360.00	70,632,000
イオンフィナンシャルサービス	98,000	1,226.00	120,148,000
アコム	304,800	353.90	107,868,720
ジャックス	18,200	5,140.00	93,548,000
オリエントコーポレーション	44,700	1,112.00	49,706,400
オリックス	1,118,200	2,699.50	3,018,580,900
三菱H C キャピタル	664,400	959.60	637,558,240
九州リースサービス	5,600	955.00	5,348,000
日本取引所グループ	478,700	2,954.00	1,414,079,800
イー・ギャランティ	27,800	1,753.00	48,733,400
アサックス	5,600	651.00	3,645,600
N E C キャピタルソリューション	8,400	3,090.00	25,956,000
R o b o t Home	51,000	188.00	9,588,000

大東建託	62,400	15,465.00	965,016,000
いちご	198,400	328.00	65,075,200
日本駐車場開発	183,900	207.00	38,067,300
スター・マイカ・ホールディングス	21,000	603.00	12,663,000
S R Eホールディングス	8,600	2,174.00	18,696,400
A Dワークスグループ	28,600	259.00	7,407,400
ヒューリック	397,900	1,345.50	535,374,450
野村不動産ホールディングス	106,800	3,687.00	393,771,600
三重交通グループホールディングス	37,800	538.00	20,336,400
サムティ	27,400	2,436.00	66,746,400
ディア・ライフ	30,000	757.00	22,710,000
地主	13,400	1,944.00	26,049,600
プレサンスコーポレーション	27,400	1,670.00	45,758,000
ハウスコム	2,600	875.00	2,275,000
J P M C	10,500	1,127.00	11,833,500
サンセイランディック	4,100	1,015.00	4,161,500
フージャースホールディングス	26,300	1,051.00	27,641,300
オープンハウスグループ	62,500	4,754.00	297,125,000
東急不動産ホールディングス	512,900	884.50	453,660,050
飯田グループホールディングス	145,400	2,312.00	336,164,800
イーランド	2,200	1,461.00	3,214,200
ムゲンエステート	8,300	1,005.00	8,341,500
A n d D oホールディングス	10,300	979.00	10,083,700
シーアールイー	9,900	1,560.00	15,444,000
ケイアイスター不動産	8,400	4,345.00	36,498,000
グッドコムアセット	16,500	994.00	16,401,000
ジェイ・エス・ビー	4,400	4,940.00	21,736,000
ロードスターキャピタル	11,500	1,842.00	21,183,000
テンポイノベーション	4,100	1,113.00	4,563,300
フェイスネットワーク	3,600	1,350.00	4,860,000
パーク24	111,000	1,659.00	184,149,000
パラカ	6,400	1,921.00	12,294,400
三井不動産	727,100	3,290.00	2,392,159,000
三菱地所	1,028,100	1,954.50	2,009,421,450
平和不動産	27,800	3,980.00	110,644,000
東京建物	149,200	2,031.50	303,099,800
京阪神ビルディング	29,200	1,365.00	39,858,000
住友不動産	308,100	3,726.00	1,147,980,600
テーオーシー	31,900	644.00	20,543,600
東京楽天地	3,000	4,135.00	12,405,000
レオパレス21	191,700	332.00	63,644,400
スターツコーポレーション	24,700	2,808.00	69,357,600

フジ住宅	24,900	720.00	17,928,000
空港施設	21,900	560.00	12,264,000
明和地所	6,100	1,160.00	7,076,000
ゴールドクレスト	16,500	2,386.00	39,369,000
エスリード	8,300	3,020.00	25,066,000
日神グループホールディングス	28,700	526.00	15,096,200
日本エスコン	31,900	893.00	28,486,700
MIRARTHホールディングス	86,100	469.00	40,380,900
A V A N T I A	7,200	824.00	5,932,800
イオンモール	88,700	1,736.50	154,027,550
毎日コムネット	5,200	730.00	3,796,000
ファースト住建	5,200	1,176.00	6,115,200
カチタス	46,100	2,057.00	94,827,700
トーセイ	28,700	1,768.00	50,741,600
穴吹興産	2,600	1,974.00	5,132,400
サンフロンティア不動産	28,900	1,457.00	42,107,300
F Jネクストホールディングス	18,600	1,041.00	19,362,600
インテリックス	2,800	509.00	1,425,200
ランドビジネス	4,200	298.00	1,251,600
サンネクスタグループ	4,100	975.00	3,997,500
グランディハウス	10,700	627.00	6,708,900
日本空港ビルデング	60,400	6,407.00	386,982,800
明豊ファシリティワークス	6,400	790.00	5,056,000
L I F U L L	62,100	226.00	14,034,600
M I X I	40,600	2,289.00	92,933,400
ジェイエシーリクルートメント	16,200	2,338.00	37,875,600
日本M & Aセンターホールディングス	305,500	665.30	203,249,150
メンバーズ	5,500	1,176.00	6,468,000
中広	2,400	410.00	984,000
UTグループ	26,300	1,932.00	50,811,600
アイティメディア	7,000	1,100.00	7,700,000
E・Jホールディングス	10,600	1,491.00	15,804,600
オープンアップグループ	53,500	1,869.00	99,991,500
コシダカホールディングス	53,500	1,009.00	53,981,500
アルトナー	3,100	1,674.00	5,189,400
パソナグループ	21,800	1,362.00	29,691,600
C D S	3,100	1,711.00	5,304,100
リンクアンドモチベーション	51,200	376.00	19,251,200
エス・エム・エス	68,100	2,275.00	154,927,500
サニーサイドアップグループ	3,900	792.00	3,088,800
パーソルホールディングス	1,961,900	216.40	424,555,160
リニカル	7,200	582.00	4,190,400

クックパッド	51,000	110.00	5,610,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	700.00	4,410,000
学情	9,200	1,705.00	15,686,000
スタジオアリス	9,000	2,030.00	18,270,000
シミックホールディングス	8,700	1,655.00	14,398,500
エプロ	3,700	766.00	2,834,200
N J S	4,000	2,799.00	11,196,000
総合警備保障	330,300	850.60	280,953,180
カカクコム	130,700	1,414.00	184,809,800
アイロムグループ	6,600	1,662.00	10,969,200
セントケア・ホールディング	11,700	823.00	9,629,100
サイネックス	2,500	858.00	2,145,000
ルネサンス	12,800	855.00	10,944,000
ディップ	31,200	2,935.00	91,572,000
デジタルホールディングス	12,900	1,008.00	13,003,200
新日本科学	19,000	1,682.00	31,958,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,895.00	4,927,000
ベネフィット・ワン	82,700	970.90	80,293,430
エムスリー	351,400	2,399.50	843,184,300
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	385.00	2,926,000
アウトソーシング	114,400	1,095.00	125,268,000
ウェルネット	9,600	563.00	5,404,800
ワールドホールディングス	8,100	2,331.00	18,881,100
ディー・エヌ・エー	71,300	1,435.00	102,315,500
博報堂D Yホールディングス	227,000	1,213.00	275,351,000
ぐるなび	33,700	262.00	8,829,400
タカミヤ	24,700	501.00	12,374,700
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	612.00	5,385,600
ファンコミュニケーションズ	32,300	400.00	12,920,000
ライク	6,800	1,362.00	9,261,600
A o b a - B B T	5,200	383.00	1,991,600
エスプール	51,900	325.00	16,867,500
W D Bホールディングス	9,200	2,022.00	18,602,400
ティア	7,700	443.00	3,411,100
C D G	1,500	1,177.00	1,765,500
アドウェイズ	25,000	535.00	13,375,000
バリューコマース	15,900	1,225.00	19,477,500
インフォマート	185,400	369.00	68,412,600
J Pホールディングス	52,000	334.00	17,368,000
エコナックホールディングス	12,300	137.00	1,685,100
C Lホールディングス	5,100	792.00	4,039,200
プレステージ・インターナショナル	75,400	599.00	45,164,600

アミューズ	9,800	1,482.00	14,523,600
ドリームインキュベータ	5,500	2,904.00	15,972,000
クイック	13,700	2,033.00	27,852,100
T A C	7,300	198.00	1,445,400
電通グループ	174,800	4,416.00	771,916,800
イオンファンタジー	7,800	2,742.00	21,387,600
シーティーエス	20,100	676.00	13,587,600
ネクシィーズグループ	4,000	880.00	3,520,000
H . U . グループホールディングス	52,200	2,444.50	127,602,900
アルプス技研	17,000	2,527.00	42,959,000
日本空調サービス	19,500	762.00	14,859,000
オリエンタルランド	940,900	4,578.00	4,307,440,200
ダスキン	39,700	3,250.00	129,025,000
明光ネットワークジャパン	22,100	695.00	15,359,500
ファルコホールディングス	8,200	1,965.00	16,113,000
ラウンドワン	149,300	534.00	79,726,200
リゾートトラスト	70,300	2,097.00	147,419,100
ビー・エム・エル	22,000	2,749.00	60,478,000
リソー教育	82,100	257.00	21,099,700
早稲田アカデミー	10,100	1,388.00	14,018,800
ユー・エス・エス	183,000	2,586.50	473,329,500
東京個別指導学院	21,700	500.00	10,850,000
サイバーエージェント	393,200	777.90	305,870,280
楽天グループ	1,522,600	575.00	875,495,000
クリーク・アンド・リバー社	10,600	1,868.00	19,800,800
S B I グローバルアセットマネジメント	29,600	538.00	15,924,800
テー・オー・ダブリュー	35,800	309.00	11,062,200
山田コンサルティンググループ	9,200	1,539.00	14,158,800
セントラルスポーツ	6,800	2,369.00	16,109,200
フルキャストホールディングス	17,100	1,699.00	29,052,900
エン・ジャパン	32,300	2,125.00	68,637,500
リソルホールディングス	1,100	4,980.00	5,478,000
テクノプロ・ホールディングス	105,300	2,953.00	310,950,900
アトラグループ	3,600	196.00	705,600
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	1,388.00	13,047,200
K e e P e r 技研	11,000	5,660.00	62,260,000
ファーストロジック	3,400	494.00	1,679,600
三機サービス	2,100	1,183.00	2,484,300
G u n o s y	14,600	721.00	10,526,600
デザインワン・ジャパン	4,800	171.00	820,800
イー・ガーディアン	6,900	1,692.00	11,674,800
リブセンス	6,500	290.00	1,885,000

ジャパンマテリアル	54,500	2,364.00	128,838,000
ベクトル	28,200	1,128.00	31,809,600
ウチヤマホールディングス	5,900	344.00	2,029,600
チャーム・ケア・コーポレーション	15,100	1,089.00	16,443,900
キャリアリンク	6,600	2,425.00	16,005,000
I B J	14,100	633.00	8,925,300
アサンテ	9,000	1,586.00	14,274,000
バリューHR	15,800	1,212.00	19,149,600
M & Aキャピタルパートナーズ	14,500	2,520.00	36,540,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,000.00	6,600,000
E R Iホールディングス	3,200	1,763.00	5,641,600
アビスト	1,900	3,095.00	5,880,500
シグマクシス・ホールディングス	27,200	1,455.00	39,576,000
ウィルグループ	15,100	1,095.00	16,534,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,700	137.00	2,013,900
メドピア	15,900	955.00	15,184,500
レアジョブ	2,600	906.00	2,355,600
リクルートホールディングス	1,316,300	4,498.00	5,920,717,400
エラン	23,900	749.00	17,901,100
土木管理総合試験所	6,400	330.00	2,112,000
日本郵政	2,139,500	1,278.50	2,735,350,750
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,476.00	35,424,000
鎌倉新書	20,700	590.00	12,213,000
S M N	3,600	376.00	1,353,600
グローバルキッズCOMPANY	2,700	620.00	1,674,000
エアトリ	13,200	1,717.00	22,664,400
アトラエ	10,800	1,029.00	11,113,200
ストライク	7,600	3,250.00	24,700,000
ソラスト	49,500	561.00	27,769,500
セラク	5,700	1,242.00	7,079,400
インソース	38,900	852.00	33,142,800
ベイカレント・コンサルティング	140,800	3,969.00	558,835,200
Orchestra Holdings	4,100	910.00	3,731,000
アイモバイル	8,100	1,339.00	10,845,900
キャリアインデックス	5,100	267.00	1,361,700
MS - Japan	4,100	1,136.00	4,657,600
船場	2,800	888.00	2,486,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,500	1,915.00	121,602,500
フルテック	1,900	1,154.00	2,192,600
GameWith	4,500	294.00	1,323,000
MS & Consulting	1,900	643.00	1,221,700
ウェルビー	13,500	610.00	8,235,000

エル・ティー・エス	2,100	3,175.00	6,667,500
ミダックホールディングス	10,900	1,711.00	18,649,900
キュービーネットホールディングス	8,600	1,567.00	13,476,200
R P Aホールディングス	25,000	297.00	7,425,000
スプリックス	3,800	798.00	3,032,400
マネジメントソリューションズ	7,700	2,396.00	18,449,200
プロレド・パートナーズ	5,000	401.00	2,005,000
テノ・ホールディングス	2,000	510.00	1,020,000
フロンティア・マネジメント	5,200	1,560.00	8,112,000
ピアラ	2,900	400.00	1,160,000
コプロ・ホールディングス	4,200	1,185.00	4,977,000
ギークス	2,000	653.00	1,306,000
アンビスホールディングス	19,100	2,312.00	44,159,200
カーブスホールディングス	49,000	653.00	31,997,000
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,294.00	13,716,400
Fast Fitness Japan	6,300	1,203.00	7,578,900
ダイレクトマーケティングミックス	19,000	410.00	7,790,000
ポピンズ	2,900	1,191.00	3,453,900
L I T A L I C O	14,000	1,875.00	26,250,000
コンフィデンス・インターワークス	800	1,497.00	1,197,600
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	422.00	2,574,200
リログループ	99,200	1,459.50	144,782,400
東祥	12,700	988.00	12,547,600
I D & Eホールディングス	10,800	3,325.00	35,910,000
ビーウィズ	4,600	2,022.00	9,301,200
T R Eホールディングス	37,700	1,128.00	42,525,600
人・夢・技術グループ	6,900	1,627.00	11,226,300
N I S S Oホールディングス	13,800	740.00	10,212,000
大栄環境	45,400	2,064.00	93,705,600
日本管財ホールディングス	18,800	2,451.00	46,078,800
M & A総研ホールディングス	8,500	2,716.00	23,086,000
エイチ・アイ・エス	51,800	1,630.00	84,434,000
ラックランド	8,200	2,842.00	23,304,400
共立メンテナンス	30,500	5,577.00	170,098,500
イチネンホールディングス	19,100	1,367.00	26,109,700
建設技術研究所	9,200	4,440.00	40,848,000
スペース	12,300	906.00	11,143,800
燦ホールディングス	15,400	1,047.00	16,123,800
スバル興業	700	12,790.00	8,953,000
東京テアトル	4,400	1,090.00	4,796,000
タナベコンサルティンググループ	4,900	1,117.00	5,473,300
ナガワ	4,800	6,610.00	31,728,000

東京都競馬	15,000	3,835.00	57,525,000
カナモト	27,700	2,444.00	67,698,800
ニシオホールディングス	16,600	3,260.00	54,116,000
トランス・コスモス	22,200	3,105.00	68,931,000
乃村工藝社	77,900	872.00	67,928,800
藤田観光	7,100	4,030.00	28,613,000
KNT-CTホールディングス	10,600	1,211.00	12,836,600
トーカイ	15,900	1,872.00	29,764,800
セコム	181,100	10,090.00	1,827,299,000
セントラル警備保障	9,700	2,480.00	24,056,000
丹青社	34,800	836.00	29,092,800
メイテックグループホールディングス	69,500	2,586.50	179,761,750
応用地質	16,700	2,250.00	37,575,000
船井総研ホールディングス	37,100	2,504.00	92,898,400
進学会ホールディングス	4,900	283.00	1,386,700
オオバ	7,700	890.00	6,853,000
いであ	3,400	1,629.00	5,538,600
学究社	7,200	2,003.00	14,421,600
ベネッセホールディングス	66,500	1,778.00	118,237,000
イオンディライト	19,800	3,260.00	64,548,000
ナック	7,900	962.00	7,599,800
ダイセキ	36,400	4,060.00	147,784,000
ステップ	6,600	1,714.00	11,312,400
合計	263,249,200		552,571,458,840

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年10月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	324,533,595
国債証券	537,757,860,640
地方債証券	32,732,279,798
特殊債券	36,597,485,692
社債券	28,806,683,000
未収入金	302,325,000
未収利息	881,425,086

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
前払費用	28,392,408
流動資産合計	637,430,985,219
資産合計	637,430,985,219
負債の部	
流動負債	
未払金	298,887,000
未払解約金	183,176,887
未払利息	143
その他未払費用	17
流動負債合計	482,064,047
負債合計	482,064,047
純資産の部	
元本等	
元本	482,957,007,939
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	153,991,913,233
元本等合計	636,948,921,172
純資産合計	636,948,921,172
負債純資産合計	637,430,985,219

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	482,957,007,939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 99,151,000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 1.3189円 (1万口当たり純資産額) (13,189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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2023年10月20日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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10月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	461,450,370,669円
期中追加設定元本額	33,615,091,852円
期中一部解約元本額	12,108,454,582円
期末元本額	482,957,007,939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）	5,440,731,848円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,675,936円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,297,825,047円
世界経済インデックスファンド	6,163,952,021円
D C マイセクション 2 5	28,285,354,291円
D C マイセクション 5 0	34,121,823,188円
D C マイセクション 7 5	10,796,877,897円
D C 日本債券インデックス・オープン	409,394,659円
D C 日本債券インデックス・オープン S	89,937,067,683円
D C 日本債券インデックス・オープン P	63,917,179,829円
D C マイセクション S 2 5	16,075,838,728円
D C マイセクション S 5 0	18,757,956,197円
D C マイセクション S 7 5	4,726,855,950円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	476,413,578円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	2,767,740,431円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,097,964,537円

区分	2023年10月20日現在
DC世界経済インデックスファンド	4,493,608,578円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,674,031円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,755,541円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,809,775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）	63,528,811円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	103,013,462円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	28,758,681円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,621,870円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,188,254,753円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	724,139,246円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,096,367,440円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	63,629,066円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	50,442,493円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	909,463,319円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,006,481,024円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,333,109,715円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	97,090,009円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,778,919,746円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,395,614,181円
分散投資コア戦略ファンドA	18,370,222,201円
分散投資コア戦略ファンドS	25,852,152,181円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	282,235,014円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,792,579,341円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	95,524,167円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,955,966円
SMT インデックスバランス・オープン	71,975,997円
SMT 世界経済インデックス・オープン	46,448,243円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	102,700,884円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	164,571,688円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,944,455円
グローバル経済コア	238,260,513円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	42,432,340円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,511,687円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	128,319,579円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	71,403,750円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,882,013円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	13,576,266円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	576,512,281円
10資産分散投資ファンド	314,840,119円
グローバル10資産バランスファンド	17,857,289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）	92,461,766,766円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	39,756,963円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,568,148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）	469,745,503円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	22,273,072,410
地方債証券	656,757,964
特殊債券	766,409,381
社債券	492,486,000
合計	24,188,725,755

(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442回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,401,464,000	
	第443回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,701,485,000	
	第444回利付国債(2年)	2,425,000,000	2,426,139,750	
	第445回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,160,440,800	
	第446回利付国債(2年)	2,760,000,000	2,760,745,200	
	第447回利付国債(2年)	1,000,000,000	1,000,140,000	
	第448回利付国債(2年)	60,000,000	59,995,200	
	第449回利付国債(2年)	1,220,000,000	1,219,695,000	
	第450回利付国債(2年)	50,000,000	49,978,500	
	第451回利付国債(2年)	1,180,000,000	1,179,681,400	
	第452回利付国債(2年)	3,340,000,000	3,336,893,800	
	第453回利付国債(2年)	670,000,000	669,155,800	
	第142回利付国債(5年)	3,910,000,000	3,916,334,200	
	第143回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,487,212,800	
	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	5,057,524,500	
	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,126,348,800	
	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,804,656,000	
	第147回利付国債(5年)	5,440,000,000	5,430,153,600	
	第148回利付国債(5年)	6,010,000,000	5,994,854,800	
	第149回利付国債(5年)	5,970,000,000	5,949,224,400	
	第150回利付国債(5年)	5,910,000,000	5,883,050,400	
	第151回利付国債(5年)	4,510,000,000	4,484,022,400	
	第152回利付国債(5年)	210,000,000	209,466,600	
	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	5,768,807,100	
	第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	5,153,892,800	
	第155回利付国債(5年)	2,590,000,000	2,593,703,700	
	第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,640,218,000	
	第157回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,453,955,600	
	第158回利付国債(5年)	3,730,000,000	3,698,332,300	
	第159回利付国債(5年)	950,000,000	940,186,500	
	第160回利付国債(5年)	3,150,000,000	3,131,919,000	
	第161回利付国債(5年)	1,510,000,000	1,507,916,200	
第1回利付国債(40年)	740,000,000	838,020,400		
第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,233,519,300		

第3回利付国債(40年)	650,000,000	707,934,500	
第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,033,001,500	
第5回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,199,990,500	
第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,287,934,200	
第7回利付国債(40年)	1,340,000,000	1,304,691,000	
第8回利付国債(40年)	1,490,000,000	1,342,132,400	
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,477,814,000	
第10回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,570,167,600	
第11回利付国債(40年)	1,525,000,000	1,126,761,500	
第12回利付国債(40年)	1,320,000,000	863,913,600	
第13回利付国債(40年)	2,330,000,000	1,506,438,200	
第14回利付国債(40年)	2,170,000,000	1,497,473,600	
第15回利付国債(40年)	2,950,000,000	2,241,056,000	
第16回利付国債(40年)	1,220,000,000	1,013,917,600	
第336回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,358,451,000	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,811,032,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,586,584,800	
第339回利付国債(10年)	3,970,000,000	3,995,646,200	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,460,832,800	
第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	5,046,505,600	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,762,284,800	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,670,000,000	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,895,693,000	
第345回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,273,237,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,735,395,000	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,537,078,000	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,238,529,600	
第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,124,963,600	
第350回利付国債(10年)	6,670,000,000	6,613,371,700	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,785,054,450	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,177,928,700	
第353回利付国債(10年)	4,475,000,000	4,414,945,500	
第354回利付国債(10年)	4,720,000,000	4,648,728,000	
第355回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,581,385,800	
第356回利付国債(10年)	4,630,000,000	4,541,937,400	
第357回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,316,877,700	
第358回利付国債(10年)	3,900,000,000	3,804,333,000	
第359回利付国債(10年)	4,145,000,000	4,031,675,700	
第360回利付国債(10年)	4,910,000,000	4,759,704,900	
第361回利付国債(10年)	4,810,000,000	4,644,872,700	
第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	4,666,476,000	
第363回利付国債(10年)	5,360,000,000	5,139,328,800	

第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,824,719,500	
第365回利付国債(10年)	6,267,000,000	5,967,562,740	
第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	4,941,422,400	
第367回利付国債(10年)	5,010,000,000	4,782,095,100	
第368回利付国債(10年)	5,230,000,000	4,977,286,400	
第369回利付国債(10年)	4,740,000,000	4,622,590,200	
第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,730,383,800	
第371回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,675,222,800	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	125,204,200	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	179,142,400	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	133,872,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	127,868,400	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,754,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	397,001,500	
第7回利付国債(30年)	380,000,000	429,343,000	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	926,670,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	253,152,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	164,414,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	281,481,200	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	212,874,100	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	444,468,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	863,610,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	395,399,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	232,830,000	
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,304,517,200	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	360,429,300	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	606,680,400	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	560,198,400	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	572,635,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	631,135,800	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	502,747,400	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	912,202,200	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	686,706,000	
第26回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,791,676,000	
第27回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,161,133,000	
第28回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,984,835,000	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,924,658,300	
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,352,285,900	
第31回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,366,546,400	
第32回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,822,761,500	
第33回利付国債(30年)	2,120,000,000	2,300,200,000	
第34回利付国債(30年)	1,865,000,000	2,073,805,400	

第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,675,820,800
第36回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,603,895,800
第37回利付国債(30年)	2,315,000,000	2,445,982,700
第38回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,565,145,200
第39回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,577,910,000
第40回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,300,987,800
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,328,942,600
第42回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,408,125,600
第43回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,254,371,600
第44回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,363,662,000
第45回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,421,193,200
第46回利付国債(30年)	1,830,000,000	1,778,137,800
第47回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,709,378,400
第48回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,720,567,900
第49回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,641,164,500
第50回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,621,180,400
第51回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,272,008,800
第52回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,261,717,800
第53回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,177,532,100
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,420,376,000
第55回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,308,808,500
第56回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,296,374,200
第57回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,275,846,000
第58回利付国債(30年)	2,200,000,000	1,793,484,000
第59回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,085,738,700
第60回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,128,147,200
第61回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,070,347,200
第62回利付国債(30年)	1,195,000,000	889,283,150
第63回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,044,217,500
第64回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,090,068,000
第65回利付国債(30年)	1,465,000,000	1,047,152,700
第66回利付国債(30年)	1,465,000,000	1,041,951,950
第67回利付国債(30年)	1,665,000,000	1,248,833,250
第68回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,203,040,300
第69回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,211,038,400
第70回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,521,255,500
第71回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,151,208,900
第72回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,269,767,800
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,419,292,600
第74回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,636,934,200
第75回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,250,698,200
第76回利付国債(30年)	1,960,000,000	1,780,444,400
第77回利付国債(30年)	2,190,000,000	2,086,281,600

第78回利付国債（30年）	1,040,000,000	943,675,200	
第79回利付国債（30年）	1,370,000,000	1,180,241,300	
第73回利付国債（20年）	360,000,000	368,514,000	
第74回利付国債（20年）	200,000,000	204,962,000	
第75回利付国債（20年）	130,000,000	133,864,900	
第76回利付国債（20年）	270,000,000	277,268,400	
第77回利付国債（20年）	290,000,000	298,212,800	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	175,324,400	
第79回利付国債（20年）	270,000,000	278,901,900	
第80回利付国債（20年）	220,000,000	227,618,600	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	404,621,100	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	623,640,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	302,786,100	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	489,711,800	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	304,062,100	
第86回利付国債（20年）	510,000,000	537,177,900	
第87回利付国債（20年）	1,830,000,000	1,923,128,700	
第88回利付国債（20年）	420,000,000	444,490,200	
第89回利付国債（20年）	350,000,000	369,481,000	
第90回利付国債（20年）	630,000,000	667,989,000	
第91回利付国債（20年）	450,000,000	478,440,000	
第92回利付国債（20年）	880,000,000	934,093,600	
第93回利付国債（20年）	410,000,000	435,403,600	
第94回利付国債（20年）	610,000,000	649,857,400	
第95回利付国債（20年）	830,000,000	893,445,200	
第96回利付国債（20年）	1,590,000,000	1,699,996,200	
第97回利付国債（20年）	900,000,000	968,886,000	
第98回利付国債（20年）	440,000,000	471,970,400	
第99回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,624,639,200	
第100回利付国債（20年）	480,000,000	519,988,800	
第101回利付国債（20年）	715,000,000	780,794,300	
第102回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,293,221,000	
第103回利付国債（20年）	400,000,000	436,544,000	
第104回利付国債（20年）	160,000,000	173,148,800	
第105回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,280,288,200	
第106回利付国債（20年）	680,000,000	741,070,800	
第107回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,197,537,000	
第108回利付国債（20年）	840,000,000	905,973,600	
第109回利付国債（20年）	920,000,000	994,593,600	
第110回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,200,848,000	
第111回利付国債（20年）	970,000,000	1,067,475,300	
第112回利付国債（20年）	990,000,000	1,084,000,500	

第113回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,216,950,000
第114回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,562,697,100
第115回利付国債（20年）	700,000,000	774,102,000
第116回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,838,566,200
第117回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,629,998,000
第118回利付国債（20年）	660,000,000	724,013,400
第119回利付国債（20年）	530,000,000	574,387,500
第120回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,360,004,900
第121回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,604,225,700
第122回利付国債（20年）	900,000,000	976,185,000
第123回利付国債（20年）	1,820,000,000	2,012,901,800
第124回利付国債（20年）	760,000,000	835,323,600
第125回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,425,715,200
第126回利付国債（20年）	730,000,000	802,459,800
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,114,013,400
第128回利付国債（20年）	970,000,000	1,060,762,900
第129回利付国債（20年）	740,000,000	803,832,400
第130回利付国債（20年）	1,685,000,000	1,830,769,350
第131回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,424,253,600
第132回利付国債（20年）	660,000,000	712,034,400
第133回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,750,053,900
第134回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,609,870,000
第135回利付国債（20年）	630,000,000	680,280,300
第136回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,125,012,000
第137回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,296,360,000
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,414,534,800
第139回利付国債（20年）	830,000,000	889,884,500
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,690,918,100
第141回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,730,256,000
第142回利付国債（20年）	1,265,000,000	1,378,824,700
第143回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,759,375,600
第144回利付国債（20年）	1,310,000,000	1,393,250,500
第145回利付国債（20年）	2,335,000,000	2,527,917,700
第146回利付国債（20年）	2,780,000,000	3,008,321,400
第147回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,552,883,200
第148回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,421,656,400
第149回利付国債（20年）	2,820,000,000	2,993,260,800
第150回利付国債（20年）	2,830,000,000	2,972,037,700
第151回利付国債（20年）	2,525,000,000	2,595,220,250
第152回利付国債（20年）	2,850,000,000	2,923,302,000
第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,598,101,000
第154回利付国債（20年）	2,795,000,000	2,855,986,900
第155回利付国債（20年）	2,650,000,000	2,642,818,500

第156回利付国債（20年）	2,700,000,000	2,497,770,000	
第157回利付国債（20年）	3,070,000,000	2,755,355,700	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,554,805,000	
第159回利付国債（20年）	2,980,000,000	2,792,647,400	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	1,966,702,400	
第161回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,211,115,200	
第162回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,137,959,100	
第163回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,183,362,500	
第164回利付国債（20年）	1,860,000,000	1,681,495,800	
第165回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,096,627,200	
第166回利付国債（20年）	1,880,000,000	1,733,698,400	
第167回利付国債（20年）	2,290,000,000	2,039,909,100	
第168回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,029,160,600	
第169回利付国債（20年）	2,250,000,000	1,921,027,500	
第170回利付国債（20年）	2,420,000,000	2,054,894,600	
第171回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,655,161,200	
第172回利付国債（20年）	2,280,000,000	1,948,510,800	
第173回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,039,976,000	
第174回利付国債（20年）	2,640,000,000	2,231,724,000	
第175回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,062,815,400	
第176回利付国債（20年）	2,580,000,000	2,198,108,400	
第177回利付国債（20年）	2,330,000,000	1,939,701,700	
第178回利付国債（20年）	2,280,000,000	1,924,160,400	
第179回利付国債（20年）	2,545,000,000	2,139,047,050	
第180回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,078,246,000	
第181回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,125,510,800	
第182回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,222,544,000	
第183回利付国債（20年）	2,240,000,000	2,179,094,400	
第184回利付国債（20年）	2,180,000,000	2,006,690,000	
第185回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,145,780,000	
国債証券合計	551,882,000,000	537,757,860,640	
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	99,451,000	
第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	74,621,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,669,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	112,522,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	109,454,000	
第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	104,488,000	
第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	101,165,000	
第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	215,372,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,089,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,830,000	

第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	75,183,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	214,186,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	213,210,000	
第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,244,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	100,398,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	99,696,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,457,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	296,025,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	193,874,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	284,940,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,023,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,649,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,801,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	196,864,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	193,476,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	98,487,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	201,394,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	96,739,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	232,606,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,615,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	216,830,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,784,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	106,819,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	103,562,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	200,862,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,605,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,021,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,645,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,457,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	193,814,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	217,118,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	215,356,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	106,865,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	151,703,660	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,691,000	
第400回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	302,124,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,634,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,471,160	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,656,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	196,846,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,381,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	96,179,000	

第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	152,724,800	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	173,183,920	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	190,062,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	109,429,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	107,396,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,701,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	89,504,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	91,455,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	134,672,060	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	107,728,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,648,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,097,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,104,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,986,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	439,368,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,472,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	89,383,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	291,486,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,866,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	95,568,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	79,895,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,792,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,429,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,667,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,493,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,566,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,441,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	298,895,800	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	109,655,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,418,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,046,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,572,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,106,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	272,133,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,914,000	
	100,000,000	78,680,000	

平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)			
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	193,610,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	96,531,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	148,770,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,389,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	109,045,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	218,398,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,003,921	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,484,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	374,797,800	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	95,693,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	97,853,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	107,597,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	108,660,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	83,747,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	219,438,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	181,074,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	216,830,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	179,774,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,616,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,518,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,864,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,492,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,101,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	95,851,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	141,888,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,718,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,888,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,098,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,993,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,758,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	107,099,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,425,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	101,607,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,605,000	
	100,000,000	78,680,000	

平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）			
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	89,879,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	290,220,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	95,408,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	89,308,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン bond・10年）	100,000,000	97,626,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	97,352,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	217,320,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,359,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	106,792,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,443,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,677,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,519,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,592,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	290,103,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,358,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	125,868,600	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,620,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	287,475,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	286,209,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	97,563,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	215,420,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	97,347,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,345,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,954,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,868,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,368,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,320,436	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,653,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,660,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,734,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,663,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,146,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,984,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,908,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,339,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,660,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,850,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,946,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	192,681,481	

第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,387,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,679,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,226,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	189,392,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,260,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,566,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,608,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,273,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	95,734,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	96,920,610	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,618,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,354,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,153,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	218,436,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	74,080,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	270,375,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	92,273,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	190,916,000	
第1回名古屋市公募公債（12年）	100,000,000	101,500,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	115,260,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,191,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	107,989,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	100,057,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,745,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	290,232,000	
第1回京都市公募公債（20年）	100,000,000	102,401,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,318,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	127,352,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	217,530,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	109,976,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	106,907,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	74,426,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	74,299,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	103,399,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	326,805,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,690,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,645,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,649,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,964,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,093,000	

	第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	206,534,000	
	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	290,262,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	95,455,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	103,949,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,407,000	
	平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,010,000	
	令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	193,792,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,704,000	
	第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	190,434,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,639,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,068,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,424,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,622,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,641,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	109,135,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	104,925,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,442,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,635,650	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,691,000	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	533,032,500	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,157,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	193,402,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	284,322,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	95,207,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	96,793,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,676,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,612,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,043,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	107,664,000	
	地方債証券合計	32,880,430,000	32,732,279,798	
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	99,515,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,912,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,553,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	59,880,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,300,000	

第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,651,000	
第21回道路債券	100,000,000	115,515,000	
第28回道路債券	200,000,000	233,452,000	
第33回道路債券	200,000,000	235,790,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,333,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,205,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,803,000	
第42回道路債券	200,000,000	205,836,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,955,000	
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	111,382,000	
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	218,142,000	
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	219,512,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,804,000	
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	109,978,000	
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	109,688,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,245,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,414,000	
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	107,683,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,704,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,090,000	
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	105,765,000	
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	106,487,000	
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	106,631,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	544,446,000	
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	107,793,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	79,812,000	
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	209,462,000	
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	104,105,000	

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	207,404,000	
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	260,243,200	
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	300,939,000	
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	401,812,000	
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	100,862,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	603,114,000	
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	202,774,000	
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	100,446,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	112,707,840	
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	200,702,000	
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	99,929,000	
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	74,532,000	
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	106,223,180	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,867,000	
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	204,067,250	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,800,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,839,000	
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	99,573,000	
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	199,022,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	287,217,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,152,000	
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	99,370,000	
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	118,996,800	
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	197,512,000	
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	270,093,000	
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	211,464,100	
	100,000,000	97,154,000	

第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	96,739,000	
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	115,473,600	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	338,325,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,310,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	349,092,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	231,864,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	114,200,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,296,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	213,680,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	146,718,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,177,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	214,826,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,372,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	527,080,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,456,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,465,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	421,706,740	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,835,500	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,214,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,340,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,489,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,942,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,630,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,248,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,416,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,515,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	249,785,160	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,569,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,464,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,397,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,111,200	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,757,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,335,480	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,824,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,003,000	

第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,646,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,086,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	711,067,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,619,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,681,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,782,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	194,096,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,911,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,590,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,621,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,453,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,069,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,895,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,257,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,312,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	102,854,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,663,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,013,000	
第19回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,720,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,174,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,506,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,533,800	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,444,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,044,900	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,836,410	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,840,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	200,318,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	120,712,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	66,885,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	141,304,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	94,706,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,434,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,535,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	99,165,000	98,254,665	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,455,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	68,188,000	67,764,552	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,474,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	118,599,000	117,256,459	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	134,016,000	131,942,772	

第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	47,649,000	47,033,374
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,099,000	10,160,502
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	170,322,000	167,988,588
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	117,038,000	115,388,934
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,231,000	10,306,709
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,591,000
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,715,000	14,229,038
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,462,000	13,943,670
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,150,000	15,802,056
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,362,000	18,096,759
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,533,000	19,363,093
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,001,000	19,815,192
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,310,000	40,939,399
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,841,000	18,546,968
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,201,000	18,886,267
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,833,000	18,522,423
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,878,000	17,520,714
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,963,000	10,038,419
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,644,000	36,840,212
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,758,000	19,385,642
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,194,000	25,889,858
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,878,000	24,548,016
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,066,000	24,759,822
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,912,000	53,188,516
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,268,000	65,086,774
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,459,000	33,807,642
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,386,000	35,020,421
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,925,000	35,600,100
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,166,000	30,765,398
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,194,000	29,551,042
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,391,000	35,100,486
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,330,500
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,348,000	91,444,824
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,380,000	123,712,718
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,734,000	35,932,681
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,160,000	37,357,319
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,964,000	38,014,492
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,415,000
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,619,000	119,607,038
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,866,000	40,692,728

第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,612,000	85,447,934	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,578,000	48,007,694	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,116,000	51,266,509	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	312,573,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,236,000	50,661,644	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,101,000	158,727,333	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	107,980,000	106,808,417	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,584,000	51,987,697	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,766,000	56,022,365	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,875,000	59,952,570	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,505,000	65,538,048	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,030,000	64,869,326	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,450,000	65,491,591	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,989,000	66,277,732	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,233,000	66,343,906	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,475,000	68,245,759	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,524,000	68,336,175	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,319,000	67,927,068	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,198,000	67,807,551	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,081,000	68,636,249	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,808,000	139,389,791	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,001,000	68,519,031	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,514,000	140,561,665	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,547,000	69,907,894	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,144,000	139,577,855	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,150,000	70,434,343	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,622,000	141,660,613	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,354,000	142,295,025	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,836,000	
	76,159,000	72,458,434	

第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,544,000	72,050,090	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,819,000	71,611,803	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,078,000	147,511,949	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,573,000	73,657,473	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,752,000	73,016,125	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,964,000	147,945,923	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,520,000	74,786,170	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	243,129,000	224,488,299	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,392,000	150,769,968	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,465,000	78,040,609	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,317,000	78,564,051	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,058,000	161,755,582	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,504,000	81,632,481	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,698,000	163,785,675	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,498,000	165,066,040	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,091,000	82,159,832	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,350,000	166,090,048	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,794,000	165,245,815	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,740,000	83,748,060	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,131,000	84,503,953	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,022,000	252,183,435	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,461,000	84,853,857	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,667,000	87,084,739	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,167,000	88,525,455	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,148,000	89,526,656	
	190,880,000	179,112,248	

第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,516,000	92,715,199	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,720,000	190,293,093	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,943,000	96,221,162	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,326,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,374,000	96,674,097	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,243,000	97,341,504	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,756,000	197,185,140	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,099,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	75,184,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	281,427,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,410,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,114,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,464,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,555,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,792,000	
い第876号商工債	300,000,000	297,588,000	
い第878号商工債	100,000,000	99,074,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,734,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,468,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,308,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	396,160,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,916,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	100,311,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,568,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,335,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,833,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,224,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	482,210,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,046,000	
第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,565,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,208,000	
第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,322,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,288,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,441,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,478,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,394,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,800,000	

	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,557,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,318,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,744,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,182,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,569,000	
	第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,942,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,396,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	184,126,000	
	特殊債券合計	36,866,133,000	36,597,485,692	
社債券	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	200,000,000	199,772,000	
	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	99,632,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,681,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	198,672,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,271,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	397,120,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,404,000	
	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	99,305,000	
	第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,148,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（2023）	400,000,000	396,368,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,229,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,914,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,490,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,351,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,600,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	94,409,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,909,000	
	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	99,799,000	
	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	99,813,000	
	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	100,528,000	
	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	299,697,000	
	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	198,452,000	
	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	299,649,000	

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	96,402,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,878,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,293,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,683,000	
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	98,252,000	
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	97,178,000	
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	99,861,000	
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	99,845,000	
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	199,270,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,702,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,598,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,187,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,526,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,289,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,698,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	94,148,000	
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	98,459,000	
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	197,716,000	
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	199,502,000	
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	79,614,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,390,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,843,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	194,206,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	282,129,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,820,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	199,700,000	
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	99,649,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,210,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,064,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	95,679,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,186,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,583,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,947,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	95,346,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,491,000	

第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,628,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,184,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,964,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,170,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,594,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	97,298,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,549,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,334,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,314,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,237,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,738,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,051,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,504,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	94,126,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,478,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,702,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,819,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,964,000	
第22回JA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,148,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,433,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	190,608,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,849,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,246,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	83,181,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,211,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	107,232,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	194,312,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,001,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,372,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	95,060,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,335,000	
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	96,026,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,996,000	
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	109,554,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,271,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,340,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,422,000	
	200,000,000	199,270,000	

第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債			
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	192,864,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,484,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,367,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,411,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,616,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,850,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,701,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,820,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,337,000	
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	99,639,000	
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	99,173,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,391,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,186,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,870,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,286,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,069,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,865,000	
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	199,142,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,988,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,946,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,200,000	
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	98,483,000	
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	99,533,000	
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	98,725,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,799,000	
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	198,090,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,702,000	
	200,000,000	198,144,000	

第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債			
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,386,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,880,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	192,462,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,906,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	83,421,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,136,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	94,599,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,141,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	79,602,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,179,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,300,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,754,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	74,122,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,900,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,560,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,098,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	217,346,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,369,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,204,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,063,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	75,301,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,484,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	72,601,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,236,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	67,125,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,583,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,026,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	71,379,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	80,308,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,115,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	81,985,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,538,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,182,000	

第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,702,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	74,887,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	63,161,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	56,421,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,936,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	76,505,000	
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	149,042,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,140,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,768,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,697,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	167,966,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,277,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	89,045,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	89,956,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	80,596,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,536,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,046,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,122,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,598,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,080,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,545,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,261,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,019,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,430,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,002,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	194,714,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	95,726,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	286,839,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,315,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,450,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	176,422,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,983,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,973,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	192,484,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	94,064,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,606,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,053,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	93,572,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,106,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,389,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,596,000	

第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	192,992,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,122,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	93,451,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	190,744,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,690,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	86,192,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	96,337,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,866,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	88,267,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,317,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,324,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,432,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	95,636,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	197,672,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,401,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,175,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	95,383,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	264,372,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	93,643,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	93,539,000	
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	98,876,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	72,211,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,356,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	188,888,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	81,711,000	
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	197,662,000	
社債券合計	29,900,000,000	28,806,683,000	
合計		635,894,309,130	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	17,705,206,431
コール・ローン	248,207,840
株式	556,451,394,689
投資信託受益証券	152,536,149
投資証券	10,576,348,052
派生商品評価勘定	3,403,307
未収配当金	404,924,500
前払金	840,138,980
差入委託証拠金	4,211,534,347
流動資産合計	590,593,694,295
資産合計	590,593,694,295
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	843,309,707
未払解約金	158,853,006
未払利息	109
その他未払費用	8
流動負債合計	1,002,162,830
負債合計	1,002,162,830
純資産の部	
元本等	
元本	115,198,793,434
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	474,392,738,031
元本等合計	589,591,531,465
純資産合計	589,591,531,465
負債純資産合計	590,593,694,295

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年10月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)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</p>

2023年10月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 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10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,198,793,434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 5.1180円 (1万口当たり純資産額) (51,180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10月20日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	<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、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、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	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10月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券

	2023年10月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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る場合、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。</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10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	122,039,565,758円
期中追加設定元本額	6,527,089,787円
期中一部解約元本額	13,367,862,111円
期末元本額	115,198,793,434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)	1,583,750,725円
S B I 資産設計オープン (分配型)	6,039,362円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,658,512,691円
世界経済インデックスファンド	12,834,667,734円
外国株式インデックス・オープン	883,215,837円
D C マイセレクション 2 5	645,357,599円
D C マイセレクション 5 0	3,495,803,105円
D C マイセレクション 7 5	4,362,243,310円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,653,500,026円
D C マイセレクション S 2 5	408,641,315円
D C マイセレクション S 5 0	1,890,392,757円
D C マイセレクション S 7 5	1,901,982,173円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	20,732,093円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	139,395,070円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	109,165,323円
D C 世界経済インデックスファンド	9,462,461,489円
外国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	1,014,285,182円
マイセレクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	1,773,665円
マイセレクション 7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	3,274,643円
外国株式インデックス・オープン V A 1 (適格機関投資家専用)	21,910,608円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	7,895,440円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	33,182,785円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	7,792,631円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	21,945,351円
バランス A (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	165,637,170円
バランス B (3 7 . 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	132,705,104円
バランス C (5 0) V A 1 (適格機関投資家専用)	1,005,871,613円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	68,790,266円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	17,846,767円
バランス D (3 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	116,133,689円

区分	2023年10月20日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	37,992,330円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	787,426,934円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	874,874,406円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,162,207,063円
コア投資戦略ファンド(安定型)	123,071,937円
コア投資戦略ファンド(成長型)	298,121,003円
分散投資コア戦略ファンドA	1,605,660,699円
分散投資コア戦略ファンドS	7,326,808,258円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,462,597,819円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,008,562,467円
コア投資戦略ファンド(切替型)	129,591,794円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	498,690,852円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,489,154円
SMT インデックスバランス・オープン	123,994,965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SMTBセレクション(SMA専用)	4,777,048,035円
SMT 世界経済インデックス・オープン	251,186,348円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,021,409,094円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	177,638,095円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,402,284円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	1,157,501,140円
グローバル経済コア	534,782,984円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,447,754円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,195,644円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	122,416,423円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	30,135,425円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	140,215,401円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	132,785,300円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	57,226,122円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	62,600,992円
10資産分散投資ファンド	53,045,957円
グローバル10資産バランスファンド	667,710円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	55,192,977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)	22,534,244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)	427,097,317円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,462,233,496円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	102,654,074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)	73,087,436円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	84,684,393円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	79,002,346円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	186,731,857円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	186,187,243円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	185,241,147円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	181,779,484円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	179,977,573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)	91,791,755円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	119,741,081円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,186,583,016
投資信託受益証券	34,924,799
投資証券	949,288,955
合計	1,202,369,262

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	23,156,881,120	-	22,316,742,140	840,138,980
合計		23,156,881,120	-	22,316,742,140	840,138,980

(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10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	61,343,700	-	61,576,280	232,580
	デンマーククローネ	61,343,700	-	61,576,280	232,580
合計		61,343,700	-	61,576,280	232,580

(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	43.30	1,012,873.60	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.58	2,751,472.56	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	175.54	3,177,098.46	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	88.77	752,947.14	
	CHEVRON CORP	135,745	169.10	22,954,479.50	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	126.38	11,384,310.40	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	29.60	1,614,561.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	49.25	2,475,108.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	168.92	2,241,061.64	

EOG RESOURCES INC	43,691	136.23	5,952,024.93
EQT CORPORATION	27,026	43.09	1,164,550.34
EXXON MOBIL	301,729	113.02	34,101,411.58
HALLIBURTON CO	70,302	43.26	3,041,264.52
HESS CORP	21,602	166.08	3,587,660.16
HF SINCLAIR CORP	13,429	56.69	761,290.01
KINDER MORGAN INC	144,061	17.01	2,450,477.61
MARATHON OIL CORP	50,360	29.19	1,470,008.40
MARATHON PETROLEUM CORP	31,527	152.84	4,818,586.68
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	66.46	3,283,522.76
ONEOK INC	43,535	69.21	3,013,057.35
OVINTIV INC	20,398	50.87	1,037,646.26
PHILLIPS 66	34,260	115.19	3,946,409.40
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	255.33	4,436,103.42
SCHLUMBERGER	105,564	59.97	6,330,673.08
TARGA RESOURCES CORP	17,298	87.71	1,517,207.58
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,965.02	1,047,355.66
VALERO ENERGY CORP	26,571	132.42	3,518,531.82
WILLIAMS COS	90,577	35.57	3,221,823.89
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	280.61	4,632,309.88
ALBEMARLE CORP	8,403	144.56	1,214,737.68
AMCOR PLC	110,292	8.62	950,717.04
AVERY DENNISON CORP	6,638	176.93	1,174,461.34
BALL CORP	21,539	45.16	972,701.24
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	116.65	1,001,090.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	85.68	1,126,606.32
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.54	625,220.00
CORTEVA INC	51,304	50.96	2,614,451.84
CROWN HOLDINGS INC	9,940	79.89	794,106.60
DOW INC	51,372	49.45	2,540,345.40
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	73.98	2,524,123.62
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	71.53	631,752.96
ECOLAB INC	18,665	160.34	2,992,746.10
FMC CORP	8,264	66.59	550,299.76
FREEMPORT-MCMORAN INC	105,762	35.23	3,725,995.26
INT'L PAPER CO	25,191	34.26	863,043.66
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	66.40	1,281,984.80
LINDE PLC	36,447	370.14	13,490,492.58
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	92.75	1,831,348.75
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	410.72	1,795,257.12
MOSAIC CO/THE	27,732	36.44	1,010,554.08
NEWMONT CORPORATION	61,808	39.45	2,438,325.60

NUCOR CORP	18,727	143.75	2,692,006.25
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,783	149.55	1,163,947.65
PPG INDUSTRIES INC	17,495	124.34	2,175,328.30
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	250.30	1,032,737.80
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	94.41	987,150.96
SEALED AIR CORP	11,690	29.03	339,360.70
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	238.89	4,359,742.50
STEEL DYNAMICS INC	11,618	99.20	1,152,505.60
VULCAN MATERIALS CO	10,153	202.69	2,057,911.57
WESTLAKE CORP	2,222	117.99	262,173.78
WESTROCK CO	21,356	35.34	754,721.04
3 M COMPANY	40,676	87.06	3,541,252.56
AECOM	10,456	78.11	816,718.16
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	58.11	695,460.48
ALLEGION PLC	5,598	98.56	551,738.88
AMETEK INC	17,753	143.65	2,550,218.45
AXON ENTERPRISE INC	5,367	212.31	1,139,467.77
BOEING CO	42,311	182.79	7,734,027.69
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	111.39	1,226,403.90
CARLISLE COS INC	3,456	246.62	852,318.72
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	49.00	3,041,087.00
CATERPILLAR	38,381	252.89	9,706,171.09
CUMMINS INC	10,414	221.70	2,308,783.80
DEERE&CO	20,925	381.37	7,980,167.25
DOVER CORP	10,657	134.43	1,432,620.51
EATON CORP	29,584	199.91	5,914,137.44
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	93.14	3,955,935.22
FASTENAL CO	44,011	58.53	2,575,963.83
FERGUSON PLC	16,260	155.29	2,525,015.40
FORTIVE CORP	25,894	71.10	1,841,063.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	57.60	593,856.00
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	93.96	489,625.56
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	237.95	4,046,101.80
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	106.95	8,667,441.90
GRACO INC	13,378	70.74	946,359.72
GRAINGER (WW) INC	3,363	702.83	2,363,617.29
HEICO CORP	3,640	160.84	585,457.60
HEICO CORP-CLASS A	4,690	127.50	597,975.00
HONEYWELL INTL INC	49,482	182.27	9,019,084.14
HOWMET AEROSPACE INC	32,364	43.71	1,414,630.44
HUBBELL INC	3,709	285.00	1,057,065.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	221.33	549,341.06

IDEX CORP	5,916	195.60	1,157,169.60
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	224.90	5,095,784.20
INGERSOLL-RAND INC	31,562	61.22	1,932,225.64
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	40.90	519,430.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	49.20	2,473,087.20
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	177.90	2,611,927.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	357.34	902,640.84
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	449.18	7,610,007.56
MASCO CORP	15,277	50.12	765,683.24
NORDSON CORP	4,121	216.17	890,836.57
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	489.94	5,261,955.60
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	78.17	2,401,147.89
OWENS CORNING	6,460	122.83	793,481.80
PACCAR INC	38,842	82.55	3,206,407.10
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	374.98	3,575,434.30
PENTAIR PLC	10,813	63.04	681,651.52
QUANTA SERVICES INC	11,573	168.74	1,952,828.02
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	271.52	2,298,688.32
RTX CORP	108,761	73.89	8,036,350.29
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	35.75	494,351.00
SMITH (A.O.) CORP	9,016	67.01	604,162.16
SNAP-ON INC	4,000	252.71	1,010,840.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	78.86	993,478.28
TEXTRON	17,063	77.34	1,319,652.42
TORO CO	8,812	83.62	736,859.44
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	191.32	3,257,796.96
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	830.62	3,392,252.08
UNITED RENTALS INC	5,364	411.19	2,205,623.16
WABTEC CORP	13,304	100.08	1,331,464.32
WATSCO INC	2,656	353.97	940,144.32
XYLEM INC	16,864	92.16	1,554,186.24
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	246.08	7,579,017.92
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	123.31	1,139,384.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	175.90	1,458,211.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	71.30	760,628.40
CINTAS CORP	6,804	502.82	3,421,187.28
CLARIVATE PLC	27,357	6.72	183,839.04
COPART INC	63,766	44.33	2,826,746.78
EQUIFAX INC	9,160	178.98	1,639,456.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	132.82	1,151,150.94
LEIDOS HOLDINGS	8,529	93.41	796,693.89
PAYCHEX INC	24,118	118.19	2,850,506.42

PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	265.50	1,124,392.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	196.05	671,079.15
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	145.79	2,398,974.45
ROBERT HALF INC	7,185	74.47	535,066.95
ROLLINS INC	17,468	32.92	575,046.56
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	50.78	782,113.56
TRANSUNION	15,741	66.35	1,044,415.35
VERISK ANALYTICS INC	10,738	234.45	2,517,524.10
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	136.03	2,689,993.25
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	157.07	4,749,168.52
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	83.31	697,054.77
CSX CORP	152,261	30.54	4,650,050.94
DELTA AIR LINES INC	9,648	32.71	315,586.08
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.78	1,409,498.40
FEDEX CORP	17,749	243.29	4,318,154.21
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.30	372,936.30
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	178.81	1,027,799.88
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	45.88	625,023.24
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	200.09	3,385,522.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	396.45	2,916,286.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	24.37	329,799.21
U-HAUL HOLDING CO	6,606	50.19	331,555.14
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	42.72	5,755,366.56
UNION PACIFIC CORP	45,361	210.33	9,540,779.13
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	152.06	8,175,353.84
APTIV PLC	21,896	90.25	1,976,114.00
BORGWARNER INC	19,781	38.11	753,853.91
FORD MOTOR COMPANY	290,797	11.53	3,352,889.41
GENERAL MOTORS CO	103,664	29.33	3,040,465.12
LEAR CORP	3,648	130.37	475,589.76
LUCID GROUP INC	61,234	4.34	265,755.56
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	17.16	880,925.76
TESLA INC	213,419	220.11	46,975,656.09
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	508.88	1,070,174.64
DR HORTON INC	22,973	101.24	2,325,786.52
GARMIN LTD	10,561	104.33	1,101,829.13
HASBRO INC	10,572	56.62	598,586.64
LENNAR CORP-CL A	18,864	104.61	1,973,363.04
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	396.19	3,414,761.61
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	79.13	329,418.19
NIKE B	91,582	103.05	9,437,525.10
NVR INC	247	5,563.55	1,374,196.85

PULTE GROUP INC	16,747	70.13	1,174,467.11
VF CORP	25,718	18.56	477,326.08
WHIRLPOOL CORP	3,785	129.15	488,832.75
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	119.97	3,686,558.13
ARAMARK	16,686	26.42	440,844.12
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	2,785.20	7,795,774.80
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	41.91	735,939.60
CARNIVAL CORPORATION	71,810	11.39	817,915.90
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,847.63	3,782,098.61
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	142.26	1,309,787.82
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	344.31	980,594.88
DOORDASH INC - A	19,212	73.37	1,409,584.44
DRAFTKINGS INC	32,654	27.72	905,168.88
EXPEDIA GROUP INC	11,638	95.66	1,113,291.08
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	150.31	2,882,194.25
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	103.88	393,393.56
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	45.88	1,172,692.80
MARRIOTT INTL A	19,516	192.31	3,753,121.96
MCDONALD'S CORP	54,264	258.38	14,020,732.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	35.99	818,916.46
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	82.08	1,404,881.28
STARBUCKS CORP	85,428	94.42	8,066,111.76
VAIL RESORTS INC	3,014	215.52	649,577.28
WYNN RESORTS LTD	6,702	88.22	591,250.44
YUM BRANDS INC	22,162	120.56	2,671,850.72
ALPHABET INC-CL A	444,829	137.75	61,275,194.75
ALPHABET INC-CL C	395,244	138.98	54,931,011.12
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	435.87	3,134,777.04
COMCAST CORP-CL A	312,679	43.07	13,467,084.53
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	128.23	2,530,362.59
FOX CORP - CLASS A	21,544	30.85	664,632.40
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.51	294,935.95
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	28.54	813,703.94
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	91.10	833,838.30
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	68.40	1,051,923.60
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	25.23	342,724.32
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	80.50	934,846.50
MATCH GROUP INC	22,730	36.20	822,826.00
META PLATFORMS INC-CLASS A	165,576	312.81	51,793,828.56
NETFLIX INC	33,103	401.77	13,299,792.31
NEWS CORP-CLASS A	33,479	21.62	723,815.98
OMNICOM GROUP	14,048	74.22	1,042,642.56

PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	11.78	382,944.24
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	26.55	1,215,113.85
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	31.67	902,690.01
ROKU INC	9,122	62.48	569,942.56
SEA LTD-ADR	28,338	45.09	1,277,760.42
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.56	275,734.08
SNAP INC - A	63,578	9.65	613,527.70
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	140.28	1,804,982.76
THE WALT DISNEY CO	135,788	83.25	11,304,351.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	75.87	2,547,942.21
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	10.39	1,843,321.07
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	17.00	372,895.00
AMAZON.COM	690,901	128.40	88,711,688.40
AUTOZONE INC	1,368	2,494.66	3,412,694.88
BATH & BODY WORKS INC	13,528	30.71	415,444.88
BEST BUY COMPANY INC	15,285	69.50	1,062,307.50
BURLINGTON STORES INC	5,108	120.62	616,126.96
CARMAX INC	10,695	63.42	678,276.90
CHEWY INC - CLASS A	6,878	16.86	115,963.08
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	108.81	538,609.50
EBAY	41,952	41.14	1,725,905.28
ETSY INC	10,294	65.42	673,433.48
GENUINE PARTS CO	9,903	130.12	1,288,578.36
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	35.34	247,380.00
HOME DEPOT	75,273	286.77	21,586,038.21
LKQ CORP	19,286	48.81	941,349.66
LOWES COMPANIES	44,328	190.46	8,442,710.88
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,179.96	3,956,405.88
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	898.39	4,111,931.03
POOL CORP	2,664	325.20	866,332.80
ROSS STORES INC	25,425	116.26	2,955,910.50
TJX COMPANIES INC	85,671	89.83	7,695,825.93
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	202.14	1,585,990.44
ULTA BEAUTY INC	3,920	372.86	1,461,611.20
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.34	558,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	565.63	18,645,992.95
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	115.51	1,881,311.37
DOLLAR TREE INC	16,318	113.11	1,845,728.98
KROGER CO	50,664	44.50	2,254,548.00
SYSCO CORP	40,090	65.66	2,632,309.40
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	108.36	3,708,079.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	20.96	1,080,844.32

WALMART INC	110,203	160.77	17,717,336.31
ALTRIA GROUP INC	132,765	42.61	5,657,116.65
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	73.84	2,999,233.12
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	55.75	1,338,334.50
BUNGE LIMITED	11,604	103.65	1,202,754.60
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	39.78	631,268.82
COCA-COLA CO	305,497	54.35	16,603,761.95
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	57.83	890,235.02
CONAGRA BRANDS INC	33,324	27.15	904,746.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	233.20	2,793,502.80
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	43.21	572,186.82
GENERAL MILLS INC	43,531	62.86	2,736,358.66
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	191.58	2,096,268.36
HORMEL FOODS CORP	23,338	31.82	742,615.16
JM SMUCKER CO	7,850	113.82	893,487.00
KELLANOVA	18,819	49.89	938,879.91
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	28.45	1,859,804.95
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	31.45	2,168,917.80
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	87.49	1,039,031.24
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	60.04	1,086,243.68
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	58.34	855,789.46
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	64.21	6,506,014.04
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	50.40	2,940,739.20
PEPSICO INC	102,377	160.56	16,437,651.12
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	90.73	10,467,701.56
TYSON FOODS INC	23,306	46.59	1,085,826.54
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	89.60	1,733,401.60
CLOROX COMPANY	9,570	123.99	1,186,584.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	73.19	4,300,717.59
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	138.81	2,356,022.13
KENVUE INC	111,921	19.84	2,220,512.64
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	122.86	3,027,638.98
PROCTER & GAMBLE CO	177,374	148.25	26,295,695.50
ABBOTT LABORATORIES	129,183	95.44	12,329,225.52
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	270.29	1,419,833.37
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	32.61	1,355,793.36
BECTON DICKINSON & CO	21,103	257.48	5,433,600.44
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	50.55	5,400,660.90
CARDINAL HEALTH	19,151	92.79	1,777,021.29
CENCORA INC	12,469	189.89	2,367,738.41
CENTENE CORP	40,934	71.94	2,944,791.96
COOPER COS INC/THE	3,504	323.80	1,134,595.20

CVS HEALTH CORP	95,131	70.61	6,717,199.91
DAVITA INC	4,627	81.62	377,655.74
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	31.50	559,881.00
DEXCOM INC	28,772	86.04	2,475,542.88
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	69.08	3,112,192.16
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	463.28	8,170,869.36
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	65.45	1,958,329.45
HCA HEALTHCARE INC	15,457	244.05	3,772,280.85
HENRY SCHEIN INC	8,755	68.75	601,906.25
HOLOGIC INC	18,875	67.82	1,280,102.50
HUMANA INC	9,297	522.72	4,859,727.84
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	425.68	2,625,594.24
INSULET CORP	5,246	145.24	761,929.04
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	273.45	7,119,270.75
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	199.43	1,305,867.64
MCKESSON CORP	10,179	453.27	4,613,835.33
MEDTRONIC PLC	98,891	72.35	7,154,763.85
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	349.62	1,589,022.90
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	122.83	1,066,041.57
RESMED INC	10,920	142.29	1,553,806.80
STERIS PLC	6,933	216.90	1,503,767.70
STRYKER CORP	25,363	268.42	6,807,936.46
TELEFLEX INC	3,934	186.02	731,802.68
THE CIGNA GROUP	22,079	310.17	6,848,243.43
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,912	531.63	37,167,316.56
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	127.66	596,427.52
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	202.17	2,275,423.35
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	104.81	1,598,771.74
ABBVIE INC	133,056	145.52	19,362,309.12
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	109.51	2,386,332.41
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	160.50	1,547,701.50
AMGEN	39,709	280.60	11,142,345.40
AVANTOR INC	49,647	20.83	1,034,147.01
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	315.99	585,529.47
BIO-TECHNE CORP	12,980	63.50	824,230.00
BIOGEN INC	10,740	257.30	2,763,402.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	82.59	1,220,927.97
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	56.48	8,830,083.20
CATALENT INC	13,739	43.14	592,700.46
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	187.40	787,829.60
DANAHER CORP	53,074	207.30	11,002,240.20
ELI LILLY & CO	60,535	590.80	35,764,078.00

EXACT SCIENCES CORP	12,208	64.45	786,805.60
GILEAD SCIENCES INC	92,825	78.44	7,281,193.00
ILLUMINA INC	11,423	119.98	1,370,531.54
INCYTE CORP	15,212	55.64	846,395.68
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	186.75	2,583,873.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	132.03	656,321.13
JOHNSON & JOHNSON	179,427	152.32	27,330,320.64
MERCK & CO	191,177	100.43	19,199,906.11
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,014.12	1,649,973.24
MODERNA INC	24,153	82.37	1,989,482.61
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	111.13	749,238.46
PFIZER	419,551	31.19	13,085,795.69
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	808.64	6,462,650.88
REPLIGEN CORP	4,353	146.28	636,756.84
REVVITY INC	8,524	101.43	864,589.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	28.11	845,633.13
SEAGEN INC	11,325	214.97	2,434,535.25
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	8.16	751,870.56
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	469.67	13,465,438.90
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	225.82	817,016.76
VERALTO CORP	17,691	70.29	1,243,500.39
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	364.80	6,984,825.60
VIATRIS INC	89,720	9.31	835,293.20
WATERS CORP	4,749	252.33	1,198,315.17
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	369.33	2,129,926.11
ZOETIS INC	34,383	168.04	5,777,719.32
BANK OF AMERICA CORP	535,131	26.96	14,427,131.76
CITIGROUP	144,682	40.06	5,795,960.92
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	24.88	983,307.36
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	24.92	1,356,146.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,355.77	1,038,519.82
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.19	495,806.52
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.03	1,144,543.36
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	145.29	31,658,255.13
KEY CORP	71,223	10.56	752,114.88
M & T BANK CORP	11,807	119.61	1,412,235.27
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	115.66	3,430,244.28
REGIONS FINL CORP	70,810	16.48	1,166,948.80
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	28.06	2,709,866.44
US BANCORP	113,859	32.75	3,728,882.25
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	40.13	572,775.49
WELLS FARGO & CO	273,135	41.18	11,247,699.30

ALLY FINANCIAL INC	21,529	24.62	530,043.98
AMERICAN EXPRESS	47,011	149.62	7,033,785.82
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	316.59	2,474,467.44
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	83.38	2,398,592.46
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	105.13	1,343,561.40
BANK NEW YORK CO	61,254	42.19	2,584,306.26
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	97,275	338.66	32,943,151.50
BLACKROCK INC	11,143	622.51	6,936,628.93
BLACKSTONE INC	52,505	94.22	4,947,021.10
BLOCK INC	39,463	44.17	1,743,080.71
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	92.70	2,789,991.90
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	27.54	431,524.26
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	162.73	1,162,543.12
CME GROUP INC	26,740	214.12	5,725,568.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	73.10	920,694.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	84.59	1,606,110.33
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	27.64	773,450.12
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	436.87	1,375,266.76
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	51.42	2,201,290.20
FISERV INC	46,319	111.97	5,186,338.43
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	241.97	1,225,336.08
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	22.63	589,964.10
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	58.43	252,183.88
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	112.41	2,332,395.09
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	299.19	7,423,502.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	109.57	4,558,550.28
INVESCO LTD	26,420	12.80	338,176.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	145.61	759,064.93
KKR & CO INC	44,805	55.61	2,491,606.05
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	225.88	1,198,745.16
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	234.83	753,099.81
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	387.87	24,539,371.29
MOODY'S CORP	12,261	311.58	3,820,282.38
MORGAN STANLEY	93,231	72.92	6,798,404.52
MSCI INC	5,952	497.27	2,959,751.04
NASDAQ INC	24,183	51.29	1,240,346.07
NORTHERN TRUST CORP	15,902	65.50	1,041,581.00
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	54.81	4,345,665.66
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	97.37	1,539,030.22
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	96.85	1,499,819.10
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	8.97	286,259.61
S&P GLOBAL INC	24,377	357.56	8,716,240.12

SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	51.90	5,796,866.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	55.58	530,789.00
STATE STREET CORP	26,059	66.36	1,729,275.24
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	28.76	839,676.96
TOAST INC-CLASS A	20,341	17.81	362,273.21
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	82.47	747,260.67
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	233.81	28,240,507.04
AFLAC	43,196	79.55	3,436,241.80
ALLSTATE CORP	18,556	124.74	2,314,675.44
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	109.10	689,402.90
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	61.17	3,335,844.78
AON PLC	15,249	319.08	4,865,650.92
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	83.78	2,221,007.80
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	231.03	3,676,380.39
ASSURANT INC	4,726	149.07	704,504.82
BROWN & BROWN INC	20,155	68.27	1,375,981.85
CHUBB LTD	30,784	210.55	6,481,571.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	100.92	1,121,221.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	304.07	658,615.62
EVEREST GROUP LTD	3,288	401.85	1,321,282.80
FNF GROUP	20,461	38.41	785,907.01
GLOBE LIFE INC	5,948	113.59	675,633.32
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	71.99	1,780,384.69
LOEWS CORP	12,757	64.08	817,468.56
MARKEL GROUP INC	1,007	1,479.33	1,489,685.31
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	191.00	7,028,609.00
METLIFE INC	48,925	61.92	3,029,436.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	69.51	1,288,437.36
PROGRESSIVE CORP	43,513	157.80	6,866,351.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	93.29	2,474,144.09
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	163.94	2,811,079.18
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	207.36	1,540,477.44
WR BERKLEY CORP	17,572	64.24	1,128,825.28
WEYERHAEUSER CO	52,615	29.33	1,543,197.95
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	302.94	14,220,912.42
ADOBE INC	34,096	555.74	18,948,511.04
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	106.99	1,228,673.16
ANSYS INC	6,794	285.92	1,942,540.48
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	189.60	453,902.40
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	192.40	2,200,286.40
AUTODESK INC	15,965	206.07	3,289,907.55
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	51.36	760,795.68

BILL HOLDINGS, INC.	7,443	102.50	762,907.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	245.06	4,976,678.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	135.50	838,203.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	62.79	1,273,569.57
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	65.44	2,375,930.08
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	29.82	366,786.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	184.52	3,057,680.92
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	168.04	520,924.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	87.75	1,554,579.00
DOCUSIGN INC	14,969	41.14	615,824.66
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	27.32	630,217.76
DYNATRACE INC	22,028	47.60	1,048,532.80
EPAM SYSTEMS INC	4,768	230.73	1,100,120.64
FAIR ISAAC CORP	1,816	919.26	1,669,376.16
FORTINET INC	48,642	57.77	2,810,048.34
GARTNER INC	5,655	353.03	1,996,384.65
GEN DIGITAL INC	43,555	17.39	757,421.45
GODADDY INC - CLASS A	11,388	75.47	859,452.36
HUBSPOT INC	3,646	444.83	1,621,850.18
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	138.01	9,305,462.26
INTUIT INC	20,854	521.52	10,875,778.08
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	196.26	921,244.44
MICROSOFT CORP	528,983	331.32	175,262,647.56
MONDAY.COM LTD	1,631	138.88	226,513.28
MONGODB INC	5,325	358.00	1,906,350.00
OKTA INC	11,505	85.46	983,217.30
ORACLE CORP	123,187	108.34	13,346,079.58
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	17.06	2,230,441.46
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	253.13	5,693,653.09
PTC INC	8,226	141.32	1,162,498.32
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	487.53	3,850,511.94
SALESFORCE INC	72,631	208.32	15,130,489.92
SERVICENOW INC	15,145	559.98	8,480,897.10
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	153.43	2,965,188.18
SPLUNK INC	11,101	147.90	1,641,837.90
SYNOPSYS INC	11,321	482.37	5,460,910.77
TWILIO INC - A	12,842	55.41	711,575.22
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	377.00	1,258,803.00
UIPATH INC - CLASS A	28,419	16.04	455,840.76
UNITY SOFTWARE INC	16,437	27.49	451,853.13
VERISIGN INC	6,723	211.66	1,422,990.18
VMWARE INC-CLASS A	17,149	150.31	2,577,666.19

WIX.COM LTD	5,010	84.08	421,240.80
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	213.26	3,233,874.64
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	62.36	1,031,870.92
ZSCALER INC	7,204	169.07	1,217,980.28
AMPHENOL CORPORATION	44,247	80.89	3,579,139.83
APPLE INC	1,177,684	175.46	206,636,434.64
ARISTA NETWORKS INC	19,289	191.48	3,693,457.72
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	112.64	488,632.32
CDW CORP/DE	9,584	202.85	1,944,114.40
CISCO SYSTEMS	304,444	53.32	16,232,954.08
COGNEX CORP	14,352	36.79	528,010.08
CORNING	58,221	27.43	1,597,002.03
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	67.03	1,214,851.72
F5 INC	4,851	148.51	720,422.01
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.30	1,588,141.60
HP INC	68,329	26.45	1,807,302.05
JABIL INC	11,304	130.34	1,473,363.36
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	25.07	634,797.47
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	123.99	1,715,773.62
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	281.94	3,440,231.88
NETAPP INC	15,191	75.04	1,139,932.64
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	66.87	852,993.72
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,534	265.05	936,686.70
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	119.35	2,720,583.25
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	393.61	1,306,785.20
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	49.53	877,572.54
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	43.06	1,110,517.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	205.99	857,330.38
AT&T INC	529,966	15.26	8,087,281.16
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	17.87	337,189.03
T-MOBILE US INC	40,399	137.84	5,568,598.16
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	31.58	9,858,612.82
AES CORP	54,375	13.84	752,550.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	49.45	1,027,472.10
AMEREN CORPORATION	20,898	77.65	1,622,729.70
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	74.42	2,762,321.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	117.02	1,693,045.36
ATMOS ENERGY CORP	11,302	110.10	1,244,350.20
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	27.47	1,303,891.02
CMS ENERGY CORP	23,697	53.51	1,268,026.47
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	87.67	2,426,267.25
CONSTELLATION ENERGY	25,114	114.29	2,870,279.06

DOMINION ENERGY INC	60,549	40.64	2,460,711.36
DTE ENERGY COMPANY	15,851	96.74	1,533,425.74
DUKE ENERGY CORP	57,283	87.78	5,028,301.74
EDISON INTL	30,900	64.00	1,977,600.00
ENERGY CORP	16,181	93.37	1,510,819.97
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	33.04	673,982.96
EVERGY INC	18,475	48.52	896,407.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	53.90	1,479,555.00
EXELON CORP	73,907	39.77	2,939,281.39
FIRSTENERGY CORP	39,425	35.66	1,405,895.50
NEXTERA ENERGY INC	150,399	52.39	7,879,403.61
NISOURCE INC	32,351	25.63	829,156.13
NRG ENERGY INC	19,068	40.76	777,211.68
PG&E CORP	148,742	16.00	2,379,872.00
PPL CORPORATION	58,459	23.82	1,392,493.38
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	59.83	2,134,913.89
SEMPRA	45,886	69.55	3,191,371.30
SOUTHERN CO	81,133	66.44	5,390,476.52
VISTRA CORP	22,676	32.11	728,126.36
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	82.45	1,933,205.15
XCEL ENERGY INC	39,963	59.05	2,359,815.15
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	102.40	12,249,907.20
ANALOG DEVICES	37,601	168.72	6,344,040.72
APPLIED MATERIALS	62,818	134.43	8,444,623.74
BROADCOM INC	30,991	867.83	26,894,919.53
ENPHASE ENERGY INC	9,617	115.90	1,114,610.30
ENTEGRIS INC	10,321	91.87	948,190.27
FIRST SOLAR INC	7,921	151.97	1,203,754.37
INTEL CORP	310,036	35.67	11,058,984.12
KLA CORP	10,294	465.05	4,787,224.70
LAM RESEARCH CORP	10,237	601.95	6,162,162.15
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	73.98	812,152.44
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	50.69	3,228,648.86
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	76.79	3,126,735.22
MICRON TECHNOLOGY	81,347	67.53	5,493,362.91
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	433.75	1,531,571.25
NVIDIA CORP	184,802	421.01	77,803,490.02
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	187.93	3,628,928.30
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	87.01	2,785,277.11
QORVO INC	6,249	90.98	568,534.02
QUALCOMM	82,879	111.28	9,222,775.12
SKYWORCS SOLUTIONS INC	11,242	93.58	1,052,026.36

	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	113.98	473,700.88	
	TERADYNE INC	12,318	92.74	1,142,371.32	
	TEXAS INSTRUMENTS	67,444	150.94	10,179,997.36	
	WOLFSPEED INC	10,256	34.00	348,704.00	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	68.32	1,571,018.40	
	COSTAR GROUP INC	29,397	73.94	2,173,614.18	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.42	337,554.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	39.39	465,156.51	
	アメリカドル 小計	25,575,550		2,770,960,518.33 (415,533,239,328)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	22.58	844,492.00	
	CAMECO CORP	31,793	52.61	1,672,629.73	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	91.15	7,502,283.05	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	29.03	3,230,835.79	
	ENBRIDGE	159,113	44.02	7,004,154.26	
	IMPERIAL OIL	16,488	83.58	1,378,067.04	
	KEYERA CORP	18,607	32.97	613,472.79	
	PARKLAND CORP	14,896	41.36	616,098.56	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	42.22	1,609,890.82	
	SUNCOR ENERGY	98,973	47.29	4,680,433.17	
	TC ENERGY CORP	75,669	47.35	3,582,927.15	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	73.28	1,832,659.52	
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	68.07	2,457,327.00	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	22.74	3,040,951.98	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,689	55.45	814,505.05	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	30.99	1,343,726.40	
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	189.35	2,593,148.25	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.88	564,095.36	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	7.36	798,199.36	
	LUNDIN MINING CORP	31,977	8.96	286,513.92	
	NUTRIEN LTD	37,152	83.48	3,101,448.96	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	20.89	468,270.24	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	54.78	1,938,445.08	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	93.33	327,121.65	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	58.95	1,880,858.70	
	CAE INC	25,999	29.34	762,810.66	
	STANTEC INC	9,001	84.77	763,014.77	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	106.40	554,663.20	
	WSP GLOBAL INC	9,951	186.29	1,853,771.79	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	41.23	576,024.33	
	RB GLOBAL INC	14,445	87.70	1,266,826.50	
	THOMSON REUTERS CORP	11,033	168.01	1,853,654.33	

AIR CANADA	13,805	17.08	235,789.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	144.12	6,087,196.44
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	97.78	6,771,069.44
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	160.69	937,947.53
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	69.23	1,402,184.42
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	97.31	298,741.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	39.87	391,523.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	90.49	2,087,875.77
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	139.06	627,577.78
DOLLARAMA INC	22,000	94.02	2,068,440.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	73.80	4,193,389.80
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	37.25	258,142.50
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	111.87	1,444,577.31
METRO INC	18,840	70.21	1,322,756.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	146.01	763,048.26
SAPUTO INC	20,898	27.13	566,962.74
BANK MONTREAL	52,757	108.44	5,720,969.08
BANK NOVA SCOTIA	88,533	58.23	5,155,276.59
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	50.32	3,388,750.08
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	88.55	2,135,029.05
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	113.03	11,643,898.48
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	79.92	10,821,647.52
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.16	1,222,682.16
BROOKFIELD CORP	104,769	42.80	4,484,113.20
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	18.86	614,439.94
IGM FINANCIAL INC	7,685	32.21	247,533.85
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	21.26	91,439.26
ONEX CORP	6,603	76.60	505,789.80
TMX GROUP LTD	23,425	29.53	691,740.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,108.90	1,945,010.60
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.64	919,168.32
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	81.85	571,067.45
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	198.44	2,630,322.20
MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.43	3,195,883.74
POWER CORP OF CANADA	43,577	34.01	1,482,053.77
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	64.12	2,796,529.68
CGI INC - CL A	16,084	135.17	2,174,074.28
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,857.61	4,257,838.90
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	100.71	703,358.64
OPEN TEXT CORP	20,463	45.86	938,433.18
SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	71.10	6,326,975.70
BCE INC	6,203	51.51	319,516.53

	QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.35	430,920.00
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	52.01	1,450,090.81
	TELUS CORP	32,908	22.45	738,784.60
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	7.07	366,353.26
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.10	636,709.50
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	31.45	355,227.75
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	29.14	300,841.36
	EMERA INC	17,459	45.53	794,908.27
	FORTIS INC	35,547	53.97	1,918,471.59
	HYDRO ONE LTD	20,587	34.89	718,280.43
	NORTHLAND POWER INC	17,854	20.32	362,793.28
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	192.15	516,883.50
	カナダドル 小計	3,050,470		174,844,350.90 (19,101,745,335)
ユーロ	ENI	174,687	15.45	2,699,263.52
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	14.67	581,841.54
	NESTE OIL OYJ	32,766	29.97	981,997.02
	OMV AG	12,549	42.94	538,854.06
	REPSOL SA	89,536	14.99	1,342,144.64
	TENARIS SA	40,648	15.62	635,125.00
	TOTALENERGIES SE	167,847	63.33	10,629,750.51
	AIR LIQUIDE	38,920	157.04	6,111,996.80
	AKZO NOBEL	12,357	64.06	791,589.42
	ARCELORMITTAL	42,704	21.36	912,370.96
	ARKEMA	4,369	85.48	373,462.12
	BASF SE	64,204	41.43	2,659,971.72
	COVESTRO AG	14,454	47.62	688,299.48
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	77.07	1,056,398.49
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	16.57	265,733.09
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	70.84	762,592.60
	OCI NV	7,248	24.68	178,880.64
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	30.69	598,577.76
	SOLVAY SA	5,356	98.68	528,530.08
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.35	478,828.99
	SYMRISE AG	10,018	91.40	915,645.20
	UMICORE	17,605	24.04	423,224.20
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	31.64	1,339,131.36
	VOESTALPINE AG	7,152	23.94	171,218.88
	WACKER CHEMIE AG	1,770	118.20	209,214.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	32.51	533,261.53
	AIRBUS SE	44,063	123.90	5,459,405.70
	ALSTOM	24,388	12.45	303,752.54

BOUYGUES ORD	16,606	31.47	522,590.82
BRENTAG SE	12,514	67.96	850,451.44
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	10.88	881,968.01
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	30.36	1,049,697.00
DASSAULT AVIATION SA	2,130	183.50	390,855.00
EIFFAGE	5,924	85.42	506,028.08
FERROVIAL SE	37,026	28.39	1,051,168.14
GEA GROUP AG	13,382	32.94	440,803.08
IMCD NV	4,641	111.45	517,239.45
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	64.16	795,455.68
KNORR-BREMSE AG	5,022	54.82	275,306.04
KONE OYJ-B	26,369	39.05	1,029,709.45
LEGRAND SA	19,340	83.12	1,607,540.80
METSO CORPORATION	51,970	9.11	473,654.58
MTU AERO ENGINES AG	3,962	167.05	661,852.10
PRYSMIAN SPA	21,155	35.11	742,752.05
RATIONAL AG	483	577.50	278,932.50
RHEINMETALL AG	3,820	258.30	986,706.00
SAFRAN SA	24,910	148.46	3,698,138.60
SAINT-GOBAIN	36,177	50.24	1,817,532.48
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	145.74	5,877,402.72
SIEMENS	56,492	129.86	7,336,051.12
SIEMENS ENERGY AG	36,841	11.24	414,277.04
THALES SA	8,524	138.30	1,178,869.20
VINCI S.A.	39,327	100.60	3,956,296.20
WARTSILA OYJ	41,917	9.87	413,720.79
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.28	583,699.44
RANDSTAD NV	10,680	48.46	517,552.80
TELEPERFORMANCE	4,734	118.85	562,635.90
WOLTERS KLUWER	18,738	121.40	2,274,793.20
ADP	2,382	103.00	245,346.00
AENA SME SA	5,508	139.95	770,844.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.80	308,695.14
DHL GROUP	74,810	37.84	2,831,184.45
GETLINK	21,115	14.67	309,862.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,011	95.31	2,097,868.41
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	88.10	439,707.10
CONTINENTAL AG	8,168	60.98	498,084.64
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	91.30	669,320.30
FERRARI NV	9,370	285.10	2,671,387.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	59,903	63.45	3,800,845.35
MICHELIN	47,236	28.45	1,343,864.20

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	45.81	538,038.45
RENAULT SA	11,597	33.42	387,629.72
STELLANTIS NV	162,367	18.08	2,936,569.56
VALEO SA	16,596	12.59	208,943.64
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	105.30	1,614,038.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	118.10	293,596.60
ADIDAS AG	12,783	174.32	2,228,332.56
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,680.00	3,956,400.00
KERING	5,534	410.65	2,272,537.10
LVMH	20,525	670.60	13,764,065.00
MONCLER SPA	14,605	53.12	775,817.60
PUMA SE	9,220	50.56	466,163.20
SEB SA	2,282	88.45	201,842.90
ACCOR	14,436	30.20	435,967.20
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	54.74	1,757,427.70
DELIVERY HERO SE	13,414	24.99	335,215.86
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	146.00	1,904,132.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	29.04	235,456.32
SODEXO	6,173	98.30	606,805.90
BOLLORE SE	83,646	5.05	422,830.53
PUBLICIS GROUPE	17,217	74.50	1,282,666.50
SCOUT24 SE	3,716	59.94	222,737.04
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	24.65	1,622,610.90
VIVENDI SE	61,243	8.25	505,622.20
D'IETEREN GROUP	2,217	148.00	328,116.00
INDITEX	81,082	33.96	2,753,544.72
PROSUS	114,372	26.45	3,025,139.40
ZALANDO SE	17,664	22.12	390,727.68
CARREFOUR	39,746	15.82	628,781.72
HELLOFRESH SE	13,805	24.41	336,980.05
JERONIMO MARTINS	27,312	20.60	562,627.20
KESKO OYJ-B SHS	20,083	15.32	307,771.97
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	27.51	1,950,813.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	50.55	3,205,982.10
DANONE (GROUPE)	47,639	54.08	2,576,317.12
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	10.93	370,291.90
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	70.35	669,169.20
HEINEKEN NV	23,160	83.48	1,933,396.80
JDE PEET'S BV	7,000	25.54	178,780.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	72.50	767,920.00
LOTUS BAKERIES	50	6,930.00	346,500.00
PERNOD-RICARD	15,339	166.15	2,548,574.85

REMY COINTREAU	1,032	119.20	123,014.40
BEIERSDORF AG	7,430	121.05	899,401.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	58.92	517,317.60
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	67.12	766,174.80
LOREAL	17,902	386.20	6,913,752.40
AMPLIFON SPA	11,650	27.08	315,482.00
BIOMERIEUX	3,044	85.90	261,479.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	78.04	267,677.20
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	82.22	170,195.40
ESSILORLUXOTTICA	21,384	162.14	3,467,201.76
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	33.15	563,052.75
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.90	838,856.10
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	17.47	1,255,070.05
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	46.03	992,729.01
ARGENX SE	4,177	450.80	1,882,991.60
BAYER	72,310	42.14	3,047,504.95
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	47.48	485,245.60
GRIFOLS SA	27,685	10.71	296,644.77
IPSEN	3,532	115.40	407,592.80
MERCK KGAA	9,080	150.05	1,362,454.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	36.67	114,740.43
QIAGEN N.V.	17,038	35.46	604,167.48
RECORDATI SPA	5,163	44.62	230,373.06
SANOFI	84,347	98.81	8,334,327.07
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	257.50	469,680.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	195.00	306,930.00
UCB (GROUPE)	9,389	72.46	680,326.94
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.04	361,150.82
AIB GROUP PLC	88,299	4.30	379,685.70
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.62	3,365,180.23
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.50	4,291,004.26
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.32	824,213.22
BNP PARIBAS	77,654	56.71	4,403,758.34
CAIXABANK	336,789	3.85	1,297,984.80
COMMERZBANK AG	81,889	10.25	839,771.69
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.37	1,131,576.23
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	32.50	824,720.00
FINECOBANK SPA	41,585	10.99	457,019.15
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.37	3,329,639.04
INTESA SANPAOLO	1,145,097	2.37	2,719,605.37
KBC GROEP NV	18,057	53.86	972,550.02
MEDIOBANCA	53,422	11.23	599,929.06

SOCIETE GENERALE	53,019	21.39	1,134,341.50
UNICREDIT SPA	139,080	22.50	3,129,995.40
ADYEN NV	1,609	699.30	1,125,173.70
AMUNDI SA	4,626	50.85	235,232.10
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	9.74	1,310,704.30
DEUTSCHE BOERSE	14,123	157.65	2,226,490.95
EDENRED	20,131	52.56	1,058,085.36
EURAZEO SA	3,357	52.80	177,249.60
EURONEXT NV	6,480	66.95	433,836.00
EXOR NV	7,825	84.42	660,586.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.20	597,753.00
NEXI SPA	48,458	6.46	313,038.68
SOFINA	1,238	180.90	223,954.20
WENDEL	2,023	75.20	152,129.60
WORLDLINE SA	20,332	24.08	489,594.56
AEGON LTD	148,741	4.58	681,680.00
AGEAS	11,086	38.96	431,910.56
ALLIANZ SE-REG	29,979	221.25	6,632,853.75
ASR NEDERLAND NV	11,959	35.74	427,414.66
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	18.58	1,323,564.88
AXA SA	136,364	27.87	3,801,146.50
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	210.80	939,114.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	377.70	3,933,367.80
NN GROUP NV	16,208	30.62	496,288.96
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.52	438,345.27
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	37.60	1,245,763.20
TALANX AG	5,053	59.35	299,895.55
BECHTLE AG	7,659	41.62	318,767.58
CAPGEMINI SA	12,235	164.40	2,011,434.00
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	34.84	1,650,015.28
NEMETSCHKE SE	5,455	64.08	349,556.40
SAP SE	77,618	127.28	9,879,219.04
NOKIA OYJ	396,129	3.05	1,208,193.45
CELLNEX TELECOM SA	41,890	27.55	1,154,069.50
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	20.35	4,902,722.00
ELISA A	10,227	41.72	426,670.44
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.35	314,533.12
KPN (KON.)	216,358	3.13	679,147.76
ORANGE	153,281	10.90	1,671,682.58
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.26	227,716.63
TELEFONICA	373,259	3.80	1,419,130.71
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.67	165,742.48

	ACCIONA SA	2,181	119.25	260,084.25
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	25.66	139,513.42
	E.ON SE	166,881	10.91	1,820,671.71
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	14.31	311,271.12
	ELIA GROUP SA/NV	987	91.60	90,409.20
	ENAGAS	21,663	15.98	346,174.74
	ENDESA	25,972	19.03	494,247.16
	ENEL	596,378	5.68	3,388,619.79
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	223,128	3.75	837,845.64
	ENGIE	146,393	14.87	2,177,449.48
	FORTUM OYJ	32,550	11.01	358,375.50
	IBERDROLA SA	444,395	10.41	4,626,151.95
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.36	263,863.60
	REDEIA CORP SA	30,678	15.07	462,470.85
	RWE STAMM	44,929	34.24	1,538,368.96
	SNAM SPA	147,559	4.42	652,948.57
	TERNA SPA	95,819	7.24	693,729.56
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	25.72	1,280,367.32
	VERBUND AG	6,430	82.35	529,510.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	370.05	1,258,170.00
	ASML HOLDING NV	29,993	562.50	16,871,062.50
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	86.80	551,787.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	30.06	2,918,409.55
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	38.93	1,957,885.41
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	55.76	294,134.00
	VONOVIA SE	52,580	20.51	1,078,415.80
	ユーロ 小計	13,592,223		328,580,853.39 (52,096,494,304)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	5.52	7,272,078.06
	SHELL PLC-NEW	499,932	27.58	13,788,124.56
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	21.56	2,012,130.12
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	13.47	402,160.32
	CRH PLC	55,581	45.68	2,538,940.08
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	41.35	451,707.40
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.86	296,803.44
	GLENCORE PLC	793,369	4.50	3,571,350.55
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	14.92	251,372.16
	MONDI PLC	41,710	12.52	522,209.20
	RIO TINTO PLC REG	83,678	50.52	4,227,412.56
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	47.77	1,591,553.09
	BAE SYSTEMS PLC	219,532	10.40	2,284,230.46
	BUNZL PLC	22,799	28.90	658,891.10

DCC PLC	6,622	45.27	299,777.94
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.60	465,841.41
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.05	1,307,428.90
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.42	408,259.92
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	83.84	462,293.76
EXPERIAN PLC	67,859	26.38	1,790,120.42
INTERTEK GROUP PLC	13,890	40.72	565,600.80
RELX PLC	141,442	28.80	4,073,529.60
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.83	879,894.72
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	3.92	287,317.85
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	39.80	276,689.60
BURBERRY GROUP PLC	29,776	17.22	512,742.72
PERSIMMON PLC	25,686	9.80	251,722.80
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.04	277,177.14
COMPASS GROUP PLC	129,701	20.46	2,653,682.46
ENTAIN PLC	49,630	9.42	467,613.86
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	61.54	699,279.02
PEARSON	55,305	9.08	502,169.40
WHITBREAD PLC	17,434	33.41	582,469.94
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.11	443,032.66
INFORMA PLC	110,598	7.01	775,955.56
WPP PLC	85,821	7.01	601,776.85
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.30	268,872.50
KINGFISHER PLC	153,717	2.02	311,891.79
NEXT PLC	7,832	69.64	545,420.48
OCADO GROUP PLC	54,753	5.02	274,969.56
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.55	378,699.25
TESCO PLC	525,585	2.73	1,439,577.31
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.41	499,613.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	24.88	3,928,253.44
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	21.37	383,805.20
DIAGEO	167,595	31.14	5,218,908.30
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.20	1,178,163.99
HALEON PLC	452,525	3.34	1,514,374.91
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	59.42	3,142,426.70
UNILEVER PLC	187,760	39.88	7,488,807.60
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	9.20	631,622.76
ASTRAZENECA	115,201	104.88	12,082,280.88
GSK PLC	304,379	14.51	4,417,148.04
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	19.92	131,870.40
BARCLAYS	1,129,529	1.47	1,669,443.86
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	6.41	9,522,005.94

	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.41	2,022,165.74
	NATWEST GROUP PLC	426,244	2.22	947,966.65
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.35	1,398,809.60
	3I GROUP PLC	74,757	20.31	1,518,314.67
	ABRDN PLC	153,430	1.53	235,515.05
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	6.92	228,972.83
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	82.26	2,455,378.74
	M&G PLC	131,539	1.98	261,039.14
	SCHRODERS PLC	39,932	3.74	149,465.47
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	6.35	260,094.63
	WISE PLC - A	49,048	6.92	339,608.35
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	24.89	404,586.95
	AVIVA PLC	193,334	4.04	782,809.36
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.11	866,016.31
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	4.55	232,105.55
	PRUDENTIAL	212,226	8.59	1,824,294.69
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.87	757,247.48
	HALMA PLC	31,069	18.60	578,038.74
	BT GROUP PLC	464,863	1.16	539,473.51
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.76	1,200,083.46
	CENTRICA PLC	453,631	1.57	712,654.30
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.71	2,527,544.90
	SEVERN TRENT PLC	17,468	25.14	439,145.52
	SSE PLC	81,692	15.87	1,296,452.04
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.16	513,892.80
	イギリスポンド 小計	20,563,714		135,973,173.22 (24,725,361,818)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	12.36	215,039.28
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	604.00	346,696.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,897.00	1,964,166.00
	HOLCIM LTD	38,804	56.48	2,191,649.92
	SIG GROUP AG	26,203	19.49	510,696.47
	SIKA AG-BR	10,856	218.20	2,368,779.20
	ABB LTD	116,833	30.26	3,535,366.58
	GEBERIT AG-REG	2,530	427.70	1,082,081.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	178.60	365,772.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	184.10	569,237.20
	VAT GROUP AG	1,956	325.80	637,264.80
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	34.36	510,452.16
	SGS SA	10,147	76.12	772,389.64
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	251.70	951,677.70
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	106.05	4,109,225.40

	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	229.60	570,096.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	43.45	171,106.10	
	DUFREY AG-REG	7,820	31.40	245,548.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,361.00	381,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	96,000.00	768,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	9,800.00	803,600.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	199,766	98.75	19,726,892.50	
	ALCON INC	38,399	65.30	2,507,454.70	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	213.70	830,651.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	113.50	969,290.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	65.80	121,730.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	342.00	1,893,312.00	
	NOVARTIS	152,294	84.75	12,906,916.50	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	252.60	559,509.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	238.45	12,452,335.90	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	27.77	845,818.66	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	99.25	246,834.75	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	55.32	845,787.48	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	976.60	1,537,168.40	
	UBS GROUP AG	249,657	21.71	5,420,053.47	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	129.10	307,128.90	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	120.00	354,600.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	574.00	1,216,306.00	
	SWISS RE LTD	22,063	98.38	2,170,557.94	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	425.70	4,761,028.80	
	TEMENOS AG - REG	5,150	62.64	322,596.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	63.02	674,440.04	
	SWISSCOM	1,856	539.40	1,001,126.40	
	BKW AG	1,744	153.10	267,006.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	82.35	467,665.65	
	スイスフラン 小計	1,133,120		95,476,136.44 (16,039,990,921)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	289.85	6,449,742.20	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	415.40	2,236,098.20	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	153.70	5,500,923.00	
	ALFA LAVAL AB	18,955	360.70	6,837,068.50	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	234.60	17,824,204.20	
	ATLAS COPCO A	207,097	142.80	29,573,451.60	
	ATLAS COPCO B	108,178	125.65	13,592,565.70	
	BEIJER REF AB	26,868	101.50	2,727,102.00	
	EPIROC AB-A	53,479	203.60	10,888,324.40	
	EPIROC AB-B	28,804	171.90	4,951,407.60	

	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	79.14	3,063,667.68	
	INDUTRADE AB	22,644	190.00	4,302,360.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	187.10	2,619,774.20	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	177.65	3,192,370.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	65.28	8,019,517.44	
	SAAB AB-B	6,388	563.60	3,600,276.80	
	SANDVIK AB	75,334	189.95	14,309,693.30	
	SKANSKA B	25,507	168.15	4,289,002.05	
	SKF AB-B	21,050	173.10	3,643,755.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	225.60	3,048,758.40	
	VOLVO B	114,238	222.85	25,457,938.30	
	SECURITAS B	28,375	92.28	2,618,445.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	45.43	2,264,185.77	
	EVOLUTION AB	13,186	1,046.20	13,795,193.20	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	152.92	6,323,394.92	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	244.10	12,076,603.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	190.70	3,393,697.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	208.80	2,993,148.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	120.76	28,576,163.36	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	134.45	14,789,634.45	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	100.55	12,140,004.80	
	SWEDBANK AB-A	58,652	206.70	12,123,368.40	
	EQT AB	31,471	207.00	6,514,497.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	285.60	3,375,220.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	284.60	3,178,412.80	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	210.00	26,992,980.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	449.90	3,275,272.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	49.51	10,629,252.39	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	95.76	14,256,557.28	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	85.10	3,979,446.20	
	TELIA CO AB	123,760	25.37	3,139,791.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	44.72	2,535,624.00	
	SAGAX AB-B	17,402	189.70	3,301,159.40	
	スウェーデンクローナ 小計	2,593,837		368,400,052.64 (5,036,028,719)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	18,105	317.80	5,753,769.00	
	EQUINOR ASA	66,436	377.80	25,099,520.80	
	NORSK HYDRO	100,517	59.32	5,962,668.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	386.00	4,824,228.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	477.00	4,123,665.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	104.00	1,988,168.00	
	MOWI ASA	31,968	182.15	5,822,971.20	

	ORKLA	77,073	80.68	6,218,249.64	
	SALMAR ASA	5,423	529.40	2,870,936.20	
	DNB BANK ASA	71,795	207.60	14,904,642.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	158.10	2,936,549.40	
	TELENOR ASA	51,193	115.40	5,907,672.20	
	ノルウェークローネ 小計	481,344		86,413,039.88 (1,176,081,472)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	430.50	3,651,931.50	
	NOVOZYMES A/S	17,111	284.30	4,864,657.30	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,518.50	1,146,467.50	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	72,778	141.36	10,287,898.08	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,460.00	2,509,740.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	11,570.00	3,540,420.00	
	DSV A/S	14,203	1,130.50	16,056,491.50	
	PANDORA A/S	7,957	814.60	6,481,772.20	
	CARLSBERG AS-B	6,810	877.40	5,975,094.00	
	COLOPLAST-B	9,208	708.00	6,519,264.00	
	DEMANT A/S	8,512	266.10	2,265,043.20	
	GENMAB A/S	4,628	1,986.00	9,191,208.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	246,100	684.20	168,381,620.00	
	DANSKE BANK A/S	58,346	164.60	9,603,751.60	
	TRYG A/S	29,772	137.65	4,098,115.80	
ORSTED A/S	12,910	325.00	4,195,750.00		
	デンマーククローネ 小計	498,098		258,769,224.68 (5,496,258,332)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	32.17	663,634.93	
	SANTOS	218,974	7.85	1,718,945.90	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	36.56	5,159,895.60	
	BHP GROUP LTD	377,956	45.23	17,094,949.88	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	17.75	617,167.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	21.87	2,679,184.35	
	IGO LTD	56,345	11.40	642,333.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,852	40.00	1,514,080.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	61.04	879,525.36	
	NEWCREST MINING LIMITED	60,966	25.14	1,532,685.24	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	11.98	882,710.36	
	ORICA LTD	38,288	15.20	581,977.60	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.86	808,612.10	
	RIO TINTO LTD	28,272	115.47	3,264,567.84	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.39	1,175,560.47	
	REECE LTD	16,814	17.80	299,289.20	
BRAMBLES LTD	108,007	14.27	1,541,259.89		

	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	26.03	1,155,107.28	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.50	418,568.50	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	4.74	402,900.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	12.05	2,710,924.65	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	38.74	1,790,175.40	
	IDP EDUCATION LTD	17,793	21.79	387,709.47	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.42	804,497.46	
	REA GROUP LTD	3,586	156.86	562,499.96	
	SEEK LTD	28,001	22.44	628,342.44	
	WESFARMERS LTD	84,329	51.70	4,359,809.30	
	COLES GROUP LTD	108,486	15.16	1,644,647.76	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.17	568,188.17	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	36.79	3,387,292.09	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.87	759,205.20	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	250.61	1,198,667.63	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	50.49	611,282.43	
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	29.62	806,848.80	
	CSL LIMITED	35,855	235.87	8,457,118.85	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	25.63	5,679,838.67	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	99.78	12,522,489.78	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	29.12	6,793,637.76	
	WESTPAC BANKING	255,840	21.15	5,411,016.00	
	ASX LTD	14,549	55.37	805,578.13	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	164.10	4,447,930.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	34.48	476,237.76	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.79	964,972.98	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.57	828,893.31	
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	15.86	1,650,756.38	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.97	1,325,250.08	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	61.63	850,555.63	
	XERO LTD	11,340	111.08	1,259,647.20	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.87	1,193,767.29	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	9.22	1,009,414.82	
	オーストラリアドル 小計	5,129,732		116,930,150.90 (11,076,793,194)	
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.81	644,020.41	
	EBOS GROUP LTD	14,283	34.29	489,764.07	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	21.15	845,577.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	4.98	484,090.86	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.04	390,585.58	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.08	561,563.52	
		409,088		3,415,601.44	

ニュージーランドドル 小計				(298,728,501)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	39.90	7,002,290.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	67.80	7,254,600.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	9.30	855,600.00
	MTR CORP	125,000	29.95	3,743,750.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	11.76	1,411,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	43.30	7,534,200.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	21.40	4,237,200.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	14.58	2,127,222.00
	WH GROUP LTD	658,301	4.36	2,870,192.36
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	20.80	5,855,200.00
	HANG SENG BANK	59,400	92.80	5,512,320.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	282.60	24,953,580.00
	AIA GROUP LTD	865,600	66.75	57,778,800.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	36.40	1,365,000.00
	CLP HOLDINGS	102,000	57.05	5,819,100.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.50	4,975,613.50
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	37.35	4,183,200.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	38.85	4,739,544.60
	ESR GROUP LTD	157,000	10.56	1,657,920.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.26	1,774,980.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	20.35	2,548,389.80
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	14.54	1,982,892.50
	SINO LAND CO	315,400	8.57	2,702,978.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	81.35	8,541,750.00	
SWIRE PACIFIC A	44,500	50.75	2,258,375.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	15.26	1,468,012.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	28.70	3,530,100.00	
香港ドル 小計		5,644,353		178,684,010.16 (3,425,372,474)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	28.79	230,320.00
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.25	705,000.00
	SEATRUM LTD	2,152,791	0.11	251,876.54
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.79	558,646.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.05	655,408.60
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.83	243,024.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.51	626,886.00
	DBS GROUP	141,600	33.17	4,696,872.00
	OCBC BANK	257,100	12.83	3,298,593.00
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	27.88	2,620,720.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.65	636,900.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.36	1,311,317.48

	SEBMCORP INDUSTRIES LTD	84,100	4.56	383,496.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.02	384,144.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.38	273,064.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.22	295,450.00	
	シンガポールドル 小計	4,416,666		17,171,717.62	(1,874,636,412)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	20.72	1,231,327.44	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	777.00	1,667,442.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	28.95	2,846,074.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	26.00	2,925,312.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	17.36	1,727,320.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	121.00	1,512,863.00	
	NICE LTD	4,991	644.00	3,214,204.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	175.00	268,975.00	
	イスラエルシェケル 小計	390,926		15,393,517.94	(570,663,879)
	合 計	83,479,121		556,451,394,689	(556,451,394,689)

(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
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	
		カナダドル 小計	1,490.00	-	(-)
		新株予約権証券合計		-	(-)
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	666,320.00	
		LENDLEASE GROUP	64,786	426,291.88	
		オーストラリアドル 小計	148,076	1,092,611.88	(103,503,123)
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,557,800.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,557,800.00	(49,033,026)
		投資信託受益証券合計	463,076	152,536,149	(152,536,149)
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,184,284.16	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	848,366.78	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	5,522,814.63	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	611,148.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,744,863.15	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	614,178.45	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	728,715.96	

	CROWN CASTLE INC	32,235	2,768,664.15	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,470,764.24	
	EQUINIX INC	6,951	4,892,183.31	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	924,304.00	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,514,013.65	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,115,431.50	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	1,765,462.50	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	826,036.75	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	441,712.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	755,020.20	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	894,174.75	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,420,452.48	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,393,728.50	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	808,501.36	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,203,625.50	
	PROLOGIS INC	68,641	7,041,193.78	
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,062,449.50	
	REALTY INCOME CORP	49,099	2,426,472.58	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	740,526.09	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,433,492.48	
	SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,496,253.50	
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	889,889.95	
	UDR INC	23,815	838,049.85	
	VENTAS INC	31,565	1,320,363.95	
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,095,975.44	
	WELLTOWER INC	36,855	3,092,871.60	
	WP CAREY INC	16,024	857,604.48	
	アメリカドル 小計	900,424	60,743,589.90 (9,109,108,741)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	212,633.37	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	267,822.10	
	カナダドル 小計	20,377	480,455.47 (52,489,760)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	188,357.52	
	GECINA SA	3,139	287,689.35	
	KLEPIERRE	17,225	374,816.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	458,242.65	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	291,856.40	
	ユーロ 小計	48,695	1,600,961.92 (253,832,512)	
イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	321,297.61	
	SEGRE PLC	78,133	553,181.64	

イギリスポンド 小計		134,422	874,479.25 (159,015,306)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	655,807.30
	GOODMAN GROUP	135,303	2,902,249.35
	GPT GROUP	167,884	634,601.52
	MIRVAC GROUP	266,683	546,700.15
	SCENTRE GROUP	381,283	960,833.16
	STOCKLAND	207,412	771,572.64
	VICINITY CENTERS	305,149	535,536.49
オーストラリアドル 小計		1,557,804	7,007,300.61 (663,801,586)
香港ドル	LINK REIT	166,900	6,000,055.00
香港ドル 小計		166,900	6,000,055.00 (115,021,054)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	724,551.90
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	595,811.04
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	430,447.28
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	292,600.00
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,043,410.22 (223,079,093)
投資証券合計		3,954,478	10,576,348,052 (10,576,348,052)
合計			10,728,884,201 (10,728,884,201)

有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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	組入新株予約権 証券 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 605銘柄	97.9%				73.3%
	投資証券 34銘柄				2.1%	1.6%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%				3.4%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 2銘柄				0.3%	0.0%
ユーロ	株式 222銘柄	99.5%				9.2%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.4%				4.4%
	投資証券 2銘柄				0.6%	0.0%

スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%				2.8%
スウェーデンクローナ	株式	43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	93.5%				2.0%
	投資信託受益証券	2銘柄			0.9%		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			1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄				3.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	89.4%				0.3%
	投資証券	4銘柄				10.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%				0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年10月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	288,702,164
コール・ローン	2,160,466,141
国債証券	283,246,705,835
派生商品評価勘定	6,633,307
未収利息	2,245,973,954
前払金	22,563,324
前払費用	171,253,994
差入委託証拠金	171,819,345
流動資産合計	288,314,118,064
資産合計	
	288,314,118,064
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,261,325
前受収益	39,012
未払解約金	53,330,457
未払利息	957

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
その他未払費用	84
流動負債合計	77,631,835
負債合計	77,631,835
純資産の部	
元本等	
元本	88,613,779,823
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	199,622,706,406
元本等合計	288,236,486,229
純資産合計	288,236,486,229
負債純資産合計	288,314,118,064

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</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 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</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)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10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,613,779,823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 3.2527円 (1万口当たり純資産額) (32,527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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

	2023年10月20日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	90,993,437,757円
期中追加設定元本額	7,315,654,418円
期中一部解約元本額	9,695,312,352円
期末元本額	88,613,779,823円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,160,587,432円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	528,651,041円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	341,382,731円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,476,273,683円
S B I 資産設計オープン（分配型）	9,245,362円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,876,691,896円
世界経済インデックスファンド	18,666,300,135円
D C マイセレクション 2 5	1,983,355,515円
D C マイセレクション 5 0	1,775,459,179円
D C マイセレクション 7 5	1,359,656,384円

区分	2023年10月20日現在
DC外国債券インデックス・オープン	2,257,273,387円
DCマイセクションS25	1,051,523,664円
DCマイセクションS50	958,143,670円
DCマイセクションS75	527,267,867円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,211,854円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	99,110,062円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,354,135円
DC世界経済インデックスファンド	13,689,307,121円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	527,167,791円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	915,764円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,050,849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）	15,978,905円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	29,577,182円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	51,554,161円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	58,397,209円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	54,812,935円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	880,523,259円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	386,122,632円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,570,361,933円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	53,833,925円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	32,587,935円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	369,062,812円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	136,319,136円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	181,973,692円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	653,508,465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）	1,501,986,154円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,367,705円
外国債券ファンド・シリーズ1	766,583,068円
分散投資コア戦略ファンドA	502,636,014円
分散投資コア戦略ファンドS	1,323,423,963円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	685,339,435円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,368,457,367円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	234,084,418円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,950,845円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,309,230,242円
SMT インデックスバランス・オープン	176,326,719円
SMT 世界経済インデックス・オープン	362,447,809円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	479,546,419円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	768,080,247円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,539,427円
グローバル経済コア	791,131,651円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,284,442円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,306,482円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	52,354,524円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	70,307,894円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	34,304,920円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	41,075,333円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	341,569,238円
10資産分散投資ファンド	26,109,243円
グローバル10資産バランスファンド	1,053,082円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	12,325,060,526円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	187,930,023円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	445,790,981円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	121,950,615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）	96,007,334円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

国債証券	11,549,533,848
合計	11,549,533,848

(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10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,681,899,386	-	1,659,336,062	22,563,324
	合計	1,681,899,386	-	1,659,336,062	22,563,324

(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10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,892,912,996	-	1,897,848,302	4,935,306
	アメリカドル	951,794,465	-	957,265,554	5,471,089
	カナダドル	76,522,580	-	76,181,420	341,160
	ユーロ	615,549,015	-	616,448,040	899,025
	イギリスポンド	102,346,840	-	101,421,768	925,072
	オフショア人民元	146,700,096	-	146,531,520	168,576
	合計	1,892,912,996	-	1,897,848,302	4,935,306

(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		T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,600,949.20	

アメリカドル	T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,496,296.85
	T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,765,921.88
	T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,793,701.18
	T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,730,937.50
	T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,264,468.76
	T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,193,750.00
	T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,430,000.00
	T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,633,105.45
	T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,261,764.08
	T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,717,695.32
	T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,613,593.76
	T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,046,660.14
	T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,741,110.97
	T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,516,800.78
	T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	2,985,253.91
	T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,915,184.35
	T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,931,146.87
	T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,281,542.95
	T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,474,609.37
	T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	6,887,207.05
	T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,098,437.52
	T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	8,964,367.18
	T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,847,862.08
	T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,098,242.20
	T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,030,250.04
	T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,127,050.76
	T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,415,468.72
	T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,539,980.44
	T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,583,437.52
	T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,623,696.08
	T 0.75% 11/15/24	2,750,000.00	2,617,792.40
	T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,178,124.96
	T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,577,714.85
	T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,461,804.68
	T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,459,734.39
	T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,135,782.81
	T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,033,496.11
	T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,804,062.48
	T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	922,732.03
	T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	2,778,546.88
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,186,336.90	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,230,193.77	

T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,802,343.76
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,418,802.72
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,085,585.96
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,606,230.48
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,019,306.82
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	7,956,992.14
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,250,781.25
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,354,055.50
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,805,000.00
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,571,457.01
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	2,958,587.49
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	9,588,810.11
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,343,593.72
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,095,328.12
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,371,640.64
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,254,474.04
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,810,937.50
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,193,246.90
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,431,500.00
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,327,978.52
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,179,781.26
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,084,232.41
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,712,590.59
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,623,593.75
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,535,367.18
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,348,925.76
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,317,497.66
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,102,695.32
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,999,265.62
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	2,748,677.34
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,502,187.50
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,252,390.56
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	4,818,074.19
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,435,351.54
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,616,406.24
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,768,920.71
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,707,234.37
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,823,945.33
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,613,437.52
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,030,396.87
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,345,046.88
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,847,683.00
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,089,523.43

T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,457,214.83	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,019,531.25	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,193,574.63	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,819,062.12	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	972,212.50	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,183,554.66	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,100,721.99	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,817,065.07	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,153,875.00	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,887,091.81	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,206,781.25	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,590,790.99	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,288,744.15	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,436,230.47	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,694,980.04	
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,248,185.56	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	4,816,777.30	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,442,623.05	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,824,804.70	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,793,680.07	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,541,298.82	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,547,253.92	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	909,478.51	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,443,042.18	
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	2,972,860.92	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,980,956.99	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,212,875.00	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,523,430.08	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	5,987,621.06	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,073,222.64	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,280,214.83	
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	10,843,054.75	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,014,894.55	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,643,257.81	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,601,494.13	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,146,039.85	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	1,987,742.18	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,859,375.00	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	2,961,492.20	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,203,328.12	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	8,613,800.75	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	1,923,173.83	

T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,045,337.47
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,153,312.50
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,680,480.45
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,243,732.78
T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,483,089.81
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,567,144.53
T 2.875% 11/15/46	1,240,000.00	834,675.00
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,101,441.42
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,492,412.10
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,259,845.69
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,208,335.93
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,945,922.64
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	3,795,562.50
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	778,189.45
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	2,779,046.85
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	3,909,051.59
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,835,429.66
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,325,446.87
T 3.125% 08/31/27	8,850,000.00	8,273,021.50
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,467,119.15
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,702,406.20
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,128,386.69
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,737,500.00
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	6,853,031.25
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,267,258.99
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,762,644.53
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	3,888,875.00
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,673,125.00
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	9,964,500.00
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	632,031.63
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,811,980.47
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	1,886,437.48
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	6,467,988.32
T 3.625% 05/15/53	1,300,000.00	1,007,601.55
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,578,750.00
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,714,578.13
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,410,195.32
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,331,660.14
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,564,382.82
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,221,738.27
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,331,610.14
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,641,088.46
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,101,375.00

T 3% 02/15/48	1,000,000.00	684,433.59	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	682,460.94	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,772,134.75	
T 3% 05/15/45	700,000.00	489,398.43	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,205,871.87	
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,646,371.11	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,219,648.43	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,543,109.38	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,032,984.39	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,794,726.55	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	1,967,546.86	
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,599,398.42	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,002,943.37	
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,110,234.33	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	805,710.94	
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,782,484.37	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	653,339.05	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	924,843.75	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,710,296.87	
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	580,683.59	
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,895,937.50	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	867,412.50	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,043,845.31	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	513,562.50	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,562,539.05	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,282,887.89	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	703,623.04	
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,345,117.22	
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	5,856,457.00	
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,203,054.68	
T 4% 11/15/52	7,800,000.00	6,479,484.33	
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	398,093.75	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,314,878.90	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,000,044.91	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,732,273.44	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,510,888.67	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,122,269.52	
アメリカドル 小計	1,085,080,000.00	912,862,836.92 (136,892,911,024)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,054,074.41	
CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,776,927.39	
CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,476,080.54	

CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	672,176.69	
CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,368,714.15	
CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,689,139.58	
CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,001,993.81	
CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,387,925.58	
CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	840,349.92	
CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,267,514.61	
CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	2,945,957.62	
CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,793,527.29	
CAN 1% 06/01/27	810,000.00	718,827.28	
CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,382,902.66	
CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,227,115.48	
CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	216,869.66	
CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,004,535.12	
CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	284,186.27	
CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,503,475.31	
CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	849,458.22	
CAN 2.75% 12/01/55	620,000.00	487,101.85	
CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	474,137.34	
CAN 2% 06/01/28	410,000.00	371,305.85	
CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,277,504.71	
CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,458,634.89	
CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	1,971,874.14	
CAN 3.25% 12/01/33	320,000.00	296,447.68	
CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,119,101.11	
CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	970,121.40	
CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	1,995,171.39	
CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,286,554.91	
CAN 3% 10/01/25	900,000.00	868,596.42	
CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,112,542.79	
CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	730,980.73	
CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,602,425.61	
CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,817,606.81	
CAN 5% 06/01/37	630,000.00	683,132.23	
カナダドル 小計	59,150,000.00	51,984,991.45 (5,679,360,315)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,575,308.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,118,547.35
	MBONO 5.5% 03/04/27	24,260,000.00	20,937,107.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	41,998,886.75
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,180,187.20
	MBONO 7.5% 05/26/33	20,330,000.00	17,231,911.30
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	28,785,330.30

	MBONO 7.75% 05/29/31	39,030,000.00	34,234,383.90
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	23,188,691.10
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,543,297.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	26,700,000.00	24,964,500.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	18,965,764.30
	MBONO 8% 07/31/53	16,550,000.00	13,559,084.00
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,308,284.00
	メキシコペソ 小計	345,310,000.00	306,591,283.50 (2,510,062,838)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,260,000.00	1,019,004.58
	BGB 0.35% 06/22/32	1,370,000.00	1,049,140.52
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	291,894.93
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,377,698.20
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	152,753.92
	BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,819,712.08
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,385,003.71
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,434,548.80
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,432,786.30
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	686,641.80
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,271,272.47
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	714,172.56
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	577,348.80
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	599,920.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	686,313.00
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	684,460.70
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	507,468.65
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,376,372.36
	BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,307,124.00
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	568,647.20
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	456,022.77
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	346,888.00
	BGB 3.3% 06/22/54	810,000.00	699,378.30
	BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	406,476.40
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	895,125.00
	BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,065,830.13
	BGB 3% 06/22/34	950,000.00	895,602.05
	BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	1,919,212.20
	BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,171,172.16
	BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,119,982.46
	BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,230,285.08
	BGB 5% 03/28/35	1,980,000.00	2,212,489.62
	BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,369,840.83

BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,609,473.00
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	792,862.40
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,355,744.56
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,414,963.20
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	553,990.84
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,690,767.72
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,764,436.74
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,093,185.60
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,334,968.24
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,146,969.93
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,245,582.20
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	618,451.50
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,707,376.16
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,767,437.79
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,319,941.83
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,607,366.84
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,031,120.00
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,888,110.96
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	717,033.99
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,306,423.54
BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	808,186.80
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,790,778.60
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,527,911.30
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	793,413.12
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,213,048.36
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,918,950.95
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	665,162.50
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,316,716.08
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,015,146.00
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,513,388.50
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,091,588.40
BTPS 1.7% 09/01/51	1,350,000.00	685,966.05
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	406,804.20
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,605,297.33
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,541,739.08
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,367,928.00
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	296,966.59
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	566,674.26
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,134,668.24
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,509,804.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,791,196.00
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	617,409.97
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,611,256.75

BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,904,387.10
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,543,700.00
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,658,888.00
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	743,811.00
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	499,445.86
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,402,324.91
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,323,738.20
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	912,527.04
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,067,470.60
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,090,266.20
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,094,562.98
BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,501,626.36
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,685,595.31
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	957,986.40
BTPS 3.4% 04/01/28	1,200,000.00	1,159,566.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,388,394.28
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	899,727.92
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,235,861.64
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	285,601.80
BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,341,792.00
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,187,698.26
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,763,889.70
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,068,821.50
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	449,565.81
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	386,808.12
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	763,517.60
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,100,072.00
BTPS 4.5% 10/01/53	1,060,000.00	934,364.56
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,684,270.05
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,405,336.50
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,562,324.36
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	803,995.80
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,195,771.57
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,623,334.08
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,829,733.22
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,438,263.00
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,168,868.34
BTPS 5% 08/01/34	3,770,000.00	3,775,104.58
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,390,293.50
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,932,000.20
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,241,745.00
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,523,732.42

DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,778,582.30
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,652,849.84
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,851,730.67
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,965,886.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,828,249.13
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,232,785.60
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	320,480.30
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,234,367.82
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	922,225.77
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,896,899.14
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,685,958.68
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,527,612.44
DBR 0% 08/15/26	3,050,000.00	2,807,260.80
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,511,290.75
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,946,077.30
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,227,341.80
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,677,873.44
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	1,961,978.82
DBR 0% 08/15/52	3,100,000.00	1,308,919.20
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,158,364.12
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,729,286.12
DBR 1.25% 08/15/48	3,330,000.00	2,286,810.90
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,875,097.56
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,786,837.36
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,441,681.79
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,335,013.31
DBR 2.1% 11/15/29	3,850,000.00	3,692,638.95
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,405,836.99
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,518,832.90
DBR 2.5% 08/15/46	3,040,000.00	2,741,073.76
DBR 2.6% 08/15/33	770,000.00	748,266.75
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,856,821.94
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,680,564.48
DBR 4.25% 07/04/39	1,590,000.00	1,809,264.49
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,549,204.51
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,473,475.28
DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,393,001.65
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,630,447.20
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,616,145.43
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,491,176.25
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,018,761.57
FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	3,914,483.43
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,427,854.06

FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,191,435.00	
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,400,419.71	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,596,463.89	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	308,781.99	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	775,136.90	
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,230,646.72	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,140,000.00	5,495,493.40	
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,353,758.28	
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,418,204.84	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,809,449.60	
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,138,217.98	
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,724,747.08	
FRTR 0% 02/25/27	3,040,000.00	2,731,136.00	
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,561,085.90	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,455,919.68	
FRTR 0% 11/25/29	4,450,000.00	3,656,291.76	
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,151,425.50	
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,199,541.50	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,720,000.00	2,964,679.21	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,363,203.20	
FRTR 1.25% 05/25/38	1,800,000.00	1,288,837.80	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,542,284.45	
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,730,796.55	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	843,491.96	
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,228,544.00	
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,079,444.72	
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,299,985.20	
FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,450,771.52	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,312,281.26	
FRTR 2.5% 05/25/43	820,000.00	661,448.08	
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,069,312.32	
FRTR 2.75% 02/25/29	970,000.00	944,779.03	
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,268,658.07	
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	1,998,699.56	
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,573,194.65	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,785,900.04	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,750,315.35	
FRTR 3% 05/25/33	3,690,000.00	3,540,230.28	
FRTR 3% 05/25/54	1,650,000.00	1,362,697.05	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,719,097.52	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,691,876.32	
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	1,944,881.23	

FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,787,988.64
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,816,055.00
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,563,551.36
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,217,453.02
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,994,887.90
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	602,947.07
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	631,410.00
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	361,642.44
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	487,718.56
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	215,843.04
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	696,034.57
IRISH 0% 10/18/31	950,000.00	732,304.65
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	946,001.24
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	356,785.33
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	410,925.70
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	496,799.20
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	458,211.25
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	945,760.40
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	750,220.34
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	727,863.64
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	429,298.94
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,191,332.99
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,813,153.83
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	808,818.60
NETHER 0.5% 01/15/40	1,560,000.00	999,932.18
NETHER 0.5% 07/15/26	1,830,000.00	1,704,178.35
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	811,520.76
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	826,605.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,526,447.00
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,108,232.72
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,666,246.96
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,371,059.90
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	593,825.28
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	702,013.77
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,097,394.75
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,233,678.04
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	385,342.84
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,459,600.90
NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	691,694.28
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,658,605.44
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	537,552.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,769,592.56
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,871,096.48

NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,671,739.20	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,849,911.05	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,190,681.25	
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,307,135.45	
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,344,800.86	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,758,639.71	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,327,927.45	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,343,811.03	
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,333,523.71	
OBL 2.4% 10/19/28	670,000.00	655,921.96	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	464,719.68	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,217,426.43	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,110,231.10	
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	102,258.80	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	791,352.32	
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	368,112.26	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,310,816.37	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	85,054.00	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,000,897.74	
RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,035,536.64	
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,302,596.07	
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	978,339.32	
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	619,705.03	
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	310,296.52	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,142,021.58	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	703,170.72	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	134,094.69	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	971,675.10	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	317,653.00	
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	401,430.90	
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	653,949.33	
RAGB 2.9% 02/20/33	1,000,000.00	948,095.00	
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	215,540.38	
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	639,565.50	
RAGB 3.15% 10/20/53	270,000.00	240,201.18	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	423,794.82	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,633,875.45	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,106,668.90	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,301,175.38	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	284,694.08	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	180,054.58	
RFGB 0.125% 09/15/31	460,000.00	355,726.28	

RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	170,307.97
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	580,110.44
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	272,843.15
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	486,168.48
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	638,343.39
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	450,919.76
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	471,435.60
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	420,001.12
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	419,040.35
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	508,753.92
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	291,925.93
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	328,434.40
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	328,460.80
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	484,715.64
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	443,554.02
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	354,792.77
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	537,643.15
RFGB 2.875% 04/15/29	210,000.00	205,296.77
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	439,658.80
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	585,130.10
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,677,018.20
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,247,863.75
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	1,987,853.88
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,021,138.78
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,701,194.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,207,724.20
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,347,999.50
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	942,885.52
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,176,845.96
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,456,656.30
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,596,520.25
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,093,476.59
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,888,150.40
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,305,330.40
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,687,426.47
SPGB 1.3% 10/31/26	2,350,000.00	2,203,134.40
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,977,753.19
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,858,470.55
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,402,797.01
SPGB 1.45% 10/31/27	3,160,000.00	2,916,142.80
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	263,931.49
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,400,996.46
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,407,041.70

	SPGB 1.85% 07/30/35	1,850,000.00	1,459,810.83	
	SPGB 1.9% 10/31/52	1,780,000.00	1,021,384.28	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,213,717.80	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,808,990.80	
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	504,469.14	
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	862,809.08	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,528,933.51	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,251,163.29	
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,775,646.18	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,247,923.80	
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,336,298.85	
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	980,950.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,515,032.96	
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,588,344.00	
	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	629,565.87	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,076,642.19	
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,090,000.00	2,007,089.70	
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	969,470.94	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	1,940,747.25	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,890,128.84	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	1,939,028.42	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,822,696.16	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,361,904.74	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,546,351.60	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,252,964.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,450,145.39	
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,013,388.19	
	ユーロ 小計	662,140,000.00	584,720,391.58 (92,707,418,085)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,139,100.98	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,251,684.30	
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,790,942.56	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,948,354.50	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,273,823.14	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,617,575.29	
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,764,274.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	446,484.00	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,309,546.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,065,478.40	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	377,653.07	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	718,037.99	
	UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,146,015.18	

UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,467,064.36
UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,208,309.62
UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	334,572.00
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	841,462.50
UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,055,120.00
UKT 1.25% 10/22/41	2,210,000.00	1,228,790.94
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,472,480.00
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	865,551.60
UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	521,176.08
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	933,254.00
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	627,964.20
UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	485,334.00
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	572,907.60
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	744,120.00
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,290,897.97
UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	2,967,135.20
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	816,074.00
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,259,510.12
UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,466,096.90
UKT 3.25% 01/31/33	3,260,000.00	2,912,705.68
UKT 3.5% 01/22/45	1,660,000.00	1,314,834.87
UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,144,262.52
UKT 3.5% 10/22/25	1,520,000.00	1,477,668.00
UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,233,294.57
UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,057,750.84
UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,289,845.62
UKT 4.125% 01/29/27	2,800,000.00	2,744,140.00
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,789,317.43
UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,465,137.00
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,165,852.38
UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,149,555.86
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,320,625.20
UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,564,375.56
UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,413,949.65
UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,557,500.00
UKT 4.5% 06/07/28	660,000.00	654,498.56
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,358,925.16
UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,675,831.50
UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,478,775.60
UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,368,610.60
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,046,038.75
UKT 4% 10/22/63	1,000,000.00	831,912.00
UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,180,824.11

	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,438,492.50	
イギリスポンド 小計		97,270,000.00	75,641,514.46 (13,754,652,989)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,606,780.42	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,795,143.91	
	SGB 0.75% 11/12/29	5,540,000.00	4,850,483.12	
	SGB 1.75% 11/11/33	2,940,000.00	2,616,819.41	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,462,344.73	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,184,334.37	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,607,249.60	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,300,000.00	4,490,619.00	
スウェーデンクローナ 小計		44,900,000.00	41,613,774.56 (568,860,298)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	2,996,226.56	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,392,294.40	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,857,062.23	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,926,095.65	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,055,701.13	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,752,516.25	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,620,000.00	3,118,890.64	
	NGB 2% 04/26/28	3,070,000.00	2,815,957.50	
	NGB 3% 08/15/33	3,460,000.00	3,164,788.64	
ノルウェークローネ 小計		37,860,000.00	34,079,533.00 (463,822,444)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,319,287.85	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,196,500.41	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,252,387.92	
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,808,120.72	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,118,328.26	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,366,301.56	
	DGB 2.25% 11/15/33	1,310,000.00	1,203,255.96	
	DGB 4.5% 11/15/39	10,290,000.00	11,823,751.24	
デンマーククローネ 小計		46,770,000.00	42,087,933.92 (893,947,716)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,949,118.92	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,331,711.44	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,124,547.45	
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,110,000.00	2,277,652.04	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,815,479.80	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,553,481.80	
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	4,992,456.35	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,877,416.80	

	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,155,926.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,894,539.61	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,329,644.60	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	603,883.80	
	POLGB 6% 10/25/33	2,380,000.00	2,397,242.61	
	POLGB 7.5% 07/25/28	1,510,000.00	1,629,667.94	
	ポーランドズロチ 小計	46,520,000.00	41,932,769.16 (1,494,211,329)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,677,968.60	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,932,011.10	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,087,161.99	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,847,085.68	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,917,084.36	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	855,641.25	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,419,783.63	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,095,977.33	
	ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,337,598.93	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,352,745.27	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,071,342.27	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	968,481.27	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	977,620.51	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,819,514.85	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,537,889.63	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,326,354.92	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,036,480.15	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,584,497.29	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	904,207.67	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,286,314.83	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,025,821.00	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,800,000.00	1,645,099.17	
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,025,501.34	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,579,893.79	
ACGB 4.25% 04/21/26	1,660,000.00	1,660,372.67		
ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	2,950,737.85		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,357,244.58		
	オーストラリアドル 小計	49,930,000.00	43,280,431.93 (4,099,955,316)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	515,488.31	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	591,527.34	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	753,130.94	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	257,720.36	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	816,022.67	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	455,742.79	

	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	307,539.56
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	403,130.59
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	984,887.45
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	575,032.08
	NZGB 4.25% 05/15/34	380,000.00	339,288.68
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	815,659.40
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	463,165.33
	ニュージーランドドル 小計	8,830,000.00	7,278,335.50 (636,563,222)
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	741,268.85
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	756,864.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	491,400.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	590,205.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	247,584.00
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	606,439.22
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	571,350.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	881,423.63
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	415,595.15
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	696,960.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	360,000.00	337,320.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	588,800.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	584,262.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	632,450.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	412,104.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	608,895.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	828,252.85
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	740,222.00
SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	479,955.00	
	シンガポールドドル 小計	12,010,000.00	11,211,350.70 (1,223,943,155)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,495,021.55
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,494,500.93
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	682,964.30
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,911,404.25
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,162,833.51
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,714,153.33
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,836,914.44
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,377,976.96
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,147,482.41
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,133,805.16
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,977,979.28
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,484,041.95
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	603,472.98

	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,700,181.40
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,285,815.16
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,857,969.79
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,512,507.35
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,747,564.64
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,557,814.61
	MGS 4.457% 03/31/53	490,000.00	485,780.61
	MGS 4.498% 04/15/30	1,610,000.00	1,651,704.31
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	360,192.31
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	907,406.60
	MGS 4.696% 10/15/42	1,450,000.00	1,487,886.61
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,001,302.06
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,917,311.15
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	1,964,741.88
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,766,891.11
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,087,369.66
	マレーシアリングット 小計	48,390,000.00	48,314,990.30 (1,515,447,985)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,996,866.15
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,041,684.28
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,296,652.84
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,550,000.00	1,215,414.51
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,201,412.98
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,189,287.34
	ILGOV 1% 03/31/30	2,720,000.00	2,235,536.43
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,480,774.85
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	328,097.60
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,494,362.72
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,221,167.65
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,017,278.54
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,426,072.89
	イスラエルシェケル 小計	24,620,000.00	22,144,608.78 (820,938,293)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,544,515.84
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,034,568.04
	CGB 2.22% 09/25/25	21,100,000.00	21,017,837.02
	CGB 2.26% 02/24/25	32,000,000.00	31,951,852.16
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,129,696.89
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,341,007.86
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	46,863,861.79
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,901,109.82
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	42,308,630.97

CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,268,875.13	
CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,513,596.60	
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	19,966,544.20	
CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,375,170.16	
CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,034,609.09	
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	31,665,953.18	
CGB 2.6% 09/15/30	10,500,000.00	10,424,517.18	
CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,090,451.39	
CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	19,944,978.40	
CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,560,787.09	
CGB 2.67% 05/25/33	13,000,000.00	12,923,997.45	
CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	33,474,234.90	
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,122,884.34	
CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,124,753.48	
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,532,345.15	
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,626,723.26	
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,720,295.76	
CGB 2.79% 12/15/29	15,000,000.00	15,101,929.50	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,283,247.09	
CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,131,690.00	
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,622,394.64	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,421,704.10	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,452,390.67	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,511,220.82	
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,651,096.20	
CGB 2% 06/15/25	3,600,000.00	3,576,454.74	
CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	12,868,996.91	
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,189,288.61	
CGB 3.02% 10/22/25	4,270,000.00	4,329,340.61	
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,111,675.80	
CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,519,320.32	
CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,698,827.04	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,148,796.31	
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,602,255.57	
CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,450,012.60	
CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	17,764,935.11	
CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,071,237.09	
CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	15,170,159.13	
CGB 3.81% 09/14/50	18,020,000.00	20,411,142.27	
CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,654,736.91	
CGB 4.08% 10/22/48	14,010,000.00	16,509,253.70	
オフィスア人民元 小計	965,130,000.00	977,715,902.89 (19,984,610,826)	

合計		283,246,705,835	
		(283,246,705,835)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 208銘柄	100.0%	48.3%
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 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 358銘柄	100.0%	32.7%
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%	1.4%
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 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 29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%	7.1%

(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

項目	2023年10月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,788,049,770
コール・ローン	47,400,320
株式	150,173,490,718
投資信託受益証券	431,846,665
投資証券	129,541,989
派生商品評価勘定	45,421
未収配当金	166,794,685
前払金	320,016,140
差入委託証拠金	837,931,658

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	157,895,117,366
資産合計	157,895,117,366
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	320,043,943
未払解約金	12,895,634
未払利息	20
その他未払費用	2
流動負債合計	332,939,599
負債合計	332,939,599
純資産の部	
元本等	
元本	41,563,685,998
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	115,998,491,769
元本等合計	157,562,177,767
純資産合計	157,562,177,767
負債純資産合計	157,895,117,366

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

2023年10月20日現在	
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,563,685,998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 3.7909円 (1万口当たり純資産額) (37,909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10月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託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10月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	40,301,623,894円
期中追加設定元本額	4,400,636,631円
期中一部解約元本額	3,138,574,527円
期末元本額	41,563,685,998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	7,702,723,731円
世界経済インデックスファンド	9,884,144,997円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,025,757,270円
DC世界経済インデックスファンド	7,223,464,468円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	101,330,314円
コア投資戦略ファンド（安定型）	55,049,837円
コア投資戦略ファンド（成長型）	133,389,704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	1,412,584,875円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,137,274,935円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	778,027,071円
コア投資戦略ファンド（切替型）	58,029,760円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	385,385,430円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,662,811円
SMT インデックスバランス・オープン	95,185,665円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,140,906,030円
SMT 世界経済インデックス・オープン	238,825,014円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,002,694,615円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	171,124,081円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,582,233円
グローバル経済コア	417,235,754円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	221,625,300円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	54,769,467円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	13,477,862円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	94,198,492円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	89,197,854円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	38,440,264円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	42,029,170円
10資産分散投資ファンド	13,140,059円
グローバル10資産バランスファンド	900,366円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,445,831,916円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	99,714,823円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,076,875円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	11,685,706円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	25,106,707円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,891,144,377
投資信託受益証券	14,604,514
投資証券	5,611,354
合計	2,911,360,245

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,100,745,463	-	6,780,729,323	320,016,140
合計		7,100,745,463	-	6,780,729,323	320,016,140

(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10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	25,462,600	-	25,481,028	18,428
	アメリカドル	25,462,600	-	25,481,028	18,428
	売建	26,974,800	-	26,975,610	810
	アメリカドル	26,974,800	-	26,975,610	810
	合計	52,437,400	-	52,456,638	17,618

(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	1.34	186,796.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	8.43	142,719.90	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,749	70.88	1,116,289.12	

	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	23.39	1,493,007.09	
	NIO INC - ADR	231,271	7.69	1,778,473.99	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	34.25	1,032,945.75	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	9.39	744,326.52	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	52.12	3,463,478.24	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	27.10	332,869.30	
	IQIYI INC-ADR	59,454	4.50	267,543.00	
	JOYY INC	6,185	39.53	244,493.05	
	KANZHUN LTD	38,815	15.30	593,869.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	6.73	764,171.31	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	11.71	61,465.79	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	24.96	267,720.96	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	94,486	104.07	9,833,158.02	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	14.75	806,471.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,037	66.48	534,299.76	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.22	492,758.00	
	CREDICORP LTD	10,882	125.96	1,370,696.72	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	0.94	107,285.02	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	14.24	295,522.72	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	1.94	274,200.48	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	25.47	199,557.45	
	KE HOLDINGS INC	114,048	14.85	1,693,612.80	
	アメリカドル 小計	1,971,438		28,097,731.49 (4,213,535,814)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,214,261	11.06	24,489,726.66	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	76.13	37,219,347.96	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	205.11	7,178,850.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	35.97	6,422,515.44	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	10.84	3,398,340.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	128.69	13,126,380.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	381.67	12,814,570.25	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	233.22	13,988,535.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	151.14	6,451,410.90	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	590,690	8.76	5,174,444.40	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	60.15	49,760,892.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	154.50	12,649,687.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	185.90	58,212,726.00	

	GRUMA S.A.B. -B	25,960	284.65	7,389,514.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	74.78	13,595,004.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	34.25	6,226,650.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	56.58	8,073,966.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	147.85	60,958,555.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	35.66	9,688,822.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	15.07	53,066,593.80	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	14.95	3,305,445.00	
	メキシコペソ 小計	10,240,130		413,191,976.51 (3,382,802,711)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	15.64	2,535,244.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	594,100	41.26	24,512,566.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	38.34	27,913,053.60	
	PRIO SA	130,000	50.03	6,503,900.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.74	1,492,344.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	11.25	1,118,250.00	
	GERDAU SA-PREF	155,590	21.63	3,365,411.70	
	SUZANO SA	121,779	55.98	6,817,188.42	
	VALE SA	525,387	64.42	33,845,430.54	
	WEG SA	255,844	33.94	8,683,345.36	
	CCR SA	248,600	11.90	2,958,340.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	51.07	7,013,953.80	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHTS	1,007	6.00	6,042.00	
	RUMO SA	244,300	21.67	5,293,981.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	12.34	2,670,955.98	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	1.61	491,855.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	19.32	3,342,360.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	8.85	1,173,510.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	26.40	4,996,992.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	10.99	1,668,282.00	
	AMBEV SA	756,200	12.52	9,467,624.00	
	JBS SA	110,000	18.97	2,086,700.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	12.50	1,253,850.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	3.82	3,992,488.28	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	23.10	2,210,670.00	
	HYPERA SA	54,500	33.82	1,843,190.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	12.61	4,111,150.03	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	14.43	11,950,666.26	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	49.50	7,746,750.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	27.06	21,114,403.86	
	ITAUSA SA	774,657	8.80	6,816,981.60	
	ITAUSA SA-RECEIPT	10,773	8.70	93,725.10	

	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	11.00	9,761,499.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	31.86	3,469,554.00	
	TOTVS SA	57,900	26.14	1,513,506.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	45.78	4,092,732.00	
	TIM SA	96,100	15.42	1,481,862.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	37.86	1,400,820.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	33.81	7,157,577.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.78	2,495,322.06	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	60.39	3,049,695.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	33.00	897,600.00	
	ENEVA SA	102,200	10.90	1,113,980.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	40.61	1,878,212.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	30.65	5,060,315.00	
	ブラジルリアル 小計	11,777,478		262,463,879.09 (7,767,697,240)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,494.30	587,234,088.90	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,733.00	235,627,345.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	49,830.00	1,058,937,330.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	54.20	133,396,389.60	
	FALABELLA SA	70,837	1,915.00	135,652,855.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,516.30	464,642,841.60	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	5,315.00	39,251,275.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	94.01	712,896,914.03	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	22,420.00	156,693,380.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	41.20	475,866,962.80	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	96.10	335,515,371.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	52.60	134,723,222.80	
	チリペソ 小計	28,286,435		4,470,437,976.23 (712,766,630)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	30,850.00	1,564,033,300.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	27,060.00	1,665,948,900.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	14,520.00	733,419,720.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		3,963,401,920.00 (140,074,550)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	22.90	119,102.90	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	35.20	714,384.00	
	OPAP SA	20,586	15.16	312,083.76	
	JUMBO SA	19,341	24.52	474,241.32	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.27	334,858.36	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.52	650,044.72	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	5.40	397,656.00	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	2.88	325,836.03	

	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.53	354,580.71	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	9.19	513,647.48	
	ユーロ 小計	1,025,550		4,196,435.28	(665,344,813)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	133.40	19,021,506.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	39.48	10,220,108.64	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	22.76	3,028,604.92	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	24.50	411,183.50	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	41.92	4,947,566.08	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	41.10	8,184,325.20	
	KOC HOLDING AS	89,884	145.70	13,096,098.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	50.75	15,161,461.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	709.30	5,093,483.30	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	213.60	18,500,964.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	860.00	14,078,200.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	268.90	8,498,046.70	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	293.90	23,872,909.20	
	AKBANK T.A.S.	586,183	30.92	18,124,778.36	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	55.65	11,762,851.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	22.98	8,834,959.74	
YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	18.61	6,906,673.47		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	49.24	7,045,800.84		
	トルコリラ 小計	3,176,329		196,789,521.55	(1,054,870,551)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	666.00	8,859,798.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	85.20	5,172,492.00	
	CEZ AS	25,283	1,012.00	25,586,396.00	
	チェココルナ 小計	99,296		39,618,686.00	(255,025,481)
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,892.00	128,760,516.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,750.00	251,483,750.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	13,350.00	534,280,350.00	
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		914,524,616.00	(379,311,887)
ポーランドズロチ	ORLEN SA	102,979	65.99	6,795,584.21	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	110.20	2,224,497.20	
	BUDIMEX	2,656	477.50	1,268,240.00	
	LPP SA	124	12,970.00	1,608,280.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	105.15	704,925.60	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	12.80	462,054.40	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	28.53	2,390,671.35	
	PEPCO GROUP NV	22,887	18.72	428,444.64	

	DINO POLSKA SA	9,471	375.00	3,551,625.00
	BANK PEKAO SA	27,684	118.95	3,293,011.80
	M BANK SA	1,423	491.30	699,119.90
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	40.55	5,283,543.35
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	411.80	3,023,847.40
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	44.71	3,868,711.59
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	7.01	699,598.00
	ポーランドズロチ 小計	637,976		36,302,154.44 (1,293,572,820)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,220	0.00	-
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
	ロシアルーブル 小計	760,525,356		76.00 (118)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	5.98	1,967,420.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	9.22	2,231,240.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.13	15,980,622.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	455,500	24.20	11,023,100.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	8.14	179,080.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.64	18,149,520.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	13.96	5,988,840.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.89	1,322,600.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	18.54	4,403,250.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	6.41	3,560,755.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	3.45	2,511,600.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	1.82	524,160.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.61	3,734,100.00
	DONGYUE GROUP	147,000	5.21	765,870.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	29.95	1,618,498.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	11.10	2,597,400.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.27	1,554,280.00

SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	14.98	1,423,100.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.74	1,943,940.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.70	10,588,500.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.41	937,750.00
BOC AVIATION LTD	23,800	51.95	1,236,410.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.13	613,480.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	6.08	1,477,440.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.63	2,562,780.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	7.76	3,429,920.00
CITIC LTD	1,038,000	6.71	6,964,980.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	3.39	3,173,040.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.62	1,330,560.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	18.56	1,447,680.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	11.50	1,840,000.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	13.86	2,307,690.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	10.92	4,464,096.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	24.45	1,523,235.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	2.65	1,020,446.10
AIR CHINA LIMITED-H	630,000	4.93	3,105,900.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	2.96	734,080.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.86	1,632,293.42
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	3.43	2,051,140.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	7.68	3,978,624.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.57	1,146,037.18
JD LOGISTICS INC	326,200	9.02	2,942,324.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.93	2,231,460.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	96.70	1,692,250.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	5.06	720,478.22
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.78	1,791,800.00
BYD CO LTD-H	169,000	248.00	41,912,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.17	843,220.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	36.90	2,154,960.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	8.90	8,437,200.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	10.20	5,036,250.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	3.65	1,307,955.60
LI AUTO INC-CLASS A	171,642	125.40	21,523,906.80
MINTH GROUP LTD	176,000	19.04	3,351,040.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	53.55	8,951,525.10
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	14.50	3,393,000.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	90.95	18,080,860.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.35	1,467,300.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	22.85	7,097,210.00

LI NING CO LTD	380,000	31.35	11,913,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	79.60	9,719,160.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.22	1,191,300.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	33.15	1,458,600.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	19.58	4,581,720.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	235,000	9.09	2,136,150.00
MEITUAN-CLASS B	806,150	110.40	88,998,960.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	48.15	11,772,675.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	15.02	2,505,336.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	12.40	979,600.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	253.80	22,247,346.60
BAIDU INC-CLASS A	351,450	107.70	37,851,165.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	99.00	2,633,400.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	27.20	1,403,520.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.92	2,434,560.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	26.70	4,571,040.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	56.10	20,891,640.00
NETEASE INC	313,630	159.80	50,118,074.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,059,100	291.20	308,409,920.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,603,988	79.15	206,105,650.20
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	3.73	387,920.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	86.80	781,200.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	10.46	2,635,920.00
JD.COM INC - CL A	379,111	97.20	36,849,589.20
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	23.00	1,485,800.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.06	2,484,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	18.76	1,725,920.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.55	3,567,200.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	35.85	6,935,182.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	16.94	909,678.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	122.00	1,854,400.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.40	2,481,600.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	458,000	25.30	11,587,400.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	42.25	10,393,500.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	43.05	12,165,930.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	5.97	1,164,150.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	9.99	4,155,840.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	58.95	6,838,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	5.25	420,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	556,000	4.86	2,702,160.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	12.66	607,680.00

HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	24.35	2,130,625.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	19.50	487,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	44.95	3,389,230.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	11.28	744,480.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	6.69	2,670,648.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.40	1,463,760.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	20.00	3,824,000.00
3SBIO INC	445,500	6.39	2,846,745.00
AKESO INC	61,000	37.60	2,293,600.00
BEIGENE LTD	110,905	99.05	10,985,140.25
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.56	2,855,320.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	5.53	7,676,524.80
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	4.76	1,613,640.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.45	1,676,700.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	19.42	2,563,440.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	11.24	1,371,280.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	42.60	8,647,800.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	17.40	1,270,200.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.68	5,282,280.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	94.20	5,999,409.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	45.95	28,856,600.00
ZAI LAB LTD	128,250	19.04	2,441,880.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	2.89	11,372,150.00
BANK OF CHINA LTD-H	12,394,200	2.76	34,207,992.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.73	6,487,076.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.58	5,603,416.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,201,620	4.55	69,167,371.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.28	855,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	30.60	19,030,843.80
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.52	1,699,488.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	10,056,515	3.79	38,114,191.85
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	3.83	4,117,250.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.76	632,320.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.92	1,893,360.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	13.42	4,713,104.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	15.26	4,360,926.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.69	1,365,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	9.85	872,710.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	4.50	1,607,400.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	10.04	2,670,640.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	11.44	15,100,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	19.68	7,608,288.00

CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	7.52	1,383,860.48
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	19.10	2,013,140.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.73	5,126,940.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.52	11,398,181.76
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,058,000	40.90	43,272,200.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	21.55	2,501,955.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	5.99	1,653,240.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	9.74	1,234,058.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	10.00	4,930,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	14.00	1,001,000.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	37.65	6,042,825.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	18.80	1,259,600.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	6.50	448,500.00
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	8.22	9,765,360.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	65.30	7,803,350.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	13.58	32,649,036.00
ZTE CORP-H	82,908	21.05	1,745,213.40
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.72	5,099,040.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.70	1,588,650.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.69	1,030,900.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.91	2,727,480.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.46	3,479,344.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	6.24	2,820,480.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.80	1,864,800.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,800	23.10	2,467,080.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	14.28	3,675,672.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	60.85	7,119,450.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	5.60	2,497,600.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	3.47	2,442,880.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.76	3,704,480.00
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	16.60	1,062,400.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.34	4,219,660.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	19.50	1,755,000.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	5.45	4,883,129.15
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	18.20	1,664,462.80
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	0.93	582,087.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	14.88	8,697,955.20
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	6.63	1,491,750.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	29.40	15,908,663.40
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	29.20	3,474,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	7.84	2,473,520.00

	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	6.86	2,339,260.00
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	7.56	548,100.00
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	11.60	3,984,600.00
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	7.66	2,455,796.00
	香港ドル 小計	131,187,629		1,738,895,112.66 (33,334,619,309)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.13	881,112.84
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	22.70	2,006,680.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	7.48	3,114,672.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.89	3,704,664.00
	GAMUDA BHD	161,910	4.57	739,928.70
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.27	763,505.42
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	7.25	777,787.25
	MISC BHD	217,540	7.19	1,564,112.60
	GENTING BHD	271,600	4.07	1,105,412.00
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.44	902,068.00
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.53	464,278.50
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.95	1,067,843.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	22.40	2,559,110.40
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	127.50	2,320,500.00
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.36	1,128,652.80
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.59	697,632.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.30	1,062,297.80
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	5.95	2,804,830.00
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.85	1,157,695.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	5.58	5,133,611.16
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.46	2,360,342.32
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.26	287,085.58
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	8.96	7,898,284.80
	PUBLIC BANK BERHAD	2,122,900	4.12	8,746,348.00
	RHB BANK BHD	219,347	5.59	1,226,149.73
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.42	1,309,435.38
CELCOMDIGI BHD	498,000	4.29	2,136,420.00	
MAXIS BHD	267,900	3.96	1,060,884.00	
TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.07	1,376,768.64	
PETRONAS GAS BHD	148,400	17.14	2,543,576.00	
TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.98	4,408,914.50	
INARI AMERTRON BHD	274,700	2.88	791,136.00	
	マレーシアリンギット 小計	11,789,202		68,101,738.42 (2,136,079,127)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	7.90	13,534,280.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	171.50	34,437,200.00

	PTT PCL-NVDR	1,684,600	33.50	56,434,100.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	50.50	14,827,052.50	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	24.60	5,077,440.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	33.75	16,407,022.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	35.00	7,094,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	290.00	37,816,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	68.00	44,533,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.20	6,699,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.55	6,111,725.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.58	2,900,874.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	29.50	10,700,771.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	38.25	6,969,150.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	12.10	10,165,633.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	18.10	14,342,440.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	27.50	4,884,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	56.25	53,797,500.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	28.25	6,720,957.50	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	18.60	10,349,040.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	23.50	6,887,850.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	27.00	50,978,700.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	262.00	21,667,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	126.50	10,524,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.30	8,465,945.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,200	103.50	8,404,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	45.75	4,643,625.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	35.25	3,165,450.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	84.00	41,664,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	226.00	46,058,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	71.50	8,712,275.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.80	13,706,202.40	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	23.50	7,543,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	118.50	8,437,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	46.75	10,280,325.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	39.25	2,676,850.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	43.00	17,324,700.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	32.00	11,393,600.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	63.50	24,028,400.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.55	6,583,600.00	
	タイパーツ 小計	20,700,490		676,949,708.40 (2,789,032,798)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	49.10	11,682,854.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	610.50	33,217,305.00	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	38.05	22,301,980.15	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	820.00	29,753,700.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	210.00	32,157,300.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	220.80	13,471,008.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	113.70	10,865,172.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	106.80	25,076,853.60	
	BDO UNIBANK INC	394,773	131.30	51,833,694.90	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	52.55	8,475,631.85	
	PLDT INC	10,460	1,206.00	12,614,760.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	375.60	19,974,408.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	29.50	37,786,550.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	31.40	48,775,190.00	
	フィリピンベソ 小計	4,913,210		357,986,407.50 (944,081,753)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,820.00	6,097,686,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	26,025.00	5,228,422,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,815.00	1,789,227,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	1,035.00	2,993,436,315.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	10,450.00	7,879,300,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,480.00	4,025,776,560.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	5,775.00	1,756,755,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,475.00	2,557,003,400.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	5,725.00	18,762,542,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	64.00	8,616,953,856.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,810.00	6,009,747,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	5,200.00	4,957,160,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	10,425.00	6,248,745,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,750.00	2,896,425,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,810.00	4,409,694,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,800.00	7,539,300,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	8,750.00	76,031,375,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,725.00	34,932,759,200.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	4,940.00	12,767,924,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,000.00	54,802,010,000.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	900.00	2,556,540,000.00		
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	3,730.00	27,228,254,000.00		
	インドネシアルピア 小計	195,177,708		300,087,036,331.00 (2,850,826,845)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	61,100.00	316,498,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	71,600.00	457,309,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	144,000.00	1,446,336,000.00	
	ECOPRO CO LTD	3,133	798,000.00	2,500,134,000.00	

HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	30,500.00	557,418,000.00
HYUNDAI STEEL CO	11,189	32,400.00	362,523,600.00
KOREA ZINC CO LTD	1,204	483,500.00	582,134,000.00
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	128,400.00	243,703,200.00
LG CHEM LTD	8,087	494,000.00	3,994,978,000.00
LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	313,500.00	274,939,500.00
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	133,700.00	309,649,200.00
POSCO HOLDINGS INC	11,785	477,000.00	5,621,445,000.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	67,200.00	157,113,600.00
SKC CO LTD	1,432	71,700.00	102,674,400.00
DOOSAN BOBCAT INC	12,098	45,000.00	544,410,000.00
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	14,030.00	1,150,502,090.00
ECOPRO BM CO LTD	8,232	239,500.00	1,971,564,000.00
GS HOLDINGS CORP	6,593	39,600.00	261,082,800.00
HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	97,300.00	566,869,800.00
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	111,600.00	236,034,000.00
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	98,300.00	616,242,700.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	36,300.00	354,578,400.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	73,000.00	210,459,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	49,000.00	657,384,000.00
LG CORP	16,658	82,000.00	1,365,956,000.00
LG ENERGY SOLUTION	7,369	452,500.00	3,334,472,500.00
NANWHA OCEAN CO LTD	10,937	25,850.00	282,721,450.00
POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	318,000.00	1,513,044,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	62,800.00	543,031,600.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	107,200.00	1,276,752,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	30,300	27,950.00	846,885,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	7,410.00	705,202,290.00
SK INC	6,394	149,300.00	954,624,200.00
SK SQUARE CO LTD	11,660	43,950.00	512,457,000.00
HMM CO LTD	35,545	14,900.00	529,620,500.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	172,800.00	482,630,400.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	19,630.00	526,515,860.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,450.00	132,325,200.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	37,650.00	266,034,900.00
HANON SYSTEMS	19,000	7,210.00	136,990,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	225,000.00	2,283,300,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	20,743	188,900.00	3,918,352,700.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	106,000.00	640,452,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	104,600.00	360,765,400.00
KIA CORP	39,244	84,100.00	3,300,420,400.00
COWAY CO LTD	9,036	44,750.00	404,361,000.00

F&F CO LTD / NEW	3,017	97,100.00	292,950,700.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	106,200.00	1,832,374,800.00
KANGWON LAND INC	28,528	14,890.00	424,781,920.00
HYBE CO LTD	2,474	227,500.00	562,835,000.00
JYP ENTERTAINMENT CORP	4,193	101,700.00	426,428,100.00
KAKAO CORP	52,020	40,500.00	2,106,810,000.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	23,300.00	70,389,300.00
KRAFTON INC	3,793	153,000.00	580,329,000.00
NAVER CORP	21,578	181,400.00	3,914,249,200.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	237,000.00	642,033,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	38,650.00	95,272,250.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	46,950.00	216,204,750.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	68,600.00	299,301,800.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	136,600.00	222,931,200.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	282,500.00	519,517,500.00
KT&G CORP	13,993	88,300.00	1,235,581,900.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	119,200.00	374,526,400.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	108,700.00	408,929,400.00
LG H&H CO LTD	1,321	390,000.00	515,190,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	63,600.00	976,896,000.00
HLB INC	23,903	28,350.00	677,650,050.00
CELLTRION INC	17,544	142,300.00	2,496,511,200.00
CELLTRION PHARM INC	2,066	61,900.00	127,885,400.00
HANMI PHARM CO LTD	1,179	275,500.00	324,814,500.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	711,000.00	1,901,925,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	76,200.00	243,611,400.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	60,700.00	127,470,000.00
YUHAN CORPORATION	13,195	61,400.00	810,173,000.00
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	43,750.00	2,242,143,750.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,920.00	337,693,600.00
KAKAObANK CORP	35,459	22,950.00	813,784,050.00
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	57,200.00	3,695,062,800.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	35,950.00	2,436,619,100.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	12,550.00	1,428,365,700.00
KAKAOPAY CORP	3,065	38,850.00	119,075,250.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	52,000.00	239,304,000.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	51,100.00	867,422,500.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,340.00	196,635,100.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,250.00	124,096,750.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	37,400.00	596,417,800.00
DB INSURANCE CO LTD	10,074	88,000.00	886,512,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	261,000.00	1,080,279,000.00

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	73,800.00	895,267,800.00
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	133,500.00	972,414,000.00
	COSMOAM&T CO LTD	3,780	169,200.00	639,576,000.00
	L&F CO LTD	4,327	156,500.00	677,175,500.00
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	12,160.00	465,740,160.00
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	218,000.00	587,728,000.00
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	39,600.00	85,773,600.00
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	142,900.00	1,319,395,700.00
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	750,499	69,500.00	52,159,680,500.00
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	133,027	54,800.00	7,289,879,600.00
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	494,000.00	4,358,562,000.00
	LG UPLUS CORP	22,125	10,230.00	226,338,750.00
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	16,910.00	748,098,400.00
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	58,700.00	424,870,600.00
	SK HYNIX INC	87,370	125,700.00	10,982,409,000.00
	韓国ウォン 小計	2,496,096		167,136,790,670.00 (18,468,615,369)
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	81.50	19,416,560.00
	ASIA CEMENT CORP	454,176	39.15	17,780,990.40
	CHINA STEEL	1,779,261	24.50	43,591,894.50
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	63.20	34,258,255.20
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	79.30	47,407,443.20
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	65.20	50,253,030.40
	TAIWAN CEMENT	913,419	31.90	29,138,066.10
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	1,055.00	19,577,635.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	28.95	10,480,710.60
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,550.00	13,950,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	35.75	17,954,114.75
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	19.25	8,951,250.00
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	26.95	10,402,700.00
	EVERGREEN MARINE	183,215	103.50	18,962,752.50
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	30.05	14,183,600.00
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	45.60	3,403,356.00
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	42.70	9,265,900.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	43.40	7,684,447.40
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	525.00	20,966,925.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	181.50	14,320,531.50
	GIANT MANUFACTURING	35,713	170.00	6,071,210.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	295.00	9,145,000.00
	POU CHEN	273,780	29.35	8,035,443.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	628.00	33,949,680.00
	MOMO.COM INC	6,600	503.00	3,319,800.00

PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	259.00	22,932,896.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	68.60	53,260,697.00
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	309.50	7,737,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	17.40	10,585,777.20
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	24.85	65,634,739.45
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,002,537	24.20	48,461,395.40
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	26.40	43,648,651.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	20.75	31,505,990.75
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,684,994	38.35	64,619,519.90
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	18.40	32,962,569.60
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	17.80	35,611,587.80
TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	13.05	10,423,296.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	25.65	38,857,851.90
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	43.40	29,945,349.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	220,702	179.00	39,505,658.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,433,822	25.10	35,988,932.20
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	45.10	69,050,670.70
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	11.85	30,528,278.10
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,166,451	61.00	71,153,511.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.97	17,328,838.02
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	496.00	34,720,000.00
ACER INC	617,803	35.30	21,808,445.90
ADVANTECH CO LTD	76,261	339.00	25,852,479.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	344.50	43,783,194.00
AUO CORP	1,268,072	15.40	19,528,308.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	185.00	21,959,500.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	29.25	23,568,480.00
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	317.50	96,171,702.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	178.50	25,704,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	243.00	18,225,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	103.50	200,608,668.00
INNOLUX CORP	1,320,576	11.95	15,780,883.20
INVENTEC CO LTD	455,511	43.45	19,791,952.95
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,040.00	30,681,600.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	107.00	37,819,364.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	159.00	15,900,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	242.50	5,092,500.00
PEGATRON CORP	340,474	76.60	26,080,308.40
QUANTA COMPUTER INC	408,270	208.50	85,124,295.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	67.90	13,722,590.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	160.00	33,760,000.00
WISTRON CORP	427,000	91.70	39,155,900.00

	WIWYNN CORP	16,000	1,465.00	23,440,000.00
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	67.50	17,596,710.00
	YAGEO CORPORATION	42,588	549.00	23,380,812.00
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	98.50	13,585,317.00
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	116.00	67,780,540.00
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	75.30	16,264,800.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	94.90	23,269,480.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	116.00	59,660,540.00
	EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,360.00	28,320,000.00
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,630.00	21,190,000.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	478.00	20,076,000.00
	MEDIATEK INC	241,804	830.00	200,697,320.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	70.50	18,259,500.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	438.50	42,115,732.50
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,135.00	9,080,000.00
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	27.35	15,753,600.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	421.50	36,225,396.00
	SILERGY CORP	53,000	304.00	16,112,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,886,389	546.00	2,121,968,394.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	49.30	83,859,300.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	74.50	14,006,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	26.40	9,213,600.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	33.40	9,321,171.80
	新台湾ドル 小計	54,542,640		4,978,230,389.82 (23,029,791,606)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	353.60	33,079,280.00
	COAL INDIA LTD	295,479	314.70	92,987,241.30
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	261.65	15,548,551.25
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	90.62	54,103,402.32
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	186.25	100,529,927.50
	PETRONET LNG LTD	83,779	230.45	19,306,870.55
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	481,342	2,305.55	1,109,758,048.10
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	437.30	32,155,980.90
	ASIAN PAINTS LTD	56,921	3,100.35	176,475,022.35
	BERGER PAINTS INDIA LTD	35,338	576.80	20,382,958.40
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,975.20	92,524,293.60
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	479.40	86,124,210.00
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	674.45	47,059,074.30
	JSW STEEL LTD	99,332	780.85	77,563,392.20
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,496.10	44,739,591.70
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,374.80	69,249,168.00
	SHREE CEMENT LTD	1,387	26,297.45	36,474,563.15

SRF LTD	19,164	2,255.05	43,215,778.20
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	4,655.25	46,608,363.00
TATA STEEL LTD	1,137,948	125.90	143,267,653.20
ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	8,514.80	169,035,809.60
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	613.75	42,748,301.25
VEDANTA LTD	107,173	227.15	24,344,346.95
ABB LTD INDIA	5,256	4,087.50	21,483,900.00
ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	2,401.90	55,248,503.80
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	176.60	42,732,431.80
ASTRAL LTD	19,918	1,843.30	36,714,849.40
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	136.95	69,489,114.75
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	380.30	26,775,401.80
CUMMINS INDIA LTD	20,968	1,704.25	35,734,714.00
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,361.65	48,564,608.90
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	21,292	1,953.50	41,593,922.00
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	3,051.70	328,332,403.00
SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,460.50	38,152,012.50
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	699.80	16,090,501.40
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	792.95	82,928,296.90
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	712.85	18,858,446.75
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,525.10	66,791,420.10
BAJAJ AUTO LTD	9,644	5,483.90	52,886,731.60
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,570.20	22,697,436.20
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,094.45	33,185,912.90
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,495.00	62,462,640.00
HERO MOTOCORP LTD	13,719	3,269.25	44,850,840.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,569.25	235,563,256.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	10,770.25	229,718,662.25
MRF LTD	432	109,559.30	47,329,617.60
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	96.19	50,137,594.65
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	549.35	32,570,412.15
TATA MOTORS LTD	277,381	668.45	185,415,329.45
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,960.70	62,624,726.40
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,598.60	65,948,644.40
PAGE INDUSTRIES LTD	886	38,685.05	34,274,954.30
TITAN CO LTD	56,531	3,284.30	185,664,763.30
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	413.95	68,093,533.15
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	529.15	23,245,559.50
ZOMATO LTD	842,242	111.70	94,078,431.40
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,174.80	59,933,428.80
TRENT LTD	37,950	2,060.65	78,201,667.50
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,765.45	107,661,746.40

BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	4,604.20	69,500,399.00
ITC LTD	480,447	450.30	216,345,284.10
MARICO LTD	81,711	546.95	44,691,831.45
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	24,122.00	124,131,812.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	894.80	83,430,257.20
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,045.95	61,271,751.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	934.20	75,070,443.60
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,088.20	54,293,200.00
DABUR INDIA LTD	79,726	525.45	41,892,026.70
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	983.65	62,359,475.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,547.85	329,951,670.70
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	4,991.25	72,682,582.50
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	580.00	69,710,780.00
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	882.95	31,269,674.25
CIPLA LTD	88,546	1,223.30	108,318,321.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,637.70	79,782,036.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,624.50	103,046,464.50
LUPIN LTD	26,552	1,199.30	31,843,813.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,140.30	165,521,386.80
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,918.45	23,443,459.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	705.30	21,253,510.20
AXIS BANK LTD	359,795	990.95	356,538,855.25
BANDHAN BANK LTD	74,811	229.20	17,146,681.20
BANK OF BARODA	248,313	205.20	50,953,827.60
HDFC BANK LTD	461,405	1,514.95	699,005,504.75
ICICI BANK LTD	812,223	935.05	759,469,116.15
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	90.80	48,217,342.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,738.25	292,224,160.50
STATE BANK OF INDIA	268,868	571.25	153,590,845.00
YES BANK LTD	2,352,478	17.07	40,156,799.46
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	7,842.60	346,423,327.20
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,634.45	89,894,750.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	6,858.05	20,539,859.75
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,196.80	65,599,001.60
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	2,864.25	40,595,015.25
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	214.35	100,997,861.70
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,251.85	15,551,732.55
POWER FINANCE CORPORATION	205,755	249.10	51,253,570.50
REC LTD	186,584	294.85	55,014,292.40
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	790.85	48,000,640.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,879.35	72,514,719.75
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	638.05	89,409,946.50

	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,372.15	46,146,776.65	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	522.55	23,679,875.80	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,347.50	98,011,760.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	139,039	1,267.50	176,231,932.50	
	INFOSYS LTD	532,498	1,433.45	763,309,258.10	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,456.95	85,668,658.05	
	MPHASIS LTD	19,317	2,258.10	43,619,717.70	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,454.75	494,654,559.75	
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,706.40	32,205,045.60	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,170.70	110,978,847.90	
	WIPRO LTD	182,000	395.20	71,926,400.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	942.70	338,405,732.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	932.80	39,718,624.00	
	ADANI POWER LTD	85,623	344.40	29,488,561.20	
	GAIL INDIA LTD	504,548	129.25	65,212,829.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	457.45	12,224,893.80	
	NTPC LTD	664,141	239.30	158,928,941.30	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	205.70	164,761,586.00	
	TATA POWER CO LTD	199,512	251.90	50,257,072.80	
	DLF LTD	87,983	560.00	49,270,480.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,675.70	21,321,606.80	
	インドルピー 小計	19,981,395		13,442,249,433.53 (24,464,893,969)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	15.91	953,231.74	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.36	1,578,762.53	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.69	750,233.25	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	13.43	3,799,602.17	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.15	2,736,663.65	
	DUKHAN BANK	319,751	3.71	1,186,276.21	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.01	2,302,205.41	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	9.35	2,005,883.55	
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	17.95	4,659,191.75	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	15.50	11,490,181.00	
	OOREDOO QSC	72,800	9.65	702,520.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.33	1,672,552.96	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.50	518,725.00	
	カタールリアル 小計	4,842,933		34,356,029.22 (1,415,468,403)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	188.13	6,437,244.21	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	161.04	2,362,456.80	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	669.06	6,684,578.46	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	350.95	23,669,120.85	

	GOLD FIELDS LTD	144,200	264.67	38,165,414.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	91.48	9,135,284.28
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	83.03	12,524,826.41
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	493.72	2,652,263.84
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	117.50	5,648,107.50
	SASOL LTD	88,115	255.63	22,524,837.45
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	25.65	10,129,800.60
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	265.70	13,365,507.10
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	2,913.23	89,118,618.93
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	16.31	7,756,677.18
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	65.80	11,601,592.80
	BID CORP LTD	58,066	403.60	23,435,437.60
	CLICKS GROUP LTD	35,422	241.90	8,568,581.80
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	234.19	19,958,608.56
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	166.13	9,333,515.66
	ABSA GROUP LTD	140,135	173.13	24,261,572.55
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,713.68	25,019,728.00
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	201.86	12,739,586.46
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	190.59	38,807,745.21
	FIRSTSTRAND LTD	816,636	60.50	49,406,478.00
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	385.94	6,633,150.78
	REMGRO LTD	74,679	145.55	10,869,528.45
	DISCOVERY LIMITED	98,779	132.53	13,091,180.87
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.00	11,695,872.00
	OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	40.73	2,937,977.09
	SANLAM LTD	307,490	65.76	20,220,542.40
	MTN GROUP LTD	255,377	106.62	27,228,295.74
	VODACOM GROUP	79,334	102.40	8,123,801.60
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	101.57	6,839,317.52
	南アフリカランド 小計	5,210,463		580,947,250.70 (4,577,864,335)
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.42	1,777,189.32
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.91	1,686,953.86
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.44	1,527,435.68
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.20	3,865,726.00
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.68	1,984,141.08
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.36	2,814,771.84
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	17.30	4,675,498.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.32	9,643,933.08
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	19.12	10,679,208.32
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.05	3,665,446.55
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.53	7,239,602.04

アラブ首長国連邦ディルハム 小計		5,964,783		49,559,905.77 (2,021,052,957)
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.52	169,454.26
	BOUBYAN BANK K.S.C	162,047	0.59	96,904.10
	GULF BANK	144,000	0.25	36,576.00
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.72	930,946.32
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,204,993	0.89	1,074,853.75
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.48	145,149.87
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.83	117,998.40
クウェートディナール 小計		3,566,062		2,571,882.70 (1,247,337,390)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.39	937,413.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	30.95	2,754,550.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	13.82	884,480.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.81	698,995.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.74	774,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	18.43	1,772,966.00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.98	1,897,580.16
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	9.49	755,404.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	18.80	186,120.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	19.79	614,479.50
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	30.00	840,000.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.95	977,585.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	24.21	712,742.40
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	5.84	2,157,880.00
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	25.12	525,761.60
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	21.11	434,866.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	12.65	1,166,330.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	20.91	434,928.00
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	51.46	530,038.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	42.79	479,248.00
	GEM CO LTD-A	289,800	5.81	1,683,738.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	25.73	638,772.98
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.10	523,110.00
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.03	1,036,925.00
	HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.18	1,813,978.00
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	55.10	132,240.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.60	737,600.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.92	235,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	10.46	233,258.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	65.55	664,677.00	
LB GROUP CO LTD-A	15,300	18.88	288,864.00	

NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	13.28	625,488.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.85	1,096,920.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.38	65,910.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	16.19	770,644.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	10.87	526,651.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	15.47	858,198.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	24.99	181,227.48
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	31.30	561,522.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.01	862,666.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	25.88	420,291.20
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	6.77	742,520.06
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.85	528,990.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	10.16	500,888.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	41.47	447,876.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	78.46	75,321.60
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	18.56	926,144.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	57.45	571,053.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	52.70	600,780.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	14.04	137,592.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.05	1,011,380.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	84.85	3,419,455.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.51	391,075.52
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	46.01	758,474.85
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	45.00	81,900.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	58.43	239,563.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	20.92	782,408.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	34.54	255,941.40
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	14.22	1,840,068.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	11.77	3,167,307.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	34.49	393,186.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	36.67	568,385.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	27.00	226,800.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	9.88	632,320.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	25.79	1,423,994.85
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.19	1,320,789.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	7.22	1,661,322.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.17	2,907,608.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	182.70	7,267,806.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	5.40	1,003,320.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	14.75	637,200.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	43.00	1,697,339.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	5.96	135,888.00

GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	84.24	202,176.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	8.90	178,987.90
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	141.12	532,022.40
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	22.34	129,572.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	31.60	831,712.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	56.46	646,805.76
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	14.64	601,704.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	13.66	657,046.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.36	1,111,824.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	14.91	539,742.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	22.43	1,883,671.40
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	72.00	427,680.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	39.80	498,853.20
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	41.46	484,045.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	13.80	557,520.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.16	842,112.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	121.30	333,817.60
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	14.62	612,578.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.52	2,199,884.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	63.64	1,806,930.52
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	7.85	196,721.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	81.81	818,100.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	15.77	641,839.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	122.66	502,415.36
TBEA CO LTD-A	29,274	14.23	416,569.02
WEICHAO POWER CO LTD-A	43,200	13.18	569,376.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.92	1,180,448.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	22.52	711,632.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	47.62	393,341.20
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	26.88	196,224.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.10	730,620.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.39	511,839.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	34.50	379,500.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	7.29	188,811.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	4.83	1,917,993.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.04	161,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	9.53	1,748,755.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.13	1,144,365.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	39.00	2,070,900.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	35.16	187,016.04
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	4.85	215,340.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	13.58	756,406.00

YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	9.53	208,135.20
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	75.91	819,828.00
BYD CO LTD -A	17,000	240.60	4,090,200.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	151.53	1,363,770.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	14.37	622,968.24
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	37.90	701,150.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.22	624,946.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	119.16	1,000,944.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	18.01	527,693.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	64.07	44,849.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.74	627,924.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	20.82	817,268.28
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	44.69	125,132.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	33.71	1,466,385.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	24.61	683,173.60
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	38.75	307,365.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	90.00	693,000.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.62	2,286,882.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	46.23	369,840.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	31.95	837,090.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	10.61	355,222.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	20.57	503,965.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.57	405,752.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.86	956,284.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	335.97	974,313.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	26.30	428,690.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	12.40	282,720.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.13	315,495.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	92.83	1,923,437.60
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.99	772,395.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	23.24	518,042.84
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	32.43	460,376.28
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	32.67	349,569.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	256.00	409,600.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	47.86	105,292.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	68.95	1,261,785.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	117.86	353,580.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	7.52	447,440.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	77.41	611,539.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	5,980	14.93	89,281.40
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	35.43	1,915,239.51
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	18.05	494,570.00

GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	42.20	717,400.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	25.30	1,988,074.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	26.16	897,340.32
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	54.17	937,141.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	116.03	1,055,873.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	72.36	405,216.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	33.55	385,825.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	33.23	232,610.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,630.00	18,745,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	197.81	3,639,704.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	32.15	1,078,889.70
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	9.90	265,320.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	26.28	1,319,256.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	224.00	2,101,120.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	56.30	641,820.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	17.20	656,352.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	144.25	5,986,375.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	32.27	325,927.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	16.37	86,761.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	17.88	531,036.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	16.73	1,534,960.77
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	28.76	460,160.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	59.60	169,144.80
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	40.93	397,839.60
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,694	7.46	161,837.24
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	16.25	240,500.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	5.71	141,836.40
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	24.74	178,350.66
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,900	260.27	2,056,133.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	82.90	165,800.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	154.17	2,895,312.60
BEIJING Tiantan Biological-A	83,180	27.13	2,256,673.40
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	48.68	1,382,512.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	44.53	466,986.11
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	55.99	901,439.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	49.70	273,350.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	77.75	704,959.25
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	132.79	292,138.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	41.75	425,850.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	57.32	851,202.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	45.86	1,017,770.98
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	66.44	531,520.00

HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	21.91	413,003.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	362.99	755,019.20
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	43.41	1,697,417.82
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	12.17	336,889.94
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	39.40	751,673.20
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.63	424,983.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	28.76	312,908.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	28.86	202,020.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	21.73	205,131.20
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	27.62	310,227.84
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	22.22	377,740.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	86.18	1,418,867.52
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	49.71	494,117.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	245.67	958,113.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	15.89	143,327.80
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	27.85	1,852,025.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	15.77	549,552.96
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.67	3,787,807.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.53	262,740.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	13.15	2,069,810.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.84	2,989,496.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	10.37	1,168,699.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.08	1,626,559.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	7.73	1,140,175.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	24.28	1,415,524.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.05	275,275.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.62	826,838.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.03	2,530,959.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	31.57	5,872,020.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.65	998,640.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.49	998,938.20
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.62	671,028.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.83	2,794,638.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	15.85	3,257,175.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	10.60	1,265,640.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.00	707,500.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	6.84	2,991,132.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.38	414,050.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.95	869,430.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.98	457,493.40
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.71	113,629.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.18	382,006.00

CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.88	397,800.80
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	21.56	3,041,684.80
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	24.25	584,425.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	14.97	1,757,882.19
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.15	58,140.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.82	350,364.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.48	877,488.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.57	1,127,931.03
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.45	2,127,195.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.46	1,045,458.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.73	1,023,296.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	147.35	795,690.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	15.80	497,700.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.38	729,042.60
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.46	343,272.96
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.34	899,248.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	8.21	2,525,396.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.17	475,380.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.84	430,008.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	7.01	2,206,748.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	29.38	2,943,876.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	46.05	4,826,040.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	9.16	246,404.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	31.23	128,043.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	327.62	1,580,111.26
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	10.63	365,650.74
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	35.17	1,134,795.22
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.51	362,607.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	30.51	505,306.62
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	53.80	581,040.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	10.09	334,988.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	86.54	259,620.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	43.65	416,028.15
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	69.96	384,780.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	16.03	211,115.10
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	20.09	761,411.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.82	437,772.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	22.40	450,240.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	31.67	886,760.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	11.32	393,936.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	64.29	585,039.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	16.53	745,503.00

GOERTEK INC -A	26,900	17.06	458,914.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.71	285,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	48.83	341,810.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	30.90	609,100.80
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	12.75	214,200.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	46,450	31.01	1,440,414.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	124.98	215,965.44
NINESTAR CORP-A	18,543	24.54	455,045.22
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.35	397,305.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	66.35	315,826.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	138.98	894,336.30
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	17.25	491,625.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.93	440,946.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.94	467,180.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	20.51	376,153.40
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	44.99	188,958.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.53	404,436.30
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	90.69	426,243.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	34.65	545,737.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	21.56	653,268.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	94.64	823,368.00
ZTE CORP-A	76,400	30.21	2,308,044.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.89	2,067,492.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.37	1,280,906.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.71	1,136,523.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.55	4,056,294.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	16.62	924,072.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.58	1,130,206.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.01	2,124,569.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	14.71	1,357,733.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	162.00	1,149,714.00
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	59.93	607,570.34
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	144.24	1,647,509.28
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	51.25	1,077,890.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	99.46	623,813.12
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	25.61	542,112.48
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	23.85	178,875.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	37.43	278,254.62
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	68.59	514,425.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	23.15	791,776.30
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	29.12	867,776.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	9.32	214,229.52

	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	25.46	2,554,656.40	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	50.40	1,061,172.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	243.13	753,703.00	
	SG MICRO CORP-A	4,095	81.05	331,899.75	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	69.54	549,366.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	168.65	472,220.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	20.25	746,718.75	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.02	295,405.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	19.98	448,870.68	
	TONGWEI CO LTD-A	31,600	29.86	943,576.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	28.93	735,342.74	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	73.59	504,753.81	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	100.50	732,645.00	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	37.18	527,956.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	43.98	748,627.56	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	11.67	638,349.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	11.46	615,402.00	
	GEMDALE CORP-A	45,500	5.38	244,790.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.59	1,876,852.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	11.63	951,334.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	11.55	147,840.00	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	3.71	294,203.00	
	オフショア人民元 小計	25,518,624		334,650,123.59 (6,840,281,991)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	10.16	456,580.24	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	33.50	13,945,179.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	37.50	441,562.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	11.92	380,581.76	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	133.00	4,975,929.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	32.85	1,551,866.85	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	39.35	8,296,711.40	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	130.20	1,217,239.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	79.10	11,385,179.40	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	23.68	2,020,448.64	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	11.78	1,218,417.18	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	39.10	1,997,188.90	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	154.60	650,402.20	
	JARIR MARKETING CO	125,000	14.86	1,857,500.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	138.40	890,050.40	
	ALMARAI CO	30,130	55.80	1,681,254.00	
	SAVOLA	36,289	36.60	1,328,177.40	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	142.00	970,286.00	

DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	230.00	2,694,910.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	100.00	1,592,400.00	
AL RAJHI BANK	307,532	65.40	20,112,592.80	
ALINMA BANK	161,322	32.40	5,226,832.80	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	23.06	1,983,874.86	
BANK AL-JAZIRA	97,894	15.80	1,546,725.20	
BANK ALBILAD	89,702	39.10	3,507,348.20	
BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	35.10	3,328,708.50	
RIYAD BANK	234,479	26.30	6,166,797.70	
SAUDI AWWAL BANK	147,895	32.00	4,732,640.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	14.52	1,025,692.80	
THE SAUDI NATIONAL BANK	437,009	31.70	13,853,185.30	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	176.80	1,937,197.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	220.20	3,131,904.60	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,260	123.60	773,736.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	308.40	1,362,202.80	
ELM CO	4,094	733.80	3,004,177.20	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	45.50	2,222,402.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.00	1,176,604.00	
SAUDI TELECOM CO	301,319	36.25	10,922,813.75	
ACWA POWER CO	16,922	230.00	3,892,060.00	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	53.50	860,333.50	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	17.18	2,785,032.62	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	14.40	1,454,270.40	
サウジアラビアリアル 小計	3,934,125		154,558,997.30 (6,188,542,251)	
合 計	1,307,841,407		150,173,490,718 (150,173,490,718)	

(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	12,637,328.00	
		メキシコペソ 小計	97,360	12,637,328.00 (103,461,804)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	5,860,778.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,230,579.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,687,488.00	
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,317,000.00	
	ブラジルリアル 小計	383,600	11,095,845.00 (328,384,861)		
投資信託受益証券合計		480,960	431,846,665 (431,846,665)		

投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	11,367,134.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	11,367,134.00 (93,062,726)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	4,629,348.11	
	南アフリカランド 小計		478,733	4,629,348.11 (36,479,263)	
投資証券合計			870,433	129,541,989 (129,541,989)	
合計				561,388,654 (561,388,654)	

(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 33銘柄	100.0%			2.8%
メキシコペソ	株式 21銘柄	94.5%			2.2%
	投資信託受益証券 1銘柄		2.9%		0.1%
	投資証券 1銘柄			2.6%	0.1%
ブラジルリアル	株式 45銘柄	95.9%			5.2%
	投資信託受益証券 4銘柄		4.1%		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%			0.4%
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 15銘柄	100.0%			0.9%
ロシアルーブル	株式 14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 189銘柄	100.0%			22.1%
マレーシアリンギット	株式 32銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 40銘柄	100.0%			1.9%
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%			1.9%
韓国ウォン	株式 103銘柄	100.0%			12.3%
新台湾ドル	株式 90銘柄	100.0%			15.3%

インドルピー	株式	122銘柄	100.0%			16.2%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	33銘柄	99.2%			3.0%
	投資証券	1銘柄			0.8%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	11銘柄	100.0%			1.3%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%			0.8%
オフショア人民元	株式	347銘柄	100.0%			4.5%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%			4.1%

(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。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	988,045,006
コール・ローン	862,958,719
国債証券	112,887,891,197
未収利息	1,756,726,629
前払費用	258,323,091
流動資産合計	116,753,944,642
資産合計	116,753,944,642
負債の部	
流動負債	
未払解約金	53,915,430
未払利息	382
その他未払費用	21
流動負債合計	53,915,833
負債合計	53,915,833
純資産の部	
元本等	
元本	56,033,592,704
剰余金	
剰余金又は欠損金()	60,666,436,105
元本等合計	116,700,028,809
純資産合計	116,700,028,809
負債純資産合計	116,753,944,642

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年10月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2023年10月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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。
4.収益及び費用の計上基準	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。
	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10月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,033,592,704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) 2,0827円 (20,827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10月20日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託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、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10月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	54,109,447,966円
期中追加設定元本額	5,146,816,295円
期中一部解約元本額	3,222,671,557円
期末元本額	56,033,592,704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	4,599,132,275円
世界経済インデックスファンド	19,264,564,320円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,781,809,455円
DC世界経済インデックスファンド	14,171,133,955円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	8,856,474円
分散投資コア戦略ファンドA	395,863,625円
分散投資コア戦略ファンドS	1,042,725,547円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	708,083,124円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,516,227,524円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	242,869,811円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,715,034円
SMT インデックスバランス・オープン	182,946,149円
SMT 世界経済インデックス・オープン	466,461,978円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	616,469,069円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	987,077,419円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,855,679円
グローバル経済コア	819,376,316円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	91,580,064円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	77,662,213円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,728,645円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	33,184,046円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	136,644,154円
10資産分散投資ファンド	42,756,995円
グローバル10資産バランスファンド	1,655,759円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	244,315,078円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	157,252,811円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	16,722,581円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	230,204,334円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	226,968,022円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	225,814,900円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	224,099,208円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	221,877,764円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	145,958,376円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,408,109,397
合計	1,408,109,397

(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	38,800,000.00	38,914,848.00	
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,004,080.80	
		MBONO 5.5% 03/04/27	109,000,000.00	94,070,270.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	157,148,449.30	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	53,224,300.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	77,000,000.00	65,265,970.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	126,980,670.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	154,462,593.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	68,488,095.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	23,951,035.00	
		MBONO 7% 09/03/26	33,000,000.00	30,030,990.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	105,600,000.00	98,736,000.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	86,996,483.00	
		MBONO 8% 07/31/53	72,500,000.00	59,397,800.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,800,230.24	
		MBONO 8% 11/07/47	96,000,000.00	79,251,840.00	
		メキシコペソ 小計			1,505,350,000.00
ブラジルレアル	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	60,679,492.47	
		BLTN 0% 07/01/24	37,250,000.00	34,559,164.66	
		BLTN 0% 07/01/25	45,300,000.00	37,926,418.43	
		BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00	58,455,064.20	
		BLTN 0% 07/01/27	10,500,000.00	7,031,144.29	
		BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000.00	54,595,743.99	
		BNTNF 10% 01/01/27	50,400,000.00	48,662,150.54	
		BNTNF 10% 01/01/29	49,700,000.00	46,603,503.12	
		BNTNF 10% 01/01/31	19,850,000.00	18,187,104.75	
		BNTNF 10% 01/01/33	23,900,000.00	21,471,791.77	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,376,368.00	
ブラジルレアル 小計			448,100,000.00	389,547,946.22 (11,528,788,332)	
チリペソ	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	514,470,462.50	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,803,493,600.46	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	1,960,000,000.00	1,860,057,451.84	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	2,090,000,000.00	1,867,917,458.99	
		BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	1,966,969,418.31	

	BTPCL 5% 10/01/28	820,000,000.00	763,330,259.20	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,800,000,000.00	1,718,286,165.00	
	BTPCL 6% 04/01/33	1,500,000,000.00	1,456,182,018.00	
	BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	512,016,963.71	
	チリペソ 小計	14,480,000,000.00	13,462,723,798.01	(2,146,496,682)
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	61,205,690,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	18,000,000,000.00	16,525,811,160.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	45,100,000,000.00	32,648,116,402.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	48,900,000,000.00	30,796,956,429.00	
	コロンビアペソ 小計	177,300,000,000.00	141,176,573,991.00	(4,989,462,477)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	3,810,997.27	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	7,250,000.00	6,017,608.60	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,681,069.20	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,800,000.00	8,444,073.70	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,531,600.02	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,650,000.00	6,561,600.28	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	10,168,641.71	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,250,000.00	10,913,487.97	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,400,000.00	9,146,668.68	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,550,000.00	2,664,362.70	
	ペルーソル 小計	73,900,000.00	68,940,110.13	(2,668,044,308)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	22,833,906.50	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,253,432.42	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	25,000,000.00	24,916,000.00	
	ウルグアイペソ 小計	67,000,000.00	64,003,338.92	(240,575,750)
ドミニカペ ソ	DOMREP 11.25% 09/15/35	32,000,000.00	32,208,000.00	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	37,786,064.32	
	ドミニカペソ 小計	64,000,000.00	69,994,064.32	(184,588,346)
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,853,852.40	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	60,188,499.20	
	CZGB 0.95% 05/15/30	98,900,000.00	78,288,251.00	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	22,650,257.76	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	76,814,360.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	55,504,800.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	21,726,884.50	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	40,733,770.50	
	CZGB 1.95% 07/30/37	20,500,000.00	14,698,069.50	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	62,711,200.00	

	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	72,470,486.60	
	CZGB 2.5% 08/25/28	98,700,000.00	89,867,337.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	72,918,268.50	
	CZGB 2% 10/13/33	74,500,000.00	58,306,680.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	19,524,670.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	32,478,127.50	
	CZGB 4.5% 11/11/32	25,000,000.00	24,537,500.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	47,894,250.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	72,144,606.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	36,700,000.00	36,820,486.10	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	81,337,440.00	
	CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	29,609,550.00	
	CZGB 6% 02/26/26	63,000,000.00	65,394,000.00	
	チェココルナ 小計	1,284,300,000.00	1,156,473,346.56 (7,444,218,931)	
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	523,442,700.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	430,680,600.00	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	725,573,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	472,020,400.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	221,000,000.00	140,003,500.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	578,000,000.00	544,839,099.60	
	HGB 2.75% 12/22/26	485,500,000.00	414,569,857.95	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	305,715,800.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	611,743,748.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	209,744,850.00	
	HGB 3% 06/26/24	292,500,000.00	281,341,125.00	
	HGB 3% 08/21/30	715,000,000.00	549,377,400.00	
	HGB 3% 10/27/27	822,000,000.00	691,745,715.60	
	HGB 3% 10/27/38	530,000,000.00	317,234,256.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	263,000,000.00	232,570,374.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	640,000,000.00	522,437,529.60	
	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	860,224,410.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	738,380,698.90	
HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	236,213,128.00		
	ハンガリーフォロント 小計	10,701,500,000.00	8,807,858,442.65 (3,653,182,599)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,955,177.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	13,382,998.20	
	POLGB 0% 10/25/25	11,500,000.00	10,422,100.51	
	POLGB 1.25% 10/25/30	19,800,000.00	14,907,479.40	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	16,624,662.80	
	POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,397,797.00	

	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	19,793,706.60	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	21,396,241.50	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,774,168.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	22,428,278.10	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,275,220.35	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	19,981,911.00	
	POLGB 6% 10/25/33	11,000,000.00	11,079,692.80	
	POLGB 7.5% 07/25/28	18,400,000.00	19,858,205.52	
	ポーランドズロチ 小計	271,400,000.00	245,277,638.78 (8,740,100,741)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,447,134.92	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	6,024,632.05	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,503,671.50	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	9,993,763.41	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,102,002.77	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,774,179.40	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,194,759.02	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,317,824.00	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,022,954.14	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,175,757.58	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,434,564.54	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	5,881,356.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,533,797.84	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,075,848.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	6,500,000.00	6,313,008.71	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,507,568.96	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,648,156.00	
	ROMGB 7.35% 04/28/31	4,800,000.00	4,885,728.00	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	5,400,000.00	5,678,586.00	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	5,500,000.00	5,895,192.05	
ROMGB 8.75% 10/30/28	4,500,000.00	4,853,162.25		
ROMGB 8% 04/29/30	3,500,000.00	3,689,175.00		
	ルーマニアレイ 小計	145,500,000.00	135,952,822.14 (4,335,494,712)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	16,200,000.00	14,678,393.45	
	MGS 3.478% 06/14/24	8,650,000.00	8,652,899.48	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,468,835.45	
	MGS 3.582% 07/15/32	13,500,000.00	12,985,941.06	
	MGS 3.733% 06/15/28	21,000,000.00	20,866,719.93	
	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	25,065,040.96	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	7,941,275.32	
	MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,288,503.52	
	MGS 3.885% 08/15/29	41,300,000.00	41,060,659.06	

	MGS 3.899% 11/16/27	15,500,000.00	15,562,781.20
	MGS 3.9% 11/30/26	10,450,000.00	10,509,408.25
	MGS 3.906% 07/15/26	17,600,000.00	17,701,874.08
	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	28,872,903.15
	MGS 4.059% 09/30/24	15,450,000.00	15,520,190.89
	MGS 4.065% 06/15/50	18,250,000.00	16,989,559.90
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,140,339.39
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,022,097.81
	MGS 4.457% 03/31/53	2,300,000.00	2,280,194.70
	MGS 4.504% 04/30/29	14,600,000.00	15,025,165.14
	MGS 4.696% 10/15/42	8,800,000.00	9,029,932.56
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,105,097.75
	MGS 4.893% 06/08/38	16,100,000.00	17,191,491.45
	MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,203,423.02
	マレーシアリングット 小計	370,050,000.00	367,162,727.52 (11,516,426,111)
タイパーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,393,253.17
	THAIGB 0.75% 09/17/24	84,000,000.00	82,742,774.52
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	138,508,557.67
	THAIGB 1.45% 12/17/24	164,000,000.00	162,182,273.20
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	49,288,870.28
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	53,613,802.87
	THAIGB 1.6% 12/17/29	104,100,000.00	95,750,569.97
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	152,892,006.51
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	199,541,505.21
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	140,806,231.56
	THAIGB 2.65% 06/17/28	135,000,000.00	133,646,928.75
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	87,007,176.74
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	100,786,791.02
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	60,904,914.04
	THAIGB 2% 12/17/31	113,000,000.00	102,897,990.97
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	142,849,233.44
	THAIGB 3.35% 06/17/33	110,000,000.00	110,219,109.00
	THAIGB 3.39% 06/17/37	76,000,000.00	74,268,546.72
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	155,155,684.74
	THAIGB 3.45% 06/17/43	69,000,000.00	67,486,771.35
	THAIGB 3.65% 06/20/31	116,500,000.00	120,229,957.20
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	185,700,852.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	108,130,924.54
	THAIGB 4.875% 06/22/29	169,500,000.00	186,388,030.80
	タイパーツ 小計	2,891,800,000.00	2,812,392,756.27 (11,587,058,155)
	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	28,428,616.20

フィリピン ペソ				
フィリピンペソ 小計		30,000,000.00	28,428,616.20 (74,971,946)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,718,682,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,102,625,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	60,139,800,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	59,000,000,000.00	57,619,990,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,645,440,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	16,745,195,140.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	59,865,340,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,393,418,978.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	43,500,000,000.00	42,832,275,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	73,394,305,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	53,063,070,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	15,000,000,000.00	14,596,508,700.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,646,600,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	16,000,000,000.00	15,950,400,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	43,800,000,000.00	43,750,944,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	18,500,000,000.00	18,408,795,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	41,000,000,000.00	42,440,740,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	20,435,795,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	68,700,000,000.00	71,109,996,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,083,560,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	83,000,000,000.00	83,480,985,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	38,972,490,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	55,000,000,000.00	55,295,900,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,326,968,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	57,824,896,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	36,987,435,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,515,952,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	48,444,880,000.00	
INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	26,983,726,000.00		
INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,824,300,000.00		
INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	26,222,628,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	12,952,615,020.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,567,417,000.00		
インドネシアルピア 小計		1,178,600,000,000.00	1,199,343,671,838.00 (11,393,764,882)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	212,400,000.00	218,251,620.00	
	SAGB 11.625% 03/31/53	16,500,000.00	14,758,354.05	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	44,081,710.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	92,100,000.00	51,916,770.00	

	SAGB 7% 02/28/31	102,700,000.00	80,429,505.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000.00	134,650,800.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	106,346,430.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	77,828,800.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	125,718,230.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	118,701,100.00	
	SAGB 8% 01/31/30	190,600,000.00	166,146,020.00	
	SAGB 9% 01/31/40	118,300,000.00	86,814,455.00	
	南アフリカランド 小計	1,560,700,000.00	1,225,643,794.05 (9,658,073,097)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,517,828.39	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,160,970.41	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	2,995,486.14	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	13,929,810.30	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	9,929,272.70	
	CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	20,929,718.04	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,008,531.20	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,390,966.93	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	5,993,393.52	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,697,491.69	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	17,847,842.84	
	CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,465,557.29	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	4,986,244.60	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,000,000.00	10,038,771.00	
	CGB 2.67% 05/25/33	8,000,000.00	7,953,229.20	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,254,596.27	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,067,746.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	9,952,894.90	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,717,176.39	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	10,958,465.42	
	CGB 2.76% 05/15/32	4,500,000.00	4,508,535.60	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,081,543.60	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,105,674.40	
	CGB 2.8% 03/25/30	9,000,000.00	9,059,260.50	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	9,948,197.16	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,632,270.56	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,431,957.48	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,099,536.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,154,485.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,172,575.90	
CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,017,169.96		
CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,695,664.05		
CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,401,448.83		

	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,823,280.75	
	CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	4,665,342.08	
	CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,330,396.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,549,603.41	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,006,211.76	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,561,862.40	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,673,465.64	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,959,637.80	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,038,403.90	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,768,587.88	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,200,005.60	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,560,106.16	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,523,364.30	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,689,447.70	
	オフショア人民元 小計	562,900,000.00	572,454,027.65 (11,701,017,570)	
	合計		112,887,891,197 (112,887,891,197)	

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 16銘柄	100.0%	9.8%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	1.9%
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%	2.4%
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 23銘柄	100.0%	6.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 19銘柄	100.0%	3.2%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.7%
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 23銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券 24銘柄	100.0%	10.3%
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%	10.1%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	8.6%
オフショア人民元	国債証券 47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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,370,521,989
投資証券	120,794,913,800
未収入金	1,505,544,603
未収配当金	1,327,571,852
前払金	103,174,070
差入委託証拠金	203,294,000
流動資産合計	129,305,020,314
資産合計	129,305,020,314
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	103,174,070
未払解約金	4,337,857,133
未払利息	2,379
その他未払費用	83
流動負債合計	4,441,033,665
負債合計	4,441,033,665
純資産の部	
元本等	
元本	59,721,905,089
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	65,142,081,560
元本等合計	124,863,986,649
純資産合計	124,863,986,649
負債純資産合計	129,305,020,314

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

	2023年10月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	59,721,905,089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 2.0908円 (1万口当たり純資産額) (20,908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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、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、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動	区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況		

区分	2023年10月20日現在
期首	2023年 4月21日
期首元本額	64,075,458,520円
期中追加設定元本額	5,419,590,048円
期中一部解約元本額	9,773,143,479円
期末元本額	59,721,905,089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）	1,926,306,251円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,960,692円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,720,884,560円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	31,341,526,838円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,011,513,433円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	1,830,619,539円
コア投資戦略ファンド（切替型）	774,110,147円
S M T インデックスバランス・オープン	23,926,149円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	256,354,957円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	11,265,406円
グローバル経済コア	279,722,753円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,206,419円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	526,962,705円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	129,646,228円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	485,714,145円
10資産分散投資ファンド	23,132,353円
グローバル10資産バランスファンド	1,630,792円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	350,484,009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）	9,025,604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）	481,841,385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）	70,960,147円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	508,907,669円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	280,535,887円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	7,004,250,963
合計	7,004,250,963

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2023年10月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	4,154,533,070	-	4,051,359,000
合計		4,154,533,070	-	4,051,359,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,369	276,462,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,734	343,901,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	5,815	703,615,000	
	東海道リート投資法人	1,734	218,484,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,025	2,459,275,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,706	1,917,469,400	
	産業ファンド投資法人	17,784	2,431,072,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,436	3,785,316,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,557	1,880,828,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,115	2,504,092,500	
	G L P 投資法人	39,372	5,197,104,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,731	1,753,686,000	
	日本プロロジスリート投資法人	20,305	5,531,082,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,150	1,307,200,000	
	O n e リート投資法人	2,033	515,568,800	
	イオンリート投資法人	14,298	2,077,499,400	
	ヒューリックリート投資法人	10,905	1,687,003,500	
	日本リート投資法人	3,786	1,323,207,000	
	積水ハウス・リート投資法人	35,024	2,836,944,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,454	346,259,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	5,067	1,425,853,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,874	403,509,600	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,176	358,570,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	37,692	6,328,486,800	
	いちごホテルリート投資法人	1,931	204,492,900	
	ラサールロジポート投資法人	14,899	2,203,562,100	
	スターアジア不動産投資法人	17,963	1,059,817,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,797	228,219,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,848	2,266,440,000	
	大江戸温泉リート投資法人	1,782	115,117,200	
投資法人みらい	14,906	705,053,800		
三菱地所物流リート投資法人	4,025	1,525,475,000		
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,018	806,392,600		
ザイマックス・リート投資法人	1,891	218,032,300		

タカラレーベン不動産投資法人	5,526	540,442,800	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,107	640,928,500	
日本ビルファンド投資法人	13,597	7,981,439,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,973	6,752,772,000	
日本都市ファンド投資法人	55,869	5,547,791,700	
オリックス不動産投資法人	23,224	4,145,484,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,971	2,825,719,500	
N T T 都市開発リート投資法人	11,204	1,508,058,400	
東急リアル・エステート投資法人	7,815	1,391,070,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,607	978,615,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,073	3,931,808,400	
森トラストリート投資法人	22,467	1,631,104,200	
インヴィンシブル投資法人	56,434	3,239,311,600	
フロンティア不動産投資法人	4,325	1,922,462,500	
平和不動産リート投資法人	8,708	1,244,373,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,466	2,133,782,800	
福岡リート投資法人	6,028	965,082,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	6,782	2,265,188,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,551	832,847,200	
大和証券オフィス投資法人	2,415	1,574,580,000	
阪急阪神リート投資法人	5,557	779,091,400	
スターツプロシード投資法人	2,020	427,432,000	
大和ハウスリート投資法人	17,569	4,666,326,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,018	2,703,947,400	
大和証券リビング投資法人	17,165	1,883,000,500	
ジャパンエクセレント投資法人	10,130	1,337,160,000	
合計	721,803	120,794,913,800	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	476,389,324
コール・ローン	17,852,619
投資証券	100,674,861,397
未収配当金	62,618,437
流動資産合計	101,231,721,777

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
資産合計	101,231,721,777
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,550
未払解約金	28,154,565
未払利息	7
その他未払費用	1
流動負債合計	28,168,123
負債合計	28,168,123
純資産の部	
元本等	
元本	41,957,336,605
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,246,217,049
元本等合計	101,203,553,654
純資産合計	101,203,553,654
負債純資産合計	101,231,721,777

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,957,336,605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 2.4121円 (1万口当たり純資産額) (24,121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10月20日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	36,512,386,081円
期中追加設定元本額	7,457,464,659円
期中一部解約元本額	2,012,514,135円
期末元本額	41,957,336,605円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	55,090,495円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,963,651円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,581,025,134円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,844,389円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,209,200,688円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,993,515,964円
コア投資戦略ファンド（安定型）	515,173,421円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,382,411,427円

区分	2023年10月20日現在
分散投資コア戦略ファンドA	1,038,546,021円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	589,093,366円
SMT インデックスバランス・オープン	111,131,449円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,792,523円
グローバル経済コア	236,938,729円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,313,636円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	444,030,757円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	109,346,956円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	160,374,329円
10資産分散投資ファンド	12,799,858円
グローバル10資産バランスファンド	1,393,067円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,602,855,414円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	238,890,182円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	80,788,109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）	63,295,249円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	49,790,330円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	95,120,470円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,682,971円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,211,639円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	92,598,015円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	91,680,030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）	79,493,312円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	59,598,092円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		7,616,875,116
合計		7,616,875,116

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

(2023年10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	18,722,500	-	18,736,050	13,550
	アメリカドル	18,722,500	-	18,736,050	13,550
合計		18,722,500	-	18,736,050	13,550

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	56,767	790,196.64	
		AGREE REALTY CORP	56,545	3,107,147.75	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,393	698,193.37	
		ALEXANDER'S INC	1,336	235,483.36	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	91,167	8,635,338.24	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	94,335.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,232	528,514.56	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	186,323	6,329,392.31	
		AMERICOLD REALTY TRUST	149,001	4,034,947.08	
		APARTMENT INCOME REIT CO	87,719	2,751,745.03	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	83,954	532,268.36	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	125,391	1,986,193.44	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	41,231	423,854.68	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	37,740.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	83,694	14,483,246.70	
		BOSTON PROPERTIES	84,625	4,616,293.75	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	79,499.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	104,507	412,802.65	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	176,456	3,578,527.68	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	110,537	1,565,203.92	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	86,000.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	62,567	5,883,800.68	
		CARETRUST REIT INC	58,902	1,259,913.78	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15,737	324,654.31	
		CENTERSPACE	8,999	486,125.98	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	245,139.58	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	59,050.28	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	36,719.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	423,185.00	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	66,436	1,570,547.04	
		COUSINS PROPERTIES INC	89,515	1,641,705.10	
		CTO REALTY GROWTH INC	12,400	198,896.00	
		CUBESMART	131,799	4,767,169.83	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	124,486	979,704.82			
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	368,800	193,620.00			
DIGITAL REALTY TRUST INC	178,300	20,618,612.00			

DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	218,416.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	98,752	1,133,672.96	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,181	612,408.51	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	26,624	4,232,151.04	
ELME COMMUNITIES	55,407	774,589.86	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	77,843	599,391.10	
EPR PROPERTIES	44,397	1,826,048.61	
EQUINIX INC	55,082	38,767,262.42	
EQUITY COMMONWEALTH	64,970	1,188,301.30	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	109,110	7,157,616.00	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	203,341	11,893,415.09	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	91,911	1,927,373.67	
ESSEX PROPERTY TRUST	37,583	8,054,036.90	
EXTRA SPACE STORAGE INC	124,512	14,007,600.00	
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	233,308.71	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,051	3,772,559.13	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	77,629	3,301,561.37	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	53,622	1,132,496.64	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	77,234.64	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	153,839	7,022,750.35	
GETTY REALTY CORP	27,420	726,355.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	244,218.00	
GLADSTONE LAND CORP	21,491	297,865.26	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	328,403.79	
GLOBAL NET LEASE INC	115,311	930,559.77	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	223,633	3,249,387.49	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	320,607	5,347,724.76	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	189,804.68	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	62,559	1,169,227.71	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	416,887	6,565,970.25	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	76,753	392,207.83	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	132,286	1,779,246.70	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	77,608.44	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	16,592	1,247,220.64	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	40,139	998,658.32	
INVITATION HOMES INC	339,192	10,704,899.52	
IRON MOUNTAIN INC	172,116	10,283,931.00	
JBG SMITH PROPERTIES	56,141	778,675.67	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	70,253.50	
KILROY REALTY CORPORATION	62,832	1,832,181.12	

KIMCO REALTY CORP	363,209	6,130,967.92
KITE REALTY GROUP TRUST	128,963	2,651,479.28
LTC PROPERTIES INC	25,125	798,975.00
LXP INDUSTRIAL TRUST	172,796	1,413,471.28
MACERICH CO/THE	127,260	1,356,591.60
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	40,923.03
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	352,832	1,637,140.48
MID-AMERICA APARTMENT COMM	68,309	8,941,648.10
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	48,998	1,500,318.76
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,669	1,260,604.59
NETSTREIT CORP	41,060	567,038.60
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,669	125,665.38
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	419,282.56
NNN REIT INC	107,048	3,786,287.76
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	105,170.73
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	143,593	4,800,313.99
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	158,909.52
ORION OFFICE REIT INC	34,844	169,341.84
PARAMOUNT GROUP INC	100,128	445,569.60
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	127,396	1,500,724.88
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	262,770.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,638	944,188.84
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	69,083	2,359,184.45
PHYSICIANS REALTY TRUST	140,705	1,587,152.40
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	75,292	390,012.56
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	436,628.32
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	178,084.80
PRIME US REIT	295,000	32,450.00
PROLOGIS INC	543,787	55,781,670.46
PUBLIC STORAGE	93,195	24,090,907.50
REALTY INCOME CORP	417,503	20,632,998.26
REGENCY CENTERS CORP	96,302	5,700,115.38
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,955	890,465.40
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	120,976	5,391,900.32
RLJ LODGING TRUST	93,642	900,836.04
RPT REALTY	48,173	491,364.60
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,079	2,988,730.80
SABRA HEALTH CARE REIT INC	136,268	1,909,114.68
SAFEHOLD INC	27,084	422,510.40
SAUL CENTERS INC	6,846	236,187.00
SERVICE PROPERTIES TRUST	100,683	739,013.22

SIMON PROPERTY GROUP	192,733	20,526,064.50	
SITE CENTERS CORP	106,484	1,243,733.12	
SL GREEN REALTY CORP	38,074	1,209,230.24	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	83,067	2,771,945.79	
STAG INDUSTRIAL INC	105,457	3,471,644.44	
STAR HOLDINGS	6,183	70,919.01	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,550	387,737.00	
SUN COMMUNITIES INC	72,848	7,696,391.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,355	1,165,206.35	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	62,168	1,463,434.72	
TERRENO REALTY CORP	49,321	2,577,022.25	
UDR INC	177,591	6,249,427.29	
UMH PROPERTIES INC	33,009	463,776.45	
UNITI GROUP INC	142,940	603,206.80	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	296,036.90	
URBAN EDGE PROPERTIES	69,794	1,047,607.94	
VENTAS INC	237,301	9,926,300.83	
VERIS RESIDENTIAL INC	48,670	776,773.20	
VICI PROPERTIES INC	597,099	16,766,539.92	
VORNADO REALTY TRUST	94,277	1,896,853.24	
WELLTOWER INC	305,485	25,636,301.20	
WHITESTONE REIT	23,074	222,664.10	
WP CAREY INC	125,317	6,706,965.84	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	64,012	750,860.76	
アメリカドル 小計	15,240,093	526,945,714.91 (79,020,779,407)	
カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	625,848.19	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	182,586.60	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,593	920,925.75	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	145,825.00	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	58,600.00	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	49,930	2,172,454.30	
CHOICE PROPERTIES REIT	100,975	1,264,207.00	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	329,554.80	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	374,077.70	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	73,332	888,050.52	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,339	44,794.21	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	66,348	865,177.92	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,135	1,286,254.70	
	76,841	698,484.69	

	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT		
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	534,239.74
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,647	590,314.32
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	147,852.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	103,018.36
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	106,019.30
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	254,327.04
	PRIMARIS REIT	30,375	400,950.00
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	70,240.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	90,439	1,563,690.31
	SLATE GROCERY REIT	16,578	176,224.14
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	43,154	973,554.24
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	52,890.00
	カナダドル 小計	951,087	14,830,160.83 (1,620,195,070)
ユーロ	AEDIFICA	28,047	1,354,109.16
	ALTAREA	1,959	142,419.30
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	252,214.74
	CARMILA	32,392	432,109.28
	COFINIMMO	20,088	1,087,765.20
	COVIVIO(FP)	29,683	1,126,766.68
	CROMWELL REIT EUR	170,400	214,704.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	502,662.80
	GECINA SA	30,327	2,779,469.55
	HAMBORNER REIT AG	37,000	229,770.00
	ICADE	17,300	492,358.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	67,512.42
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	167,444	869,871.58
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	17,797	359,499.40
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	194,250.00
	KLEPIERRE	114,775	2,497,504.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	194,140.00
	MERCIALYS	57,605	460,551.97
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	189,710	1,463,612.65
	MONTEA NV	9,200	595,240.00
	NSI NV	7,359	125,250.18
	RETAIL ESTATES	7,545	411,957.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	59,750	2,618,842.50
	VASTNED RETAIL	10,650	195,321.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	94,769	2,141,779.40

	WERELDHAVE NV	26,376	369,000.24
	XIOR STUDENT HOUSING NV	14,491	375,316.90
	ユーロ 小計	1,470,834	21,553,997.95 (3,417,386,374)
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	58,951.64
	AEW UK REIT PLC	68,000	67,252.00
	ASSURA PLC	1,786,232	716,636.27
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	235,743.20
	BIG YELLOW GROUP PLC	104,673	965,085.06
	BRITISH LAND CO PLC	555,554	1,643,328.73
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	72,534.92
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	202,180.18
	DERWENT LONDON PLC	66,805	1,212,510.75
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	378,010	325,466.61
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	143,805	546,459.00
	HAMMERSON PLC	2,341,785	543,294.12
	HELICAL PLC	45,400	89,801.20
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	193,107.52
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	442,805	2,527,530.94
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	115,009.70
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	587,656	959,054.59
	LXI REIT PLC	1,027,299	870,122.25
	NEWRIVER REIT PL	126,000	98,910.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	173,664.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	805,185	700,913.54
	PRS REIT PLC/THE	260,002	192,661.48
	REGIONAL REIT LTD	222,000	58,497.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	130,446	892,902.87
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	86,752.50
	SEGRO PLC	718,700	5,088,396.00
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,161,077	1,276,023.62
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	758,029	541,990.73
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	391,491	295,967.19
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	103,066.00	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,128,484	1,511,040.07	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	534,722	285,006.82	
UNITE GROUP PLC	234,188	2,010,503.98	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	296,651	299,024.20	
WAREHOUSE REIT PLC	237,876	176,266.11	

	WORKSPACE GROUP PLC	84,396	386,533.68
	イギリスポンド 小計	17,451,144	25,673,855.26 (4,668,533,840)
オーストラ リアドル	ABACUS GROUP	194,329	206,960.38
	ABACUS STORAGE KING	347,779	366,906.84
	ARENA REIT	192,648	655,003.20
	BWP TRUST	291,007	1,009,794.29
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	664,139.25
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	322,336	957,337.92
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	232,479.06
	CHARTER HALL GROUP	278,742	2,530,977.36
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,694	1,209,187.74
	CHARTER HALL RETAIL REIT	312,344	996,377.36
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	552,652.42
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	251,040.00
	DEXUS	630,095	4,391,762.15
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	296,060.00
	GDI PROPERTY GROUP	185,597	98,366.41
	GOODMAN GROUP	1,009,869	21,661,690.05
	GPT GROUP	1,122,648	4,243,609.44
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	295,665.30
	HEALTHCO REIT	300,321	453,484.71
	HMC CAPITAL LTD	149,361	703,490.31
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	1,068,653	1,196,891.36
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	280,387.38
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	226,796	879,968.48
	MIRVAC GROUP	2,310,356	4,736,229.80
	NATIONAL STORAGE REIT	745,720	1,640,584.00
	REGION RE GROUP	685,991	1,440,581.10
RURAL FUNDS GROUP	272,079	510,148.12	
SCENTRE GROUP	3,086,143	7,777,080.36	
STOCKLAND	1,396,697	5,195,712.84	
VICINITY CENTERS	2,270,223	3,984,241.36	
WAYPOINT REIT LTD	406,596	931,104.84	
	オーストラリアドル 小計	20,112,998	70,349,913.83 (6,664,247,337)
ニュージ ーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	507,278	583,369.70
	GOODMAN PROPERTY TRUST	583,375	1,230,921.25
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	923,753	775,952.52
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	796,295	927,683.67
	ニュージ ーランド ドル 小計	2,810,701	3,517,927.14 (307,677,907)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	3,034,200.00

	FORTUNE REIT	875,000	4,051,250.00	
	LINK REIT	1,511,000	54,320,450.00	
	PROSPERITY REIT	492,000	698,640.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,301,520.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,489,592.40	
	香港ドル 小計	5,912,660	64,895,652.40 (1,244,049,656)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	365,000	470,850.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,089,518	5,328,270.90	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,358,877	1,202,606.14	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	540,305.64	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,972,144	5,230,973.44	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	383,973.50	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-LOGOS REIT	3,606,764	973,826.28	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	313,200.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	642,062	1,354,750.82	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,726,296	1,795,347.84	
	KEPPEL DC REIT	798,203	1,420,801.34	
	KEPPEL REIT	1,178,300	977,989.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	1,058,150	534,365.75	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,221,663	2,651,008.71	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,958,485	2,976,897.20	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,369,273	1,821,133.09	
	PARAGON REIT	761,500	624,430.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	233,900	828,006.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	189,312.00	
STARHILL GLOBAL REIT	663,000	321,555.00		
SUNTEC REIT	1,326,500	1,512,210.00		
	シンガポールドル 小計	25,386,556	31,498,517.25 (3,438,693,128)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	85,990,800.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	102,340	349,491,100.00	
	JR REIT XXVII	95,683	382,253,585.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	135,049,230.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	214,178,400.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	49,854,915.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	222,281,800.00	
	SK REITS CO LTD	75,914	302,137,720.00	
	韓国ウォン 小計	451,419	1,741,237,550.00 (192,406,749)	

イスラエル シェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	506,520.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,438,650.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	776,365.00	
イスラエルシェケル 小計		578,500	2,721,535.00	(100,891,929)
合計		90,365,992	100,674,861,397	(100,674,861,397)

(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	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 142銘柄	100.0%	78.5%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.6%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	3.4%
イギリスポンド	投資証券 38銘柄	100.0%	4.6%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.2%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年10月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,857,590
コール・ローン	3,261,238
投資証券	489,841,775
未収配当金	2,088,962
流動資産合計	502,049,565
資産合計	502,049,565
負債の部	
流動負債	

	2023年10月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	1,536
未払解約金	90,000
未払利息	1
流動負債合計	91,537
負債合計	91,537
純資産の部	
元本等	
元本	644,804,803
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	142,846,775
元本等合計	501,958,028
純資産合計	501,958,028
負債純資産合計	502,049,565

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年10月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	644,804,803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 142,846,775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 0.7785円 (1万口当たり純資産額) (7,785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10月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2023年10月20日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、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、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10月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年10月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 4月21日
期首元本額	676,753,226円
期中追加設定元本額	20,436,677円
期中一部解約元本額	52,385,100円
期末元本額	644,804,803円
期末元本額の内訳	
SMT インデックスバランス・オープン	228,155,380円
SMT 新興国REITインデックス・オープン	416,649,423円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年10月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	10,103,602	

合計	10,103,602
----	------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2023年10月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,521,600	-	2,520,064	1,536
	南アフリカランド	2,521,600	-	2,520,064	1,536
	合計	2,521,600	-	2,520,064	1,536

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	309,200	8,972,984.00		
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	80,200	2,287,304.00		
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,700	2,578,713.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	64,800	4,215,888.00		
	メキシコペソ 小計			539,900	18,054,889.00 (147,815,376)	
	トルコリラ	AKFEN GAYRIMENKUL YATIRIM OR	65,000	307,450.00		
		AKIS GAYRIMENKUL YATIRIMI AS	42,000	470,820.00		
		EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	191,362	1,375,892.78		
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	51,071	1,134,797.62		
		KIZILBUK GAYRIMENKUL YATIRIM	12,000	216,960.00		
		OZAK GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	43,000	406,350.00		
		PASIFIK GAYRIMENKUL YATIRIM	60,000	334,800.00		
		PEKER GAYRIMENKUL YATIRIM OR	39,500	1,125,750.00		
		REYSAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	16,000	423,680.00		
SERVET GAYRIMENKUL YATIRIM O		1,140	373,464.00			
SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	76,700	236,236.00				
TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	16,000	536,000.00				

	YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	22,138	867,809.60	
	ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	104,000	553,280.00	
	トルコリラ 小計	739,911	8,363,290.00 (44,830,579)	
香港ドル	CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	72,000	93,600.00	
	SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	58,000	150,800.00	
	香港ドル 小計	130,000	244,400.00 (4,685,148)	
マレーシア リンギット	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	176,500	319,465.00	
	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	183,000	314,760.00	
	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	122,700	147,240.00	
	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	223,000	330,040.00	
	マレーシアリンギット 小計	705,200	1,111,505.00 (34,863,465)	
タイバーツ	BA AIRPORT LEASEHOLD REIT	78,300	677,295.00	
	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	185,500	1,827,175.00	
	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600	1,596,620.00	
	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	71,500	915,200.00	
	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	174,000	2,035,800.00	
	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	181,300	1,722,350.00	
	タイバーツ 小計	855,200	8,774,440.00 (36,150,692)	
フィリピン ペソ	AREIT INC	72,520	2,451,176.00	
	CITICORE ENERGY REIT CORP	303,000	769,620.00	
	MREIT INC	106,000	1,293,200.00	
	RL COMMERCIAL REIT INC	431,700	2,072,160.00	
	フィリピンペソ 小計	913,220	6,586,156.00 (17,369,010)	
インドル ピー	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	26,651	6,390,909.80	
	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	71,839	22,114,199.37	
	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,792	7,923,523.20	
	インドルピー 小計	123,282	36,428,632.37 (66,300,110)	
南アフリカ ランド	ATTACQ LTD	81,466	692,461.00	
	BURSTONE GROUP LIMITED	70,263	526,269.87	
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	23,614	191,037.26	
	EQUITES PROPERTY FUND LTD	85,527	1,062,245.34	
	FAIRVEST LTD-B	150,040	484,629.20	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	375,593	3,631,984.31	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	39,395	1,133,394.15	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	784,627	2,722,655.69	

	RESILIENT REIT LTD	32,432	1,235,010.56	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	275,044	530,834.92	
	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	48,877	590,434.16	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	96,165	1,227,065.40	
	南アフリカランド 小計	2,063,043	14,028,021.86	(110,540,812)
サウジアラビアリアル	AL MAATHER REIT FUND	3,945	35,938.95	
	AL RAJHI REIT	13,464	112,155.12	
	ALAHLI REIT FUND 1	4,800	38,352.00	
	ALINMA RETAIL REIT FUND	10,174	46,698.66	
	ALKHABEER REIT	8,225	52,557.75	
	BONYAN REIT	7,800	71,526.00	
	DERAYAH REIT	11,621	91,573.48	
	MUSHARAKA REIT FUND	8,654	48,462.40	
	RIYAD REIT FUND	13,266	108,781.20	
	SEDCO CAPITAL REIT FUND	9,489	75,437.55	
	サウジアラビアリアル 小計	91,438	681,483.11	(27,286,583)
	合計	6,161,194	489,841,775	(489,841,775)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	投資証券 4銘柄	100.0%	30.2%
トルコリラ	投資証券 14銘柄	100.0%	9.2%
香港ドル	投資証券 2銘柄	100.0%	1.0%
マレーシアリングット	投資証券 4銘柄	100.0%	7.1%
タイバーツ	投資証券 6銘柄	100.0%	7.4%
フィリピンペソ	投資証券 4銘柄	100.0%	3.5%
インドルピー	投資証券 3銘柄	100.0%	13.5%
南アフリカランド	投資証券 12銘柄	100.0%	22.6%
サウジアラビアリアル	投資証券 10銘柄	100.0%	5.6%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【SMT インデックスバランス・オープン】

【純資産額計算書】

(2023年11月30日現在)

資産総額	2,779,083,738円
負債総額	10,797,820円
純資産総額(-)	2,768,285,918円
発行済口数	1,840,532,612口
1口当たり純資産額(/)	1.5041円
(1万口当たり純資産額)	(15,041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11月30日現在)

資産総額	593,783,273,527円
負債総額	695,177,511円
純資産総額(-)	593,088,096,016円
発行済口数	243,435,511,696口
1口当たり純資産額(/)	2.4363円
(1万口当たり純資産額)	(24,363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11月30日現在)

資産総額	663,351,789,264円
負債総額	15,948,395,847円
純資産総額(-)	647,403,393,417円
発行済口数	484,362,830,241口
1口当たり純資産額(/)	1.3366円
(1万口当たり純資産額)	(13,366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11月30日現在)

資産総額	626,059,512,240円
負債総額	848,173,674円
純資産総額(-)	625,211,338,566円
発行済口数	116,465,150,732口

1口当たり純資産額（ / ）	5.3682円
（1万口当たり純資産額）	（53,682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11月30日現在）

資産総額	301,816,047,366円
負債総額	153,121,341円
純資産総額（ - ）	301,662,926,025円
発行済口数	89,075,643,958口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3866円
（1万口当たり純資産額）	（33,866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11月30日現在）

資産総額	166,080,607,001円
負債総額	193,727,122円
純資産総額（ - ）	165,886,879,879円
発行済口数	42,206,543,981口
1口当たり純資産額（ / ）	3.9304円
（1万口当たり純資産額）	（39,304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11月30日現在）

資産総額	125,309,245,477円
負債総額	68,201,746円
純資産総額（ - ）	125,241,043,731円
発行済口数	57,308,361,929口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1854円
（1万口当たり純資産額）	（21,854円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2023年11月30日現在）

資産総額	119,427,624,988円
負債総額	427,420,560円
純資産総額（ - ）	119,000,204,428円
発行済口数	55,883,006,367口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1295円

（1万口当たり純資産額）	（21,295円）
--------------	-----------

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2023年11月30日現在）

資産総額	109,484,990,990円
負債総額	105,323,081円
純資産総額（ - ）	109,379,667,909円
発行済口数	42,345,696,733口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5830円
（1万口当たり純資産額）	（25,830円）

新興国REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2023年11月30日現在）

資産総額	514,992,296円
負債総額	1,530,806円
純資産総額（ - ）	513,461,490円
発行済口数	641,258,985口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8007円
（1万口当たり純資産額）	（8,007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。

八．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します。）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11月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

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2024年 1月19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11月30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	528	14,380,411
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	64	217,711
単体型公社債投資信託	51	174,255
合計	643	14,772,377

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（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。
また、第38期事業年度の間接会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の間接財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (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
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の

内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

- (1) 投資信託委託業務
当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (2) 投資一任業務
当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (3) 投資助言業務
当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (4) 成功報酬
当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

- (1) ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
- (2) ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
- (3) ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
- (4) ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21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、金額の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、それら的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)				
其他有価証券	-	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）
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	0
合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

種類	契約額等 （百万円）	契約額等の うち1年超 （百万円）	時価 （百万円）	評価損益 （百万円）
----	---------------	-------------------------	-------------	---------------

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
合計	7,458	-	48	48	

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	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	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)
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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(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あります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

- (ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(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いません。

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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

負債の部

流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

純資産の部

株主資本

資本金		2,000
-----	--	-------

資本剰余金

その他資本剰余金		17,239
----------	--	--------

資本剰余金合計		17,239
---------	--	--------

利益剰余金

利益準備金		500
-------	--	-----

その他利益剰余金

別途積立金		2,100
-------	--	-------

繰越利益剰余金		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間
（自 2023年4月1日
至 2023年9月30日）

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 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。

3. 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中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間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。

4. 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。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(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。

7. 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。

（表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30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	当中間会計期間末
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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「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) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(*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（中間貸借対照表計上額1,041百万円）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中間貸借対照表計上額は16,243百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）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) 時価をもって中間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、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額	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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(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)
第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

〔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〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
普通株式の期中平均株式数	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

2024年 1月19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。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	11,757	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

ソニー銀行株式会社	38,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
G M O クリック証券株式会社	4,346	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（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12月26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 山田信之

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SMT インデックスバランス・オープンの2023年4月21日から2023年10月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの2023年10月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

田中洋一

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。