

【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2月22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】	10資産分散投資ファンド
【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】

10資産分散投資ファンド

（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め
られます（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」とい
います。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受
益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2024年 2月23日から2024年 8月23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

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。

（ 1 0 ）【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。

（ 1 1 ）【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

（ 1 2 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号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。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

収益分配金を再投資する場合を除き、申込日当日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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

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

(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

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。

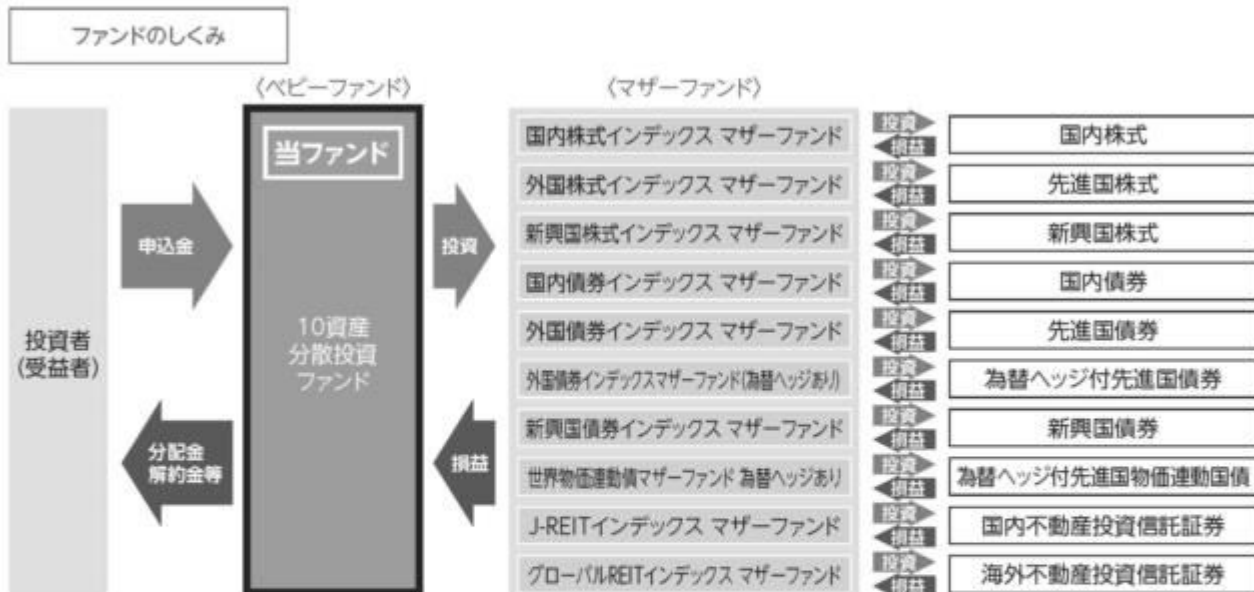
ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

1.

国内、先進国、新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券*並びに国内及び海外の不動産投資信託証券(REIT)に投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

*先進国債券には、為替ヘッジ付債券及び為替ヘッジ付物価連動国債を含みます。



? DR(預託証券)とは

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

? 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。

? 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。

●各資産毎に、以下のマザーファンドを投資対象ファンドとします。

資産	マザーファンド	インデックス
国内株式	国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX(東証株価指数)(配当 込み) ¹
先進国株式	外国株式インデックス マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース) ²
新興国株式	新興国株式インデックス マザーファンド	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
国内債券	国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合 ⁴
先進国債券	外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ⁵
為替ヘッジ付先進国債券	外国債券インデックス マザーファンド(為替ヘッジあ り)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベ ース) ⁶
新興国債券	新興国債券インデックス マザーファンド	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) ⁷

為替ヘッジ付 先進国物価連動国債	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	ブルームバーグ世界インフレ連動 国債インデックス（除く日本、円 ヘッジベース） ⁸
国内不動産投資信託証券	J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み） ⁹
海外不動産投資信託証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数 （除く日本、配当込み、円ベ ース） ¹⁰

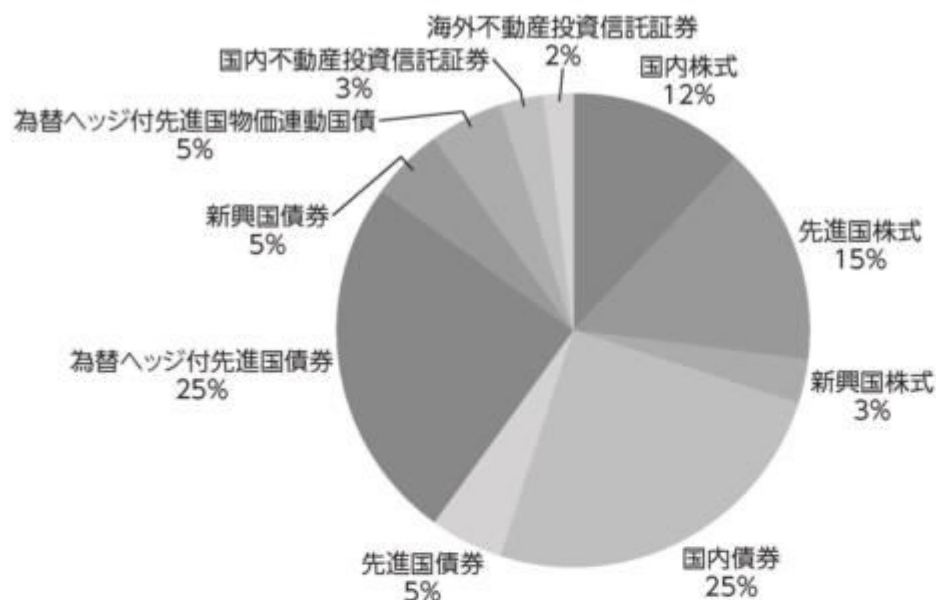
* 1:各マザーファンドは、上記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

* 2: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に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標準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 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※7 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディパーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※8 「ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行うインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスを表します。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。Bloomberg®及びブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
- ※9 「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標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準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。
- ※10 「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®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SPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、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を負いません。

- 投資対象ファンドにおいて組入れ継続困難な事象等が発生した場合には、委託会社の判断により投資対象ファンドの見直しを行う場合があります。この際、投資対象ファンドとして定められていたマザーファンドが投資対象ファンドから除外されることや、新たなマザーファンドが投資対象ファンドとして定められることがあります。また、この際に先進国資産を投資対象とするマザーファンドには国内資産が含まれる場合があります。
- 為替ヘッジ付先進国債券部分及び為替ヘッジ付先進国物価連動国債部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

2. 基本配分比率は以下の通りです。



- 基本配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

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。

分配方針

- 原則として毎年5月24日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 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。

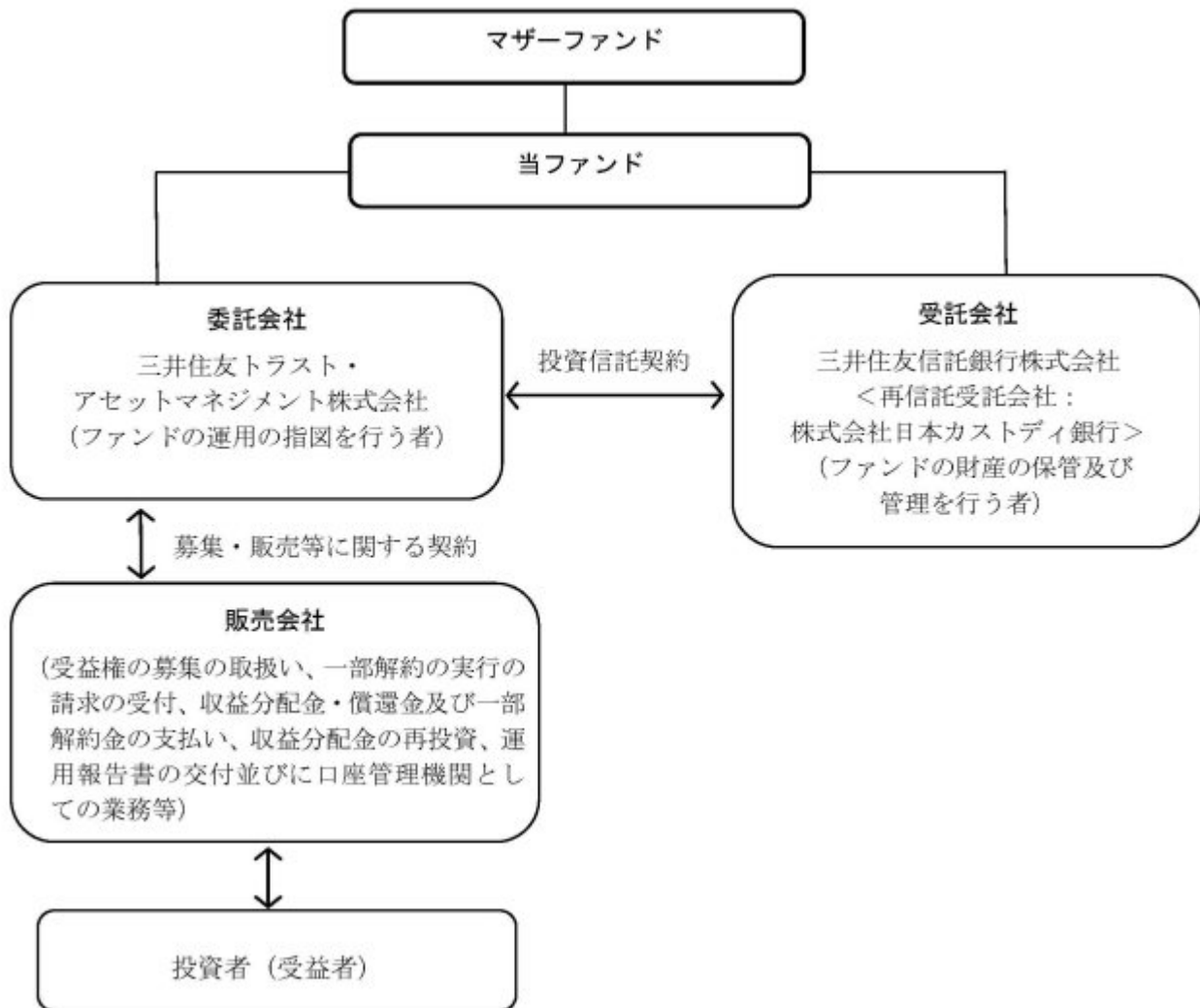
(2) 【ファンドの沿革】

2022年 6月30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12月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1) 【投資方針】

基本方針

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

投資対象

別に定めるマザーファンド（ ）（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．投資対象ファンドへの投資を通じて、主として国内株式、先進国株式、新興国株式（DR（預託証券）を含みます。）、国内債券、先進国債券、為替ヘッジ付先進国債券、新興国債券、為替ヘッジ付先進国物価連動国債、国内不動産投資信託証券、海外不動産投資信託証券に投資します。

ロ．各資産の基本配分比率は以下の通りとします。また、基本配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

資産	基本配分比率
国内株式	12%
先進国株式	15%
新興国株式	3%
国内債券	25%
先進国債券	5%
為替ヘッジ付先進国債券	25%
新興国債券	5%
為替ヘッジ付先進国物価連動国債	5%
国内不動産投資信託証券	3%
海外不動産投資信託証券	2%

ハ．投資対象ファンドにおいて組入れ継続困難な事象等が発生した場合には、委託会社の判断により投資対象ファンドの見直しを行う場合があります。この際、投資対象ファンドとして定められていたマザーファンドが投資対象ファンドから除外されることや、新たなマザーファンドが投資対象ファンドとして定められることがあります。また、この際に先進国資産を投資対象とするマザーファンドには国内資産が含まれる場合があります。

ニ．為替ヘッジ付先進国債券部分及び為替ヘッジ付先進国物価連動国債部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

上記の別に定めるマザーファンドは以下の通りです。

後記（2）の別に定める親投資信託も同様です。

資産	マザーファンド
国内株式	国内株式インデックス マザーファンド
先進国株式	外国株式インデックス マザーファンド
新興国株式	新興国株式インデックス マザーファンド
国内債券	国内債券インデックス マザーファンド

先進国債券	外国債券インデックス マザーファンド
為替ヘッジ付 先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）
新興国債券	新興国債券インデックス マザーファンド
為替ヘッジ付 先進国物価連動国債	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり
国内不動産投資信託証券	J-REITインデックス マザーファンド
海外不動産投資信託証券	グローバルREITインデックス マザーファンド

（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別に定める親投資信託（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 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、新投資口予約権証券、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す。）
 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す。）
 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号の証券及び第14号の証券（「新投資口予約権証券」、「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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2

条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

3. 運用制限

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

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

有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

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

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

3. 運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

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。

「外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

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、円ヘッジ・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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、）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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、）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

株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

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。

「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）に連動する投資成果を目指します。

インフレ連動国債（物価連動国債）への投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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、）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、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投資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「不動産投資指数先物取引」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資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。

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券、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に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券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。

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。

(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】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

（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ます。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

（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新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みません。）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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）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。

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効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図に当たっては、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当たり、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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、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当たっては、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が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当たり、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、有価証券の貸付に当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当たり、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、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに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)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に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にする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の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て（一部解約に伴う支払資金の手当て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てを目的として、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てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

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。

なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

物価変動リスク

物価の下落はインフレ連動国債（物価連動国債）の元本や利金を減少させるため、インフレ連動国債（物価連動国債）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。

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ある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

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

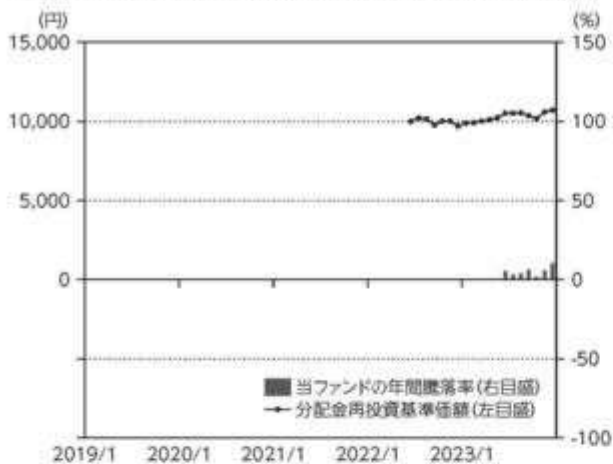
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

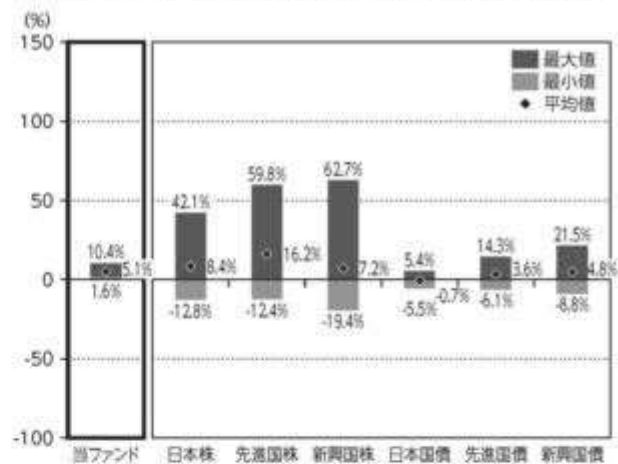
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドについては2023年6月～2023年12月の7ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を指すマーケットバシチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社（以下「JPX」といふ。）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、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI 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、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公債固定利付国債の市場全体の動き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計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、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 Global Emerging Markets Bond Index (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する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0.176%（税抜 0.16%）（ ）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 0.088% （税抜 0.08%）	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 0.055% （税抜 0.05%）	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 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

（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間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2023年12月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率（①+②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.22%	0.18%	0.04%

※対象期間は2022年6月30日～2023年5月24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12月29日現在の状況について記載してあります。

【10 資産分散投資ファンド】

（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	1,778,051,935	98.91
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		19,521,900	1.09
合計（純資産総額）		1,797,573,835	100.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載してあります。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
------	----	-----	----	-----------	-----------	----------	----------	---------

日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	518,924,085	0.8430	437,489,846	0.8497	440,929,795	24.53
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	324,764,954	1.3650	443,318,605	1.3421	435,867,044	24.25
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	51,603,798	4.6853	241,783,793	5.4634	281,932,189	15.68
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	93,144,762	2.1863	203,642,844	2.4310	226,434,916	12.60
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	42,915,984	1.9660	84,374,694	2.1639	92,865,897	5.17
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	26,209,330	3.1542	82,671,624	3.3905	88,862,733	4.94
日本	親投資信託受益証券	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	80,843,039	0.9204	74,412,540	0.9220	74,537,281	4.15
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	13,193,884	3.6281	47,869,462	3.9494	52,107,925	2.90
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	23,230,078	2.0856	48,450,264	2.0947	48,660,044	2.71
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	12,848,173	2.4059	30,911,878	2.7906	35,854,111	1.99

(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	98.91
合計	98.91

(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)
第1期計算期間末 (2023年 5月24日)	1,640,336,672	1,640,336,672	10,203
2022年12月末日	485,085		9,702
2023年 1月末日	681,370,276		9,891
2月末日	1,563,297,959		9,918
3月末日	1,599,534,482		10,012
4月末日	1,625,661,662		10,100
5月末日	1,654,914,164		10,228
6月末日	1,712,919,483		10,522
7月末日	1,722,344,673		10,518
8月末日	1,743,070,091		10,531
9月末日	1,727,579,970		10,353
10月末日	1,699,490,946		10,174

11月末日	1,766,715,535		10,583
12月末日	1,797,573,835		10,710

【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	2022年 6月30日～2023年 5月24日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	2.0
第2期中間計算期間	2023年 5月25日～2023年11月24日	3.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	1,628,450,903	20,709,270	1,607,741,633
第2期中間計算期間	2023年 5月25日～2023年11月24日	98,251,916	44,186,117	1,661,807,432

(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	586,637,466,610	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,241,509,381	1.22
合計(純資産総額)		593,878,975,991	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	7,168,980,000	1.21

(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。

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	9,585,900	1,944.31	18,637,971,918	2,590.50	24,832,273,950	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,234,900	13,262.64	16,378,034,785	13,410.00	16,560,009,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,476,900	935.07	9,796,634,883	1,211.50	12,692,764,350	2.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,700	68,435.49	11,955,681,814	62,120.00	10,852,364,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1,585,700	4,415.41	7,001,522,280	5,917.00	9,382,586,900	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,500	19,749.13	7,297,307,208	25,255.00	9,331,722,500	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,081,600	162.92	8,485,138,853	172.30	8,973,659,680	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,400	8,161.66	6,916,194,878	10,170.00	8,618,058,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,222,500	5,682.91	6,947,368,917	6,880.00	8,410,800,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,660,000	2,002.89	7,330,597,902	2,253.50	8,247,810,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,200	5,922.79	6,528,102,549	7,359.00	8,111,089,800	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,328,700	4,450.16	5,912,928,191	5,963.00	7,923,038,100	1.33
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,700	4,702.71	6,544,769,731	5,298.00	7,373,226,600	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,241,600	4,993.91	6,200,440,714	5,767.00	7,160,307,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,549,600	4,531.81	7,022,503,107	4,054.00	6,282,078,400	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,257,300	1,346.23	5,731,320,672	1,466.00	6,241,201,800	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,000	4,358.82	5,897,485,430	4,486.00	6,069,558,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,130.60	5,891,213,340	17,625.00	6,061,237,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,699,500	3,118.90	5,300,580,579	3,529.00	5,997,535,500	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,525,300	4,533.12	6,914,370,121	3,872.00	5,905,961,600	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,320,800	2,084.61	4,837,983,290	2,412.50	5,598,930,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	863,700	5,563.87	4,805,515,260	6,293.00	5,435,264,100	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	949,800	5,369.03	5,099,512,290	5,251.00	4,987,399,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,817,100	1,514.97	4,267,827,507	1,759.50	4,956,687,450	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,500	26,686.15	5,617,435,672	22,985.00	4,838,342,500	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,588,400	2,751.28	4,370,145,617	2,993.00	4,754,081,200	0.80
日本	株式	S M C	機械	52,800	74,470.94	3,932,065,937	75,760.00	4,000,128,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,962,500	1,824.24	3,580,089,531	1,999.00	3,923,037,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,044,500	3,091.13	3,228,692,742	3,645.00	3,807,202,500	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	636,600	6,139.85	3,908,633,900	5,595.00	3,561,777,000	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	0.34
		建設業	2.10
		食料品	3.33

繊維製品	0.40
パルプ・紙	0.17
化学	6.12
医薬品	4.56
石油・石炭製品	0.46
ゴム製品	0.69
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.95
非鉄金属	0.67
金属製品	0.52
機械	5.27
電気機器	17.33
輸送用機器	8.09
精密機器	2.34
その他製品	2.35
電気・ガス業	1.39
陸運業	2.81
海運業	0.83
空運業	0.45
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	7.63
卸売業	6.92
小売業	4.25
銀行業	6.79
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	2.35
その他金融業	1.14
不動産業	1.93
サービス業	4.94
小計	98.78
合計	98.78

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	303円		7,109,275,050	7,168,980,000	1.21

(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。

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	436,821,245,267	68.92
	イギリス	24,618,803,131	3.88
	カナダ	21,498,781,749	3.39
	スイス	19,790,379,855	3.12
	フランス	19,459,694,281	3.07
	ドイツ	15,130,555,628	2.39
	オーストラリア	12,419,341,448	1.96
	オランダ	11,967,127,087	1.89
	アイルランド	11,327,699,665	1.79
	デンマーク	5,948,861,645	0.94
	スウェーデン	5,745,002,531	0.91
	スペイン	4,599,683,457	0.73
	イタリア	3,492,708,022	0.55
	香港	2,923,160,701	0.46
	シンガポール	1,990,878,487	0.31
	フィンランド	1,897,947,389	0.30
	ジャージー	1,668,614,638	0.26
	ベルギー	1,356,764,905	0.21
	イスラエル	1,251,430,089	0.20
	ノルウェー	1,170,291,225	0.18
	ケイマン	822,555,086	0.13
	キュラソー	817,138,352	0.13
	バミューダ	800,661,258	0.13
	ニュージーランド	515,461,679	0.08
	リベリア	381,134,046	0.06
	ルクセンブルク	370,673,947	0.06
	オーストリア	340,212,200	0.05
ポルトガル	336,147,214	0.05	
パナマ	190,150,446	0.03	
マン島	89,348,667	0.01	
	小計	609,742,454,095	96.20
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	68,791,609	0.01
	香港	52,713,045	0.01
	小計	121,504,654	0.02
投資証券	アメリカ	10,967,896,802	1.73
	オーストラリア	793,123,448	0.13
	フランス	271,340,844	0.04

	シンガポール	254,235,875	0.04
	イギリス	199,518,358	0.03
	香港	132,831,954	0.02
	ベルギー	58,274,249	0.01
	カナダ	56,326,500	0.01
	小計	12,733,548,030	2.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		11,202,036,242	1.77
合計（純資産総額）		633,799,543,021	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	7,950,153,003	1.25
	買建	カナダ	326,532,931	0.05
	買建	ドイツ	1,461,803,793	0.23
	買建	イギリス	629,755,623	0.10
	買建	オーストラリア	460,889,112	0.07

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		283,731,555	0.04
	売建		82,169,702	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。

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	1,210,717	24,864.28	30,103,617,309	27,455.45	33,240,781,753	5.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	546,594	47,251.92	25,827,617,340	53,225.96	29,092,991,692	4.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	719,107	17,107.66	12,302,245,001	21,753.88	15,643,371,268	2.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	191,277	55,480.53	10,612,150,623	70,237.05	13,434,732,710	2.12

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	459,452	17,683.37	8,124,662,630	19,888.82	9,137,958,540	1.44
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	172,117	37,414.47	6,439,667,075	50,820.52	8,747,076,405	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	405,242	17,782.83	7,206,352,964	20,037.74	8,120,134,806	1.28
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	27,675.29	6,122,190,807	35,908.51	7,943,503,119	1.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	112,604.02	3,869,862,560	159,191.41	5,470,931,198	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	19,435.67	4,353,727,963	24,153.64	5,410,586,452	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	72,060	68,537.16	4,938,788,253	74,446.56	5,364,619,618	0.85
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	62,580	61,232.73	3,831,944,793	82,381.95	5,155,462,775	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	101,297	45,681.93	4,627,443,415	50,714.15	5,137,191,567	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,044	31,931.14	3,960,866,891	36,932.53	4,581,258,999	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	309,867	14,897.75	4,616,321,599	14,209.94	4,403,193,864	0.69
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	187,036	21,871.54	4,090,766,648	22,207.74	4,153,647,120	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	53,062.81	3,442,184,632	60,464.96	3,922,362,318	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	41,483.25	3,196,989,945	49,266.06	3,796,788,124	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	183,167	20,662.70	3,784,726,574	20,668.88	3,785,857,824	0.60
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	253,029	12,058.28	3,051,094,979	14,718.05	3,724,094,992	0.59
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	207,970	18,760.39	3,901,598,775	16,283.94	3,386,572,998	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,384	106,521.72	3,343,077,703	107,768.60	3,382,209,993	0.53
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,608	72,335.68	2,503,393,454	94,047.47	3,254,794,946	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	198,157	15,714.70	3,113,979,758	15,426.84	3,056,938,137	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	137,931	19,562.12	2,698,223,009	21,948.19	3,027,336,140	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,373	21,833.04	3,108,436,053	21,241.87	3,024,270,053	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	35,550	59,724.68	2,123,212,633	84,462.60	3,002,645,487	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	30,481.93	2,275,842,509	37,667.21	2,812,309,338	0.44

アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	321,355	8,522.92	2,738,884,773	8,332.51	2,677,694,554	0.42
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	126,574	17,853.61	2,259,803,749	21,098.63	2,670,538,095	0.42

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.62
		素材	4.01
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	2.06
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.08
		メディア・娯楽	5.90
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.54
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.47
		家庭用品・パーソナル用品	1.60
		ヘルスケア機器・サービス	4.27
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.83
		銀行	5.41
		金融サービス	6.68
		保険	2.98
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.97
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.67		
電気通信サービス	1.15		
公益事業	2.64		
半導体・半導体製造装置	6.52		
不動産管理・開発	0.36		
		小計	96.20
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			2.01
合計			98.23

(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	232	アメリカドル	54,426,043.1	7,719,245,693	56,054,100	7,950,153,003	1.25
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	12	カナダドル	2,960,170	317,448,631	3,044,880	326,532,931	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	23	スイスフラン	2,553,261	429,560,630	2,534,140	426,343,713	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	145	ユーロ	6,638,194	1,042,993,041	6,590,250	1,035,460,080	0.16
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,632,025	449,028,503	4,754,375	460,889,112	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	45	イギリスポンド	3,417,853.75	617,537,816	3,485,475	629,755,623	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。

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	1,670,000.00	236,572,200	236,629,815	0.04
	ユーロ	買建	300,000.00	47,249,100	47,101,740	0.01
	アメリカドル	売建	580,000.00	82,162,800	82,169,702	0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	インド	27,373,751,943	16.30
	台湾	25,312,046,881	15.08
	ケイマン	24,776,930,336	14.76
	韓国	21,142,409,403	12.59
	中国	16,385,534,532	9.76
	ブラジル	9,000,147,496	5.36
	サウジアラビア	6,724,167,134	4.01
	南アフリカ	4,577,727,992	2.73
	メキシコ	4,165,689,427	2.48
	インドネシア	3,067,411,281	1.83
	タイ	2,917,439,982	1.74
	マレーシア	2,160,458,425	1.29

	アラブ首長国連邦	2,013,040,022	1.20
	香港	1,490,809,284	0.89
	ポーランド	1,465,093,995	0.87
	カタール	1,448,993,951	0.86
	クウェート	1,193,728,245	0.71
	トルコ	1,009,437,156	0.60
	フィリピン	981,616,209	0.58
	チリ	818,656,347	0.49
	ギリシャ	769,781,700	0.46
	バミューダ	658,873,422	0.39
	アメリカ	593,551,562	0.35
	ハンガリー	416,412,040	0.25
	チェコ	249,361,169	0.15
	ルクセンブルク	226,829,759	0.14
	イギリス	182,542,842	0.11
	エジプト	166,403,778	0.10
	コロンビア	157,920,139	0.09
	ペルー	36,449,941	0.02
	シンガポール	25,270,245	0.02
	オランダ	21,343,337	0.01
	ロシア	122	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	161,529,830,097	96.21
投資信託受益証券	ブラジル	386,672,252	0.23
	メキシコ	130,787,763	0.08
	小計	517,460,015	0.31
投資証券	メキシコ	182,927,853	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,662,722,373	3.37
合計(純資産総額)		167,892,940,338	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,653,658,662	3.37

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		857,491,239	0.51

売建	18,671,160	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。

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	3,979,389	2,580.77	10,269,915,911	2,745.23	10,924,354,778	6.51
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	771,665	7,775.85	6,000,358,738	8,674.24	6,693,615,126	3.99
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,083,100	5,576.70	6,040,130,737	5,317.95	5,759,871,645	3.43
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,643,588	1,488.49	3,934,957,611	1,376.67	3,639,368,119	2.17
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	494,885	3,977.88	1,968,593,316	4,481.97	2,218,062,693	1.32
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	97,780	15,551.41	1,520,617,380	20,614.99	2,015,733,771	1.20
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	847,011	1,612.38	1,365,704,058	1,729.28	1,464,725,958	0.87
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,365.25	1,259,495,154	2,688.35	1,431,546,323	0.85
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	14,144.00	1,235,761,281	15,635.75	1,366,095,478	0.81
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,557.98	1,180,266,607	2,932.94	1,353,275,026	0.81
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	80.94	1,230,555,937	84.03	1,277,460,536	0.76
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	833,450	2,072.81	1,727,583,887	1,494.65	1,245,718,126	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	550,487	2,060.92	1,134,514,260	2,252.72	1,240,096,862	0.74
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	4,189.60	1,013,063,732	4,745.13	1,147,392,624	0.68
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	2,681.90	824,771,301	3,295.56	1,013,490,158	0.60
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	152,359	5,775.02	879,877,439	6,537.80	996,093,584	0.59
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,056,248	454.19	933,928,977	481.45	989,996,227	0.59
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	6,287.44	836,400,611	6,884.14	915,777,822	0.55
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	82.78	775,697,407	86.48	810,274,360	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	3,208.92	1,006,413,580	2,560.96	803,195,453	0.48
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	379,500	1,915.79	727,042,578	2,085.43	791,422,583	0.47

ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	1,017.81	741,008,105	1,086.67	791,145,121	0.47
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	1,853.11	702,536,281	2,043.69	774,785,360	0.46
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	853.23	665,762,978	991.25	773,459,930	0.46
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	2,554,200	298.89	763,448,488	295.48	754,720,124	0.45
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	67.38	731,202,578	68.60	744,489,890	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	50.75	682,021,197	53.90	724,338,985	0.43
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	634,100	1,095.78	694,839,926	1,137.45	721,258,308	0.43
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	490,774	1,327.71	651,607,573	1,465.95	719,453,090	0.43
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	24,609.47	752,828,474	23,083.57	706,149,514	0.42

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.99
		素材	7.59
		資本財	4.48
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	2.01
		自動車・自動車部品	3.71
		耐久消費財・アパレル	1.20
		消費者サービス	2.09
		メディア・娯楽	5.83
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.34
		生活必需品流通・小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	3.44
		家庭用品・パーソナル用品	0.73
		ヘルスケア機器・サービス	0.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.66
		銀行	16.30
		金融サービス	2.64
		保険	2.48
		ソフトウェア・サービス	2.62
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9.11
電気通信サービス	2.66		
公益事業	2.59		
半導体・半導体製造装置	9.74		
不動産管理・開発	1.48		
	小計	96.21	

投資信託受益証券		0.31
投資証券		0.11
合計		96.63

(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	772	アメリカドル	38,489,603	5,458,980,393	39,862,220	5,653,658,662	3.37

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,051,690.39	857,440,727	857,491,239	0.51
	ブラジルリアル	売建	639,852.91	18,813,527	18,671,160	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。

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	549,387,054,480	84.55
地方債証券	日本	32,859,840,918	5.06
特殊債券	日本	36,607,573,370	5.63
	国際機関	299,901,000	0.05
	小計	36,907,474,370	5.68
社債券	日本	27,984,534,000	4.31
	フランス	1,395,463,000	0.21
	韓国	99,613,000	0.02
	小計	29,479,610,000	4.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,123,042,875	0.17
合計(純資産総額)		649,757,022,643	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	99.74	6,653,258,300	0.100	2028/3/20	1.02
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	99.92	6,005,552,600	0.005	2026/6/20	0.92
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	100.16	5,909,558,000	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	99.72	5,793,964,400	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	100.12	5,757,302,500	0.100	2027/3/20	0.89
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	99.89	5,673,808,800	0.005	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,610,000,000	100.08	5,614,488,000	99.85	5,601,697,200	0.005	2026/12/20	0.86
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	5,350,000,000	100.62	5,383,203,600	101.69	5,440,682,500	0.800	2033/9/20	0.84
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	97.13	5,390,770,500	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	97.68	5,196,895,200	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	100.14	5,157,467,500	0.100	2025/6/20	0.79
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	99.92	5,155,923,600	0.100	2027/12/20	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	99.98	5,089,032,900	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,070,000,000	100.37	5,088,759,000	100.15	5,077,757,100	0.100	2025/9/20	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	100.54	5,047,509,600	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	99.94	5,037,177,600	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	97.67	4,942,253,800	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	97.12	4,930,985,480	0.100	2031/12/20	0.76
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,000,000,000	98.02	4,901,000,000	97.39	4,869,600,000	0.100	2031/9/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,940,000,000	98.68	4,874,823,000	98.49	4,865,406,000	0.100	2030/9/20	0.75
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	97.40	4,850,868,600	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	98.16	4,839,583,800	0.400	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	99.30	4,825,980,000	0.500	2033/3/20	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	99.64	4,817,884,100	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	4,807,488,000	0.100	2025/12/20	0.74
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	100.15	4,767,330,400	0.100	2026/3/20	0.73
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	97.96	4,751,399,500	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	98.23	4,725,055,400	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	98.70	4,683,362,450	0.100	2030/6/20	0.72
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	4,650,000,000	100.79	4,686,736,200	99.48	4,626,192,000	0.500	2032/12/20	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	84.55
地方債証券	5.06
特殊債券	5.68
社債券	4.54
合計	99.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	138,828,155,278	45.99
	フランス	25,137,414,172	8.33
	イタリア	22,555,698,209	7.47
	中国	22,192,630,962	7.35
	ドイツ	19,616,876,170	6.50
	イギリス	15,617,157,420	5.17
	スペイン	14,722,033,558	4.88
	カナダ	5,945,031,157	1.97
	ベルギー	5,358,708,128	1.78
	オランダ	4,549,218,529	1.51
	オーストラリア	4,245,766,262	1.41
	オーストリア	3,582,221,297	1.19
	メキシコ	2,700,465,553	0.89
	アイルランド	1,759,172,154	0.58
	フィンランド	1,583,609,641	0.52
	ポーランド	1,522,256,383	0.50
	マレーシア	1,491,873,985	0.49
	シンガポール	1,266,874,133	0.42
	イスラエル	888,889,820	0.29
	デンマーク	844,917,398	0.28
ニュージーランド	730,448,334	0.24	
スウェーデン	637,896,631	0.21	
ノルウェー	539,822,201	0.18	

	小計	296,317,137,375	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,551,829,720	1.84
合計(純資産総額)		301,868,967,095	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	1,057,010,248	0.35
	買建	ドイツ	1,031,283,830	0.34

(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		2,273,903,860	0.75

(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	14,370.29	2,011,841,580	14,462.78	2,024,789,452	4.125	2032/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,524.72	1,843,419,967	13,657.78	1,861,556,202	3.375	2033/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,024.24	1,680,128,108	13,029.52	1,680,808,502	2.750	2032/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,309.58	1,555,890,143	13,470.80	1,574,736,862	2.375	2027/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,457.94	1,507,289,389	13,799.33	1,545,525,943	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,722.99	1,474,752,411	11,810.39	1,485,747,637	1.375	2031/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,091.00	1,409,900,981	13,375.78	1,440,572,355	1.625	2026/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,174.94	1,426,903,209	12,229.51	1,433,298,956	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,176.54	1,417,654,589	14,313.47	1,431,347,254	4.500	2026/7/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	13,706.58	1,398,071,810	13,894.63	1,417,252,343	3.125	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,348.89	1,356,192,724	11,521.74	1,376,848,933	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,491.33	1,357,228,616	13,600.72	1,368,232,565	2.875	2028/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,181.32	1,331,313,889	13,182.71	1,331,453,784	2.875	2032/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	13,531.43	1,244,892,265	14,388.81	1,323,771,414	4.125	2030/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,528.95	1,285,477,999	11,675.21	1,301,786,232	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,832.84	1,219,120,267	13,107.64	1,245,225,851	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	13,583.85	1,222,547,120	13,811.25	1,243,012,521	2.875	2025/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,087.07	1,197,403,879	11,400.69	1,231,274,976	2.875	2052/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,493.24	1,187,405,195	13,747.59	1,209,788,742	1.500	2024/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,187.68	1,170,017,725	12,467.46	1,196,876,778	0.625	2027/12/31	0.40

アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,348.35	1,173,093,379	12,568.02	1,193,962,055	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	13,548.08	1,146,168,347	13,760.83	1,164,166,574	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,332.29	1,133,245,244	13,620.11	1,157,709,536	1.125	2025/2/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,060.15	1,143,090,457	14,175.24	1,152,447,304	3.875	2029/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,607.64	1,143,042,314	13,702.93	1,151,046,845	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,379.87	1,114,189,028	12,645.86	1,138,127,573	1.250	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	13,270.89	1,090,867,305	13,570.80	1,115,520,099	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	8,350,000	13,545.82	1,131,076,740	13,226.20	1,104,387,824	3.625	2053/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	11,662.47	1,076,446,019	11,768.56	1,086,238,622	1.250	2031/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000	17,871.22	1,057,976,319	18,272.36	1,081,723,989	5.500	2029/4/25	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	98.16
合計	98.16

(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	28	アメリカドル	3,019,726.92	428,287,869	3,043,250	431,624,147	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	18	アメリカドル	2,005,495.72	284,439,458	2,032,031.34	288,203,005	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	19	アメリカドル	2,297,490.69	325,853,104	2,377,375	337,183,096	0.11
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,169,788.1	183,797,106	1,172,710	184,256,195	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,782,261.5	280,028,927	1,794,900	282,014,688	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	26	ユーロ	3,549,464.6	557,691,878	3,596,060	565,012,947	0.19

(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	7,820,000.00	1,120,056,741	1,105,931,770	0.37
	カナダドル	買建	860,000.00	91,810,503	91,986,718	0.03
	ユーロ	買建	4,800,000.00	751,781,098	752,531,520	0.25
	イギリスポンド	買建	740,000.00	134,213,963	133,329,352	0.04
	オフショア人民元	買建	9,560,000.00	191,600,350	190,124,500	0.06

(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（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	32,241,769,738	44.82
	フランス	5,836,797,722	8.11
	イタリア	5,237,116,338	7.28
	中国	5,148,113,565	7.16
	ドイツ	4,531,597,249	6.30
	イギリス	3,623,748,305	5.04
	スペイン	3,421,262,358	4.76
	カナダ	1,383,753,077	1.92
	ベルギー	1,247,048,907	1.73
	オランダ	1,055,718,709	1.47
	オーストラリア	990,195,380	1.38
	オーストリア	829,961,432	1.15
	メキシコ	639,137,208	0.89
	アイルランド	406,145,203	0.56
	フィンランド	364,947,378	0.51
	ポーランド	359,124,539	0.50
	マレーシア	340,927,616	0.47
	シンガポール	298,427,742	0.41
	イスラエル	206,339,343	0.29
	デンマーク	192,614,545	0.27
ニュージーランド	167,460,761	0.23	
スウェーデン	145,124,879	0.20	
ノルウェー	121,764,787	0.17	
	小計	68,789,096,781	95.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,141,343,843	4.37
合計(純資産総額)		71,930,440,624	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	113,760,957	0.16
	買建	ドイツ	171,848,428	0.24

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		67,096,911,274	93.28

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.25% 04/30/28	5,040,000	12,462.75	628,122,965	12,692.12	639,682,994	1.250	2028/4/30	0.89
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	3,800,000	13,381.32	508,490,465	13,799.33	524,374,873	3.500	2033/2/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	3,700,000	13,794.62	510,401,295	13,894.63	514,101,339	3.125	2025/8/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 4.25% 10/15/25	3,300,000	14,055.29	463,824,818	14,153.08	467,051,727	4.250	2025/10/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/15/26	2,890,000	14,138.67	408,607,798	14,277.73	412,626,629	4.375	2026/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	2,930,000	13,366.09	391,626,506	13,600.72	398,501,134	2.875	2028/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	11,525.07	367,649,816	11,860.53	378,351,027	1.125	2031/2/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	2,500,000	14,045.60	351,140,055	14,462.78	361,569,545	4.125	2032/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	2,730,000	12,807.91	349,656,049	13,182.71	359,888,003	2.875	2032/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 04/15/25	2,600,000	13,750.86	357,522,404	13,830.64	359,596,668	2.625	2025/4/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	2,500,000	13,584.37	339,609,441	13,781.33	344,533,325	3.125	2027/8/31	0.48
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	2,050,000	15,994.70	327,891,474	16,129.13	330,647,327	3.500	2026/4/25	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	2,350,000	13,452.52	316,134,221	13,702.93	322,019,057	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	2,390,000	12,517.88	299,177,392	13,226.20	316,106,214	3.625	2053/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	2,620,000	11,466.62	300,425,523	11,810.39	309,432,338	1.375	2031/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	11,352.49	298,570,599	11,675.21	307,058,098	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	2,200,000	13,689.45	301,168,029	13,747.59	302,447,185	1.500	2024/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	2,290,000	12,918.71	295,838,656	13,080.77	299,549,642	1.125	2026/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	2,200,000	13,017.33	286,381,363	13,148.63	289,270,040	0.750	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	2,150,000	12,971.35	278,884,039	13,107.64	281,814,271	0.750	2026/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.25% 06/30/29	2,030,000	13,460.55	273,249,234	13,743.65	278,996,286	3.250	2029/6/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 4% 02/28/30	1,950,000	13,964.71	272,311,939	14,272.19	278,307,855	4.000	2030/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	2,000,000	13,780.22	275,604,499	13,869.69	277,393,996	3.000	2025/7/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	2,260,000	11,876.04	268,398,648	12,229.51	276,387,000	1.875	2032/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1% 12/15/24	2,000,000	13,608.03	272,160,770	13,672.27	273,445,534	1.000	2024/12/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	2,000,000	13,335.06	266,701,342	13,558.89	271,177,851	2.750	2028/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	2,020,000	13,237.83	267,404,288	13,375.78	270,190,914	1.625	2026/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	2,120,000	12,489.35	264,774,228	12,715.66	269,572,181	1.250	2028/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/26	1,900,000	13,944.55	264,946,624	14,048.64	266,924,335	3.750	2026/4/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	2,050,000	12,842.81	263,277,754	12,997.66	266,452,169	0.750	2026/8/31	0.37

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	95.63
合計	95.63

(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	3	アメリカドル	322,002.81	45,669,658	326,062.5	46,245,444	0.06
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	2	アメリカドル	220,531.26	31,277,948	225,781.26	32,022,556	0.04
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	2	アメリカドル	240,659.05	34,132,673	250,250	35,492,957	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	3	ユーロ	318,229.2	50,000,173	319,830	50,251,690	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	3	ユーロ	354,344.2	55,674,560	358,980	56,402,937	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	3	ユーロ	404,040	63,482,764	414,930	65,193,801	0.09

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	222,262,000.00	32,147,993,470	31,463,186,458	43.74
	カナダドル	売建	12,667,000.00	1,349,218,830	1,356,055,551	1.89
	メキシコペソ	売建	76,619,000.00	634,379,514	636,979,718	0.89
	ユーロ	売建	141,783,000.00	22,115,070,899	22,244,561,722	30.93
	イギリスポンド	売建	19,122,000.00	3,472,569,004	3,448,522,669	4.79
	スウェーデンクローナ	売建	9,965,000.00	137,931,544	141,608,629	0.20
	ノルウェークローネ	売建	8,685,000.00	115,437,546	120,693,708	0.17
	デンマーククローネ	売建	8,764,000.00	183,450,677	184,507,615	0.26
	ポーランドズロチ	売建	9,900,000.00	355,070,157	357,230,609	0.50
	オーストラリアドル	売建	9,941,000.00	946,382,962	962,179,449	1.34
	ニュージーランドドル	売建	1,823,000.00	161,525,456	163,595,472	0.23
	シンガポールドル	売建	2,748,000.00	296,563,583	294,929,649	0.41
	マレーシアリングット	売建	11,100,000.00	343,721,490	341,764,560	0.48
	イスラエルシェケル	売建	5,296,000.00	206,907,684	206,623,969	0.29
	オフショア人民元	売建	260,025,000.00	5,238,290,797	5,174,471,496	7.19

(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	12,314,242,573	9.86
	ブラジル	12,311,429,684	9.86
	マレーシア	12,281,160,017	9.83
	中国	12,168,745,552	9.74
	インドネシア	12,155,671,554	9.73
	タイ	12,108,981,843	9.70
	南アフリカ	10,189,855,066	8.16
	ポーランド	9,412,123,549	7.54
	チェコ	7,724,692,812	6.18
	コロンビア	5,728,441,977	4.59
	ルーマニア	4,701,887,380	3.76
	ハンガリー	3,928,186,892	3.15
	ペルー	2,847,797,489	2.28
	チリ	2,363,960,245	1.89
	ウルグアイ	235,702,281	0.19
	ドミニカ共和国	200,185,445	0.16
	フィリピン	72,357,347	0.06
	小計	120,745,421,706	96.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,151,045,923	3.32
合計(純資産総額)		124,896,467,629	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	3.49	2,281,655,175	3.48	2,274,750,950	9.850	2027/6/28	1.82
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,346.03	1,794,719,813	2,419.66	1,851,045,690	0.000	2026/1/1	1.48
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,227.75	1,737,648,349	2,316.66	1,807,001,331	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	792.89	1,644,472,733	799.52	1,658,222,109	10.500	2026/12/21	1.33
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000	2,886.39	1,596,175,171	2,918.06	1,613,687,194	10.000	2025/1/1	1.29
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	54,900,000	2,864.71	1,572,726,050	2,934.21	1,610,883,969	10.000	2027/1/1	1.29
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,798.00	1,438,175,636	2,907.93	1,494,678,790	10.000	2029/1/1	1.20
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	48,100,000,000	2.81	1,352,222,368	3.02	1,453,818,351	7.250	2034/10/18	1.16
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	200,100,000	682.39	1,365,479,917	704.04	1,408,803,849	8.000	2030/1/31	1.13

マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	44,600,000	3,090.79	1,378,494,452	3,108.59	1,386,433,981	3.885	2029/8/15	1.11
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	749.30	1,319,520,515	779.13	1,372,065,450	7.750	2031/5/29	1.10
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	757.82	1,328,468,218	772.32	1,353,878,842	5.750	2026/3/5	1.08
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	186,500,000	642.71	1,198,655,980	667.47	1,244,838,823	8.250	2032/3/31	1.00
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	45,110,000,000	2.43	1,097,452,868	2.67	1,206,662,617	7.250	2050/10/26	0.97
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	38,200,000	3,071.81	1,173,432,597	3,094.28	1,182,018,510	3.733	2028/6/15	0.95
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	45,300,000	2,472.69	1,120,132,254	2,539.01	1,150,173,595	0.000	2025/7/1	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	794.53	1,109,176,713	818.17	1,142,168,842	8.500	2029/5/31	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	774.83	1,077,026,466	791.47	1,100,149,383	7.500	2027/6/3	0.88
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	37,250,000	2,726.79	1,015,732,545	2,774.85	1,033,634,015	0.000	2024/7/1	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	552.37	1,003,663,194	564.48	1,025,677,603	8.750	2048/2/28	0.82
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.89	976,722,226	0.90	983,917,276	5.500	2026/4/15	0.79
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	621.03	937,755,300	645.60	974,862,795	8.875	2035/2/28	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	116,900,000	814.64	952,314,219	819.26	957,715,622	8.000	2024/9/5	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000	692.64	855,421,073	737.72	911,093,265	7.750	2042/11/13	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000	733.04	879,652,010	749.56	899,482,869	5.500	2027/3/4	0.72
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,111.58	893,024,961	3,107.79	891,937,555	3.955	2025/9/15	0.71
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	578.20	842,445,559	597.02	869,868,339	8.500	2037/1/31	0.70
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000	0.93	844,256,492	0.95	858,321,360	7.000	2033/2/15	0.69
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	3,160.56	824,906,654	3,237.16	844,900,460	2.750	2029/10/25	0.68
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	409.52	831,740,168	412.33	837,444,004	2.125	2026/12/17	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.68
合計	96.68

(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。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	976,145,109	51.45
	イギリス	403,919,389	21.29
	フランス	168,157,594	8.86
	イタリア	100,990,582	5.32
	ドイツ	52,955,981	2.79
	スペイン	44,385,704	2.34
	カナダ	31,689,436	1.67
	オーストラリア	20,796,567	1.10
	スウェーデン	13,781,257	0.73
	ニュージーランド	10,433,039	0.55
	デンマーク	3,044,259	0.16
	小計	1,826,298,917	96.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		71,022,257	3.74
合計(純資産総額)		1,897,321,174	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		1,761,408,029	92.84

(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	T11 0.125% 01/15/32	260,000	12,730.66	35,568,811	12,497.19	36,065,921	0.125	2032/1/15	1.90
アメリカ	国債証券	T11 0.375% 07/15/25	170,000	13,620.27	29,419,238	13,731.90	30,288,442	0.375	2025/7/15	1.60
アメリカ	国債証券	T11 2.375% 01/15/25	130,000	14,224.13	29,222,409	14,064.03	29,844,100	2.375	2025/1/15	1.57
アメリカ	国債証券	T11 1.375% 07/15/33	210,000	13,435.21	28,400,397	13,810.79	29,382,595	1.375	2033/7/15	1.55
アメリカ	国債証券	T11 3.875% 04/15/29	100,000	16,253.71	29,438,882	15,647.62	29,286,879	3.875	2029/4/15	1.54
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 01/15/31	190,000	12,846.54	28,014,316	12,694.99	28,509,700	0.125	2031/1/15	1.50
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 04/15/26	180,000	13,441.22	27,480,028	13,492.60	28,494,358	0.125	2026/4/15	1.50
アメリカ	国債証券	T11 0.625% 01/15/26	160,000	13,734.81	27,555,235	13,680.48	28,343,991	0.625	2026/1/15	1.49
アメリカ	国債証券	T11 1.625% 10/15/27	190,000	14,339.01	27,395,331	14,076.38	27,779,625	1.625	2027/10/15	1.46

アメリカ	国債証券	T11 0.125% 07/15/26	160,000	13,486.61	26,815,999	13,506.61	27,739,772	0.125	2026/7/15	1.46
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 01/15/30	180,000	13,035.73	27,276,882	12,883.47	27,733,226	0.125	2030/1/15	1.46
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 04/15/25	170,000	13,561.78	26,588,091	13,665.80	27,673,573	0.125	2025/4/15	1.46
アメリカ	国債証券	T11 0.5% 01/15/28	160,000	13,534.83	26,150,819	13,419.48	26,782,713	0.500	2028/1/15	1.41
アメリカ	国債証券	T11 2.375% 01/15/27	120,000	14,394.52	25,828,434	14,312.67	26,204,733	2.375	2027/1/15	1.38
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 04/15/27	180,000	13,298.83	25,375,662	13,324.86	26,137,384	0.125	2027/4/15	1.38
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 07/15/31	180,000	12,772.63	25,623,298	12,648.63	26,136,912	0.125	2031/7/15	1.38
アメリカ	国債証券	T11 3.625% 04/15/28	90,000	15,665.12	25,966,770	15,194.47	26,014,693	3.625	2028/4/15	1.37
アメリカ	国債証券	T11 1.125% 01/15/33	180,000	14,038.33	25,467,515	13,477.46	25,058,297	1.125	2033/1/15	1.32
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 07/15/30	160,000	12,946.86	24,115,901	12,846.83	24,667,353	0.125	2030/7/15	1.30
アメリカ	国債証券	T11 0.25% 07/15/29	150,000	13,216.97	23,117,205	13,120.07	23,672,612	0.250	2029/7/15	1.25
アメリカ	国債証券	T11 0.75% 07/15/28	140,000	13,673.83	22,768,723	13,574.61	23,294,902	0.750	2028/7/15	1.23
アメリカ	国債証券	T11 0.875% 01/15/29	140,000	13,747.58	22,704,461	13,580.09	23,167,230	0.875	2029/1/15	1.22
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 10/15/25	140,000	13,524.97	22,011,469	13,627.51	22,623,879	0.125	2025/10/15	1.19
アメリカ	国債証券	T11 0.375% 01/15/27	130,000	13,533.41	21,698,859	13,479.55	22,320,459	0.375	2027/1/15	1.18
イギリス	国債証券	JKTI 0.125% 08/10/28	90,000	18,044.51	20,775,422	18,312.18	22,303,201	0.125	2028/8/10	1.18
フランス	国債証券	FRTRI 1.85% 07/25/27	100,000	16,785.65	21,663,038	16,647.36	22,052,266	1.850	2027/7/25	1.16
アメリカ	国債証券	T11 0.625% 07/15/32	160,000	13,324.92	21,856,934	13,006.04	22,037,031	0.625	2032/7/15	1.16
アメリカ	国債証券	T11 0.375% 07/15/27	130,000	13,523.49	21,407,469	13,473.15	22,030,844	0.375	2027/7/15	1.16
アメリカ	国債証券	T11 0.125% 10/15/26	140,000	13,495.12	20,622,526	13,461.87	21,221,107	0.125	2026/10/15	1.12
イギリス	国債証券	JKTI 1.25% 11/22/32	60,000	20,158.46	19,979,500	20,070.22	20,957,046	1.250	2032/11/22	1.10

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	96.26
合計	96.26

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

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	6,723,100.00	987,569,538	951,867,254	50.17
	カナダドル	売建	289,200.00	31,381,867	30,964,556	1.63

ユーロ	売建	2,263,000.00	363,111,475	355,088,687	18.72
イギリスポンド	売建	2,088,700.00	388,030,028	376,741,533	19.86
スウェーデンクローナ	売建	950,100.00	13,341,883	13,503,106	0.71
デンマーククローネ	売建	140,900.00	3,030,555	2,966,677	0.16
オーストラリアドル	売建	207,900.00	20,226,448	20,125,051	1.06
ニュージーランドドル	売建	113,100.00	10,255,281	10,151,165	0.54

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

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

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	113,947,288,900	96.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,880,684,862	3.29
合計(純資産総額)		117,827,973,762	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	3,835,260,000	3.25

(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	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	12,914	608,224.14	7,854,606,614	611,000	7,890,454,000	6.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,371	563,403.9	6,406,465,857	584,000	6,640,664,000	5.64
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,799	166,861.57	5,973,477,470	165,000	5,906,835,000	5.01
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	53,063	98,045.54	5,202,590,697	101,900	5,407,119,700	4.59
日本	投資証券	G L P 投資法人	37,394	136,675.2	5,110,832,505	140,500	5,253,857,000	4.46
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,285	275,190.86	5,307,055,878	271,400	5,233,949,000	4.44
日本	投資証券	K D X 不動産投資法人	31,858	161,397.36	5,141,797,181	160,800	5,122,766,400	4.35
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	16,687	271,838.8	4,536,174,173	251,700	4,200,117,900	3.56
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,057	170,910.58	3,769,774,831	166,500	3,672,490,500	3.12
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,763	149,810.19	3,709,749,864	144,100	3,568,348,300	3.03
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,861	325,137.11	3,531,314,258	316,000	3,432,076,000	2.91
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	53,600	56,997.43	3,055,062,443	61,000	3,269,600,000	2.77

日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,571	347,793.65	2,633,145,756	350,000	2,649,850,000	2.25
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	33,265	78,251.86	2,603,048,311	77,100	2,564,731,500	2.18
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,058	66,722.23	2,472,592,740	69,200	2,564,413,600	2.18
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	16,891	136,222.53	2,300,934,819	139,600	2,357,983,600	2.00
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,822	608,160.33	2,324,388,787	604,000	2,308,488,000	1.96
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,808	400,152.05	2,324,083,152	388,500	2,256,408,000	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,151	149,996.73	2,122,603,740	152,000	2,150,952,000	1.83
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	4,604	467,587.07	2,152,770,904	457,500	2,106,330,000	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	7,091	284,833.61	2,019,755,171	286,000	2,028,026,000	1.72
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,579	142,881.13	1,940,182,865	141,400	1,920,070,600	1.63
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,018	139,031.71	1,809,914,914	140,200	1,825,123,600	1.55
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,107	452,434.72	1,858,149,435	433,000	1,778,331,000	1.51
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,444	318,030.43	1,731,357,690	317,000	1,725,748,000	1.46
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,302	109,044.09	1,777,636,896	104,300	1,700,298,600	1.44
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	21,338	73,210.7	1,562,170,047	72,500	1,547,005,000	1.31
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,357	150,916.92	1,563,046,573	149,200	1,545,264,400	1.31
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,293	652,734.89	1,496,721,123	665,000	1,524,845,000	1.29
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,823	377,544.98	1,443,354,487	374,500	1,431,713,500	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	96.71
合計	96.71

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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 (%)
不動産投資指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,145円		3,832,253,430	3,835,260,000	3.25

(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。

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	89,580,950,096	77.14
	オーストラリア	7,855,754,177	6.76

イギリス	5,585,558,664	4.81
シンガポール	4,044,496,482	3.48
フランス	2,117,085,357	1.82
カナダ	1,734,071,768	1.49
ベルギー	1,354,575,124	1.17
香港	1,305,391,650	1.12
スペイン	508,867,736	0.44
ガンジー	337,745,375	0.29
ニュージーランド	333,095,718	0.29
オランダ	206,035,202	0.18
韓国	205,939,949	0.18
イスラエル	129,516,722	0.11
ドイツ	39,705,795	0.03
アイルランド	36,492,691	0.03
イタリア	12,237,441	0.01
小計	115,387,519,947	99.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	746,927,207	0.64
合計(純資産総額)	116,134,447,154	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		255,791,308	0.22

(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	538,311	14,648.20	7,885,288,482	19,173.99	10,321,573,876	8.89
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	54,670	107,366.72	5,869,739,037	115,462.38	6,312,328,572	5.44
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	322,082	12,004.49	3,866,430,535	12,929.22	4,164,269,938	3.59
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	92,329	34,976.69	3,229,363,393	43,655.27	4,030,647,793	3.47
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	190,349	16,138.83	3,072,011,237	20,463.23	3,895,155,824	3.35
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	422,284	7,128.37	3,010,199,047	8,308.40	3,508,504,977	3.02
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	176,646	18,098.92	3,197,102,935	19,305.89	3,410,309,941	2.94
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	122,824	16,750.12	2,057,317,107	22,999.15	2,824,847,943	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	601,417	3,992.51	2,401,166,093	4,564.08	2,744,920,955	2.36
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,004,249	2,179.21	2,188,470,668	2,443.85	2,454,241,350	2.11

アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,977	23,596.25	1,957,946,626	26,890.96	2,231,331,852	1.92
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	200,564	7,617.68	1,527,834,236	8,864.37	1,777,874,507	1.53
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	169,893	8,349.53	1,418,527,057	10,013.19	1,701,172,248	1.46
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	234,121	5,968.20	1,397,282,451	7,226.23	1,691,814,184	1.46
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,751	13,414.28	1,217,359,451	18,281.88	1,659,099,527	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	334,687	4,426.51	1,481,496,791	4,921.50	1,647,162,405	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	72,554	16,223.93	1,177,111,286	19,165.48	1,390,532,809	1.20
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	37,407	29,439.65	1,101,249,103	35,847.53	1,340,948,648	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	67,804	16,988.39	1,151,881,297	19,366.88	1,313,152,372	1.13
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	127,703	7,706.52	984,146,283	9,315.39	1,189,603,811	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	1,484,800	717.10	1,064,759,731	795.87	1,181,718,912	1.02
イギリス	投資証券	SEGO PLC	714,819	1,403.88	1,003,522,671	1,621.06	1,158,765,173	1.00
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	411,756	2,304.73	948,989,494	2,789.79	1,148,715,283	0.99
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	360,964	2,510.39	906,160,777	3,091.89	1,116,062,426	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,515	9,217.53	1,000,240,452	10,157.86	1,102,280,677	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,899	6,380.93	994,780,871	7,044.69	1,098,261,077	0.95
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	123,085	6,334.68	779,704,471	8,081.47	994,708,153	0.86
アメリカ	投資証券	UDR INC	175,963	4,537.14	798,369,065	5,498.74	967,576,388	0.83
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	184,939	4,890.29	904,406,896	5,148.42	952,145,311	0.82
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	96,265	8,426.12	811,140,471	9,594.79	923,643,374	0.80

(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	99.36
合計	99.36

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

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	653,000.00	92,503,980	92,521,694	0.08
	カナダドル	売建	638,000.00	68,494,404	68,359,849	0.06
	ユーロ	売建	20,000.00	3,149,940	3,140,116	0.00
	イギリスポンド	売建	90,000.00	16,324,560	16,246,044	0.01
	オーストラリアドル	売建	150,000.00	14,584,050	14,529,675	0.01
	ニュージーランドドル	売建	200,000.00	18,016,200	17,964,960	0.02
	香港ドル	売建	650,000.00	11,787,100	11,787,425	0.01
	シンガポールドル	売建	240,000.00	25,769,340	25,773,915	0.02
	イスラエルシェケル	売建	140,000.00	5,475,400	5,467,630	0.00

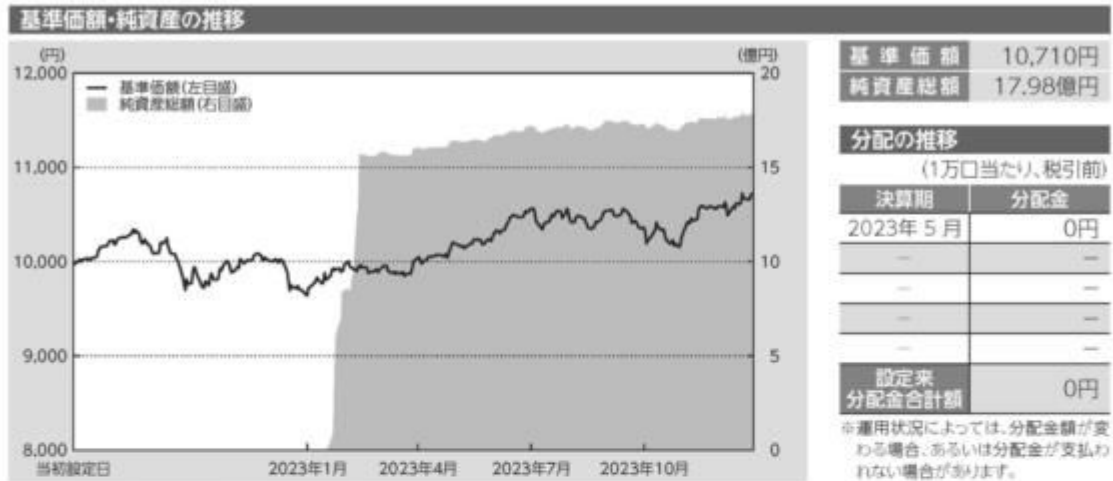
(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

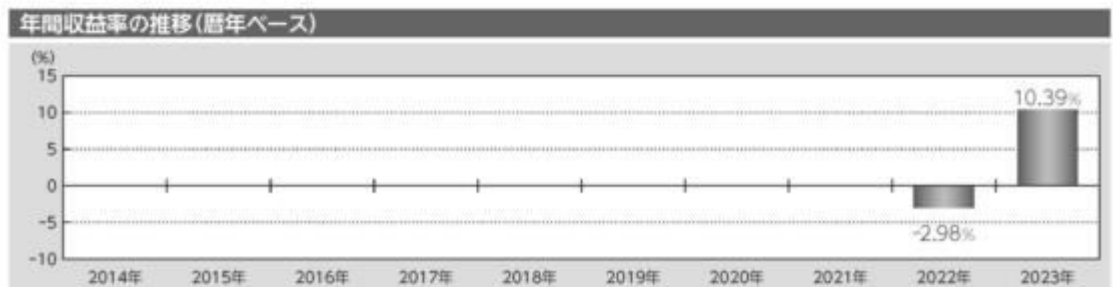
当初設定日：2022年6月30日
作成基準日：2023年12月29日

※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。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国債券インデックスマザーファンド(海陸ヘッジ型)	24.5%	T 1.25% 04/30/28	アメリカ	国債	-	1.250%	2028/04/30	0.2%
国内債券インデックスマザーファンド	24.2%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.2%
外国株式インデックスマザーファンド	15.7%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア/ハードウェア	-	-	0.8%
国内株式インデックスマザーファンド	12.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.5%
新興国債券インデックスマザーファンド	5.2%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.1%
外国債券インデックスマザーファンド	4.9%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.0%
世界地域分散型マザーファンド(海陸ヘッジ型)	4.1%	TII 0.125% 01/15/32	アメリカ	国債	-	0.125%	2032/01/15	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	2.9%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.2%
J-REITインデックスマザーファンド	2.7%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	2.0%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.2%

※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。



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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】**<一部解約手続>**

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

1口以上1口単位とします。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。

<一部解約代金の支払い>

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに基づき振り込まれることとなります。

<受付不可日>

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

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

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

- ・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

- ・公社債等

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。

（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

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。（2022年6月30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5月25日から翌年5月24日までとします。

ただし、第1計算期間は2022年6月30日から2023年5月24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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

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

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

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

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

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びそ

の内容を監督官庁に届け出ます。

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

(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ものを除きます。）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。

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であっても、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。

< 反対受益者の受益権買取請求の不適用 >

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が投資信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、投資信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益

権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、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1期計算期間(2022年6月30日から2023年5月24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】

【10 資産分散投資ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2023年 5月24日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,085,368
親投資信託受益証券	1,623,873,177
未収入金	2,814,060
流動資産合計	1,642,772,605
資産合計	1,642,772,605
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,574,662
未払受託者報酬	156,598
未払委託者報酬	678,591
未払利息	27
その他未払費用	26,055
流動負債合計	2,435,933
負債合計	2,435,933
純資産の部	
元本等	
元本	1,607,741,633
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	32,595,039
(分配準備積立金)	45,271,760
元本等合計	1,640,336,672
純資産合計	1,640,336,672
負債純資産合計	1,642,772,605

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日
営業収益	
受取利息	17
有価証券売買等損益	46,319,631
営業収益合計	46,319,648
営業費用	
支払利息	1,460
受託者報酬	156,631
委託者報酬	678,948
その他費用	26,055
営業費用合計	863,094
営業利益又は営業損失 ()	45,456,554
経常利益又は経常損失 ()	45,456,554
当期純利益又は当期純損失 ()	45,456,554
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 ()	184,794
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	165,895
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	165,895
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,842,616
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,842,616
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ()	32,595,039

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月25日から翌年5月24日までとなっておりますが、第1期計算期間は信託約款の定めにより、2022年6月30日から2023年5月24日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2023年5月24日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		1,607,741,633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)	1.0203円 (10,203円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日		
分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,760,271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	33,511,489円
収益調整金額	C	1,299,954円
分配準備積立金額	D	- 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	46,571,714円
当ファンドの期末残存口数	F	1,607,741,633口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	289円
1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第1期 (2023年5月24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

	第1期 (2023年 5月24日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日
投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	500,000円
期中追加設定元本額	1,627,950,903円
期中一部解約元本額	20,709,270円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2023年 5月24日現在)
	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	46,356,085
合計	46,356,085

（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	23,278,646	48,549,944	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	12,883,589	30,963,129	
	新興国株式インデックス マザーファンド	13,222,484	47,938,115	
	国内株式インデックス マザーファンド	94,928,039	207,313,344	
	外国株式インデックス マザーファンド	54,899,371	256,808,277	
	国内債券インデックス マザーファンド	290,045,987	396,782,910	
	外国債券インデックス マザーファンド	26,268,302	82,789,807	
	新興国債券インデックス マザーファンド	43,010,445	84,468,212	
	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	81,045,193	74,658,831	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	465,689,314	393,600,608	

合計	1,105,271,370	1,623,873,177
----	---------------	---------------

(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 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,411,731,367
株式	550,656,091,320
派生商品評価勘定	490,937,650
未収入金	7,138,050
未収配当金	6,435,214,832
差入委託証拠金	281,416,000
流動資産合計	560,282,529,219
資産合計	560,282,529,219
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,239,850
前受金	479,707,700
未払解約金	1,070,610,139
未払利息	4,129
流動負債合計	1,561,561,818
負債合計	1,561,561,818
純資産の部	
元本等	
元本	255,830,605,457
剰余金	
剰余金又は欠損金()	302,890,361,944
元本等合計	558,720,967,401
純資産合計	558,720,967,401
負債純資産合計	560,282,529,219

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>先物取引</p>

2023年 5月24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、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 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。</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>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	255,830,605,457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) 2.1839円 (21,839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 5月24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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</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 5月24日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	263,160,749,632円
期中追加設定元本額	18,141,196,059円
期中一部解約元本額	25,471,340,234円
期末元本額	255,830,605,457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）	362,878,393円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,963,142,299円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,555,365円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,525,054,760円
世界経済インデックスファンド	4,566,265,474円
日本株式インデックス・オープン	3,140,721,737円
DCマイセレクション25	6,045,173,372円
DCマイセレクション50	18,793,016,286円
DCマイセレクション75	19,229,670,153円
DC日本株式インデックス・オープン	6,046,419,003円
DCマイセレクションS25	3,261,719,945円
DCマイセレクションS50	9,713,793,438円
DCマイセレクションS75	7,776,031,159円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,747,506,071円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	129,727,086円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	663,185,405円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	505,890,627円
DC世界経済インデックスファンド	3,622,884,150円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,177,996,350円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,046,202円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,113,328円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	159,307,912円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,122,651円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	21,562,672円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	84,833,818円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	18,447,216円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,219,315円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	671,214,598円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	374,198,792円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,470,463,855円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	34,980,647円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	15,436,739円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	392,112,893円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,528,893円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	294,769,307円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	27,140,956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）	506,483,173円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,926,856,302円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,800,526,166円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,567,288,518円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,623,169,168円
分散投資コア戦略ファンドA	1,671,155,657円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	529,704,355円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	389,078,045円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,677,177,841円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,605,425円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,607,738円

区分	2023年 5月24日現在
SMT インデックスバランス・オープン	51,089,647円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	27,824,772,823円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	421,486,060円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,538,835円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	190,841,716円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	32,754,228円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,002,503円
グローバル経済コア	210,706,092円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	32,454,761円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	551,349,339円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	27,252,043円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	260,308,230円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	24,926,111円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	23,963,276円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	11,524,456円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	15,213,616円
10資産分散投資ファンド	94,928,039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)	42,709,027,658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)	688,177,800円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	303,775,822円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,663,670円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	693,708,422円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	44,803,096,881円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,223,246円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	214,813,189円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		58,661,261,955
合計		58,661,261,955

(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 5月24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	7,294,242,300	-	7,773,950,000	479,707,700
合計		7,294,242,300	-	7,773,950,000	479,707,700

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,500	3,625.00	34,437,500	
ニッセイ	250,800	636.00	159,508,800	
マルハニチロ	37,200	2,553.00	94,971,600	
雪国まいたけ	21,400	991.00	21,207,400	
カネコ種苗	7,700	1,544.00	11,888,800	
サカタのタネ	28,500	4,085.00	116,422,500	
ホクト	22,300	1,841.00	41,054,300	
ホクリヨウ	2,800	914.00	2,559,200	
住石ホールディングス	30,300	365.00	11,059,500	
日鉄鉱業	10,100	3,940.00	39,794,000	
三井松島ホールディングス	11,400	2,941.00	33,527,400	
I N P E X	927,500	1,553.00	1,440,407,500	
石油資源開発	29,100	4,490.00	130,659,000	
K & O エナジーグループ	11,400	2,282.00	26,014,800	
ショーボンドホールディングス	34,200	5,690.00	194,598,000	
ミライト・ワン	82,900	1,802.00	149,385,800	
タマホーム	15,800	3,920.00	61,936,000	
サンヨーホームズ	2,400	711.00	1,706,400	
日本アクア	8,100	918.00	7,435,800	
ファーストコーポレーション	5,000	920.00	4,600,000	
ベステラ	4,200	949.00	3,985,800	
R o b o t H o m e	42,700	191.00	8,155,700	
キャンディル	3,500	575.00	2,012,500	
ダイセキ環境ソリューション	3,900	923.00	3,599,700	
第一カッター興業	6,400	1,255.00	8,032,000	
安藤・間	145,300	1,037.00	150,676,100	
東急建設	71,400	730.00	52,122,000	
コムシスホールディングス	84,900	2,811.00	238,653,900	
ビーアールホールディングス	39,800	383.00	15,243,400	
高松コンストラクショングループ	16,300	2,346.00	38,239,800	
東建コーポレーション	7,200	7,630.00	54,936,000	
ソネック	2,100	973.00	2,043,300	
ヤマウラ	12,700	1,226.00	15,570,200	
オリエンタル白石	90,100	310.00	27,931,000	
大成建設	164,100	4,710.00	772,911,000	
大林組	627,400	1,160.00	727,784,000	
清水建設	527,400	877.00	462,529,800	
飛島建設	19,400	1,202.00	23,318,800	
長谷工コーポレーション	181,100	1,638.00	296,641,800	
松井建設	16,400	705.00	11,562,000	

銭高組	1,700	3,115.00	5,295,500
鹿島建設	389,000	2,074.00	806,786,000
不動テトラ	12,100	1,779.00	21,525,900
大末建設	5,000	1,277.00	6,385,000
鉄建建設	12,600	1,998.00	25,174,800
西松建設	29,700	3,420.00	101,574,000
三井住友建設	141,400	370.00	52,318,000
大豊建設	7,300	3,815.00	27,849,500
佐田建設	8,700	460.00	4,002,000
ナカノフドー建設	9,700	380.00	3,686,000
奥村組	28,400	3,830.00	108,772,000
東鉄工業	24,100	2,694.00	64,925,400
イチケン	3,100	1,898.00	5,883,800
富士ピー・エス	6,100	441.00	2,690,100
浅沼組	14,000	3,185.00	44,590,000
戸田建設	215,800	811.00	175,013,800
熊谷組	29,400	2,920.00	85,848,000
北野建設	2,600	3,015.00	7,839,000
植木組	3,900	1,307.00	5,097,300
矢作建設工業	23,900	1,107.00	26,457,300
ピーエス三菱	22,200	706.00	15,673,200
日本ハウスホールディングス	34,800	385.00	13,398,000
新日本建設	24,600	1,126.00	27,699,600
東亜道路工業	7,000	4,170.00	29,190,000
日本道路	3,500	8,260.00	28,910,000
東亜建設工業	15,000	3,085.00	46,275,000
日本国土開発	52,600	624.00	32,822,400
若築建設	7,800	3,580.00	27,924,000
東洋建設	56,800	987.00	56,061,600
五洋建設	248,700	708.00	176,079,600
世紀東急工業	22,500	1,298.00	29,205,000
福田組	6,600	4,835.00	31,911,000
住友林業	134,600	3,125.00	420,625,000
日本基礎技術	8,200	522.00	4,280,400
巴コーポレーション	15,300	445.00	6,808,500
大和ハウス工業	490,200	3,600.00	1,764,720,000
ライト工業	32,500	1,991.00	64,707,500
積水ハウス	549,600	2,864.00	1,574,054,400
日特建設	16,700	998.00	16,666,600
北陸電気工事	12,000	863.00	10,356,000
ユアテック	38,600	847.00	32,694,200
日本リーテック	15,400	1,471.00	22,653,400

四電工	7,300	2,096.00	15,300,800
中電工	27,200	2,229.00	60,628,800
関電工	96,100	1,071.00	102,923,100
きんでん	123,500	1,864.00	230,204,000
東京エネシス	17,400	961.00	16,721,400
トーエネック	5,800	3,685.00	21,373,000
住友電設	16,700	2,891.00	48,279,700
日本電設工業	28,800	1,910.00	55,008,000
エクシオグループ	80,800	2,641.00	213,392,800
新日本空調	9,700	2,205.00	21,388,500
九電工	42,700	3,790.00	161,833,000
三機工業	38,900	1,492.00	58,038,800
日揮ホールディングス	173,500	1,704.00	295,644,000
中外炉工業	5,700	1,912.00	10,898,400
ヤマト	11,300	950.00	10,735,000
太平電業	10,900	4,195.00	45,725,500
高砂熱学工業	42,300	2,390.00	101,097,000
三晃金属工業	1,700	4,175.00	7,097,500
朝日工業社	7,300	2,489.00	18,169,700
明星工業	30,200	915.00	27,633,000
大気社	20,200	3,780.00	76,356,000
ダイダン	11,500	2,588.00	29,762,000
日比谷総合設備	15,100	2,366.00	35,726,600
フィル・カンパニー	3,100	909.00	2,817,900
テスホールディングス	18,900	1,059.00	20,015,100
インフロニア・ホールディングス	183,800	1,250.00	229,750,000
東洋エンジニアリング	23,200	552.00	12,806,400
レイズネクスト	25,400	1,427.00	36,245,800
ニッポン	47,500	1,818.00	86,355,000
日清製粉グループ本社	162,900	1,785.00	290,776,500
日東富士製粉	3,100	4,725.00	14,647,500
昭和産業	15,300	2,628.00	40,208,400
鳥越製粉	11,000	619.00	6,809,000
中部飼料	24,400	1,106.00	26,986,400
フィード・ワン	25,700	738.00	18,966,600
東洋精糖	2,600	1,423.00	3,699,800
日本甜菜製糖	10,300	1,829.00	18,838,700
D M三井製糖ホールディングス	17,500	2,628.00	45,990,000
塩水港精糖	16,400	200.00	3,280,000
ウェルネオシュガー	9,100	2,032.00	18,491,200
森永製菓	32,200	4,320.00	139,104,000
中村屋	4,400	3,070.00	13,508,000

江崎グリコ	50,400	3,760.00	189,504,000
名糖産業	6,900	1,610.00	11,109,000
井村屋グループ	9,600	2,295.00	22,032,000
不二家	12,100	2,507.00	30,334,700
山崎製パン	117,900	2,038.00	240,280,200
第一屋製パン	2,600	401.00	1,042,600
モロゾフ	5,700	3,785.00	21,574,500
亀田製菓	11,200	4,260.00	47,712,000
寿スピリッツ	18,700	10,250.00	191,675,000
カルビー	80,600	2,808.00	226,324,800
森永乳業	32,000	5,220.00	167,040,000
六甲バター	12,900	1,381.00	17,814,900
ヤクルト本社	125,800	9,440.00	1,187,552,000
明治ホールディングス	218,300	3,255.00	710,566,500
雪印メグミルク	42,600	1,977.00	84,220,200
プリマハム	23,700	2,270.00	53,799,000
日本ハム	68,900	3,870.00	266,643,000
林兼産業	4,200	488.00	2,049,600
丸大食品	17,700	1,490.00	26,373,000
S Foods	19,400	3,150.00	61,110,000
柿安本店	6,900	2,338.00	16,132,200
伊藤ハム米久ホールディングス	134,500	727.00	97,781,500
サッポロホールディングス	58,000	3,900.00	226,200,000
アサヒグループホールディングス	406,900	5,440.00	2,213,536,000
キリンホールディングス	794,700	2,158.00	1,714,962,600
宝ホールディングス	120,200	1,068.00	128,373,600
オエノンホールディングス	52,600	356.00	18,725,600
養命酒製造	5,800	1,830.00	10,614,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	138,000	1,591.00	219,558,000
サントリー食品インターナショナル	124,000	5,310.00	658,440,000
ダイトーグループホールディングス	10,000	5,030.00	50,300,000
伊藤園	59,700	4,165.00	248,650,500
キーコーヒー	19,700	2,050.00	40,385,000
ユニカフェ	4,500	910.00	4,095,000
ジャパンフーズ	2,100	1,100.00	2,310,000
日清オイリオグループ	24,800	3,430.00	85,064,000
不二製油グループ本社	41,000	2,033.00	83,353,000
かどや製油	1,700	3,490.00	5,933,000
J - オイルミルズ	17,900	1,591.00	28,478,900
キッコーマン	116,700	8,250.00	962,775,000
味の素	425,200	5,268.00	2,239,953,600
ブルドックソース	9,300	1,999.00	18,590,700

キューピー	94,600	2,301.00	217,674,600
ハウス食品グループ本社	53,900	3,220.00	173,558,000
カゴメ	82,100	3,335.00	273,803,500
焼津水産化学工業	5,400	824.00	4,449,600
アリアケジャパン	15,400	5,390.00	83,006,000
ピエトロ	2,000	1,809.00	3,618,000
エバラ食品工業	4,700	3,000.00	14,100,000
やまみ	1,300	1,441.00	1,873,300
ニチレイ	80,700	3,050.00	246,135,000
東洋水産	89,000	5,920.00	526,880,000
イトアンドホールディングス	7,500	2,183.00	16,372,500
大冷	1,700	1,911.00	3,248,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	844.00	9,368,400
日清食品ホールディングス	61,900	12,110.00	749,609,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,188.00	18,816,800
一正蒲鉾	5,900	766.00	4,519,400
フジッコ	18,100	1,907.00	34,516,700
ロック・フィールド	19,700	1,477.00	29,096,900
日本たばこ産業	1,159,400	3,088.00	3,580,227,200
ケンコーマヨネーズ	12,100	1,291.00	15,621,100
わらべや日洋ホールディングス	13,000	2,310.00	30,030,000
なとり	11,100	1,942.00	21,556,200
イフジ産業	2,300	1,058.00	2,433,400
ファーマフーズ	25,300	1,827.00	46,223,100
ユーグレナ	113,800	862.00	98,095,600
紀文食品	13,700	996.00	13,645,200
ピクルスホールディングス	10,300	1,243.00	12,802,900
ミヨシ油脂	4,800	990.00	4,752,000
理研ビタミン	15,200	2,039.00	30,992,800
片倉工業	16,800	1,778.00	29,870,400
ゲンゼ	12,900	4,500.00	58,050,000
東洋紡	78,000	1,028.00	80,184,000
ユニチカ	56,800	221.00	12,552,800
富士紡ホールディングス	7,200	3,105.00	22,356,000
倉敷紡績	13,600	2,297.00	31,239,200
シキボウ	7,700	982.00	7,561,400
日本毛織	47,800	1,009.00	48,230,200
トーア紡コーポレーション	5,400	371.00	2,003,400
帝国繊維	20,600	1,656.00	34,113,600
帝人	172,600	1,427.00	246,300,200
東レ	1,201,200	751.30	902,461,560
住江織物	3,000	2,320.00	6,960,000

日本フェルト	9,100	410.00	3,731,000	
イチカワ	2,200	1,334.00	2,934,800	
日東製網	1,500	1,403.00	2,104,500	
アツギ	8,600	417.00	3,586,200	
ダイニック	3,600	753.00	2,710,800	
セーレン	34,900	2,183.00	76,186,700	
ソトー	4,700	787.00	3,698,900	
東海染工	1,500	1,115.00	1,672,500	
小松マテーレ	26,300	673.00	17,699,900	
ワコールホールディングス	34,600	2,926.00	101,239,600	
ホギメディカル	24,100	3,365.00	81,096,500	
T S Iホールディングス	60,600	677.00	41,026,200	
マツオカコーポレーション	3,900	1,164.00	4,539,600	
ワールド	23,100	1,531.00	35,366,100	
三陽商会	5,300	1,669.00	8,845,700	
ナイガイ	5,400	263.00	1,420,200	
オンワードホールディングス	116,700	386.00	45,046,200	
ルックホールディングス	4,100	2,287.00	9,376,700	
ゴールドウイン	31,800	12,080.00	384,144,000	
デサント	30,900	3,995.00	123,445,500	
キング	6,400	582.00	3,724,800	
ヤマトインターナショナル	11,700	271.00	3,170,700	
特種東海製紙	8,000	3,120.00	24,960,000	
王子ホールディングス	746,300	552.00	411,957,600	
日本製紙	93,300	1,218.00	113,639,400	
三菱製紙	16,800	509.00	8,551,200	
北越コーポレーション	113,200	942.00	106,634,400	
中越パルプ工業	5,600	1,258.00	7,044,800	
巴川製紙所	4,400	666.00	2,930,400	
大王製紙	79,100	1,089.00	86,139,900	
阿波製紙	3,300	565.00	1,864,500	
レンゴー	163,200	844.00	137,740,800	
トーモク	10,300	1,865.00	19,209,500	
ザ・パック	13,300	3,080.00	40,964,000	
北の達人コーポレーション	75,500	293.00	22,121,500	
クラレ	284,800	1,317.00	375,081,600	
旭化成	1,118,800	965.00	1,079,642,000	
共和レザー	8,000	539.00	4,312,000	
レゾナック・ホールディングス	173,100	2,114.00	365,933,400	
住友化学	1,329,100	433.00	575,500,300	
住友精化	7,500	4,260.00	31,950,000	
日産化学	85,100	6,120.00	520,812,000	

ラサ工業	6,900	2,027.00	13,986,300
クレハ	15,300	8,230.00	125,919,000
多木化学	7,000	4,365.00	30,555,000
テイカ	12,000	1,256.00	15,072,000
石原産業	32,400	1,264.00	40,953,600
片倉コープアグリ	2,900	1,304.00	3,781,600
日本曹達	19,200	4,675.00	89,760,000
東ソー	239,200	1,678.00	401,377,600
トクヤマ	57,900	2,192.00	126,916,800
セントラル硝子	28,700	2,925.00	83,947,500
東亜合成	89,800	1,250.00	112,250,000
大阪ソーダ	10,700	4,075.00	43,602,500
関東電化工業	34,600	904.00	31,278,400
デンカ	65,200	2,690.00	175,388,000
信越化学工業	1,489,200	4,253.00	6,333,567,600
日本カーバイド工業	5,300	1,307.00	6,927,100
堺化学工業	13,600	1,800.00	24,480,000
第一稀元素化学工業	16,300	911.00	14,849,300
エア・ウォーター	169,000	1,869.00	315,861,000
日本酸素ホールディングス	173,800	2,920.00	507,496,000
日本化学工業	6,000	1,815.00	10,890,000
東邦アセチレン	3,000	1,303.00	3,909,000
日本パーカライズン	88,700	1,088.00	96,505,600
高压ガス工業	26,000	737.00	19,162,000
チタン工業	1,700	1,402.00	2,383,400
四国化成ホールディングス	21,300	1,442.00	30,714,600
戸田工業	4,100	2,328.00	9,544,800
ステラ ケミファ	10,600	2,983.00	31,619,800
保土谷化学工業	5,100	3,155.00	16,090,500
日本触媒	27,300	5,270.00	143,871,000
大日精化工業	12,400	1,955.00	24,242,000
カネカ	40,900	3,890.00	159,101,000
三菱瓦斯化学	133,800	1,964.00	262,783,200
三井化学	147,700	3,515.00	519,165,500
J S R	167,300	3,195.00	534,523,500
東京応化工業	31,300	7,690.00	240,697,000
大阪有機化学工業	13,500	2,264.00	30,564,000
三菱ケミカルグループ	1,209,000	815.70	986,181,300
K Hネオケム	29,800	2,297.00	68,450,600
ダイセル	263,400	1,173.00	308,968,200
住友ベークライト	26,500	5,420.00	143,630,000
積水化学工業	366,400	1,973.00	722,907,200

日本ゼオン	107,500	1,501.00	161,357,500
アイカ工業	45,200	3,000.00	135,600,000
UBE	92,300	2,237.00	206,475,100
積水樹脂	26,100	2,111.00	55,097,100
タキロンシーアイ	39,100	532.00	20,801,200
旭有機材	11,900	3,575.00	42,542,500
ニチバン	11,100	1,874.00	20,801,400
リケンテクノス	38,600	612.00	23,623,200
大倉工業	8,300	2,116.00	17,562,800
積水化成成品工業	25,100	433.00	10,868,300
群栄化学工業	4,200	2,550.00	10,710,000
タイガースポリマー	6,400	551.00	3,526,400
ミライアル	4,300	1,660.00	7,138,000
ダイキアクシス	5,100	717.00	3,656,700
ダイキョーニシカワ	39,500	748.00	29,546,000
竹本容器	4,700	801.00	3,764,700
森六ホールディングス	9,100	1,973.00	17,954,300
恵和	11,600	1,135.00	13,166,000
日本化薬	136,900	1,226.00	167,839,400
カーリットホールディングス	16,100	723.00	11,640,300
日本精化	10,200	2,500.00	25,500,000
扶桑化学工業	16,600	3,945.00	65,487,000
トリケミカル研究所	23,900	2,370.00	56,643,000
ADEKA	62,500	2,449.00	153,062,500
日油	55,400	6,030.00	334,062,000
新日本理化	19,200	219.00	4,204,800
ハリマ化成グループ	9,800	855.00	8,379,000
花王	436,300	5,217.00	2,276,177,100
第一工業製薬	6,400	1,877.00	12,012,800
石原ケミカル	8,200	1,655.00	13,571,000
日華化学	5,600	852.00	4,771,200
ニイタカ	2,500	2,170.00	5,425,000
三洋化成工業	11,000	4,195.00	46,145,000
有機合成薬品工業	10,300	301.00	3,100,300
大日本塗料	21,900	895.00	19,600,500
日本ペイントホールディングス	792,800	1,148.00	910,134,400
関西ペイント	164,100	2,180.00	357,738,000
神東塗料	11,600	130.00	1,508,000
中国塗料	29,400	1,106.00	32,516,400
日本特殊塗料	8,800	1,026.00	9,028,800
藤倉化成	24,100	419.00	10,097,900
太陽ホールディングス	27,200	2,610.00	70,992,000

D I C	70,000	2,546.00	178,220,000
サカティンクス	39,900	1,185.00	47,281,500
東洋インキSCホールディングス	35,100	2,178.00	76,447,800
T & K T O K A	15,900	1,185.00	18,841,500
富士フィルムホールディングス	344,200	8,294.00	2,854,794,800
資生堂	374,600	6,532.00	2,446,887,200
ライオン	215,200	1,408.00	303,001,600
高砂香料工業	12,100	2,643.00	31,980,300
マンダム	38,700	1,571.00	60,797,700
ミルボン	26,600	5,100.00	135,660,000
ファンケル	78,500	2,240.00	175,840,000
コーセー	36,500	14,320.00	522,680,000
コタ	16,500	1,591.00	26,251,500
シーボン	1,800	1,599.00	2,878,200
ポーラ・オルビスホールディングス	92,000	2,024.00	186,208,000
ノエビアホールディングス	16,000	5,370.00	85,920,000
アジュバンホールディングス	3,400	921.00	3,131,400
新日本製薬	10,200	1,393.00	14,208,600
アクシージア	9,100	1,226.00	11,156,600
エステー	13,800	1,574.00	21,721,200
アグロ カネショウ	7,200	1,692.00	12,182,400
コニシ	30,000	2,177.00	65,310,000
長谷川香料	34,300	3,215.00	110,274,500
星光PMC	7,100	561.00	3,983,100
小林製薬	52,200	7,950.00	414,990,000
荒川化学工業	15,200	1,002.00	15,230,400
メック	14,800	3,050.00	45,140,000
日本高純度化学	4,500	2,539.00	11,425,500
タカラバイオ	48,300	1,684.00	81,337,200
J C U	20,000	3,470.00	69,400,000
新田ゼラチン	8,600	757.00	6,510,200
O A T アグリオ	5,700	1,773.00	10,106,100
デクセリアルズ	51,800	2,899.00	150,168,200
アース製薬	16,200	5,070.00	82,134,000
北興化学工業	18,100	915.00	16,561,500
大成ラミック	5,700	3,070.00	17,499,000
クミアイ化学工業	71,300	930.00	66,309,000
日本農薬	32,900	646.00	21,253,400
アキレス	11,300	1,426.00	16,113,800
有沢製作所	29,200	1,107.00	32,324,400
日東電工	130,200	9,920.00	1,291,584,000
レック	25,500	850.00	21,675,000

三光合成	22,600	546.00	12,339,600
きもと	20,500	181.00	3,710,500
藤森工業	14,200	3,300.00	46,860,000
前澤化成工業	11,600	1,583.00	18,362,800
未来工業	6,400	2,356.00	15,078,400
ウェーブロックホールディングス	4,200	579.00	2,431,800
J S P	12,600	1,680.00	21,168,000
エフピコ	33,900	2,938.00	99,598,200
天馬	15,200	2,408.00	36,601,600
信越ポリマー	33,200	1,374.00	45,616,800
東リ	31,300	303.00	9,483,900
ニフコ	64,700	3,935.00	254,594,500
バルカー	15,000	3,340.00	50,100,000
ユニ・チャーム	373,700	5,327.00	1,990,699,900
ショーエイコーポレーション	4,000	562.00	2,248,000
協和キリン	216,700	2,730.00	591,591,000
武田薬品工業	1,587,500	4,550.00	7,223,125,000
アステラス製薬	1,694,600	2,324.00	3,938,250,400
住友ファーマ	133,100	707.00	94,101,700
塩野義製薬	226,200	6,286.00	1,421,893,200
わかもと製薬	13,000	236.00	3,068,000
日本新薬	42,300	6,450.00	272,835,000
中外製薬	561,500	3,752.00	2,106,748,000
科研製薬	30,700	3,665.00	112,515,500
エーザイ	218,200	8,610.00	1,878,702,000
ロート製薬	173,800	3,040.00	528,352,000
小野薬品工業	346,100	2,644.00	915,088,400
久光製薬	39,900	3,780.00	150,822,000
持田製薬	20,600	3,585.00	73,851,000
参天製薬	326,800	1,276.00	416,996,800
扶桑薬品工業	5,700	2,053.00	11,702,100
日本ケミファ	1,400	1,845.00	2,583,000
ツムラ	56,500	2,866.00	161,929,000
キッセイ薬品工業	27,700	2,940.00	81,438,000
生化学工業	34,200	785.00	26,847,000
栄研化学	29,100	1,591.00	46,298,100
鳥居薬品	9,600	3,480.00	33,408,000
J C R ファーマ	60,700	1,452.00	88,136,400
東和薬品	27,600	1,893.00	52,246,800
富士製薬工業	13,200	1,206.00	15,919,200
ゼリア新薬工業	24,900	2,515.00	62,623,500
そーせいグループ	61,600	3,035.00	186,956,000

第一三共	1,562,800	4,791.00	7,487,374,800
杏林製薬	38,900	1,786.00	69,475,400
大幸薬品	32,500	374.00	12,155,000
ダイト	12,500	2,512.00	31,400,000
大塚ホールディングス	410,400	5,202.00	2,134,900,800
大正製薬ホールディングス	39,900	5,570.00	222,243,000
ペプチドリーム	87,000	1,975.00	171,825,000
あすか製薬ホールディングス	18,400	1,271.00	23,386,400
サワイグループホールディングス	41,000	3,695.00	151,495,000
日本コークス工業	161,800	102.00	16,503,600
ニチレキ	21,200	1,750.00	37,100,000
ユシロ化学工業	9,300	991.00	9,216,300
ビーピー・カストロール	5,400	895.00	4,833,000
富士石油	36,600	270.00	9,882,000
MORESCO	4,500	1,145.00	5,152,500
出光興産	199,200	2,858.00	569,313,600
ENEOSホールディングス	3,042,800	478.90	1,457,196,920
コスモエネルギーホールディングス	70,900	4,285.00	303,806,500
横浜ゴム	102,100	3,065.00	312,936,500
TOYO TIRE	103,100	1,721.00	177,435,100
ブリヂストン	572,800	5,690.00	3,259,232,000
住友ゴム工業	175,900	1,287.00	226,383,300
藤倉コンポジット	9,900	880.00	8,712,000
オカモト	10,000	3,980.00	39,800,000
フコク	9,400	1,154.00	10,847,600
ニッタ	18,200	3,040.00	55,328,000
住友理工	34,800	767.00	26,691,600
三ツ星ベルト	26,200	3,990.00	104,538,000
バンドー化学	28,400	1,310.00	37,204,000
日東紡績	20,300	1,850.00	37,555,000
AGC	182,600	5,030.00	918,478,000
日本板硝子	91,500	610.00	55,815,000
石塚硝子	2,300	1,533.00	3,525,900
日本山村硝子	5,500	911.00	5,010,500
日本電気硝子	73,300	2,559.00	187,574,700
オハラ	8,700	1,197.00	10,413,900
住友大阪セメント	25,300	3,535.00	89,435,500
太平洋セメント	114,300	2,453.00	280,377,900
日本ヒューム	16,000	746.00	11,936,000
日本コンクリート工業	35,500	289.00	10,259,500
三谷セキサン	7,600	4,930.00	37,468,000
アジアパイルホールディングス	28,400	621.00	17,636,400

東海カーボン	150,600	1,227.00	184,786,200
日本カーボン	10,300	4,355.00	44,856,500
東洋炭素	11,300	4,905.00	55,426,500
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	4,965.00	44,685,000
TOTO	118,400	4,335.00	513,264,000
日本碍子	208,700	1,749.00	365,016,300
日本特殊陶業	136,600	2,640.00	360,624,000
MARUWA	6,600	19,170.00	126,522,000
品川リフラクトリーズ	5,100	4,840.00	24,684,000
黒崎播磨	3,700	6,680.00	24,716,000
ヨータイ	12,100	1,481.00	17,920,100
東京窯業	13,400	326.00	4,368,400
ニッカトー	6,600	606.00	3,999,600
フジインコーポレーテッド	14,300	8,610.00	123,123,000
クニミネ工業	4,300	942.00	4,050,600
エーアンドエーマテリアル	2,700	1,058.00	2,856,600
ニチアス	45,400	2,719.00	123,442,600
ニチハ	22,500	2,961.00	66,622,500
日本製鉄	826,300	2,861.50	2,364,457,450
神戸製鋼所	371,200	1,097.00	407,206,400
中山製鋼所	38,000	798.00	30,324,000
合同製鐵	9,200	3,070.00	28,244,000
JFEホールディングス	493,200	1,787.00	881,348,400
東京製鐵	51,900	1,351.00	70,116,900
共英製鋼	21,000	1,864.00	39,144,000
大和工業	30,400	5,510.00	167,504,000
東京鐵鋼	8,800	2,540.00	22,352,000
大阪製鐵	8,500	1,313.00	11,160,500
淀川製鋼所	21,000	2,948.00	61,908,000
中部鋼鈹	15,200	1,917.00	29,138,400
丸一鋼管	56,200	3,150.00	177,030,000
モリ工業	3,300	3,180.00	10,494,000
大同特殊鋼	23,300	5,380.00	125,354,000
日本高周波鋼業	5,000	333.00	1,665,000
日本冶金工業	13,500	4,050.00	54,675,000
山陽特殊製鋼	18,200	2,628.00	47,829,600
愛知製鋼	10,700	2,627.00	28,108,900
日本金属	3,100	915.00	2,836,500
大平洋金属	13,100	1,664.00	21,798,400
新日本電工	118,100	286.00	33,776,600
栗本鐵工所	8,800	2,001.00	17,608,800
虹技	1,800	1,153.00	2,075,400

三菱製鋼	11,600	1,250.00	14,500,000
日亜鋼業	14,700	296.00	4,351,200
日本精線	2,500	4,510.00	11,275,000
エンビプロ・ホールディングス	10,000	585.00	5,850,000
シンニッタン	15,700	246.00	3,862,200
新家工業	3,100	2,197.00	6,810,700
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,320.00	34,716,000
日本軽金属ホールディングス	49,800	1,386.00	69,022,800
三井金属鉱業	53,700	3,160.00	169,692,000
東邦亜鉛	11,000	1,708.00	18,788,000
三菱マテリアル	123,200	2,407.00	296,542,400
住友金属鉱山	214,000	4,382.00	937,748,000
D O W Aホールディングス	41,500	4,420.00	183,430,000
古河機械金属	27,100	1,389.00	37,641,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,100	3,065.00	83,061,500
東邦チタニウム	33,400	1,824.00	60,921,600
U A C J	25,900	2,605.00	67,469,500
C Kサンエツ	4,500	4,225.00	19,012,500
古河電気工業	61,500	2,422.00	148,953,000
住友電気工業	637,300	1,708.50	1,088,827,050
フジクラ	198,000	1,036.00	205,128,000
S W C C	20,700	1,891.00	39,143,700
タツタ電線	37,700	716.00	26,993,200
カナレ電気	2,300	1,358.00	3,123,400
平河ヒューテック	10,700	1,367.00	14,626,900
リョービ	19,700	1,532.00	30,180,400
アーレスティ	16,000	638.00	10,208,000
アサヒホールディングス	74,700	1,988.00	148,503,600
稲葉製作所	9,600	1,474.00	14,150,400
宮地エンジニアリンググループ	5,100	4,020.00	20,502,000
トーカロ	50,700	1,352.00	68,546,400
アルファC o	5,300	1,090.00	5,777,000
S U M C O	351,300	1,960.00	688,548,000
川田テクノロジーズ	4,400	4,855.00	21,362,000
R S Technologies	12,300	3,020.00	37,146,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,885.00	5,481,500
信和	7,900	737.00	5,822,300
東洋製罐グループホールディングス	122,100	2,114.00	258,119,400
ホッカンホールディングス	9,900	1,378.00	13,642,200
コロナ	10,300	886.00	9,125,800
横河ブリッジホールディングス	23,100	2,296.00	53,037,600
駒井ハルテック	2,300	1,774.00	4,080,200

高田機工	1,200	2,741.00	3,289,200
三和ホールディングス	170,000	1,584.00	269,280,000
文化シャッター	53,100	1,154.00	61,277,400
三協立山	21,100	678.00	14,305,800
アルインコ	14,100	994.00	14,015,400
東洋シャッター	3,300	541.00	1,785,300
L I X I L	268,900	1,951.00	524,623,900
日本フィルコン	9,300	462.00	4,296,600
ノーリツ	27,200	1,773.00	48,225,600
長府製作所	18,600	2,357.00	43,840,200
リンナイ	100,400	3,180.00	319,272,000
ダイニチ工業	7,100	701.00	4,977,100
日東精工	26,700	604.00	16,126,800
三洋工業	1,600	1,917.00	3,067,200
岡部	29,700	783.00	23,255,100
ジーテクト	20,600	1,394.00	28,716,400
東プレ	32,500	1,480.00	48,100,000
高周波熱錬	28,500	894.00	25,479,000
東京製綱	10,900	1,079.00	11,761,100
サンコール	12,800	502.00	6,425,600
モリテック スチール	10,600	268.00	2,840,800
パイオラックス	25,500	1,980.00	50,490,000
エイチワン	19,000	655.00	12,445,000
日本発條	163,200	994.00	162,220,800
中央発條	13,700	708.00	9,699,600
アドバネクス	1,800	1,038.00	1,868,400
立川ブラインド工業	8,300	1,258.00	10,441,400
三益半導体工業	14,200	2,853.00	40,512,600
日本ドライケミカル	3,400	1,770.00	6,018,000
日本製鋼所	49,800	2,791.00	138,991,800
三浦工業	75,500	3,810.00	287,655,000
タクマ	55,600	1,444.00	80,286,400
ツガミ	40,200	1,324.00	53,224,800
オークマ	18,100	6,410.00	116,021,000
芝浦機械	18,100	4,305.00	77,920,500
アマダ	288,300	1,353.00	390,069,900
アイダエンジニアリング	37,300	910.00	33,943,000
T A K I S A W A	3,800	1,212.00	4,605,600
F U J I	78,600	2,350.00	184,710,000
牧野フライス製作所	20,000	4,955.00	99,100,000
オーエスジー	86,300	2,019.00	174,239,700
ダイジェット工業	1,600	865.00	1,384,000

旭ダイヤモンド工業	50,600	892.00	45,135,200
D M G 森精機	109,600	2,250.00	246,600,000
ソディック	49,900	726.00	36,227,400
ディスコ	86,900	19,100.00	1,659,790,000
日東工器	8,800	2,077.00	18,277,600
日進工具	15,100	1,138.00	17,183,800
パンチ工業	12,800	496.00	6,348,800
富士ダイス	6,700	699.00	4,683,300
豊和工業	7,800	791.00	6,169,800
東洋機械金属	9,800	652.00	6,389,600
エンシュウ	3,200	687.00	2,198,400
島精機製作所	28,800	1,779.00	51,235,200
オプトラン	26,700	2,275.00	60,742,500
N C ホールディングス	2,900	2,148.00	6,229,200
イワキポンプ	12,100	1,299.00	15,717,900
フリー	19,000	1,105.00	20,995,000
ヤマシンフィルタ	43,300	318.00	13,769,400
日阪製作所	17,600	876.00	15,417,600
やまびこ	29,600	1,467.00	43,423,200
野村マイクロ・サイエンス	6,100	5,650.00	34,465,000
平田機工	8,600	6,860.00	58,996,000
P E G A S U S	20,100	572.00	11,497,200
マルマエ	7,900	1,685.00	13,311,500
タツモ	9,900	1,926.00	19,067,400
ナプテスコ	113,400	3,150.00	357,210,000
三井海洋開発	22,700	1,376.00	31,235,200
レオン自動機	19,000	1,533.00	29,127,000
S M C	58,600	73,590.00	4,312,374,000
ホソカワミクロン	12,700	2,893.00	36,741,100
ユニオンツール	8,000	3,220.00	25,760,000
オイレス工業	25,300	1,896.00	47,968,800
日精エー・エス・ビー機械	7,200	4,100.00	29,520,000
サトーホールディングス	25,700	1,955.00	50,243,500
技研製作所	17,000	2,073.00	35,241,000
日本エアーテック	9,200	1,124.00	10,340,800
カワタ	4,100	946.00	3,878,600
日精樹脂工業	13,600	967.00	13,151,200
オカダアイヨン	4,400	1,840.00	8,096,000
ワイエイシイホールディングス	6,000	2,970.00	17,820,000
小松製作所	846,500	3,471.00	2,938,201,500
住友重機械工業	106,900	3,225.00	344,752,500
日立建機	72,000	3,535.00	254,520,000

日工	27,000	638.00	17,226,000
巴工業	7,800	2,454.00	19,141,200
井関農機	17,000	1,230.00	20,910,000
TOWA	18,500	2,368.00	43,808,000
丸山製作所	2,400	1,798.00	4,315,200
北川鉄工所	7,200	1,236.00	8,899,200
ローツェ	9,400	11,140.00	104,716,000
タカキタ	4,100	443.00	1,816,300
クボタ	956,000	2,033.00	1,943,548,000
荏原実業	8,700	3,030.00	26,361,000
三菱化工機	5,900	2,414.00	14,242,600
月島ホールディングス	24,500	1,177.00	28,836,500
帝国電機製作所	12,700	2,286.00	29,032,200
新東工業	36,600	1,074.00	39,308,400
澁谷工業	17,000	2,587.00	43,979,000
アイチ コーポレーション	25,300	848.00	21,454,400
小森コーポレーション	42,000	953.00	40,026,000
鶴見製作所	13,900	2,395.00	33,290,500
日本ギア工業	4,900	383.00	1,876,700
酒井重工業	2,300	4,465.00	10,269,500
荏原製作所	74,000	6,200.00	458,800,000
石井鐵工所	1,700	2,816.00	4,787,200
西島製作所	15,700	1,652.00	25,936,400
北越工業	18,200	1,378.00	25,079,600
ダイキン工業	215,700	27,175.00	5,861,647,500
オルガノ	24,800	3,710.00	92,008,000
トーヨーカネツ	6,900	3,280.00	22,632,000
栗田工業	101,100	5,940.00	600,534,000
椿本チエイン	25,600	3,435.00	87,936,000
大同工業	5,800	733.00	4,251,400
木村化工機	14,000	742.00	10,388,000
アネスト岩田	30,800	1,062.00	32,709,600
ダイフク	279,500	2,778.00	776,451,000
サムコ	4,900	5,530.00	27,097,000
加藤製作所	6,700	1,091.00	7,309,700
油研工業	2,200	2,029.00	4,463,800
タダノ	95,400	1,079.00	102,936,600
フジテック	63,300	3,660.00	231,678,000
C K D	50,000	2,072.00	103,600,000
平和	60,100	2,491.00	149,709,100
理想科学工業	16,100	2,315.00	37,271,500
SANKYO	35,500	5,820.00	206,610,000

日本金銭機械	19,900	1,147.00	22,825,300
マースグループホールディングス	10,700	3,145.00	33,651,500
フクシマガリレイ	13,300	5,280.00	70,224,000
オーイズミ	5,400	506.00	2,732,400
ダイコク電機	9,900	2,964.00	29,343,600
竹内製作所	32,800	3,850.00	126,280,000
アマノ	51,300	2,938.00	150,719,400
JUKI	28,100	590.00	16,579,000
ジャノメ	18,400	618.00	11,371,200
マックス	22,300	2,323.00	51,802,900
グローリー	43,400	2,715.00	117,831,000
新晃工業	18,200	2,019.00	36,745,800
大和冷機工業	27,700	1,435.00	39,749,500
セガサミーホールディングス	145,200	2,753.00	399,735,600
日本ピストンリング	4,800	1,433.00	6,878,400
リケン	7,200	2,818.00	20,289,600
T P R	20,700	1,507.00	31,194,900
ツバキ・ナカシマ	44,600	910.00	40,586,000
ホシザキ	116,300	5,200.00	604,760,000
大豊工業	15,700	826.00	12,968,200
日本精工	331,900	863.00	286,429,700
NTN	356,100	293.00	104,337,300
ジェイテクト	160,800	1,186.00	190,708,800
不二越	13,400	3,960.00	53,064,000
日本トムソン	44,400	576.00	25,574,400
THK	104,300	3,025.00	315,507,500
ユーシン精機	14,400	713.00	10,267,200
前澤給装工業	12,800	1,149.00	14,707,200
イーグル工業	20,000	1,505.00	30,100,000
前澤工業	8,100	744.00	6,026,400
日本ピラー工業	16,800	3,925.00	65,940,000
キッツ	66,600	1,035.00	68,931,000
マキタ	224,800	3,865.00	868,852,000
三井E & S	84,000	506.00	42,504,000
日立造船	148,200	852.00	126,266,400
三菱重工業	315,900	5,864.00	1,852,437,600
I H I	113,900	3,395.00	386,690,500
スター精密	34,100	1,880.00	64,108,000
日清紡ホールディングス	147,100	1,070.00	157,397,000
イビデン	103,700	6,540.00	678,198,000
コニカミノルタ	404,300	478.00	193,255,400
ブラザー工業	241,500	2,118.00	511,497,000

ミネベアミツミ	314,400	2,624.00	824,985,600
日立製作所	878,400	8,086.00	7,102,742,400
東芝	347,700	4,494.00	1,562,563,800
三菱電機	1,867,000	1,784.00	3,330,728,000
富士電機	109,800	6,060.00	665,388,000
東洋電機製造	4,600	1,016.00	4,673,600
安川電機	214,100	5,770.00	1,235,357,000
シンフォニアテクノロジー	19,900	1,624.00	32,317,600
明電舎	27,400	1,879.00	51,484,600
オリジン	3,100	1,240.00	3,844,000
山洋電気	7,900	7,230.00	57,117,000
デンヨー	13,800	1,952.00	26,937,600
P H C ホールディングス	25,500	1,456.00	37,128,000
ソシオネクスト	24,800	13,900.00	344,720,000
東芝テック	27,000	4,090.00	110,430,000
芝浦メカトロニクス	3,500	14,260.00	49,910,000
マブチモーター	45,000	3,955.00	177,975,000
ニデック	439,600	7,252.00	3,187,979,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,000	493.00	6,902,000
トレックス・セミコンダクター	8,700	2,067.00	17,982,900
東光高岳	11,100	2,072.00	22,999,200
ダブル・スコープ	59,100	1,081.00	63,887,100
ダイヘン	16,300	4,930.00	80,359,000
ヤーマン	31,500	1,150.00	36,225,000
J V C ケンウッド	165,300	495.00	81,823,500
ミマキエンジニアリング	17,700	748.00	13,239,600
I - P E X	10,300	1,281.00	13,194,300
大崎電気工業	42,800	566.00	24,224,800
オムロン	165,500	8,501.00	1,406,915,500
日東工業	24,400	3,125.00	76,250,000
I D E C	26,700	3,200.00	85,440,000
正興電機製作所	5,700	1,003.00	5,717,100
不二電機工業	3,200	1,114.00	3,564,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,500	2,463.00	146,548,500
サクサホールディングス	2,900	1,885.00	5,466,500
メルコホールディングス	4,600	3,305.00	15,203,000
テクノメディカ	4,600	1,825.00	8,395,000
日本電気	255,500	6,470.00	1,653,085,000
富士通	180,000	18,410.00	3,313,800,000
沖電気工業	81,700	814.00	66,503,800
岩崎通信機	6,100	860.00	5,246,000
電気興業	7,300	2,213.00	16,154,900

サンケン電気	16,800	10,630.00	178,584,000
ナカヨ	2,200	1,114.00	2,450,800
アイホン	11,000	2,296.00	25,256,000
ルネサスエレクトロニクス	1,178,900	2,124.50	2,504,573,050
セイコーエプソン	231,800	2,144.00	496,979,200
ワコム	137,900	738.00	101,770,200
アルバック	42,900	5,450.00	233,805,000
アクセル	5,500	1,307.00	7,188,500
E I Z O	13,200	4,765.00	62,898,000
日本信号	41,100	1,074.00	44,141,400
京三製作所	37,800	435.00	16,443,000
能美防災	24,600	1,867.00	45,928,200
ホーチキ	13,700	1,639.00	22,454,300
星和電機	6,400	483.00	3,091,200
エレコム	43,500	1,415.00	61,552,500
パナソニック ホールディングス	2,133,900	1,446.50	3,086,686,350
シャープ	217,500	847.00	184,222,500
アンリツ	127,200	1,213.00	154,293,600
富士通ゼネラル	51,200	3,225.00	165,120,000
ソニーグループ	1,265,200	13,185.00	16,681,662,000
T D K	286,100	5,220.00	1,493,442,000
帝国通信工業	8,400	1,552.00	13,036,800
タムラ製作所	77,500	705.00	54,637,500
アルプスアルパイン	161,600	1,244.00	201,030,400
池上通信機	4,400	610.00	2,684,000
日本電波工業	22,000	1,273.00	28,006,000
鈴木	10,100	885.00	8,938,500
メイコー	19,900	2,521.00	50,167,900
日本トリム	4,200	2,892.00	12,146,400
ローランド ディー . ジー .	10,000	3,400.00	34,000,000
フォスター電機	16,700	1,030.00	17,201,000
S M K	4,300	2,405.00	10,341,500
ヨコオ	14,600	1,697.00	24,776,200
ホシデン	42,400	1,707.00	72,376,800
ヒロセ電機	29,900	19,190.00	573,781,000
日本航空電子工業	37,000	2,611.00	96,607,000
T O A	20,500	864.00	17,712,000
マクセル	36,800	1,462.00	53,801,600
古野電気	23,900	972.00	23,230,800
スミダコーポレーション	16,800	1,325.00	22,260,000
アイコム	7,000	2,930.00	20,510,000
リオン	7,600	1,867.00	14,189,200

横河電機	197,600	2,622.00	518,107,200
新電元工業	6,900	3,315.00	22,873,500
アズビル	125,000	4,420.00	552,500,000
東亜ディーケーケー	7,000	847.00	5,929,000
日本光電工業	82,700	3,795.00	313,846,500
チノー	7,400	2,190.00	16,206,000
共和電業	13,000	360.00	4,680,000
日本電子材料	11,800	1,523.00	17,971,400
堀場製作所	39,800	7,700.00	306,460,000
アドバンテスト	140,900	14,060.00	1,981,054,000
小野測器	6,000	438.00	2,628,000
エスベック	14,500	2,030.00	29,435,000
キーエンス	178,900	68,410.00	12,238,549,000
日置電機	9,400	9,280.00	87,232,000
シスメックス	154,300	9,360.00	1,444,248,000
日本マイクロニクス	29,700	1,578.00	46,866,600
メガチップス	14,800	3,390.00	50,172,000
O B A R A G R O U P	9,900	4,170.00	41,283,000
澤藤電機	2,000	1,130.00	2,260,000
原田工業	6,600	808.00	5,332,800
コーセル	21,800	1,139.00	24,830,200
イリソ電子工業	16,500	4,265.00	70,372,500
オブテックスグループ	33,000	1,963.00	64,779,000
千代田インテグレ	6,400	2,373.00	15,187,200
レーザーテック	82,000	22,660.00	1,858,120,000
スタンレー電気	127,400	2,936.00	374,046,400
ウシオ電機	91,100	1,858.00	169,263,800
岡谷電機産業	12,100	275.00	3,327,500
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	697.00	9,270,100
エノモト	3,800	1,633.00	6,205,400
日本セラミック	18,400	2,654.00	48,833,600
遠藤照明	6,500	1,206.00	7,839,000
古河電池	13,500	1,090.00	14,715,000
双信電機	6,600	370.00	2,442,000
山一電機	15,800	1,918.00	30,304,400
図研	15,700	3,560.00	55,892,000
日本電子	44,900	4,225.00	189,702,500
カシオ計算機	133,200	1,191.00	158,641,200
ファナック	877,800	4,799.00	4,212,562,200
日本シイエムケイ	38,800	470.00	18,236,000
エンプラス	5,300	4,435.00	23,505,500
大真空	22,400	695.00	15,568,000

ローム	82,700	11,750.00	971,725,000
浜松ホトニクス	143,600	7,200.00	1,033,920,000
三井ハイテック	18,500	9,260.00	171,310,000
新光電気工業	63,400	4,650.00	294,810,000
京セラ	277,900	7,549.00	2,097,867,100
太陽誘電	87,200	4,110.00	358,392,000
村田製作所	542,500	8,046.00	4,364,955,000
双葉電子工業	34,800	504.00	17,539,200
北陸電気工業	5,500	1,188.00	6,534,000
ニチコン	36,800	1,316.00	48,428,800
日本ケミコン	17,900	1,511.00	27,046,900
K O A	27,300	1,707.00	46,601,100
市光工業	26,500	517.00	13,700,500
小糸製作所	215,200	2,682.00	577,166,400
ミツバ	33,500	711.00	23,818,500
S C R E E Nホールディングス	30,600	13,070.00	399,942,000
キャノン電子	20,000	1,915.00	38,300,000
キャノン	981,300	3,428.00	3,363,896,400
リコー	448,500	1,165.00	522,502,500
象印マホービン	53,600	1,734.00	92,942,400
M U T O Hホールディングス	2,100	1,748.00	3,670,800
東京エレクトロン	378,500	18,250.00	6,907,625,000
イノテック	12,200	1,520.00	18,544,000
トヨタ紡織	75,400	2,292.00	172,816,800
芦森工業	2,600	1,678.00	4,362,800
ユニプレス	32,200	1,005.00	32,361,000
豊田自動織機	130,800	8,370.00	1,094,796,000
モリタホールディングス	31,400	1,516.00	47,602,400
三櫻工業	27,400	758.00	20,769,200
デンソー	368,900	8,687.00	3,204,634,300
東海理化電機製作所	50,500	1,895.00	95,697,500
川崎重工業	134,800	2,958.00	398,738,400
名村造船所	35,700	515.00	18,385,500
日本車輛製造	6,900	2,045.00	14,110,500
三菱ロジスネクスト	28,500	1,153.00	32,860,500
近畿車輛	1,900	1,481.00	2,813,900
日産自動車	2,540,800	520.90	1,323,502,720
いすゞ自動車	520,000	1,708.00	888,160,000
トヨタ自動車	9,821,200	1,956.50	19,215,177,800
日野自動車	230,600	563.00	129,827,800
三菱自動車工業	697,800	473.00	330,059,400
エフテック	9,700	730.00	7,081,000

レシップホールディングス	5,500	491.00	2,700,500	
G M B	2,800	1,485.00	4,158,000	
ファルテック	2,300	624.00	1,435,200	
武蔵精密工業	43,700	1,796.00	78,485,200	
日産車体	31,600	894.00	28,250,400	
新明和工業	56,200	1,254.00	70,474,800	
極東開発工業	29,500	1,678.00	49,501,000	
トピー工業	14,500	2,003.00	29,043,500	
ティラド	4,500	1,900.00	8,550,000	
曙ブレーキ工業	109,200	139.00	15,178,800	
タチエス	28,300	1,410.00	39,903,000	
N O K	69,500	1,865.00	129,617,500	
フタバ産業	48,100	472.00	22,703,200	
K Y B	17,200	4,650.00	79,980,000	
大同メタル工業	35,100	489.00	17,163,900	
プレス工業	80,000	564.00	45,120,000	
ミクニ	16,200	399.00	6,463,800	
太平洋工業	41,100	1,222.00	50,224,200	
アイシン	138,000	3,955.00	545,790,000	
マツダ	591,600	1,219.00	721,160,400	
今仙電機製作所	8,900	625.00	5,562,500	
本田技研工業	1,453,900	3,958.00	5,754,536,200	
スズキ	328,500	4,627.00	1,519,969,500	
S U B A R U	565,900	2,363.50	1,337,504,650	
安永	6,100	937.00	5,715,700	
ヤマハ発動機	281,100	3,535.00	993,688,500	
T B K	14,100	310.00	4,371,000	
エクセディ	29,300	2,173.00	63,668,900	
豊田合成	52,200	2,336.00	121,939,200	
愛三工業	29,600	1,001.00	29,629,600	
盟和産業	2,100	973.00	2,043,300	
日本プラスト	11,100	453.00	5,028,300	
ヨロズ	16,900	834.00	14,094,600	
エフ・シー・シー	31,700	1,719.00	54,492,300	
シマノ	73,200	21,745.00	1,591,734,000	
テイ・エス テック	81,900	1,858.00	152,170,200	
ジャムコ	7,600	1,412.00	10,731,200	
テルモ	550,100	4,189.00	2,304,368,900	
クリエートメディック	4,500	902.00	4,059,000	
日機装	41,700	902.00	37,613,400	
日本エム・ディ・エム	10,600	964.00	10,218,400	
島津製作所	217,800	4,400.00	958,320,000	

JMS	16,600	528.00	8,764,800
長野計器	13,000	1,693.00	22,009,000
ブイ・テクノロジー	8,800	2,545.00	22,396,000
東京計器	13,700	1,279.00	17,522,300
愛知時計電機	7,000	1,608.00	11,256,000
インターアクション	8,500	1,413.00	12,010,500
オーバル	12,300	389.00	4,784,700
東京精密	39,200	5,560.00	217,952,000
マニー	71,600	1,714.00	122,722,400
ニコン	258,600	1,543.00	399,019,800
トプコン	94,200	1,930.00	181,806,000
オリンパス	1,101,000	2,200.50	2,422,750,500
理研計器	11,100	4,800.00	53,280,000
タムロン	13,400	3,555.00	47,637,000
HOYA	382,000	16,140.00	6,165,480,000
シード	7,100	581.00	4,125,100
ノーリツ鋼機	17,000	2,239.00	38,063,000
A & Dホロンホールディングス	26,100	1,395.00	36,409,500
朝日インテック	199,900	2,754.00	550,524,600
シチズン時計	196,700	796.00	156,573,200
リズム	4,300	1,722.00	7,404,600
大研医器	10,500	504.00	5,292,000
メニコン	61,400	2,631.00	161,543,400
シンシア	1,300	549.00	713,700
松風	8,100	2,164.00	17,528,400
セイコーグループ	27,700	2,556.00	70,801,200
ニプロ	149,100	1,026.00	152,976,600
KYORITSU	20,700	145.00	3,001,500
中本パックス	4,200	1,619.00	6,799,800
スノーピーク	30,600	1,884.00	57,650,400
パラマウントベッドホールディングス	41,300	2,421.00	99,987,300
トランザクション	11,800	1,736.00	20,484,800
粧美堂	3,800	380.00	1,444,000
ニホンフラッシュ	16,800	1,071.00	17,992,800
前田工織	15,100	3,040.00	45,904,000
永大産業	14,800	218.00	3,226,400
アートネイチャー	18,400	766.00	14,094,400
バンダイナムコホールディングス	490,000	3,340.00	1,636,600,000
アイフィスジャパン	3,800	627.00	2,382,600
SHOEI	40,400	2,650.00	107,060,000
フランスベッドホールディングス	22,200	1,115.00	24,753,000
パイロットコーポレーション	28,000	4,710.00	131,880,000

萩原工業	12,000	1,275.00	15,300,000
フジシールインターナショナル	36,200	1,546.00	55,965,200
タカラトミー	82,600	1,701.00	140,502,600
広済堂ホールディングス	9,400	2,375.00	22,325,000
エステールホールディングス	3,200	615.00	1,968,000
タカノ	5,200	733.00	3,811,600
プロネクサス	14,800	987.00	14,607,600
ホクシン	10,600	130.00	1,378,000
ウッドワン	4,600	1,242.00	5,713,200
大建工業	10,900	2,267.00	24,710,300
凸版印刷	233,900	2,903.00	679,011,700
大日本印刷	195,500	4,010.00	783,955,000
共同印刷	5,000	2,798.00	13,990,000
N I S S H A	34,000	1,643.00	55,862,000
光村印刷	1,200	1,178.00	1,413,600
TAKARA & COMPANY	11,400	2,353.00	26,824,200
アシックス	165,100	3,755.00	619,950,500
ツツミ	3,100	2,176.00	6,745,600
ローランド	13,200	4,090.00	53,988,000
小松ウオール工業	6,600	2,424.00	15,998,400
ヤマハ	112,800	5,580.00	629,424,000
河合楽器製作所	4,800	3,170.00	15,216,000
クリナップ	20,000	684.00	13,680,000
ピジョン	113,900	2,103.00	239,531,700
キングジム	15,800	918.00	14,504,400
リンテック	35,900	2,275.00	81,672,500
イトーキ	36,700	830.00	30,461,000
任天堂	1,129,200	5,930.00	6,696,156,000
三菱鉛筆	25,400	1,753.00	44,526,200
タカラスタANDARD	32,900	1,733.00	57,015,700
コクヨ	86,100	2,001.00	172,286,100
ナカバヤシ	19,300	484.00	9,341,200
グローブライド	14,400	2,246.00	32,342,400
オカムラ	53,800	1,741.00	93,665,800
美津濃	17,800	3,570.00	63,546,000
東京電力ホールディングス	1,612,300	491.00	791,639,300
中部電力	659,100	1,668.00	1,099,378,800
関西電力	690,700	1,617.00	1,116,861,900
中国電力	284,800	830.00	236,384,000
北陸電力	168,800	748.00	126,262,400
東北電力	437,300	828.00	362,084,400
四国電力	152,700	927.00	141,552,900

九州電力	412,300	877.00	361,587,100
北海道電力	172,800	572.00	98,841,600
沖縄電力	41,900	1,213.00	50,824,700
電源開発	134,700	2,134.00	287,449,800
エフオン	11,600	578.00	6,704,800
イーレックス	31,800	1,271.00	40,417,800
レノバ	47,600	1,668.00	79,396,800
東京瓦斯	378,100	3,005.00	1,136,190,500
大阪瓦斯	362,300	2,302.00	834,014,600
東邦瓦斯	70,400	2,583.00	181,843,200
北海道瓦斯	10,700	2,076.00	22,213,200
広島ガス	37,700	368.00	13,873,600
西部ガスホールディングス	16,800	2,020.00	33,936,000
静岡ガス	40,800	1,203.00	49,082,400
メタウォーター	22,400	1,788.00	40,051,200
SBSホールディングス	15,900	3,180.00	50,562,000
東武鉄道	196,500	3,615.00	710,347,500
相鉄ホールディングス	59,100	2,627.00	155,255,700
東急	501,500	1,890.00	947,835,000
京浜急行電鉄	202,900	1,338.00	271,480,200
小田急電鉄	271,100	2,080.00	563,888,000
京王電鉄	94,600	5,100.00	482,460,000
京成電鉄	115,300	5,170.00	596,101,000
富士急行	22,000	5,180.00	113,960,000
東日本旅客鉄道	303,300	7,806.00	2,367,559,800
西日本旅客鉄道	228,500	5,939.00	1,357,061,500
東海旅客鉄道	137,800	16,725.00	2,304,705,000
西武ホールディングス	216,400	1,500.00	324,600,000
鴻池運輸	30,500	1,646.00	50,203,000
西日本鉄道	47,800	2,429.00	116,106,200
ハマキョウレックス	14,000	3,580.00	50,120,000
サカイ引越センター	8,500	4,685.00	39,822,500
近鉄グループホールディングス	178,500	4,660.00	831,810,000
阪急阪神ホールディングス	238,100	4,420.00	1,052,402,000
南海電気鉄道	85,300	3,215.00	274,239,500
京阪ホールディングス	98,400	3,615.00	355,716,000
神戸電鉄	4,900	3,130.00	15,337,000
名古屋鉄道	197,300	2,368.00	467,206,400
山陽電気鉄道	13,400	2,313.00	30,994,200
アルプス物流	14,200	1,333.00	18,928,600
ヤマトホールディングス	228,600	2,555.00	584,073,000
山九	45,400	4,940.00	224,276,000

丸運	6,800	238.00	1,618,400
丸全昭和運輸	11,000	3,685.00	40,535,000
センコーグループホールディングス	94,600	947.00	89,586,200
トナミホールディングス	3,900	4,260.00	16,614,000
ニッコンホールディングス	57,200	2,725.00	155,870,000
日本石油輸送	1,400	2,840.00	3,976,000
福山通運	13,600	3,475.00	47,260,000
セイノーホールディングス	111,100	1,601.00	177,871,100
エスライン	3,900	795.00	3,100,500
神奈川中央交通	5,100	3,210.00	16,371,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	43,100	2,072.00	89,303,200
C & F ロジホールディングス	17,200	1,353.00	23,271,600
九州旅客鉄道	126,300	3,035.00	383,320,500
S Gホールディングス	342,700	2,162.00	740,917,400
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,700	8,340.00	556,278,000
日本郵船	478,100	3,027.00	1,447,208,700
商船三井	315,100	3,210.00	1,011,471,000
川崎汽船	134,500	3,305.00	444,522,500
N S ユナイテッド海運	9,900	3,430.00	33,957,000
飯野海運	66,900	834.00	55,794,600
共栄タンカー	3,700	853.00	3,156,100
乾汽船	23,500	1,393.00	32,735,500
日本航空	438,600	2,653.00	1,163,605,800
A N Aホールディングス	485,900	3,030.00	1,472,277,000
パスコ	2,700	1,620.00	4,374,000
トランコム	5,200	6,750.00	35,100,000
日新	13,600	2,546.00	34,625,600
三菱倉庫	38,400	3,495.00	134,208,000
三井倉庫ホールディングス	16,700	3,485.00	58,199,500
住友倉庫	48,200	2,272.00	109,510,400
澁澤倉庫	7,100	2,375.00	16,862,500
東陽倉庫	18,400	274.00	5,041,600
日本トランスシティ	35,900	635.00	22,796,500
ケイヒン	2,400	1,722.00	4,132,800
中央倉庫	8,600	1,056.00	9,081,600
川西倉庫	2,300	1,017.00	2,339,100
安田倉庫	12,200	971.00	11,846,200
ファイズホールディングス	2,500	1,282.00	3,205,000
東洋埠頭	4,000	1,329.00	5,316,000
上組	85,600	3,135.00	268,356,000
サンリツ	3,100	713.00	2,210,300
キムラユニティー	6,600	1,132.00	7,471,200

キユーソー流通システム	8,300	997.00	8,275,100
東海運	8,100	283.00	2,292,300
エーアイテーター	11,200	1,671.00	18,715,200
内外トランスライン	6,400	2,493.00	15,955,200
日本コンセプト	5,600	1,663.00	9,312,800
NEC ネットエスアイ	60,100	1,921.00	115,452,100
クロスキャット	10,500	1,138.00	11,949,000
システナ	302,400	307.00	92,836,800
デジタルアーツ	11,400	5,730.00	65,322,000
日鉄ソリューションズ	30,700	4,070.00	124,949,000
キューブシステム	10,900	1,174.00	12,796,600
コア	8,100	1,722.00	13,948,200
手間いらず	3,100	4,170.00	12,927,000
ラクーンホールディングス	15,200	741.00	11,263,200
ソリトンシステムズ	9,500	1,200.00	11,400,000
ソフトクリエイティブホールディングス	14,900	1,673.00	24,927,700
T I S	196,300	3,985.00	782,255,500
J N Sホールディングス	7,000	390.00	2,730,000
グリー	48,500	692.00	33,562,000
G M Oペパボ	2,700	1,680.00	4,536,000
コーエーテクモホールディングス	112,500	2,380.00	267,750,000
三菱総合研究所	8,800	5,210.00	45,848,000
電算	1,800	1,608.00	2,894,400
A G S	6,200	705.00	4,371,000
ファインデックス	14,700	584.00	8,584,800
ブレインパッド	13,800	744.00	10,267,200
K L a b	35,700	350.00	12,495,000
ポルトゥウィンホールディングス	30,900	961.00	29,694,900
ネクソン	464,600	3,055.00	1,419,353,000
アイスタイル	52,600	551.00	28,982,600
エムアップホールディングス	22,200	1,217.00	27,017,400
エイチーム	11,000	694.00	7,634,000
エニグモ	23,500	405.00	9,517,500
テクノスジャパン	11,900	534.00	6,354,600
コロブラ	70,000	677.00	47,390,000
ブロードリーフ	105,400	425.00	44,795,000
クロス・マーケティンググループ	8,800	691.00	6,080,800
デジタルハーツホールディングス	11,400	1,340.00	15,276,000
システム情報	14,600	746.00	10,891,600
メディアドゥ	7,400	1,350.00	9,990,000
じげん	52,700	640.00	33,728,000
バイキューブ	22,100	510.00	11,271,000

エンカレッジ・テクノロジー	3,700	504.00	1,864,800
サイバーリンクス	4,800	702.00	3,369,600
フィックスターズ	20,400	1,333.00	27,193,200
CARTA HOLDINGS	8,600	1,343.00	11,549,800
オブティム	15,000	1,050.00	15,750,000
セレス	7,400	1,104.00	8,169,600
SHIFT	11,900	24,800.00	295,120,000
ティーガイア	18,900	1,686.00	31,865,400
セック	2,000	3,105.00	6,210,000
テクマトリックス	32,900	1,822.00	59,943,800
プロシップ	8,000	1,411.00	11,288,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52,600	2,828.00	148,752,800
GMOペイメントゲートウェイ	35,900	11,290.00	405,311,000
ザッパラス	4,500	352.00	1,584,000
システムリサーチ	5,700	2,324.00	13,246,800
インターネットイニシアティブ	100,200	2,757.00	276,251,400
さくらインターネット	20,500	656.00	13,448,000
ヴィンクス	4,300	1,415.00	6,084,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,500	3,590.00	19,745,000
SRAホールディングス	9,300	3,070.00	28,551,000
システムインテグレータ	4,800	424.00	2,035,200
朝日ネット	19,700	617.00	12,154,900
eBASE	25,600	749.00	19,174,400
アバントグループ	22,900	1,433.00	32,815,700
アドソル日進	7,700	1,772.00	13,644,400
ODKソリューションズ	3,500	585.00	2,047,500
フリービット	9,600	1,558.00	14,956,800
コムチュア	23,800	2,165.00	51,527,000
サイバーコム	2,400	1,541.00	3,698,400
アステリア	14,400	660.00	9,504,000
アイル	8,500	2,747.00	23,349,500
マークラインズ	9,800	2,610.00	25,578,000
メディカル・データ・ビジョン	27,100	742.00	20,108,200
gumi	26,700	729.00	19,464,300
ショーケース	4,000	300.00	1,200,000
モバイルファクトリー	3,200	861.00	2,755,200
テラスカイ	7,800	2,487.00	19,398,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,500	1,513.00	15,886,500
PCIホールディングス	5,600	1,014.00	5,678,400
アイビーシー	2,600	626.00	1,627,600
ネオジャパン	6,300	934.00	5,884,200
PR TIMES	4,700	1,426.00	6,702,200

ラクス	85,000	2,203.00	187,255,000
ランドコンピュータ	3,600	1,222.00	4,399,200
ダブルスタンダード	7,400	2,356.00	17,434,400
オープンドア	12,700	1,324.00	16,814,800
アカツキ	8,600	2,192.00	18,851,200
ベネフィットジャパン	1,000	1,196.00	1,196,000
U b i c o mホールディングス	5,700	1,920.00	10,944,000
カナミックネットワーク	19,900	471.00	9,372,900
ノムラシステムコーポレーション	15,300	118.00	1,805,400
チェンジホールディングス	44,000	2,014.00	88,616,000
シンクロ・フード	9,200	661.00	6,081,200
オークネット	9,000	1,745.00	15,705,000
キャピタル・アセット・プランニング	3,000	698.00	2,094,000
セグエグループ	4,100	1,035.00	4,243,500
エイトレッド	2,300	1,434.00	3,298,200
マクロミル	35,500	925.00	32,837,500
ビーグリー	2,600	1,152.00	2,995,200
オロ	5,500	2,199.00	12,094,500
ユーザーローカル	6,600	2,114.00	13,952,400
テモナ	4,100	266.00	1,090,600
ニーズウェル	4,000	1,319.00	5,276,000
マネーフォワード	43,300	5,700.00	246,810,000
サインポスト	5,400	525.00	2,835,000
Sun Asterisk	12,900	1,223.00	15,776,700
電算システムホールディングス	8,700	3,165.00	27,535,500
Appier Group	68,100	1,333.00	90,777,300
ソルクシーズ	12,000	409.00	4,908,000
フェイス	4,400	505.00	2,222,000
プロトコーポレーション	22,700	1,094.00	24,833,800
ハイマックス	5,800	1,395.00	8,091,000
野村総合研究所	357,400	3,585.00	1,281,279,000
サイバネットシステム	15,300	855.00	13,081,500
CEホールディングス	7,700	557.00	4,288,900
日本システム技術	5,900	2,062.00	12,165,800
インテージホールディングス	20,400	1,630.00	33,252,000
東邦システムサイエンス	4,100	1,127.00	4,620,700
ソースネクスト	92,400	192.00	17,740,800
インフォコム	23,200	2,249.00	52,176,800
シンプレクス・ホールディングス	30,700	2,289.00	70,272,300
HEROZ	6,200	1,388.00	8,605,600
ラクスル	43,200	1,321.00	57,067,200
メルカリ	108,100	2,820.00	304,842,000

I P S	5,900	2,345.00	13,835,500
F I G	17,000	280.00	4,760,000
システムサポート	7,100	1,795.00	12,744,500
イーソル	11,700	953.00	11,150,100
アルテリア・ネットワークス	16,900	1,961.00	33,140,900
東海ソフト	2,300	1,032.00	2,373,600
ウイングアーク1st	18,600	2,252.00	41,887,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	1,524.00	7,620,000
サーバーワークス	3,800	1,996.00	7,584,800
東名	1,200	2,019.00	2,422,800
ヴィッツ	1,600	1,150.00	1,840,000
トピラシステムズ	3,700	983.00	3,637,100
S a n s a n	58,800	1,672.00	98,313,600
L i n k - U	3,600	1,049.00	3,776,400
ギフトィ	19,600	2,234.00	43,786,400
メドレー	24,100	4,785.00	115,318,500
ベース	6,100	5,530.00	33,733,000
J M D C	29,500	5,660.00	166,970,000
フォーカスシステムズ	13,300	1,027.00	13,659,100
クレスコ	14,000	1,951.00	27,314,000
フジ・メディア・ホールディングス	172,500	1,365.00	235,462,500
オービック	60,000	23,080.00	1,384,800,000
ジャストシステム	25,800	4,390.00	113,262,000
T D C ソフト	15,300	1,452.00	22,215,600
Zホールディングス	2,553,600	353.00	901,420,800
トレンドマイクロ	103,600	6,550.00	678,580,000
I Dホールディングス	12,300	1,123.00	13,812,900
日本オラクル	34,300	10,800.00	370,440,000
アルファシステムズ	5,700	3,590.00	20,463,000
フューチャー	44,800	1,764.00	79,027,200
C A C H o l d i n g s	11,100	1,695.00	18,814,500
S Bテクノロジー	7,700	2,420.00	18,634,000
トーセ	4,400	725.00	3,190,000
オービックビジネスコンサルタント	35,400	5,370.00	190,098,000
伊藤忠テクノソリューションズ	96,400	3,635.00	350,414,000
アイティフォー	23,900	983.00	23,493,700
東計電算	2,500	6,140.00	15,350,000
エクスネット	2,200	1,002.00	2,204,400
大塚商会	101,700	5,230.00	531,891,000
サイボウズ	24,800	2,519.00	62,471,200
電通国際情報サービス	21,800	5,110.00	111,398,000
A C C E S S	21,500	862.00	18,533,000

デジタルガレージ	31,900	4,170.00	133,023,000
E Mシステムズ	30,200	800.00	24,160,000
ウェザーニューズ	5,600	6,930.00	38,808,000
C I J	30,300	527.00	15,968,100
ビジネスエンジニアリング	3,000	3,490.00	10,470,000
日本エンタープライズ	16,200	138.00	2,235,600
WOWOW	13,700	1,134.00	15,535,800
スカラ	17,000	756.00	12,852,000
インテリジェント ウェイブ	7,800	771.00	6,013,800
I M A G I C A G R O U P	15,400	595.00	9,163,000
ネットワンシステムズ	66,900	3,235.00	216,421,500
システムソフト	65,900	73.00	4,810,700
アルゴグラフィックス	16,500	4,025.00	66,412,500
マーベラス	29,500	680.00	20,060,000
エイベックス	30,600	1,531.00	46,848,600
B I P R O G Y	66,100	3,425.00	226,392,500
都築電気	9,600	1,764.00	16,934,400
T B S ホールディングス	91,900	2,217.00	203,742,300
日本テレビホールディングス	159,000	1,288.00	204,792,000
朝日放送グループホールディングス	17,200	648.00	11,145,600
テレビ朝日ホールディングス	43,700	1,535.00	67,079,500
スカパーJ S A Tホールディングス	159,600	541.00	86,343,600
テレビ東京ホールディングス	13,000	2,747.00	35,711,000
日本BS放送	5,300	906.00	4,801,800
ビジョン	23,800	1,675.00	39,865,000
スマートバリュー	4,000	400.00	1,600,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	20,200	3,170.00	64,034,000
ワイヤレスゲート	7,200	226.00	1,627,200
クロップス	2,500	1,034.00	2,585,000
日本電信電話	2,298,600	4,131.00	9,495,516,600
K D D I	1,386,200	4,415.00	6,120,073,000
ソフトバンク	2,881,900	1,504.00	4,334,377,600
光通信	21,100	20,050.00	423,055,000
エムティーアイ	12,700	598.00	7,594,600
G M O インターネットグループ	66,400	2,692.00	178,748,800
ファイバーゲート	9,800	1,416.00	13,876,800
アйдママーケティングコミュニケーション	4,000	277.00	1,108,000
K A D O K A W A	94,900	3,160.00	299,884,000
学研ホールディングス	30,100	887.00	26,698,700
ゼンリン	30,900	904.00	27,933,600
昭文社ホールディングス	6,800	297.00	2,019,600
インプレスホールディングス	13,400	208.00	2,787,200

アイネット	11,000	1,456.00	16,016,000
松竹	10,300	12,050.00	124,115,000
東宝	112,300	5,540.00	622,142,000
東映	5,000	17,650.00	88,250,000
エヌ・ティ・ティ・データ	563,000	2,017.00	1,135,571,000
ピー・シー・エー	10,500	1,269.00	13,324,500
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	2,095.00	16,341,000
D T S	38,300	3,475.00	133,092,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	90,200	6,520.00	588,104,000
シーイーシー	25,300	1,443.00	36,507,900
カブコン	178,300	5,580.00	994,914,000
アイ・エス・ピー	9,300	1,528.00	14,210,400
ジャステック	11,200	1,260.00	14,112,000
S C S K	146,500	2,276.00	333,434,000
N S W	7,100	2,383.00	16,919,300
アイネス	12,800	1,448.00	18,534,400
T K C	28,700	3,665.00	105,185,500
富士ソフト	20,300	8,960.00	181,888,000
N S D	64,100	2,722.00	174,480,200
コナミグループ	76,800	7,450.00	572,160,000
福井コンピュータホールディングス	12,600	2,745.00	34,587,000
J B C Cホールディングス	13,200	2,227.00	29,396,400
ミロク情報サービス	16,500	1,507.00	24,865,500
ソフトバンクグループ	885,000	5,058.00	4,476,330,000
高千穂交易	5,300	2,576.00	13,652,800
オルバヘルスケアホールディングス	2,200	1,844.00	4,056,800
伊藤忠食品	4,300	5,230.00	22,489,000
エレマテック	17,000	1,755.00	29,835,000
あらた	14,500	4,580.00	66,410,000
トーメンデバイス	2,700	5,810.00	15,687,000
東京エレクトロン デバイス	7,000	8,880.00	62,160,000
円谷フィールズホールディングス	32,500	2,325.00	75,562,500
双日	200,900	2,855.00	573,569,500
アルフレッサ ホールディングス	190,000	2,177.00	413,630,000
横浜冷凍	51,600	1,088.00	56,140,800
ラサ商事	6,800	1,373.00	9,336,400
アルコニックス	24,900	1,340.00	33,366,000
神戸物産	146,400	4,090.00	598,776,000
ハイパー	2,800	446.00	1,248,800
あい ホールディングス	30,300	2,332.00	70,659,600
ディーブイエックス	4,100	971.00	3,981,100
ダイワボウホールディングス	77,300	2,626.00	202,989,800

マクニカホールディングス	44,800	4,705.00	210,784,000
ラクト・ジャパン	7,300	2,012.00	14,687,600
グリムス	7,900	2,537.00	20,042,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,700	957.00	26,508,900
八洲電機	15,300	1,270.00	19,431,000
メディアスホールディングス	12,100	809.00	9,788,900
レスターホールディングス	18,100	2,304.00	41,702,400
ジューテックホールディングス	3,400	1,163.00	3,954,200
大光	6,200	602.00	3,732,400
OCHIホールディングス	3,400	1,230.00	4,182,000
TOKAIホールディングス	93,500	878.00	82,093,000
黒谷	4,100	606.00	2,484,600
Cominix	2,900	782.00	2,267,800
三洋貿易	21,400	1,286.00	27,520,400
ビューティガレージ	3,000	3,810.00	11,430,000
ウイン・パートナーズ	13,800	1,000.00	13,800,000
ミタチ産業	3,800	1,400.00	5,320,000
シップヘルスケアホールディングス	68,000	2,411.00	163,948,000
明治電機工業	7,000	1,292.00	9,044,000
デリカフーズホールディングス	5,800	570.00	3,306,000
スターティアホールディングス	2,900	1,200.00	3,480,000
コメダホールディングス	46,400	2,670.00	123,888,000
ピーバンドットコム	2,100	471.00	989,100
アセンテック	6,400	566.00	3,622,400
富士興産	3,300	1,384.00	4,567,200
協栄産業	1,400	1,929.00	2,700,600
フルサト・マルカホールディングス	18,800	2,639.00	49,613,200
ヤマエグループホールディングス	10,700	2,340.00	25,038,000
小野建	18,600	1,529.00	28,439,400
南陽	2,800	2,153.00	6,028,400
佐島電機	9,300	1,704.00	15,847,200
エコートレーディング	2,900	763.00	2,212,700
伯東	10,800	4,700.00	50,760,000
コンドーテック	14,600	1,098.00	16,030,800
中山福	7,900	339.00	2,678,100
ナガイレーベン	23,900	2,149.00	51,361,100
三菱食品	17,500	3,730.00	65,275,000
松田産業	14,400	2,167.00	31,204,800
第一興商	73,200	2,420.00	177,144,000
メディバルホールディングス	181,000	2,257.00	408,517,000
S P K	8,400	1,740.00	14,616,000
萩原電気ホールディングス	7,200	3,145.00	22,644,000

アズワン	26,900	5,530.00	148,757,000
スズデン	6,600	2,247.00	14,830,200
尾家産業	3,500	1,159.00	4,056,500
シモジマ	13,000	1,083.00	14,079,000
ドウシシャ	20,000	2,214.00	44,280,000
小津産業	3,300	1,780.00	5,874,000
高速	9,800	2,001.00	19,609,800
たけびし	7,200	1,675.00	12,060,000
リックス	3,000	2,729.00	8,187,000
丸文	16,900	1,120.00	18,928,000
ハピネット	16,100	2,029.00	32,666,900
橋本総業ホールディングス	7,500	1,134.00	8,505,000
日本ライフライン	55,500	1,059.00	58,774,500
タカショー	16,500	748.00	12,342,000
I D O M	57,200	878.00	50,221,600
進和	11,600	2,167.00	25,137,200
エスケイジャパン	3,600	537.00	1,933,200
ダイترون	7,500	2,831.00	21,232,500
シークス	27,000	1,444.00	38,988,000
田中商事	4,200	654.00	2,746,800
オーハシテクニカ	9,200	1,600.00	14,720,000
白銅	6,800	2,367.00	16,095,600
ダイコー通産	1,500	1,343.00	2,014,500
伊藤忠商事	1,166,100	4,780.00	5,573,958,000
丸紅	1,476,800	1,965.50	2,902,650,400
高島	2,300	3,360.00	7,728,000
長瀬産業	86,800	2,365.00	205,282,000
蝶理	10,200	2,678.00	27,315,600
豊田通商	165,800	6,180.00	1,024,644,000
三共生興	27,200	570.00	15,504,000
兼松	73,500	1,860.00	136,710,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,348.00	2,830,800
三井物産	1,343,000	4,431.00	5,950,833,000
日本紙パルプ商事	10,100	5,020.00	50,702,000
カメイ	20,100	1,452.00	29,185,200
東都水産	800	6,640.00	5,312,000
O U G ホールディングス	2,200	2,470.00	5,434,000
スターゼン	14,400	2,361.00	33,998,400
山善	51,000	1,060.00	54,060,000
椿本興業	3,100	3,970.00	12,307,000
住友商事	1,172,000	2,651.00	3,106,972,000
内田洋行	7,700	5,280.00	40,656,000

三菱商事	1,170,500	5,651.00	6,614,495,500
第一実業	6,700	5,820.00	38,994,000
キヤノンマーケティングジャパン	43,800	3,455.00	151,329,000
西華産業	7,400	2,018.00	14,933,200
佐藤商事	13,100	1,426.00	18,680,600
菱洋エレクトロ	16,100	2,593.00	41,747,300
東京産業	17,300	861.00	14,895,300
ユアサ商事	17,000	4,365.00	74,205,000
神鋼商事	4,700	5,470.00	25,709,000
トルク	8,000	215.00	1,720,000
阪和興業	34,000	4,265.00	145,010,000
正栄食品工業	12,600	3,975.00	50,085,000
カナデン	12,700	1,242.00	15,773,400
R Y O D E N	15,300	2,006.00	30,691,800
岩谷産業	43,100	6,660.00	287,046,000
ナイス	4,000	1,448.00	5,792,000
ニチモウ	1,800	3,520.00	6,336,000
極東貿易	11,300	1,546.00	17,469,800
アステナホールディングス	32,800	457.00	14,989,600
三愛オブリ	50,100	1,510.00	75,651,000
稲畑産業	38,200	2,972.00	113,530,400
G S I クレオス	11,000	1,814.00	19,954,000
明和産業	25,200	670.00	16,884,000
クワザワホールディングス	4,800	446.00	2,140,800
ワキタ	34,800	1,395.00	48,546,000
東邦ホールディングス	47,100	2,664.00	125,474,400
サンゲツ	47,500	2,522.00	119,795,000
ミツウロコグループホールディングス	24,200	1,382.00	33,444,400
シナネンホールディングス	6,100	3,760.00	22,936,000
伊藤忠エネクス	46,900	1,201.00	56,326,900
サンリオ	53,600	5,860.00	314,096,000
サンワテクノス	9,700	2,160.00	20,952,000
リョーサン	20,100	3,635.00	73,063,500
新光商事	25,500	1,106.00	28,203,000
トーホー	8,100	2,396.00	19,407,600
三信電気	7,600	2,101.00	15,967,600
東陽テクニカ	19,200	1,360.00	26,112,000
モスフードサービス	27,800	3,135.00	87,153,000
加賀電子	15,400	5,120.00	78,848,000
ソーダニッカ	10,800	791.00	8,542,800
立花エレテック	13,800	2,140.00	29,532,000
フォーバル	7,500	1,170.00	8,775,000

PAL TAC	29,800	5,070.00	151,086,000
三谷産業	33,200	313.00	10,391,600
西本Wismettacホールディングス	4,800	4,140.00	19,872,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,110.00	2,532,000
コア商事ホールディングス	10,700	715.00	7,650,500
KPPグループホールディングス	44,100	608.00	26,812,800
ヤマタネ	8,400	1,634.00	13,725,600
丸紅建材リース	1,300	2,122.00	2,758,600
泉州電業	9,500	3,250.00	30,875,000
トラスコ中山	39,800	2,295.00	91,341,000
オートバックスセブン	65,900	1,527.00	100,629,300
モリト	13,600	1,081.00	14,701,600
加藤産業	23,400	3,880.00	90,792,000
北恵	3,300	738.00	2,435,400
イエローハット	33,400	1,853.00	61,890,200
JKホールディングス	14,600	1,016.00	14,833,600
日伝	11,200	2,207.00	24,718,400
北沢産業	7,900	355.00	2,804,500
杉本商事	8,400	2,030.00	17,052,000
因幡電機産業	49,100	3,090.00	151,719,000
東テク	6,300	4,275.00	26,932,500
ミスミグループ本社	285,600	3,275.00	935,340,000
アルテック	8,300	260.00	2,158,000
タキヒヨー	3,600	1,007.00	3,625,200
蔵王産業	2,400	2,322.00	5,572,800
スズケン	55,400	3,640.00	201,656,000
ジェコス	11,300	860.00	9,718,000
グローセル	17,800	402.00	7,155,600
ローソン	47,000	6,460.00	303,620,000
サンエー	14,600	4,635.00	67,671,000
カワチ薬品	15,000	2,181.00	32,715,000
エービーシー・マート	27,700	7,650.00	211,905,000
ハードオフコーポレーション	6,300	1,329.00	8,372,700
アスクル	39,400	1,828.00	72,023,200
ゲオホールディングス	18,800	1,706.00	32,072,800
アダストリア	23,000	2,680.00	61,640,000
くら寿司	22,300	3,100.00	69,130,000
キャンドウ	7,000	2,403.00	16,821,000
IKホールディングス	6,000	388.00	2,328,000
パルグループホールディングス	18,700	3,450.00	64,515,000
エディオン	75,300	1,395.00	105,043,500
サーラコーポレーション	40,400	777.00	31,390,800

ワッツ	7,900	707.00	5,585,300
ハローズ	8,800	3,280.00	28,864,000
あみやき亭	4,700	3,535.00	16,614,500
大黒天物産	5,900	5,300.00	31,270,000
ハニーズホールディングス	15,300	1,571.00	24,036,300
ファーマライズホールディングス	4,000	645.00	2,580,000
アルペン	15,900	1,972.00	31,354,800
ハブ	5,500	755.00	4,152,500
クオールホールディングス	26,300	1,547.00	40,686,100
ジーンズホールディングス	11,400	3,110.00	35,454,000
ビックカメラ	101,200	1,066.00	107,879,200
D C Mホールディングス	115,900	1,306.00	151,365,400
Monotaro	268,500	1,908.00	512,298,000
東京一番フーズ	4,400	502.00	2,208,800
きちりホールディングス	3,500	852.00	2,982,000
アークランドサービスホールディングス	15,700	2,896.00	45,467,200
J . フロント リテイリング	235,600	1,375.00	323,950,000
ドトール・日レスホールディングス	33,800	2,050.00	69,290,000
マツキヨココカラ&カンパニー	114,800	7,210.00	827,708,000
ブロンコビリー	10,300	2,775.00	28,582,500
Z O Z O	125,200	2,945.00	368,714,000
トレジャー・ファクトリー	9,400	1,595.00	14,993,000
物語コーポレーション	31,800	3,140.00	99,852,000
三越伊勢丹ホールディングス	318,900	1,413.00	450,605,700
H a m e e	7,100	942.00	6,688,200
マーケットエンタープライズ	1,900	1,265.00	2,403,500
ウエルシアホールディングス	98,300	3,120.00	306,696,000
クリエイトSDホールディングス	31,400	3,515.00	110,371,000
丸善CHIホールディングス	18,800	350.00	6,580,000
ミサワ	3,500	619.00	2,166,500
ティーライフ	2,400	1,363.00	3,271,200
チムニー	4,500	1,256.00	5,652,000
シュッピン	14,600	977.00	14,264,200
オイシックス・ラ・大地	25,600	2,321.00	59,417,600
ネクステージ	43,400	2,431.00	105,505,400
ジョイフル本田	56,500	1,789.00	101,078,500
鳥貴族ホールディングス	7,200	2,244.00	16,156,800
ホットランド	14,800	1,730.00	25,604,000
すかいらーくホールディングス	259,000	1,818.00	470,862,000
S F Pホールディングス	10,300	1,916.00	19,734,800
綿半ホールディングス	15,000	1,359.00	20,385,000
ヨシックスホールディングス	3,100	2,156.00	6,683,600

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62,100	1,128.00	70,048,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,200	819.00	7,534,800
B E E N O S	8,300	1,811.00	15,031,300
あさひ	16,200	1,286.00	20,833,200
日本調剤	13,300	1,133.00	15,068,900
コスモス薬品	18,800	13,920.00	261,696,000
トーエル	7,200	768.00	5,529,600
セブン&アイ・ホールディングス	652,200	6,410.00	4,180,602,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	142,300	999.00	142,157,700
ツルハホールディングス	39,800	9,930.00	395,214,000
サンマルクホールディングス	15,500	1,879.00	29,124,500
フェリシモ	3,800	1,014.00	3,853,200
トリドールホールディングス	47,200	2,938.00	138,673,600
T O K Y O B A S E	20,600	461.00	9,496,600
ウイルプラスホールディングス	2,800	1,139.00	3,189,200
J Mホールディングス	14,500	2,056.00	29,812,000
サツドラホールディングス	7,300	779.00	5,686,700
アレンザホールディングス	14,700	986.00	14,494,200
串カツ田中ホールディングス	5,400	1,647.00	8,893,800
パロックジャパンリミテッド	12,900	844.00	10,887,600
クスリのアオキホールディングス	16,900	7,090.00	119,821,000
力の源ホールディングス	8,400	1,481.00	12,440,400
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	101,100	3,275.00	331,102,500
メディカルシステムネットワーク	17,700	385.00	6,814,500
はるやまホールディングス	7,200	492.00	3,542,400
ノジマ	62,100	1,488.00	92,404,800
カップ・クリエイト	29,700	1,509.00	44,817,300
ライトオン	11,100	575.00	6,382,500
良品計画	206,900	1,467.00	303,522,300
パリミキホールディングス	20,000	330.00	6,600,000
アドヴァングループ	18,500	967.00	17,889,500
アルピス	6,400	2,430.00	15,552,000
コナカ	16,000	366.00	5,856,000
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,612.00	3,385,200
G - 7ホールディングス	24,000	1,335.00	32,040,000
イオン北海道	28,200	812.00	22,898,400
コジマ	32,200	560.00	18,032,000
ヒマラヤ	5,200	940.00	4,888,000
コーナン商事	25,700	3,625.00	93,162,500
エコス	7,300	1,865.00	13,614,500

ワタミ	22,800	919.00	20,953,200
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	382,100	2,477.00	946,461,700
西松屋チェーン	42,200	1,685.00	71,107,000
ゼンショーホールディングス	103,700	5,400.00	559,980,000
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,060.00	13,038,000
ハークスレイ	5,900	638.00	3,764,200
サイゼリヤ	28,100	3,385.00	95,118,500
V Tホールディングス	72,900	512.00	37,324,800
魚力	6,100	2,160.00	13,176,000
フジ・コーポレーション	11,100	1,347.00	14,951,700
ユナイテッドアローズ	20,400	2,360.00	48,144,000
ハイデイ日高	28,300	2,255.00	63,816,500
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	11,500	199.00	2,288,500
コロワイド	87,200	2,012.00	175,446,400
ピーシーデボコーポレーション	22,200	478.00	10,611,600
壱番屋	15,000	5,260.00	78,900,000
P L A N T	4,100	716.00	2,935,600
スギホールディングス	38,200	6,040.00	230,728,000
薬王堂ホールディングス	10,800	2,558.00	27,626,400
スクロール	28,700	884.00	25,370,800
ヨンドシーホールディングス	16,600	1,783.00	29,597,800
木曽路	28,900	2,346.00	67,799,400
S R S ホールディングス	31,700	968.00	30,685,600
千趣会	36,100	422.00	15,234,200
リテールパートナーズ	28,400	1,576.00	44,758,400
ケーヨー	30,700	820.00	25,174,000
上新電機	17,100	1,926.00	32,934,600
日本瓦斯	101,700	2,040.00	207,468,000
ロイヤルホールディングス	36,700	2,734.00	100,337,800
いなげや	18,500	1,465.00	27,102,500
チヨダ	18,700	845.00	15,801,500
ライフコーポレーション	16,600	2,958.00	49,102,800
リンガーハット	24,400	2,366.00	57,730,400
M r M a x H D	27,400	618.00	16,933,200
A O K I ホールディングス	35,800	837.00	29,964,600
オークワ	30,400	900.00	27,360,000
コメリ	29,300	3,045.00	89,218,500
青山商事	40,900	1,190.00	48,671,000
しまむら	22,300	12,740.00	284,102,000
はせがわ	8,500	352.00	2,992,000
高島屋	142,800	1,915.00	273,462,000

松屋	32,200	1,133.00	36,482,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	92,200	1,456.00	134,243,200
近鉄百貨店	8,300	2,462.00	20,434,600
丸井グループ	139,600	2,401.00	335,179,600
アクシアル リテイリング	13,100	3,365.00	44,081,500
イオン	641,600	2,848.50	1,827,597,600
イズミ	28,800	3,255.00	93,744,000
平和堂	31,700	2,105.00	66,728,500
フジ	29,100	1,797.00	52,292,700
ヤオコー	21,400	7,160.00	153,224,000
ゼビオホールディングス	26,100	1,171.00	30,563,100
ケーズホールディングス	134,200	1,257.00	168,689,400
Olympicグループ	6,500	537.00	3,490,500
日産東京販売ホールディングス	20,300	337.00	6,841,100
シルバーライフ	4,000	1,286.00	5,144,000
Genky DrugStores	8,400	4,165.00	34,986,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	949.00	2,752,100
ブックオフグループホールディングス	10,000	1,327.00	13,270,000
ギフトホールディングス	4,100	4,785.00	19,618,500
アインホールディングス	26,200	5,910.00	154,842,000
元気寿司	5,500	3,230.00	17,765,000
ヤマダホールディングス	777,200	424.00	329,532,800
アーケランズ	28,000	1,555.00	43,540,000
ニトリホールディングス	76,600	18,170.00	1,391,822,000
グルメ杵屋	15,800	1,046.00	16,526,800
愛眼	10,900	175.00	1,907,500
ケーユーホールディングス	11,500	1,333.00	15,329,500
吉野家ホールディングス	74,300	2,529.00	187,904,700
松屋フーズホールディングス	9,100	4,115.00	37,446,500
サガミホールディングス	30,800	1,283.00	39,516,400
関西フードマーケット	17,400	1,627.00	28,309,800
王将フードサービス	12,500	6,290.00	78,625,000
ミニストップ	13,900	1,443.00	20,057,700
アークス	34,900	2,475.00	86,377,500
バローホールディングス	36,400	2,005.00	72,982,000
ベルク	9,500	6,060.00	57,570,000
大庄	8,400	1,103.00	9,265,200
ファーストリテイリング	85,200	33,300.00	2,837,160,000
サンドラッグ	72,000	4,050.00	291,600,000
サクスパー ホールディングス	18,500	969.00	17,926,500
ヤマザワ	3,100	1,277.00	3,958,700
やまや	3,200	2,659.00	8,508,800

ペルーナ	46,300	708.00	32,780,400
いよぎんホールディングス	209,600	764.00	160,134,400
しずおかフィナンシャルグループ	398,100	1,030.00	410,043,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	148,300	879.00	130,355,700
島根銀行	4,700	472.00	2,218,400
じもとホールディングス	12,100	376.00	4,549,600
めぶきフィナンシャルグループ	874,100	331.00	289,327,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,600	2,985.00	67,461,000
九州フィナンシャルグループ	309,900	520.00	161,148,000
ゆうちょ銀行	493,600	1,063.00	524,696,800
富山第一銀行	58,500	640.00	37,440,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	970,900	552.00	535,936,800
西日本フィナンシャルホールディングス	109,300	1,070.00	116,951,000
三十三フィナンシャルグループ	15,800	1,551.00	24,505,800
第四北越フィナンシャルグループ	27,700	3,115.00	86,285,500
ひろぎんホールディングス	229,800	753.00	173,039,400
おきなわフィナンシャルグループ	16,800	2,237.00	37,581,600
十六フィナンシャルグループ	22,800	3,050.00	69,540,000
北國フィナンシャルホールディングス	19,800	4,825.00	95,535,000
プロクレアホールディングス	21,600	2,121.00	45,813,600
あいちフィナンシャルグループ	24,600	2,105.00	51,783,000
S B I 新生銀行	41,100	2,803.00	115,203,300
あおぞら銀行	110,800	2,537.00	281,099,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,032,200	930.10	10,261,049,220
りそなホールディングス	2,226,500	654.80	1,457,912,200
三井住友トラスト・ホールディングス	320,100	5,172.00	1,655,557,200
三井住友フィナンシャルグループ	1,287,300	5,642.00	7,262,946,600
千葉銀行	490,900	890.00	436,901,000
群馬銀行	341,800	510.00	174,318,000
武蔵野銀行	22,600	2,245.00	50,737,000
千葉興業銀行	32,000	473.00	15,136,000
筑波銀行	77,300	197.00	15,228,100
七十七銀行	56,400	2,353.00	132,709,200
秋田銀行	11,800	1,680.00	19,824,000
山形銀行	19,600	1,101.00	21,579,600
岩手銀行	12,100	2,033.00	24,599,300
東邦銀行	139,300	222.00	30,924,600
東北銀行	6,700	1,000.00	6,700,000
ふくおかフィナンシャルグループ	140,600	2,637.00	370,762,200
スルガ銀行	155,300	504.00	78,271,200
八十二銀行	361,300	593.00	214,250,900
山梨中央銀行	18,100	1,130.00	20,453,000

大垣共立銀行	33,600	1,827.00	61,387,200
福井銀行	15,700	1,447.00	22,717,900
清水銀行	7,000	1,432.00	10,024,000
富山銀行	2,100	1,616.00	3,393,600
滋賀銀行	29,300	2,741.00	80,311,300
南都銀行	26,500	2,399.00	63,573,500
百五銀行	165,700	396.00	65,617,200
京都銀行	55,800	6,850.00	382,230,000
紀陽銀行	63,000	1,546.00	97,398,000
ほくほくフィナンシャルグループ	112,000	1,081.00	121,072,000
山陰合同銀行	110,200	783.00	86,286,600
鳥取銀行	4,400	1,146.00	5,042,400
百十四銀行	16,100	1,819.00	29,285,900
四国銀行	28,000	855.00	23,940,000
阿波銀行	24,700	2,062.00	50,931,400
大分銀行	10,600	2,077.00	22,016,200
宮崎銀行	11,500	2,306.00	26,519,000
佐賀銀行	10,300	1,633.00	16,819,900
琉球銀行	40,400	916.00	37,006,400
セブン銀行	631,000	274.00	172,894,000
みずほフィナンシャルグループ	2,547,600	2,071.00	5,276,079,600
高知銀行	4,700	676.00	3,177,200
山口フィナンシャルグループ	194,500	925.00	179,912,500
長野銀行	4,200	1,494.00	6,274,800
名古屋銀行	11,600	3,510.00	40,716,000
北洋銀行	266,900	262.00	69,927,800
大光銀行	4,100	1,060.00	4,346,000
愛媛銀行	23,700	829.00	19,647,300
トマト銀行	4,500	1,011.00	4,549,500
京葉銀行	80,600	545.00	43,927,000
栃木銀行	80,600	238.00	19,182,800
北日本銀行	6,200	2,001.00	12,406,200
東和銀行	32,300	523.00	16,892,900
福島銀行	14,400	219.00	3,153,600
大東銀行	5,400	622.00	3,358,800
トモニホールディングス	142,400	373.00	53,115,200
フィデアホールディングス	18,200	1,315.00	23,933,000
池田泉州ホールディングス	225,500	228.00	51,414,000
F P G	59,700	1,123.00	67,043,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,600	1,070.00	15,622,000
マーキュリアホールディングス	8,300	685.00	5,685,500
S B I ホールディングス	255,100	2,760.00	704,076,000

ジャフコ グループ	58,900	1,744.00	102,721,600
大和証券グループ本社	1,259,900	646.00	813,895,400
野村ホールディングス	3,244,600	506.50	1,643,389,900
岡三証券グループ	155,100	460.00	71,346,000
丸三証券	59,100	414.00	24,467,400
東洋証券	59,000	281.00	16,579,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	192,300	362.00	69,612,600
光世証券	3,600	418.00	1,504,800
水戸証券	47,900	294.00	14,082,600
いちよし証券	32,800	590.00	19,352,000
松井証券	104,300	790.00	82,397,000
マネックスグループ	190,200	494.00	93,958,800
極東証券	22,200	607.00	13,475,400
岩井コスモホールディングス	20,200	1,348.00	27,229,600
アイザワ証券グループ	25,700	759.00	19,506,300
マネーパートナーズグループ	15,000	260.00	3,900,000
スパークス・グループ	19,800	1,438.00	28,472,400
かんぽ生命保険	213,900	2,208.00	472,291,200
S O M P Oホールディングス	302,300	6,049.00	1,828,612,700
アニコム ホールディングス	59,800	590.00	35,282,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	358,500	4,795.00	1,719,007,500
第一生命ホールディングス	860,600	2,495.00	2,147,197,000
東京海上ホールディングス	1,741,200	3,055.00	5,319,366,000
T & Dホールディングス	472,800	1,976.00	934,252,800
アドバンスクリエイト	10,200	1,136.00	11,587,200
全国保証	46,100	5,080.00	234,188,000
あんしん保証	7,900	314.00	2,480,600
イントラスト	5,600	990.00	5,544,000
日本モーゲージサービス	8,200	566.00	4,641,200
C a s a	5,700	878.00	5,004,600
アルヒ	22,100	1,002.00	22,144,200
プレミアグループ	29,900	1,598.00	47,780,200
ネットプロテクションズホールディングス	59,200	384.00	22,732,800
クレディセゾン	111,800	1,942.00	217,115,600
芙蓉総合リース	16,200	10,200.00	165,240,000
みずほリース	26,300	4,275.00	112,432,500
東京センチュリー	33,000	5,040.00	166,320,000
日本証券金融	71,000	1,111.00	78,881,000
アイフル	292,800	340.00	99,552,000
リコーリース	16,800	3,935.00	66,108,000
イオンフィナンシャルサービス	101,400	1,234.00	125,127,600
アコム	315,500	328.00	103,484,000

ジャックス	18,800	4,645.00	87,326,000
オリエントコーポレーション	46,300	1,101.00	50,976,300
オリックス	1,156,500	2,372.50	2,743,796,250
三菱HCキャピタル	687,300	764.00	525,097,200
九州リースサービス	6,800	823.00	5,596,400
日本取引所グループ	495,100	2,317.00	1,147,146,700
イー・ギャランティ	28,800	2,080.00	59,904,000
アサックス	6,800	630.00	4,284,000
NECキャピタルソリューション	8,800	2,877.00	25,317,600
大東建託	64,700	13,670.00	884,449,000
いちご	210,100	247.00	51,894,700
日本駐車場開発	193,800	237.00	45,930,600
スター・マイカ・ホールディングス	18,600	653.00	12,145,800
SREホールディングス	9,100	3,860.00	35,126,000
ADワークスグループ	34,500	187.00	6,451,500
ヒューリック	412,400	1,203.00	496,117,200
三栄建築設計	9,700	1,505.00	14,598,500
野村不動産ホールディングス	110,700	3,400.00	376,380,000
三重交通グループホールディングス	40,800	555.00	22,644,000
サムティ	28,800	2,180.00	62,784,000
ディア・ライフ	32,500	742.00	24,115,000
地主	14,400	1,930.00	27,792,000
プレサンスコーポレーション	28,700	1,922.00	55,161,400
ハウスコム	3,900	993.00	3,872,700
JPMC	10,500	1,143.00	12,001,500
サンセイランディック	6,000	902.00	5,412,000
フージャースホールディングス	27,200	927.00	25,214,400
オープンハウスグループ	64,800	5,270.00	341,496,000
東急不動産ホールディングス	532,000	745.00	396,340,000
飯田グループホールディングス	155,000	2,500.00	387,500,000
イーランド	3,300	1,462.00	4,824,600
ムゲンエステート	11,800	663.00	7,823,400
And Doホールディングス	10,500	1,164.00	12,222,000
シーアールイー	11,200	1,303.00	14,593,600
ケイアイスター不動産	8,900	4,530.00	40,317,000
グッドコムアセット	18,400	856.00	15,750,400
ジェイ・エス・ビー	4,800	4,380.00	21,024,000
ロードスターキャピタル	11,300	1,447.00	16,351,100
テンポイノベーション	5,800	1,080.00	6,264,000
フェイスネットワーク	5,200	1,256.00	6,531,200
パーク24	138,100	2,144.00	296,086,400
パラカ	7,100	1,916.00	13,603,600

三井不動産	761,900	2,719.00	2,071,606,100
三菱地所	1,064,000	1,627.00	1,731,128,000
平和不動産	29,000	3,840.00	111,360,000
東京建物	168,900	1,765.00	298,108,500
京阪神ビルディング	31,200	1,171.00	36,535,200
住友不動産	319,000	3,172.00	1,011,868,000
テオオーシー	34,700	628.00	21,791,600
東京楽天地	3,300	4,285.00	14,140,500
スターツコーポレーション	25,900	2,659.00	68,868,100
フジ住宅	27,200	695.00	18,904,000
空港施設	24,500	550.00	13,475,000
明和地所	8,600	890.00	7,654,000
ゴールドクレスト	17,800	1,720.00	30,616,000
エスリード	9,100	2,419.00	22,012,900
日神グループホールディングス	32,100	464.00	14,894,400
日本エスコン	39,600	764.00	30,254,400
MIRARTHホールディングス	89,000	413.00	36,757,000
AVANTIA	9,800	828.00	8,114,400
イオンモール	92,300	1,811.00	167,155,300
毎日コムネット	7,300	801.00	5,847,300
ファースト住建	7,200	1,093.00	7,869,600
カチタス	48,000	2,642.00	126,816,000
トーセイ	30,400	1,650.00	50,160,000
穴吹興産	3,500	2,235.00	7,822,500
サンフロンティア不動産	30,700	1,330.00	40,831,000
FJネクストホールディングス	20,300	1,013.00	20,563,900
インテリックス	3,300	563.00	1,857,900
ランドビジネス	5,000	244.00	1,220,000
サンネクスタグループ	5,800	1,023.00	5,933,400
グランディハウス	14,700	552.00	8,114,400
日本空港ビルデング	62,600	6,540.00	409,404,000
明豊ファシリティワークス	7,600	734.00	5,578,400
日本工営	11,200	3,800.00	42,560,000
LIFULL	64,200	233.00	14,958,600
MIXI	42,000	2,784.00	116,928,000
ジェイエイシーリクルートメント	16,800	2,298.00	38,606,400
日本M&Aセンターホールディングス	315,800	1,036.00	327,168,800
メンバーズ	5,600	1,430.00	8,008,000
中広	2,800	398.00	1,114,400
UTグループ	27,100	2,677.00	72,546,700
アイティメディア	7,200	1,269.00	9,136,800
E・Jホールディングス	11,000	1,587.00	17,457,000

オープンアップグループ	55,300	1,951.00	107,890,300
コシダカホールディングス	55,300	1,112.00	61,493,600
アルトナー	3,700	1,449.00	5,361,300
パソナグループ	22,500	1,788.00	40,230,000
C D S	3,700	1,809.00	6,693,300
リンクアンドモチベーション	52,900	446.00	23,593,400
エス・エム・エス	70,100	2,985.00	209,248,500
サニーサイドアップグループ	4,700	620.00	2,914,000
パーソルホールディングス	205,900	2,859.00	588,668,100
リニカル	8,600	728.00	6,260,800
クックパッド	52,200	172.00	8,978,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	648.00	4,860,000
学情	8,500	1,640.00	13,940,000
スタジオアリス	9,300	2,155.00	20,041,500
シミックホールディングス	9,000	2,055.00	18,495,000
エプロ	3,500	743.00	2,600,500
N J S	4,200	2,378.00	9,987,600
総合警備保障	68,300	3,955.00	270,126,500
カカクコム	135,100	2,077.00	280,602,700
アイロムグループ	6,800	1,923.00	13,076,400
セントケア・ホールディング	12,100	781.00	9,450,100
サイネックス	3,000	584.00	1,752,000
ルネサンス	13,200	914.00	12,064,800
ディップ	32,300	3,555.00	114,826,500
デジタルホールディングス	14,700	1,083.00	15,920,100
新日本科学	19,600	2,198.00	43,080,800
キャリアデザインセンター	3,200	1,607.00	5,142,400
ベネフィット・ワン	85,400	1,549.00	132,284,600
エムスリー	363,400	3,175.00	1,153,795,000
ツカダ・グローバルホールディング	9,200	418.00	3,845,600
アウトソーシング	109,800	1,260.00	138,348,000
ウェルネット	11,400	621.00	7,079,400
ワールドホールディングス	8,400	2,747.00	23,074,800
ディー・エヌ・エー	73,700	1,914.00	141,061,800
博報堂D Yホールディングス	234,700	1,515.00	355,570,500
ぐるなび	34,600	358.00	12,386,800
タカミヤ	25,600	506.00	12,953,600
ジャパンベストレスキューシステム	9,100	706.00	6,424,600
ファンコミュニケーションズ	36,800	400.00	14,720,000
ライク	7,000	1,839.00	12,873,000
ビジネス・ブレークスルー	6,100	427.00	2,604,700
エスプール	53,400	607.00	32,413,800

WDBホールディングス	9,500	2,106.00	20,007,000	
ティア	9,200	434.00	3,992,800	
CDG	1,800	1,349.00	2,428,200	
アドウェイズ	25,800	688.00	17,750,400	
バリューコマース	14,100	1,425.00	20,092,500	
インフォマート	192,000	289.00	55,488,000	
J Pホールディングス	53,900	343.00	18,487,700	
エコナックホールディングス	27,900	95.00	2,650,500	
CLホールディングス	5,400	885.00	4,779,000	
プレステージ・インターナショナル	77,900	614.00	47,830,600	
アミューズ	10,100	1,777.00	17,947,700	
ドリームインキュベータ	5,700	2,454.00	13,987,800	
クイック	14,200	2,041.00	28,982,200	
TAC	8,600	202.00	1,737,200	
電通グループ	180,800	4,610.00	833,488,000	
イオンファンタジー	8,000	3,585.00	28,680,000	
シーティーエス	20,800	728.00	15,142,400	
ネクシィーズグループ	4,900	681.00	3,336,900	
H.U.グループホールディングス	53,900	2,712.00	146,176,800	
アルプス技研	16,100	2,774.00	44,661,400	
日本空調サービス	20,200	750.00	15,150,000	
オリエンタルランド	973,100	5,200.00	5,060,120,000	
ダスキン	41,000	3,235.00	132,635,000	
明光ネットワークジャパン	22,800	643.00	14,660,400	
ファルコホールディングス	8,500	1,863.00	15,835,500	
ラウンドワン	154,300	601.00	92,734,300	
リゾートトラスト	72,700	2,168.00	157,613,600	
ビー・エム・エル	22,900	3,090.00	70,761,000	
りらいあコミュニケーションズ	30,600	1,458.00	44,614,800	
リソー教育	84,700	288.00	24,393,600	
早稲田アカデミー	10,400	1,377.00	14,320,800	
ユー・エス・エス	189,200	2,350.00	444,620,000	
東京個別指導学院	22,400	536.00	12,006,400	
サイバーエージェント	406,500	1,033.00	419,914,500	
楽天グループ	852,600	584.00	497,918,400	
クリーク・アンド・リバー社	10,900	2,057.00	22,421,300	
SBIグローバルアセットマネジメント	30,600	495.00	15,147,000	
テー・オー・ダブリュー	37,000	329.00	12,173,000	
山田コンサルティンググループ	9,500	1,713.00	16,273,500	
セントラルスポーツ	7,000	2,496.00	17,472,000	
フルキャストホールディングス	17,700	2,366.00	41,878,200	
エン・ジャパン	33,400	2,465.00	82,331,000	

リゾルホールディングス	1,400	4,670.00	6,538,000
テクノプロ・ホールディングス	108,900	3,295.00	358,825,500
アトラグループ	3,200	182.00	582,400
インターワークス	4,600	351.00	1,614,600
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	1,813.00	17,586,100
K e e P e r 技研	11,400	5,510.00	62,814,000
ファーストロジック	2,000	879.00	1,758,000
三機サービス	2,500	1,095.00	2,737,500
G u n o s y	15,100	588.00	8,878,800
デザインワン・ジャパン	5,400	175.00	945,000
イー・ガーディアン	7,100	2,052.00	14,569,200
リブセンス	7,700	268.00	2,063,600
ジャパンマテリアル	56,400	2,192.00	123,628,800
ベクトル	29,100	1,286.00	37,422,600
ウチヤマホールディングス	7,200	296.00	2,131,200
チャーム・ケア・コーポレーション	15,600	1,140.00	17,784,000
キャリアリンク	6,900	2,736.00	18,878,400
I B J	11,700	662.00	7,745,400
アサンテ	9,300	1,620.00	15,066,000
バリューHR	16,300	1,484.00	24,189,200
M & A キャピタルパートナーズ	15,000	3,230.00	48,450,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,900	1,015.00	7,003,500
E R I ホールディングス	3,900	1,374.00	5,358,600
アビスト	2,300	3,080.00	7,084,000
シグマクシス・ホールディングス	28,100	1,162.00	32,652,200
ウィルグループ	15,700	1,049.00	16,469,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,300	142.00	2,456,600
メドピア	16,400	1,157.00	18,974,800
レアジョブ	3,000	1,077.00	3,231,000
リクルートホールディングス	1,361,300	4,418.00	6,014,223,400
エラン	24,700	927.00	22,896,900
土木管理総合試験所	7,000	335.00	2,345,000
日本郵政	2,410,100	1,018.00	2,453,481,800
ベルシステム24ホールディングス	24,900	1,386.00	34,511,400
鎌倉新書	21,300	837.00	17,828,100
S M N	4,100	461.00	1,890,100
グローバルキッズCOMPANY	3,100	688.00	2,132,800
エアトリ	13,500	2,673.00	36,085,500
アトラエ	11,200	839.00	9,396,800
ストライク	7,900	3,660.00	28,914,000
ソラスト	51,200	618.00	31,641,600
セラク	5,800	1,642.00	9,523,600

インソース	40,200	1,253.00	50,370,600
ペイカレント・コンサルティング	145,600	5,340.00	777,504,000
Orchestra Holdings	4,200	1,190.00	4,998,000
アイモバイル	8,400	1,337.00	11,230,800
キャリアインデックス	5,900	313.00	1,846,700
MS - Japan	5,000	1,030.00	5,150,000
船場	2,900	723.00	2,096,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,700	1,981.00	130,151,700
フルテック	2,300	1,107.00	2,546,100
GameWith	5,200	381.00	1,981,200
MS&Consulting	2,200	610.00	1,342,000
ウェルビー	14,000	550.00	7,700,000
エル・ティー・エス	2,500	3,005.00	7,512,500
ミダックホールディングス	11,300	1,826.00	20,633,800
日総工産	14,200	818.00	11,615,600
キュービーネットホールディングス	8,900	1,615.00	14,373,500
RPAホールディングス	25,800	364.00	9,391,200
スプリックス	4,500	889.00	4,000,500
マネジメントソリューションズ	10,200	3,040.00	31,008,000
プロレド・パートナーズ	5,200	499.00	2,594,800
テノ・ホールディングス	2,200	714.00	1,570,800
フロンティア・マネジメント	6,400	1,197.00	7,660,800
ピアラ	2,900	552.00	1,600,800
コプロ・ホールディングス	2,500	1,889.00	4,722,500
ギークス	2,300	788.00	1,812,400
アンビスホールディングス	19,800	2,893.00	57,281,400
カーブスホールディングス	50,700	706.00	35,794,200
フォーラムエンジニアリング	11,000	1,145.00	12,595,000
Fast Fitness Japan	6,500	1,306.00	8,489,000
ダイレクトマーケティングミックス	22,300	1,228.00	27,384,400
ポピンズ	2,900	1,663.00	4,822,700
LITALICO	14,400	2,390.00	34,416,000
アドバンテッジリスクマネジメント	7,100	574.00	4,075,400
リログループ	102,500	2,026.00	207,665,000
東祥	13,100	1,219.00	15,968,900
ビーウィズ	4,800	1,856.00	8,908,800
TREホールディングス	39,000	1,132.00	44,148,000
人・夢・技術グループ	7,100	1,484.00	10,536,400
大栄環境	46,900	2,044.00	95,863,600
日本管財ホールディングス	19,400	2,685.00	52,089,000
エイチ・アイ・エス	48,200	1,914.00	92,254,800
ラックランド	7,700	3,165.00	24,370,500

共立メンテナンス	31,500	5,180.00	163,170,000	
イチネンホールディングス	19,700	1,315.00	25,905,500	
建設技術研究所	9,600	3,390.00	32,544,000	
スペース	13,600	1,055.00	14,348,000	
燦ホールディングス	8,000	2,216.00	17,728,000	
スバル興業	900	9,450.00	8,505,000	
東京テアトル	5,300	1,136.00	6,020,800	
タナベコンサルティンググループ	5,900	880.00	5,192,000	
ナガワ	5,000	6,070.00	30,350,000	
東京都競馬	15,500	4,110.00	63,705,000	
カナモト	33,800	2,263.00	76,489,400	
ニシオホールディングス	17,200	3,295.00	56,674,000	
トランス・コスモス	22,900	3,310.00	75,799,000	
乃村工藝社	80,500	950.00	76,475,000	
藤田観光	8,200	3,605.00	29,561,000	
KNT-CTホールディングス	11,000	1,438.00	15,818,000	
トーカイ	16,400	1,962.00	32,176,800	
セコム	187,300	9,329.00	1,747,321,700	
セントラル警備保障	10,000	2,803.00	28,030,000	
丹青社	36,000	799.00	28,764,000	
メイテック	71,900	2,353.00	169,180,700	
応用地質	17,300	1,947.00	33,683,100	
船井総研ホールディングス	38,400	2,581.00	99,110,400	
進学会ホールディングス	5,800	295.00	1,711,000	
オオバ	9,300	782.00	7,272,600	
いであ	3,400	1,659.00	5,640,600	
学究社	7,500	2,123.00	15,922,500	
ベネッセホールディングス	68,800	1,914.00	131,683,200	
イオンディライト	20,400	3,090.00	63,036,000	
ナック	8,500	965.00	8,202,500	
ダイセキ	37,600	3,990.00	150,024,000	
ステップ	6,900	1,824.00	12,585,600	
合 計	209,148,600		550,656,091,320	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,531,439,775
コール・ローン	1,104,818,529
株式	543,608,651,138
投資信託受益証券	179,501,153
投資証券	11,243,887,744
派生商品評価勘定	537,577,801
未収入金	37,697,497
未収配当金	931,272,038
差入委託証拠金	4,380,947,121
流動資産合計	571,555,792,796
資産合計	571,555,792,796
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,947,240
前受金	530,624,604
未払解約金	1,253,877,945
未払利息	1,891
流動負債合計	1,791,451,680
負債合計	1,791,451,680
純資産の部	
元本等	
元本	121,801,757,578
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	447,962,583,538
元本等合計	569,764,341,116
純資産合計	569,764,341,116
負債純資産合計	571,555,792,796

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24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>

2023年 5月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <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 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	121,801,757,578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	4.6778円 (1万口当たり純資産額) (46,778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 5月24日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 5月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p>

	2023年 5月24日現在
	「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	125,790,379,423円
期中追加設定元本額	14,880,027,424円
期中一部解約元本額	18,868,649,269円
期末元本額	121,801,757,578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）	1,819,808,636円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,317,802円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,979,791,451円
世界経済インデックスファンド	11,633,003,005円
外国株式インデックス・オープン	905,515,671円
D C マイセレクション 2 5	772,351,973円
D C マイセレクション 5 0	3,718,032,451円
D C マイセレクション 7 5	4,452,815,816円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,398,781,585円
D C マイセレクション S 2 5	414,087,663円
D C マイセレクション S 5 0	1,942,823,086円
D C マイセレクション S 7 5	1,790,450,783円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	29,134,945円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	149,000,509円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	113,673,135円
D C 世界経済インデックスファンド	9,234,958,023円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,089,000,402円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,046,222円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,528,471円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	23,465,526円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	9,533,949円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	37,948,390円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	8,554,198円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	24,215,124円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	208,327,066円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	151,997,491円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	1,134,703,301円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	79,260,045円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	20,988,576円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	139,025,105円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	45,581,213円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	910,857,976円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	971,795,816円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,126,062,616円

区分	2023年 5月24日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	304,044,821円
コア投資戦略ファンド（成長型）	736,906,633円
分散投資コア戦略ファンドA	1,713,566,608円
分散投資コア戦略ファンドS	8,325,826,600円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,350,123,858円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	991,812,152円
コア投資戦略ファンド（切替型）	339,465,119円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	526,661,106円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,533,591円
SMT インデックスバランス・オープン	129,525,359円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	194,441,045円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	10,821,370,570円
SMT 世界経済インデックス・オープン	233,194,391円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	936,834,088円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	160,812,928円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,969,943円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	734,798,363円
グローバル経済コア	535,992,516円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,448,004円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,130,745円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	288,399,668円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	61,645,058円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	65,380,603円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	64,533,106円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,056,765円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	40,687,735円
10資産分散投資ファンド	54,899,371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）	137,784,897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）	25,020,451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）	474,221,381円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,489,075,387円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	105,891,475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）	82,116,060円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,599,882円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	74,935,355円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	214,968,295円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	209,372,552円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	208,311,048円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	209,262,076円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	207,193,300円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	103,512,005円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	134,994,647円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,955,582,920
投資信託受益証券	33,601,781
投資証券	2,542,348,359
合計	4,379,632,780

(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 5月24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	13,590,477,857	-	14,121,102,461	530,624,604
合計		13,590,477,857	-	14,121,102,461	530,624,604

(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 5月24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	677,400,690	-	677,394,733	5,957
	アメリカドル	401,747,000	-	401,924,590	177,590
	ユーロ	198,559,690	-	198,558,493	1,197
	スイスフラン	77,094,000	-	76,911,650	182,350
	合計	677,400,690	-	677,394,733	5,957

(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	33.91	793,222.72	
	BAKER HUGHES CO	77,332	28.40	2,196,228.80	
	CHENIERE ENERGY INC	18,243	145.60	2,656,180.80	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	80.78	685,175.96	
	CHEVRON CORP	146,184	156.85	22,928,960.40	
	CONOCOPHILLIPS	98,490	104.39	10,281,371.10	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	25.77	1,649,280.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	49.11	2,468,072.16	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	132.93	1,763,582.31	
	EOG RESOURCES INC	46,173	113.46	5,238,788.58	
	EQT CORPORATION	27,026	35.85	968,882.10	

EXXON MOBIL	327,418	106.40	34,837,275.20
HALLIBURTON CO	70,302	30.58	2,149,835.16
HESS CORP	21,535	131.96	2,841,758.60
HF SINCLAIR CORP	13,429	43.13	579,192.77
KINDER MORGAN INC	157,856	16.54	2,610,938.24
MARATHON OIL CORP	50,360	23.64	1,190,510.40
MARATHON PETROLEUM CORP	37,518	109.92	4,123,978.56
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,802	59.68	3,449,623.36
ONEOK INC	35,533	58.54	2,080,101.82
OVINTIV INC	20,998	36.13	758,657.74
PHILLIPS 66	37,618	95.64	3,597,785.52
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,482	214.02	3,741,497.64
SCHLUMBERGER	111,773	46.06	5,148,264.38
TARGA RESOURCES CORP	17,298	70.96	1,227,466.08
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,354.20	721,788.60
VALERO ENERGY CORP	30,789	112.50	3,463,762.50
WILLIAMS COS	98,553	29.38	2,895,487.14
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,457	271.50	4,739,575.50
ALBEMARLE CORP	9,440	216.07	2,039,700.80
ALCOA CORP	15,500	35.67	552,885.00
AMCOR PLC	110,292	10.12	1,116,155.04
AVERY DENNISON CORP	6,638	169.61	1,125,871.18
BALL CORP	25,605	54.76	1,402,129.80
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	108.18	928,400.76
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	67.49	1,115,407.23
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.77	635,110.00
CORTEVA INC	55,406	56.03	3,104,398.18
CROWN HOLDINGS INC	9,940	81.48	809,911.20
DOW INC	55,796	51.96	2,899,160.16
DUPONT DE NEMOURS INC	38,372	67.39	2,585,889.08
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	82.47	728,375.04
ECOLAB INC	19,940	167.53	3,340,548.20
FMC CORP	10,507	106.64	1,120,466.48
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,600	34.68	3,870,288.00
INT'L PAPER CO	25,191	31.96	805,104.36
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	83.03	1,603,060.21
LINDE PLC	39,250	353.94	13,892,145.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	90.73	1,791,463.85
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,892	397.26	1,943,395.92
MOSAIC CO/THE	27,732	35.68	989,477.76
NEWMONT CORPORATION	61,808	42.49	2,626,221.92
NUCOR CORP	20,956	136.92	2,869,295.52

PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	127.93	983,397.91
PPG INDUSTRIES INC	19,305	136.88	2,642,468.40
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,000	243.87	1,219,350.00
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	79.52	831,461.12
SEALED AIR CORP	11,690	42.08	491,915.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,339	227.05	4,390,919.95
STEEL DYNAMICS INC	13,766	95.84	1,319,333.44
VULCAN MATERIALS CO	10,153	195.20	1,981,865.60
WESTLAKE CORP	2,222	115.76	257,218.72
WESTROCK CO	21,356	28.18	601,812.08
3 M COMPANY	43,028	100.70	4,332,919.60
AECOM	10,456	78.31	818,809.36
AERCAP HOLDINGS NV	11,005	58.91	648,304.55
ALLEGION PLC	7,601	107.86	819,843.86
AMETEK INC	17,753	145.97	2,591,405.41
AXON ENTERPRISE INC	5,367	195.80	1,050,858.60
BOEING CO	44,686	202.60	9,053,383.60
CARLISLE COS INC	4,378	211.47	925,815.66
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	41.51	2,829,238.58
CATERPILLAR	41,312	212.71	8,787,475.52
CUMMINS INC	11,372	215.98	2,456,124.56
DEERE&CO	22,675	360.48	8,173,884.00
DOVER CORP	10,657	139.32	1,484,733.24
EATON CORP	31,311	171.36	5,365,452.96
EMERSON ELECTRIC CO	46,386	81.11	3,762,368.46
FASTENAL CO	44,011	54.32	2,390,677.52
FERGUSON PLC	16,011	144.67	2,316,311.37
FORTIVE CORP	25,400	65.03	1,651,762.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	62.86	648,086.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	117.55	612,553.05
GENERAL DYNAMICS CORP	18,106	206.95	3,747,036.70
GENERAL ELECTRIC CO	87,133	101.70	8,861,426.10
GRACO INC	13,378	76.99	1,029,972.22
GRAINGER (WW) INC	3,667	659.64	2,418,899.88
HEICO CORP	3,640	164.83	599,981.20
HEICO CORP-CLASS A	6,394	130.85	836,654.90
HONEYWELL INTL INC	52,641	194.97	10,263,415.77
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	43.77	1,382,869.38
HUBBELL INC	4,432	275.79	1,222,301.28
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	202.37	712,747.14
IDEX CORP	5,916	204.58	1,210,295.28
ILLINOIS TOOL WORKS	24,371	223.06	5,436,195.26

INGERSOLL-RAND INC	31,562	58.01	1,830,911.62
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	51.03	648,081.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	53,782	61.97	3,332,870.54
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	184.69	2,711,618.58
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	275.42	695,710.92
LOCKHEED MARTIN CORP	18,902	452.63	8,555,612.26
MASCO CORP	19,462	51.12	994,897.44
NORDSON CORP	4,121	219.58	904,889.18
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,590	443.03	5,134,717.70
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	82.24	2,784,481.92
OWENS CORNING	6,460	108.12	698,455.20
PACCAR INC	42,159	71.39	3,009,731.01
PARKER HANNIFIN CORP	10,335	328.78	3,397,941.30
PENTAIR PLC	14,533	57.73	838,990.09
PLUG POWER INC	41,884	8.81	368,998.04
QUANTA SERVICES INC	11,465	166.61	1,910,183.65
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,466	94.08	11,051,201.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,188	278.46	2,558,490.48
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	41.31	571,234.68
SMITH (A.O.) CORP	9,016	66.73	601,637.68
SNAP-ON INC	4,000	258.47	1,033,880.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	81.33	1,024,595.34
TEXTRON	16,934	63.97	1,083,267.98
TORO CO	8,812	104.66	922,263.92
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	168.02	3,131,556.76
TRANSDIGM GROUP INC	3,986	783.22	3,121,914.92
UNITED RENTALS INC	5,364	343.62	1,843,177.68
WABTEC CORP	12,976	96.78	1,255,817.28
XYLEM INC	15,077	104.14	1,570,118.78
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,866	215.55	7,084,266.30
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	93.50	1,062,534.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	151.11	1,472,113.62
CINTAS CORP	7,433	460.58	3,423,491.14
CLARIVATE PLC	27,357	7.58	207,366.06
COPART INC	35,164	86.53	3,042,740.92
COSTAR GROUP INC	32,116	78.50	2,521,106.00
EQUIFAX INC	9,230	210.06	1,938,853.80
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	116.00	1,236,676.00
LEIDOS HOLDINGS	11,220	81.08	909,717.60
PAYCHEX INC	26,437	108.85	2,877,667.45
REPUBLIC SERVICES INC	18,327	142.70	2,615,262.90
ROBERT HALF INTL INC	7,185	68.52	492,316.20

ROLLINS INC	17,468	39.84	695,925.12
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	56.22	1,087,013.70
TRANSUNION	15,741	72.10	1,134,926.10
VERISK ANALYTICS INC	12,079	215.76	2,606,165.04
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	137.55	2,720,051.25
WASTE MANAGEMENT INC	32,506	162.78	5,291,326.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	101.47	848,999.49
CSX CORP	169,261	31.61	5,350,340.21
DELTA AIR LINES INC	14,609	35.91	524,609.19
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.55	1,406,674.00
FEDEX CORP	19,274	226.64	4,368,259.36
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.01	340,163.11
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	171.54	1,209,700.08
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	55.25	752,670.75
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,087	214.00	4,084,618.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,302	301.30	2,200,092.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	29.48	398,952.84
U-HAUL HOLDING CO	6,606	58.64	387,375.84
UBER TECHNOLOGIES INC	119,525	38.66	4,620,836.50
UNION PACIFIC CORP	48,838	196.38	9,590,806.44
UNITED PARCEL SERVICE B	58,304	169.79	9,899,436.16
APTIV PLC	21,362	92.48	1,975,557.76
BORGWARNER INC	19,781	46.73	924,366.13
FORD MOTOR COMPANY	306,411	11.73	3,594,201.03
GENERAL MOTORS CO	112,798	33.42	3,769,709.16
LEAR CORP	5,287	125.63	664,205.81
LUCID GROUP INC	31,234	7.55	235,816.70
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	26,935	14.20	382,477.00
TESLA INC	213,069	185.77	39,581,828.13
DR HORTON INC	25,466	105.89	2,696,594.74
GARMIN LTD	12,854	104.05	1,337,458.70
HASBRO INC	10,572	60.79	642,671.88
LENNAR CORP-CL A	20,844	107.10	2,232,392.40
LULULEMON ATHLETICA INC	9,374	353.86	3,317,083.64
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	95.74	398,565.62
NEWELL BRANDS INC	31,461	9.02	283,778.22
NIKE B	99,374	108.78	10,809,903.72
NVR INC	247	5,611.29	1,385,988.63
PULTE GROUP INC	16,747	65.69	1,100,110.43
VF CORP	25,718	18.97	487,870.46
WHIRLPOOL CORP	3,785	132.75	502,458.75
AIRBNB INC-CLASS A	29,936	106.25	3,180,700.00

ARAMARK	16,686	38.46	641,743.56
BOOKING HOLDINGS INC	3,056	2,637.49	8,060,169.44
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	42.25	741,910.00
CARNIVAL CORPORATION	84,361	11.04	931,345.44
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,159	2,047.01	4,419,494.59
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	160.57	1,478,367.99
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	304.29	866,617.92
DOORDASH INC - A	19,212	66.03	1,268,568.36
EXPEDIA GROUP INC	11,638	94.16	1,095,834.08
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,810	137.71	2,865,745.10
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	55.71	1,423,947.60
MARRIOTT INTL A	21,339	169.54	3,617,814.06
MCDONALD'S CORP	58,058	286.37	16,626,069.46
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	40.17	914,028.18
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	78.85	1,349,596.60
STARBUCKS CORP	90,925	100.34	9,123,414.50
VAIL RESORTS INC	3,014	234.26	706,059.64
WYNN RESORTS LTD	9,302	101.88	947,687.76
YUM BRANDS INC	21,705	131.45	2,853,122.25
ACTIVISION BLIZZARD INC	61,442	79.13	4,861,905.46
ALPHABET INC-CL A	474,294	122.56	58,129,472.64
ALPHABET INC-CL C	433,996	123.29	53,507,366.84
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	8,752	336.44	2,944,522.88
COMCAST CORP-CL A	344,872	40.38	13,925,931.36
DISH NETWORK CORPORATION-A	20,132	6.60	132,871.20
ELECTRONIC ARTS INC	21,551	125.29	2,700,124.79
FOX CORP - CLASS A	21,544	31.35	675,404.40
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.98	299,798.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	38.39	1,094,537.29
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	76.63	701,394.39
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	70.41	1,082,835.39
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	28.00	380,352.00
LIBERTY SIRIUSXM-A	6,384	28.05	179,071.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,491	82.06	1,189,131.46
MATCH GROUP INC	22,730	34.68	788,276.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	179,617	246.74	44,318,698.58
NETFLIX INC	35,024	355.99	12,468,193.76
NEWS CORP-CLASS A	33,479	18.37	615,009.23
OMNICOM GROUP	16,538	92.04	1,522,157.52
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	48,586	14.92	724,903.12
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	23.76	1,087,423.92
ROBLOX CORP -CLASS A	28,059	39.66	1,112,819.94

ROKU INC	9,122	55.88	509,737.36
SEA LTD-ADR	28,338	64.36	1,823,833.68
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	3.53	213,452.04
SNAP INC - A	83,375	9.80	817,075.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	135.78	1,747,081.26
THE WALT DISNEY CO	144,810	89.82	13,006,834.20
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	66.82	2,450,356.22
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	11.69	2,073,957.97
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	24.74	542,671.90
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	116.78	539,056.48
AMAZON.COM	727,070	114.99	83,605,779.30
AUTOZONE INC	1,495	2,463.41	3,682,797.95
BATH & BODY WORKS INC	19,806	38.51	762,729.06
BEST BUY COMPANY INC	15,285	69.49	1,062,154.65
BURLINGTON STORES INC	5,108	161.74	826,167.92
CARMAX INC	13,591	71.98	978,280.18
CHEWY INC - CLASS A	6,878	32.04	220,371.12
EBAY	41,952	43.78	1,836,658.56
ETSY INC	10,294	88.03	906,180.82
GENUINE PARTS CO	11,319	160.47	1,816,359.93
HOME DEPOT	80,884	294.94	23,855,926.96
LKQ CORP	19,286	54.54	1,051,858.44
LOWES COMPANIES	47,875	206.65	9,893,368.75
MERCADOLIBRE INC	3,552	1,299.83	4,616,996.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,175	911.99	4,719,548.25
POOL CORP	3,304	338.08	1,117,016.32
ROSS STORES INC	28,076	101.88	2,860,382.88
TJX COMPANIES INC	91,766	77.49	7,110,947.34
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	218.54	1,949,813.88
ULTA BEAUTY INC	3,920	480.61	1,883,991.20
COSTCO WHOLESALE CORP	35,279	484.87	17,105,728.73
DOLLAR GENERAL CORP	17,687	208.18	3,682,079.66
DOLLAR TREE INC	17,931	156.13	2,799,567.03
KROGER CO	51,785	49.10	2,542,643.50
SYSCO CORP	39,357	70.80	2,786,475.60
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,243	147.16	5,333,519.88
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	31.60	1,888,637.20
WALMART INC	117,948	148.31	17,492,867.88
ALTRIA GROUP INC	142,110	44.93	6,385,002.30
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,835	75.05	3,289,816.75
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	62.98	1,511,897.88
BUNGE LIMITED	11,604	91.81	1,065,363.24

CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	51.87	823,125.03
COCA-COLA CO	326,933	61.40	20,073,686.20
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	64.35	990,603.90
CONAGRA BRANDS INC	40,304	35.22	1,419,506.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	235.91	3,052,675.40
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	65.87	872,250.54
GENERAL MILLS INC	46,616	85.47	3,984,269.52
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	262.42	3,154,025.98
HORMEL FOODS CORP	23,338	39.10	912,515.80
JM SMUCKER CO	7,850	149.40	1,172,790.00
KELLOGG CO	18,772	68.53	1,286,445.16
KEURIG DR PEPPER INC	62,155	32.02	1,990,203.10
KRAFT HEINZ CO/THE	56,727	38.69	2,194,767.63
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	109.87	1,304,816.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	87.29	1,814,759.10
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	61.62	903,903.78
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,308	75.65	8,193,500.20
MONSTER BEVERAGE CORP	60,676	57.94	3,515,567.44
PEPSICO INC	108,690	186.07	20,223,948.30
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,090	92.94	11,532,924.60
TYSON FOODS INC	23,306	51.67	1,204,221.02
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	93.92	1,816,976.32
CLOROX COMPANY	9,570	160.25	1,533,592.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,289	77.04	4,798,744.56
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,174	191.75	3,484,864.50
KIMBERLY-CLARK CORP	26,373	138.57	3,654,506.61
PROCTER & GAMBLE CO	187,873	147.55	27,720,661.15
ABBOTT LABORATORIES	137,251	105.74	14,512,920.74
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	282.55	1,679,194.65
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,707	171.26	2,004,940.82
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	42.50	1,700,552.50
BECTON DICKINSON & CO	22,473	246.48	5,539,145.04
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,067	51.50	5,925,950.50
CARDINAL HEALTH	21,902	84.79	1,857,070.58
CENTENE CORP	45,335	65.03	2,948,135.05
CVS HEALTH CORP	104,660	69.67	7,291,662.20
DAVITA INC	4,627	96.94	448,541.38
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	38.05	676,300.70
DEXCOM INC	30,645	115.69	3,545,320.05
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,456	84.74	4,106,161.44
ELEVANCE HEALTH INC	19,014	457.51	8,699,095.14
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	77.19	2,309,601.99

HCA HEALTHCARE INC	16,567	267.76	4,435,979.92
HENRY SCHEIN INC	11,747	76.85	902,756.95
HOLOGIC INC	18,875	80.42	1,517,927.50
HUMANA INC	9,946	506.93	5,041,925.78
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	461.08	3,112,751.08
INSULET CORP	5,246	296.43	1,555,071.78
INTUITIVE SURGICAL INC	28,238	301.44	8,512,062.72
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	218.89	1,433,291.72
MASIMO CORP	4,147	155.24	643,780.28
MCKESSON CORP	11,489	393.14	4,516,785.46
MEDTRONIC PLC	105,263	87.13	9,171,565.19
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	284.85	1,294,643.25
NOVOCURE LTD	7,933	80.38	637,654.54
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	131.09	1,137,730.11
RESMED INC	11,169	222.55	2,485,660.95
STERIS PLC	8,018	201.88	1,618,673.84
STRYKER CORP	26,887	274.16	7,371,339.92
TELEFLEX INC	3,934	237.27	933,420.18
THE CIGNA GROUP	24,609	251.92	6,199,499.28
THE COOPER COS INC	4,134	380.04	1,571,085.36
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,171	479.44	35,560,544.24
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	126.93	593,016.96
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	163.97	1,845,482.35
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,923	130.32	2,205,405.36
ABBVIE INC	140,386	142.52	20,007,812.72
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	128.64	3,059,702.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	191.83	1,849,816.69
AMGEN	42,448	224.44	9,527,029.12
AVANTOR INC	49,647	20.88	1,036,629.36
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	382.56	708,883.68
BIO-TECHNE CORP	12,980	83.21	1,080,065.80
BIOGEN INC	11,060	303.15	3,352,839.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	91.99	1,359,888.17
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	169,623	66.53	11,285,018.19
CATALENT INC	13,739	38.13	523,868.07
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	202.30	850,469.20
DANAHER CORP	54,898	230.01	12,627,088.98
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,061	8.62	310,845.82
EXACT SCIENCES CORP	14,756	82.00	1,209,992.00
GILEAD SCIENCES INC	99,953	78.58	7,854,306.74
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	100.10	1,794,392.60
ILLUMINA INC	12,687	204.37	2,592,842.19

INCYTE CORP	15,212	65.08	989,996.96
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	201.78	3,052,124.28
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	130.38	648,118.98
JOHNSON & JOHNSON	207,999	156.81	32,616,323.19
LILLY (ELI) & CO	63,340	423.21	26,806,121.40
MERCK & CO	201,265	113.27	22,797,286.55
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,355.61	2,450,942.88
MODERNA INC	26,107	137.75	3,596,239.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	93.64	631,320.88
PFIZER	445,597	39.64	17,663,465.08
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,615	748.56	6,448,844.40
REPLIGEN CORP	4,353	170.05	740,227.65
REVVITY INC	10,545	120.30	1,268,563.50
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	33.07	994,844.81
SEAGEN INC	10,981	196.49	2,157,656.69
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.69	708,564.29
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,133	525.10	16,347,938.30
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	216.19	782,175.42
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,685	333.51	6,898,654.35
VIATRIS INC	89,720	9.24	829,012.80
WATERS CORP	4,749	265.92	1,262,854.08
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	342.81	1,976,985.27
ZOETIS INC	36,859	172.67	6,364,443.53
BANK OF AMERICA CORP	574,499	28.58	16,419,181.42
CITIGROUP	153,036	45.91	7,025,882.76
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	27.87	1,101,478.14
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.92	1,410,566.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	1,298.26	1,233,347.00
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.24	498,021.92
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.53	1,201,599.36
JPMORGAN CHASE & CO	232,844	136.59	31,804,161.96
KEY CORP	71,223	10.46	744,992.58
M & T BANK CORP	13,674	123.99	1,695,439.26
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,049	121.49	3,893,633.01
REGIONS FINL CORP	70,810	17.67	1,251,212.70
TRUIST FINANCIAL CORP	104,155	30.75	3,202,766.25
US BANCORP	111,007	31.14	3,456,757.98
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	36.85	525,960.05
WELLS FARGO & CO	304,998	41.21	12,568,967.58
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.94	579,991.26
AMERICAN EXPRESS	50,389	152.56	7,687,345.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	300.40	2,614,080.80

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	64.32	2,048,849.28
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	84.74	1,082,977.20
BANK NEW YORK CO	61,254	41.14	2,519,989.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,354	323.11	33,394,710.94
BLACKROCK INC	11,937	661.53	7,896,683.61
BLACKSTONE INC	56,921	83.73	4,765,995.33
BLOCK INC	43,057	61.56	2,650,588.92
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,514	102.17	3,015,445.38
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	27.87	436,695.03
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	135.55	1,203,006.25
CME GROUP INC	28,271	179.08	5,062,770.68
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	9,576	59.10	565,941.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,002	101.90	2,140,103.80
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	25.18	704,611.94
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	389.04	1,224,697.92
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	46,912	55.79	2,617,220.48
FISERV INC	47,748	118.27	5,647,155.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	236.58	1,419,953.16
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	24.37	635,325.90
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	38.62	166,683.92
GLOBAL PAYMENTS INC	20,864	101.80	2,123,955.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,705	323.57	8,640,936.85
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,833	107.89	4,729,142.37
INVESCO LTD	26,420	15.06	397,885.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	148.89	776,163.57
KKR & CO INC	44,282	50.12	2,219,413.84
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	197.03	1,258,233.58
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	278.49	893,117.43
MASTERCARD INC-CLASS A	67,952	373.75	25,397,060.00
MOODY'S CORP	13,065	312.79	4,086,601.35
MORGAN STANLEY	100,851	82.64	8,334,326.64
MSCI INC	6,518	460.10	2,998,931.80
NASDAQ INC	28,971	54.40	1,576,022.40
NORTHERN TRUST CORP	15,902	72.95	1,160,050.90
PAYPAL HOLDINGS INC	86,747	62.00	5,378,314.00
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	106.02	1,898,500.14
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	90.32	1,398,695.52
S&P GLOBAL INC	26,714	362.19	9,675,543.66
SCHWAB (CHARLES) CORP	116,330	52.79	6,141,060.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	57.87	552,658.50
STATE STREET CORP	29,059	68.37	1,986,763.83
SYNCHRONY FINANCIAL	36,117	30.67	1,107,708.39

TOAST INC-CLASS A	20,341	20.52	417,397.32
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	70.37	637,622.57
VISA INC-CLASS A SHARES	128,824	224.58	28,931,293.92
AFLAC	46,816	66.04	3,091,728.64
ALLSTATE CORP	20,709	116.26	2,407,628.34
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	115.97	732,814.43
AMERICAN INT'L GROUP	59,547	55.77	3,320,936.19
AON PLC	16,687	314.40	5,246,392.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	73.17	2,175,051.42
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,436	206.61	3,395,841.96
ASSURANT INC	4,726	129.36	611,355.36
BROWN & BROWN INC	19,873	63.20	1,255,973.60
CHUBB LTD	33,210	196.44	6,523,772.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,206	102.71	1,150,968.26
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	218.16	472,534.56
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	365.01	1,200,152.88
FNF GROUP	20,461	34.78	711,633.58
GLOBE LIFE INC	8,106	107.45	870,989.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	71.07	1,757,632.17
LOEWS CORP	16,741	57.91	969,471.31
MARKEL CORP	1,007	1,341.27	1,350,658.89
MARSH & MCLENNAN COS	39,396	174.40	6,870,662.40
METLIFE INC	54,127	51.84	2,805,943.68
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	70.49	1,306,602.64
PROGRESSIVE CORP	47,071	133.35	6,276,917.85
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,190	81.79	2,387,450.10
TRAVELERS COS INC/THE	18,521	179.31	3,321,000.51
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,448	221.41	1,870,471.68
WR BERKLEY CORP	17,572	57.76	1,014,958.72
WEYERHAEUSER CO	59,710	29.19	1,742,934.90
ACCENTURE PLC-CL A	49,817	288.10	14,352,277.70
ADOBE INC	36,682	370.42	13,587,746.44
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	87.03	999,452.52
ANSYS INC	6,794	298.80	2,030,047.20
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	168.88	404,298.72
ATLASSIAN CORP-CL A	11,855	159.41	1,889,805.55
AUTODESK INC	17,467	196.64	3,434,710.88
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	13,996	46.38	649,134.48
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	96.76	720,184.68
BLACK KNIGHT INC	11,543	54.52	629,324.36
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,364	205.76	4,395,856.64
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	62.88	670,803.84

CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	122.01	991,209.24
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	55.92	1,134,225.36
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,936	63.30	2,527,948.80
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,682	143.90	2,400,539.80
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	147.65	457,715.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	93.07	1,874,150.59
DOCUSIGN INC	14,969	54.40	814,313.60
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.24	513,032.32
DYNATRACE INC	14,790	48.94	723,822.60
EPAM SYSTEMS INC	4,768	264.84	1,262,757.12
FAIR ISAAC CORP	2,115	760.21	1,607,844.15
FORTINET INC	51,829	68.09	3,529,036.61
GARTNER INC	6,340	325.29	2,062,338.60
GEN DIGITAL INC	43,555	16.96	738,692.80
GODADDY INC - CLASS A	11,388	72.38	824,263.44
HUBSPOT INC	3,646	481.18	1,754,382.28
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,616	128.18	9,179,738.88
INTUIT INC	21,209	449.80	9,539,808.20
MICROSOFT CORP	562,164	315.26	177,227,822.64
MONGODB INC	5,325	272.81	1,452,713.25
OKTA INC	11,505	83.42	959,747.10
ORACLE CORP	128,416	98.54	12,654,112.64
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	125,244	12.64	1,583,084.16
PALO ALTO NETWORKS INC	24,051	189.74	4,563,436.74
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	283.97	1,202,612.95
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	175.08	599,298.84
PTC INC	8,226	130.86	1,076,454.36
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,196	449.98	3,688,036.08
SALESFORCE INC	79,382	206.64	16,403,496.48
SERVICENOW INC	16,202	500.14	8,103,268.28
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,680	175.16	3,096,828.80
SPLUNK INC	13,355	96.52	1,289,024.60
SYNOPSYS INC	12,010	393.09	4,721,010.90
TWILIO INC - A	12,842	59.13	759,347.46
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	390.11	1,302,577.29
UNITY SOFTWARE INC	21,912	28.31	620,328.72
VERISIGN INC	7,790	223.02	1,737,325.80
VMWARE INC-CLASS A	16,717	124.43	2,080,096.31
WIX.COM LTD	5,010	77.57	388,625.70
WORKDAY INC-CLASS A	15,455	192.87	2,980,805.85
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,515	65.65	1,084,209.75
ZSCALER INC	7,204	124.47	896,681.88

AMPHENOL CORPORATION	47,254	74.66	3,527,983.64
APPLE INC	1,262,821	171.56	216,649,570.76
ARISTA NETWORKS INC	18,674	140.47	2,623,136.78
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	122.72	532,359.36
CDW CORP/DE	10,882	170.20	1,852,116.40
CISCO SYSTEMS	326,126	48.91	15,950,822.66
COGNEX CORP	14,352	52.10	747,739.20
CORNING	64,989	30.77	1,999,711.53
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	46.35	1,041,994.35
F5 INC	4,851	144.27	699,853.77
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	14.38	1,401,072.16
HP INC	77,329	30.56	2,363,174.24
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.33	742,664.93
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	157.49	2,179,346.62
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,014	285.43	3,714,586.02
NETAPP INC	18,303	66.46	1,216,417.38
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	62.37	1,034,281.71
TE CONNECTIVITY LTD	24,490	122.17	2,991,943.30
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	404.67	1,577,808.33
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	47.53	842,136.54
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	37.80	974,862.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	271.22	1,128,817.64
AT&T INC	569,565	16.10	9,169,996.50
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	17.19	266,720.04
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	17.92	338,132.48
T-MOBILE US INC	49,791	141.37	7,038,953.67
VERIZON COMMUNICATIONS	331,476	36.24	12,012,690.24
AES CORP	54,375	20.76	1,128,825.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	52.44	1,089,598.32
AMEREN CORPORATION	20,898	82.71	1,728,473.58
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,907	86.00	3,432,002.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,892	143.50	1,993,502.00
ATMOS ENERGY CORP	11,302	116.40	1,315,552.80
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.86	1,369,868.76
CMS ENERGY CORP	23,697	58.63	1,389,355.11
CONSOLIDATED EDISON INC	27,140	93.88	2,547,903.20
CONSTELLATION ENERGY	25,114	84.04	2,110,580.56
DOMINION ENERGY INC	66,179	52.29	3,460,499.91
DTE ENERGY COMPANY	15,851	109.16	1,730,295.16
DUKE ENERGY CORP	60,751	90.75	5,513,153.25
EDISON INTL	30,339	67.37	2,043,938.43
ENTERGY CORP	16,181	100.29	1,622,792.49

ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	40.72	830,647.28
EVERGY INC	18,475	58.75	1,085,406.25
EVERSOURCE ENERGY	27,450	72.75	1,996,987.50
EXELON CORP	81,368	40.44	3,290,521.92
FIRSTENERGY CORP	45,523	37.90	1,725,321.70
NEXTERA ENERGY INC	155,688	74.16	11,545,822.08
NISOURCE INC	32,351	27.36	885,123.36
NRG ENERGY INC	19,068	33.81	644,689.08
PG&E CORP	118,132	16.41	1,938,546.12
PPL CORPORATION	58,459	26.78	1,565,532.02
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	61.31	2,419,783.08
SEMPRA ENERGY	24,582	146.50	3,601,263.00
SOUTHERN CO	85,837	71.15	6,107,302.55
UGI CORP	18,019	28.23	508,676.37
VISTRA CORP	31,797	24.56	780,934.32
WEC ENERGY GROUP INC	26,142	88.86	2,322,978.12
XCEL ENERGY INC	43,741	65.59	2,868,972.19
ADVANCED MICRO DEVICES	127,756	108.12	13,812,978.72
ANALOG DEVICES	40,091	187.92	7,533,900.72
APPLIED MATERIALS	68,040	124.49	8,470,299.60
BROADCOM INC	33,103	686.50	22,725,209.50
ENPHASE ENERGY INC	11,020	162.83	1,794,386.60
ENTEGRIS INC	12,483	95.01	1,186,009.83
FIRST SOLAR INC	7,921	200.89	1,591,249.69
INTEL CORP	325,216	29.51	9,597,124.16
KLA CORP	11,488	414.69	4,763,958.72
LAM RESEARCH CORP	10,752	573.49	6,166,164.48
MARVELL TECHNOLOGY INC	65,557	46.59	3,054,300.63
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	77.62	3,437,712.18
MICRON TECHNOLOGY	86,632	66.01	5,718,578.32
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	423.70	1,496,084.70
NVIDIA CORP	196,006	306.88	60,150,321.28
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,458	175.06	3,581,377.48
ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	82.54	2,844,988.72
QORVO INC	8,556	94.12	805,290.72
QUALCOMM	89,339	103.56	9,251,946.84
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	100.83	1,348,298.76
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	288.95	1,200,876.20
TERADYNE INC	12,318	95.55	1,176,984.90
TEXAS INSTRUMENTS	72,562	169.74	12,316,673.88
WOLFSPEED INC	10,256	49.97	512,492.32
CBRE GROUP INC-A	25,904	76.13	1,972,071.52

	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.41	435,267.00
	ZILLOW GROUP INC-C	13,427	45.59	612,136.93
	アメリカドル 小計	26,909,917		2,843,928,614.31 (394,253,823,801)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	17.69	970,473.40
	CAMECO CORP	31,793	38.24	1,215,764.32
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,954	78.45	6,899,991.30
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	22.53	2,507,431.29
	ENBRIDGE	159,030	49.57	7,883,117.10
	IMPERIAL OIL	16,488	64.62	1,065,454.56
	KEYERA CORP	18,607	30.80	573,095.60
	PARKLAND CORP	14,075	34.60	486,995.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	41.78	1,907,925.48
	SUNCOR ENERGY	109,226	39.35	4,298,043.10
	TC ENERGY CORP	78,423	54.11	4,243,468.53
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	61.05	1,526,799.45
	AGNICO EAGLE MINES	36,354	72.16	2,623,304.64
	BARRICK GOLD CORP	133,727	23.98	3,206,773.46
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	67.58	887,933.62
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	30.60	1,326,816.00
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	203.62	3,128,214.06
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.72	555,799.84
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.81	738,551.31
	LUNDIN MINING CORP	62,243	10.39	646,704.77
	NUTRIEN LTD	41,509	81.39	3,378,417.51
	PAN AMERICAN SILVER CORP	18,411	21.34	392,890.74
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	54.53	1,929,598.58
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	99.75	349,623.75
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	37,268	62.33	2,322,914.44
	CAE INC	25,999	29.42	764,890.58
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	113.25	590,372.25
	WSP GLOBAL INC	9,951	173.80	1,729,483.80
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,505	49.69	671,063.45
	RB GLOBAL INC	10,245	77.13	790,196.85
	THOMSON REUTERS CORP	13,293	168.12	2,234,819.16
	AIR CANADA	13,805	21.46	296,255.30
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,034	156.13	7,187,288.42
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	72,867	106.74	7,777,823.58
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	148.30	865,627.10
	MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	70.91	1,436,211.14
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	100.67	309,056.90
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	38.68	660,615.72

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	97.13	2,241,080.49
QUEBECOR INC -CL B	15,200	34.28	521,056.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	166.95	753,445.35
DOLLARAMA INC	22,000	82.52	1,815,440.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	65,467	65.48	4,286,779.16
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	34.89	532,177.17
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	119.36	1,541,295.68
METRO INC	18,840	73.13	1,377,769.20
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	164.64	860,408.64
SAPUTO INC	20,898	35.22	736,027.56
BANK MONTREAL	54,470	117.43	6,396,412.10
BANK NOVA SCOTIA	93,348	66.51	6,208,575.48
CANADIAN IMPERIAL BANK	73,910	56.25	4,157,437.50
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	101.28	2,763,829.92
ROYAL BANK OF CANADA	109,566	125.88	13,792,168.08
TORONTO-DOMINION BANK	142,518	82.71	11,787,663.78
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.66	1,237,182.66
BROOKFIELD CORP	114,442	42.42	4,854,629.64
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.14	656,141.06
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.83	298,408.55
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	43.89	188,770.89
ONEX CORP	6,603	61.71	407,471.13
TMX GROUP LTD	4,685	145.45	681,433.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	973.43	1,707,396.22
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.32	935,344.16
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	88.00	613,976.00
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	202.06	2,678,305.30
MANULIFE FINANCIAL CORP	143,336	25.59	3,667,968.24
POWER CORP OF CANADA	43,577	35.66	1,553,955.82
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,433	66.90	3,240,167.70
CGI INC - CL A	16,084	137.73	2,215,249.32
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,603.25	4,175,613.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	103.39	722,075.76
OPEN TEXT CORP	20,463	54.96	1,124,646.48
SHOPIFY INC - CLASS A	95,607	78.77	7,530,963.39
BCE INC	6,203	62.88	390,044.64
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,381	64.40	1,956,536.40
TELUS CORP	32,908	26.92	885,883.36
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	11.59	600,570.62
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	23.29	568,159.55
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	47.29	534,140.55
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.98	381,781.52

	EMERA INC	23,223	56.66	1,315,815.18
	FORTIS INC	35,547	58.07	2,064,214.29
	HYDRO ONE LTD	28,888	38.90	1,123,743.20
	NORTHLAND POWER INC	17,854	29.90	533,834.60
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	193.84	521,429.60
	カナダドル 小計	3,211,307		189,517,224.29 (19,461,523,762)
ユーロ	ENI	198,271	13.36	2,649,693.64
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.64	422,003.68
	NESTE OIL OYJ	32,766	37.39	1,225,120.74
	OMV AG	12,549	43.58	546,885.42
	REPSOL SA	111,112	13.34	1,482,789.64
	TENARIS SA	40,648	12.30	499,970.40
	TOTALENERGIES SE	195,959	57.02	11,173,582.18
	AIR LIQUIDE	41,239	160.00	6,598,240.00
	AKZO NOBEL	15,301	75.54	1,155,837.54
	ARCELORMITTAL	41,072	24.46	1,004,826.48
	ARKEMA	4,369	87.18	380,889.42
	BASF SE	73,837	47.46	3,504,673.20
	COVESTRO AG	14,454	39.76	574,691.04
	CRH PLC	60,480	45.49	2,751,235.20
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	115.00	1,576,305.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.68	315,688.34
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,001	69.56	695,669.56
	OCI NV	7,248	23.07	167,211.36
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	35.08	684,200.32
	SOLVAY SA	5,356	104.55	559,969.80
	STORA ENSO OYJ R	42,169	12.10	510,244.90
	SYMRISE AG	10,018	104.80	1,049,886.40
	UMICORE	17,605	28.71	505,439.55
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.79	1,260,831.96
	VOESTALPINE AG	7,152	30.46	217,849.92
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	31.09	485,687.98
	AIRBUS SE	46,560	126.28	5,879,596.80
	ALSTOM	24,388	26.98	657,988.24
	BOUYGUES ORD	16,606	30.66	509,139.96
	BRENTAG SE	12,514	74.78	935,796.92
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	13.08	1,059,820.08
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	33,494	29.15	976,350.10
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	167.20	356,136.00
	EIFFAGE	5,924	103.70	614,318.80
	FERROVIAL SA	37,026	29.44	1,090,045.44

GEA GROUP AG	13,382	40.00	535,280.00
IMCD NV	4,641	143.55	666,215.55
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	63.24	784,049.52
KNORR-BREMSE AG	5,022	66.64	334,666.08
KONE OYJ-B	26,369	49.03	1,292,872.07
LEGRAND SA	21,768	86.66	1,886,414.88
METSO CORPORATION	51,970	10.46	543,606.20
MTU AERO ENGINES AG	3,962	224.20	888,280.40
PRYSMIAN SPA	21,155	34.92	738,732.60
RATIONAL AG	483	616.00	297,528.00
RHEINMETALL AG	3,660	253.40	927,444.00
SAFRAN SA	26,468	139.88	3,702,343.84
SAINT-GOBAIN	40,093	54.85	2,199,101.05
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,646	163.28	6,963,238.88
SIEMENS	60,788	155.44	9,448,886.72
SIEMENS ENERGY AG	36,841	23.98	883,447.18
THALES SA	8,524	134.25	1,144,347.00
VINCI S.A.	41,377	109.68	4,538,229.36
WARTSILA OYJ	41,917	10.75	450,817.33
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.83	622,562.59
RANDSTAD NV	10,558	48.12	508,050.96
TELEPERFORMANCE	4,734	160.25	758,623.50
WOLTERS KLUWER	20,644	107.95	2,228,519.80
ADP	2,382	143.10	340,864.20
AENA SME SA	5,508	148.50	817,938.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.49	430,305.07
DEUTSCHE POST AG-REG	81,221	42.08	3,418,185.78
GETLINK	35,220	16.95	596,979.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,705	104.48	2,790,138.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	98.20	490,116.20
CONTINENTAL AG	8,168	67.16	548,562.88
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	120.35	1,131,290.00
FERRARI NV	10,170	269.50	2,740,815.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	62,534	71.26	4,456,172.84
MICHELIN	55,356	27.88	1,543,325.28
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	55.52	652,082.40
RENAULT SA	17,362	33.69	585,012.59
STELLANTIS NV	175,794	15.23	2,678,748.97
VALEO SA	16,596	19.06	316,402.74
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,283	121.16	1,851,688.28
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	151.30	376,131.80
ADIDAS AG	12,635	159.28	2,012,502.80

HERMES INTERNATIONAL	2,516	1,890.20	4,755,743.20
KERING	5,997	525.90	3,153,822.30
LVMH	22,026	834.20	18,374,089.20
MONCLER SPA	14,541	61.20	889,909.20
PUMA SE	9,220	46.96	432,971.20
SEB SA	2,282	101.40	231,394.80
ACCOR	14,436	31.48	454,445.28
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,321	66.42	2,346,020.82
DELIVERY HERO SE	13,414	36.09	484,111.26
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,563	188.60	2,369,381.80
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	16.04	249,837.16
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	37.74	305,995.92
SODEXO	6,173	102.00	629,646.00
BOLLORE SE	83,646	5.99	501,039.54
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.72	1,234,803.24
SCOUT24 SE	7,492	58.74	440,080.08
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	53,677	19.24	1,032,745.48
VIVENDI SE	61,243	9.10	557,311.30
D' IETEREN GROUP	2,217	165.10	366,026.70
INDITEX	87,326	31.07	2,713,218.82
PROSUS	64,875	66.76	4,331,055.00
ZALANDO SE	17,664	30.09	531,509.76
CARREFOUR	52,544	17.88	939,749.44
HELLOFRESH SE	13,805	21.81	301,087.05
JERONIMO MARTINS	24,901	22.74	566,248.74
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.06	362,698.98
KONINKLIJKE AHOLD NV	86,126	30.69	2,643,206.94
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,606	54.51	3,685,203.06
DANONE (GROUPE)	51,543	58.27	3,003,410.61
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	51,242	12.33	632,070.07
HEINEKEN HOLDING NV	6,849	84.80	580,795.20
HEINEKEN NV	20,157	101.55	2,046,943.35
JDE PEET'S BV	7,000	27.40	191,800.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	94.94	1,238,967.00
PERNOD-RICARD	16,694	211.90	3,537,458.60
REMY COINTREAU	2,519	152.25	383,517.75
BEIERSDORF AG	7,430	125.15	929,864.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	68.64	602,659.20
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	77.22	1,114,979.58
LOREAL	19,143	412.60	7,898,401.80
AMPLIFON SPA	11,650	33.06	385,149.00
BIOMERIEUX	3,044	98.86	300,929.84

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	108.65	372,669.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	101.70	210,519.00
ESSILORLUXOTTICA	22,662	177.16	4,014,799.92
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	42.52	722,202.20
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	27.42	923,752.38
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	18.68	1,341,978.30
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	53.16	1,146,501.72
ARGENX SE	4,177	388.00	1,620,676.00
BAYER	76,626	54.05	4,141,635.30
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	61.72	630,778.40
GRIFOLS SA	27,685	11.56	320,177.02
IPSEN	3,532	112.50	397,350.00
MERCK KGAA	10,555	166.35	1,755,824.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	41.78	411,700.12
QIAGEN N.V.	17,038	42.75	728,374.50
RECORDATI SPA	10,171	44.34	450,982.14
SANOFI	90,096	101.10	9,108,705.60
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	332.80	607,027.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,524	246.50	622,166.00
UCB (GROUPE)	9,389	85.84	805,951.76
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	14.84	410,983.82
AIB GROUP PLC	88,299	4.02	354,961.98
BANCO BILBAO VIZCAYA	472,469	6.49	3,067,268.74
BANCO SANTANDER SA	1,306,699	3.22	4,214,104.27
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.20	813,077.60
BNP PARIBAS	89,945	57.08	5,134,060.60
CAIXABANK	336,789	3.50	1,181,455.81
COMMERZBANK AG	81,889	9.97	816,760.88
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.96	1,189,656.78
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	31.46	798,328.96
FINECOBANK SPA	41,585	12.30	511,495.50
ING GROEP NV-CVA	293,860	12.21	3,589,206.04
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.34	2,921,656.71
KBC GROEP NV	21,452	60.46	1,296,987.92
MEDIOBANCA	53,990	10.17	549,348.25
SOCIETE GENERALE	63,329	24.26	1,536,678.18
UNICREDIT SPA	149,896	19.12	2,866,910.89
ADYEN NV	1,746	1,502.60	2,623,539.60
AMUNDI SA	4,626	58.10	268,770.60
DEUTSCHE BANK NAMEN	157,109	9.96	1,565,434.07
DEUTSCHE BOERSE	15,678	167.00	2,618,226.00
EDEMRED	20,131	60.62	1,220,341.22

EURAZEO SA	3,357	63.55	213,337.35
EURONEXT NV	6,480	65.25	422,820.00
EXOR NV	7,825	78.70	615,827.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	75.24	640,668.60
NEXI SPA	48,458	7.77	376,712.49
SOFINA	1,238	202.00	250,076.00
WENDEL	2,023	101.40	205,132.20
WORLDLINE SA	20,332	40.61	825,682.52
AEGON	148,741	4.42	658,773.88
AGEAS	11,086	41.29	457,740.94
ALLIANZ SE-REG	31,825	211.60	6,734,170.00
ASSICURAZIONI GENERALI	82,625	18.10	1,495,925.62
AXA SA	145,657	27.86	4,058,004.02
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	197.65	880,530.75
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,181	336.80	3,765,760.80
NN GROUP NV	22,611	35.87	811,056.57
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.90	455,838.57
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	43.40	1,677,627.00
BECHTLE AG	7,659	38.70	296,403.30
CAPGEMINI SA	13,474	162.80	2,193,567.20
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	39.40	2,079,019.80
NEMETSCHKE SE	5,455	70.60	385,123.00
SAP SE	82,544	121.82	10,055,510.08
NOKIA OYJ	451,941	3.81	1,723,251.03
CELLNEX TELECOM SA	47,754	38.27	1,827,545.58
DEUTSCHE TELEKOM	256,698	21.87	5,615,268.75
ELISA A	10,227	54.90	561,462.30
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.87	360,551.25
KPN (KON.)	282,927	3.28	929,981.04
ORANGE	149,082	11.60	1,729,649.36
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.27	234,451.80
TELEFONICA	431,420	3.99	1,723,091.48
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.76	272,848.26
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,513	14.34	136,416.42
ACCIONA SA	2,181	165.90	361,827.90
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	31.72	172,461.64
E.ON SE	186,604	11.45	2,136,615.80
EDP RENOVAVEIS SA	21,466	19.66	422,021.56
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	21,466	0.26	5,688.49
ELIA GROUP SA/NV	3,125	119.30	372,812.50
ENAGAS	21,663	17.95	388,850.85
ENDESA	25,972	20.09	521,777.48

	ENEL	630,812	6.03	3,804,427.17
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	225,753	4.73	1,068,940.45
	ENGIE	145,658	14.41	2,098,931.78
	FORTUM OYJ	32,550	13.37	435,193.50
	IBERDROLA SA	486,473	11.64	5,664,978.08
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.60	266,266.00
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	16.07	492,995.46
	RWE STAMM	50,344	40.89	2,058,566.16
	SNAM SPA	147,559	5.03	743,402.24
	TERNA SPA	123,882	7.85	972,969.22
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,273	27.77	1,368,311.21
	VERBUND AG	6,430	74.50	479,035.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,965	359.30	1,424,624.50
	ASML HOLDING NV	31,858	635.00	20,229,830.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,329	35.65	3,755,505.49
	STMICROELECTRONICS NV	55,076	41.54	2,287,857.04
	AROUNDTOWN SA	64,068	1.04	66,726.82
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	53.18	280,524.50
	VONOVIA SE	52,580	18.57	976,673.50
	ユーロ 小計	14,631,130		379,340,100.05 (56,643,063,739)
イギリスポンド	BP PLC	1,440,571	4.88	7,034,308.19
	SHELL PLC-NEW	562,022	24.18	13,589,691.96
	ANGLO AMERICAN PLC	101,345	23.46	2,377,553.70
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	13.89	414,849.12
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	62.94	687,556.56
	GLENCORE PLC	833,513	4.27	3,565,768.61
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	19.09	321,712.56
	MONDI PLC	41,710	13.08	545,566.80
	RIO TINTO PLC REG	88,610	48.95	4,337,459.50
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	49.19	1,638,863.23
	BAE SYSTEMS PLC	240,104	9.63	2,313,642.14
	BUNZL PLC	29,127	31.06	904,684.62
	DCC PLC	6,622	50.24	332,689.28
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.53	974,212.58
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.54	438,045.42
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	111.00	612,054.00
	EXPERIAN PLC	74,115	28.27	2,095,231.05
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	41.92	582,268.80
	RELX PLC	149,499	24.92	3,725,515.08
	RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	6.34	1,348,398.08
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.94	362,276.69

BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	42.05	292,331.60
BURBERRY GROUP PLC	29,776	22.58	672,342.08
PERSIMMON PLC	25,686	12.86	330,321.96
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.23	325,112.02
COMPASS GROUP PLC	142,427	22.13	3,151,909.51
ENTAIN PLC	49,630	14.71	730,305.45
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	53.20	787,945.20
PEARSON	55,305	8.33	460,801.26
WHITBREAD PLC	17,434	33.30	580,552.20
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.22	451,293.33
INFORMA PLC	110,598	7.27	804,268.65
WPP PLC	85,821	8.94	767,583.02
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.55	322,543.58
KINGFISHER PLC	153,717	2.46	379,373.55
NEXT PLC	11,044	65.54	723,823.76
OCADO GROUP PLC	54,753	4.02	220,435.57
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.78	412,371.30
TESCO PLC	601,050	2.68	1,611,415.05
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	18.68	480,951.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO	169,799	27.38	4,649,945.61
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	25.28	454,028.80
DIAGEO	179,481	35.38	6,350,935.18
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	18.19	1,245,957.21
HALEON PLC	405,046	3.36	1,362,574.74
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,052	64.60	3,620,959.20
UNILEVER PLC	200,460	42.16	8,451,393.60
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.69	870,470.55
ASTRAZENECA	123,190	120.34	14,824,684.60
GSK PLC	318,698	14.30	4,558,018.79
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	18.42	303,164.95
BARCLAYS	1,252,105	1.63	2,046,440.41
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,575,458	6.17	9,733,179.52
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,254,644	0.47	2,500,685.07
NATWEST GROUP PLC	412,008	2.74	1,128,901.92
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.59	1,253,528.12
3I GROUP PLC	74,757	19.25	1,439,072.25
ABRDN PLC	153,430	2.11	323,890.73
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.25	273,166.38
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	30,297	84.78	2,568,579.66
M&G PLC	229,107	2.00	458,443.10
SCHRODERS PLC	82,861	4.68	387,872.34
ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	11.39	466,442.93

	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.00	373,865.00
	AVIVA PLC	240,378	4.23	1,018,721.96
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,759	2.37	1,165,552.62
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.81	296,621.81
	PRUDENTIAL	212,226	11.71	2,485,166.46
	SAGE GROUP PLC	76,660	8.59	658,509.40
	HALMA PLC	31,069	23.80	739,442.20
	BT GROUP PLC	479,168	1.48	711,564.48
	VODAFONE GROUP PLC	2,054,746	0.84	1,727,630.43
	NATIONAL GRID PLC	286,962	11.11	3,189,582.63
	SEVERN TRENT PLC	17,468	27.97	488,579.96
	SSE PLC	81,692	18.69	1,527,231.94
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.41	526,537.80
	イギリスbond 小計	21,744,140		145,889,371.31 (25,133,820,889)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.82	240,440.36
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	706.00	405,244.00
	GIVAUDAN-REG	748	3,020.00	2,258,960.00
	HOLCIM LTD	44,847	57.46	2,576,908.62
	SIG GROUP AG	26,203	25.66	672,368.98
	SIKA AG-BR	11,714	250.20	2,930,842.80
	ABB LTD	122,184	33.27	4,065,061.68
	GEBERIT AG-REG	2,964	491.60	1,457,102.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	185.80	380,518.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	192.30	594,591.60
	VAT GROUP AG	1,956	330.10	645,675.60
	ADECCO GROUP AG-REG	15,639	28.85	451,185.15
	SGS SA	12,650	80.70	1,020,855.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	259.20	1,186,358.40
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,941	148.45	6,077,691.45
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	279.80	694,743.40
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	51.50	202,807.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,920.00	537,600.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,400.00	875,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,930.00	896,260.00
	NESTLE SA - REGISTERED	218,301	112.42	24,541,398.42
	ALCON INC	38,399	72.76	2,793,911.24
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	245.90	955,813.30
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	138.10	1,179,374.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	95.75	177,137.50
	LONZA GROUP AG-REG	5,733	580.40	3,327,433.20
	NOVARTIS	171,731	90.81	15,594,892.11

	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	314.00	695,510.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,824	286.55	15,996,367.20
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	89.60	222,835.20
	CREDIT SUISSE GROUP AG	297,417	0.80	239,063.78
	JULIUS BAER GROUP LTD	18,791	58.18	1,093,260.38
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	861.80	1,579,679.40
	UBS GROUP AG	261,888	18.11	4,742,791.68
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,366	142.50	622,155.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	537.00	1,299,003.00
	SWISS RE LTD	24,445	92.12	2,251,873.40
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,854	432.40	5,125,669.60
	TEMENOS AG - REG	5,150	76.16	392,224.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	58.76	862,949.36
	SWISSCOM	1,861	583.00	1,084,963.00
	BKW AG	1,744	163.30	284,795.20
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	76.95	436,999.05
	スイスフラン 小計	1,475,426		113,670,513.86 (17,485,935,147)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	336.95	7,497,811.40
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	417.50	2,247,402.50
	SCA SV CELLULOSA B	53,887	147.55	7,951,026.85
	ALFA LAVAL AB	19,283	391.10	7,541,581.30
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	246.60	18,735,928.20
	ATLAS COPCO A	207,097	152.30	31,540,873.10
	ATLAS COPCO B	127,608	132.70	16,933,581.60
	EPIROC AB-A	53,479	204.00	10,909,716.00
	EPIROC AB-B	28,804	174.20	5,017,656.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	88.98	3,444,593.76
	INDUTRADE AB	22,644	257.60	5,833,094.40
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	218.50	3,059,437.00
	LIFCO AB-B SHS	17,970	231.30	4,156,461.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	112.25	13,789,688.00
	SANDVIK AB	87,644	201.90	17,695,323.60
	SKANSKA B	25,507	151.70	3,869,411.90
	SKF AB-B	36,050	183.30	6,607,965.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	214.80	2,902,807.20
	VOLVO B	114,238	207.85	23,744,368.30
	SECURITAS B	28,375	84.56	2,399,390.00
	VOLVO CAR AB-B	49,839	39.31	1,959,171.09
	ELECTROLUX AB-SER B	21,269	161.80	3,441,324.20
	EVOLUTION AB	15,096	1,408.80	21,267,244.80
	EMBRACER GROUP AB	53,147	41.25	2,192,313.75

	HENNES & MAURITZ B	55,229	143.80	7,941,930.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	302.30	14,955,990.20	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	251.30	4,472,134.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	238.40	3,417,464.00	
	NORDEA BANK ABP	258,570	110.16	28,484,071.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	116.60	15,303,167.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	89.18	10,767,236.48	
	SWEDBANK AB-A	72,526	171.65	12,449,087.90	
	EQT AB	31,471	210.60	6,627,792.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	293.10	3,463,855.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	292.30	3,264,406.40	
	INVESTOR AB-A SHS	38,925	220.50	8,582,962.50	
	INVESTOR AB-B SHS	140,493	218.15	30,648,547.95	
	KINNEVIK AB - B	18,792	164.50	3,091,284.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	482.20	3,510,416.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	55.96	12,013,996.44	
	HEXAGON AB-B SHS	147,005	120.30	17,684,701.50	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	101.20	4,732,314.40	
	TELIA CO AB	230,643	26.69	6,155,861.67	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	41.25	2,338,875.00	
	SAGAX AB-B	17,402	223.30	3,885,866.60	
	スウェーデンクローナ 小計	2,947,684		428,530,134.39 (5,596,603,555)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	27,755	254.50	7,063,647.50	
	EQUINOR ASA	73,436	304.15	22,335,559.40	
	NORSK HYDRO	100,517	68.64	6,899,486.88	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	426.70	5,332,896.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	462.00	3,993,990.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	80.20	1,533,183.40	
	MOWI ASA	31,968	185.90	5,942,851.20	
	ORKLA	69,804	81.24	5,670,876.96	
	SALMAR ASA	5,423	463.30	2,512,475.90	
	DNB BANK ASA	71,795	188.00	13,497,460.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	185.00	3,436,190.00	
	TELENOR ASA	51,193	117.55	6,017,737.15	
	ノルウェークローネ 小計	490,725		84,236,354.99 (1,066,432,254)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	536.80	4,553,674.40	
	NOVOZYMES A/S	17,111	357.60	6,118,893.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,713.00	1,293,315.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	81,654	202.40	16,526,769.60	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,570.00	2,533,830.00	

	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	11,725.00	5,088,650.00
	DSV A/S	14,203	1,333.50	18,939,700.50
	PANDORA A/S	7,957	577.00	4,591,189.00
	CARLSBERG AS-B	6,830	1,118.50	7,639,355.00
	COLOPLAST-B	9,208	886.40	8,161,971.20
	DEMANT A/S	8,512	275.00	2,340,800.00
	GENMAB A/S	5,250	2,895.00	15,198,750.00
	NOVO NORDISK A/S-B	131,448	1,142.20	150,139,905.60
	DANSKE BANK A/S	56,132	145.45	8,164,399.40
	TRYG A/S	29,772	159.95	4,762,031.40
	ORSTED A/S	15,439	644.00	9,942,716.00
	デンマーククローネ 小計	393,407		265,995,950.70 (5,333,218,811)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	30.94	638,261.26
	SANTOS	265,406	7.40	1,964,004.40
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	33.49	462,563.88
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	147,086	34.73	5,108,296.78
	BHP GROUP LTD	399,952	43.80	17,517,897.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.19	667,236.30
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	20.45	2,834,206.40
	IGO LTD	56,345	14.73	829,961.85
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	37.69	1,392,570.12
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	74.03	1,066,698.27
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	26.43	1,954,207.77
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	13.09	1,330,310.52
	ORICA LTD	38,288	15.82	605,716.16
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.77	999,243.45
	RIO TINTO LTD	28,272	109.38	3,092,391.36
	SOUTH32 LTD	346,773	4.01	1,390,559.73
	REECE LTD	16,814	18.44	310,050.16
	BRAMBLES LTD	108,007	14.38	1,553,140.66
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	22.12	981,597.12
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.52	420,960.32
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.36	540,600.00
	TRANSURBAN GROUP	249,674	14.60	3,645,240.40
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	38.73	1,789,713.30
	IDP EDUCATION LTD	17,793	26.54	472,226.22
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.93	897,324.09
	REA GROUP LTD	3,586	139.19	499,135.34
	SEEK LTD	28,001	24.30	680,424.30
	WESFARMERS LTD	92,975	49.91	4,640,382.25
	COLES GROUP LTD	108,486	18.03	1,956,002.58

	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.27	689,079.27	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	101,437	37.94	3,848,519.78	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.95	828,282.00	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	244.75	1,170,639.25	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	58.89	712,981.23	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	35.17	1,310,117.67	
	CSL LIMITED	37,924	309.20	11,726,100.80	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	236,293	23.97	5,663,943.21	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,440	99.44	13,368,713.60	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	247,090	26.67	6,589,890.30	
	WESTPAC BANKING	272,224	21.26	5,787,482.24	
	ASX LTD	14,549	67.97	988,895.53	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,094	180.27	5,244,775.38	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.18	863,309.16	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.51	814,962.33	
	QBE INSURANCE GROUP	126,465	14.94	1,889,387.10	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	12.92	1,225,642.88	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	72.96	1,006,920.96	
	XERO LTD	11,340	110.43	1,252,276.20	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.35	1,341,831.45	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	8.25	1,249,602.75	
	オーストラリアドル 小計	5,435,162		127,814,275.68 (11,710,343,937)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.86	730,604.46	
	EBOS GROUP LTD	14,283	42.91	612,883.53	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	25.66	1,025,886.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.22	904,541.55	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.40	413,523.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.44	601,359.36	
	ニュージーランドドル 小計	484,999		4,288,798.90 (371,710,200)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	48.35	10,346,706.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	77.60	8,303,200.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.78	1,083,760.00	
	MTR CORP	125,000	38.50	4,812,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	13.26	1,591,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	52.15	9,074,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	26.15	5,177,700.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.85	3,042,015.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.33	2,850,443.33	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.10	6,784,150.00	
	HANG SENG BANK	59,400	112.40	6,676,560.00	

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,400	306.20	28,905,280.00	
	AIA GROUP LTD	931,200	78.30	72,912,960.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	41.25	1,546,875.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	57.25	7,871,875.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	7.32	6,622,089.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	42.10	4,715,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	42.65	7,015,754.40	
	ESR GROUP LTD	157,000	11.82	1,855,740.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	12.72	2,200,560.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.90	3,368,633.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	19.20	2,618,400.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.94	3,450,476.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	124,500	103.30	12,860,850.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	55.15	2,233,575.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.86	1,910,532.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	40.95	5,036,850.00	
	香港ドル 小計	5,848,053		224,867,984.77 (3,977,914,650)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	35.32	282,560.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.50	733,200.00	
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.12	277,710.03	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.71	546,854.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.38	691,158.16	
	GENTING SINGAPORE LTD	315,000	1.02	321,300.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.97	709,042.00	
	DBS GROUP	140,400	31.49	4,421,196.00	
	OCBC BANK	257,100	12.26	3,152,046.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	93,900	27.95	2,624,505.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.37	618,420.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	15.28	392,696.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.54	1,729,595.22	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.45	771,075.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.84	292,752.00	
UOL GROUP LIMITED	47,500	6.76	321,100.00		
	シンガポールドル 小計	4,600,766		17,885,209.41 (1,840,030,344)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	23.44	1,392,968.88	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	727.50	1,561,215.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	31.16	3,063,339.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	27.96	3,145,835.52	
	FIRST INTL BANK ISRAEL	5,099	143.70	732,726.30	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.73	1,863,635.00	

MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	128.00	1,600,384.00
NICE LTD	4,991	715.00	3,568,565.00
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	176,957	4.91	868,858.87
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	149.90	1,499,000.00
AZRIELI GROUP	1,537	201.40	309,551.80
イスラエルシケル 小計	582,982		19,606,079.97 (734,230,049)
合 計	88,755,698		543,608,651,138 (543,608,651,138)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	837,064.50	
		LENDLEASE GROUP	64,786	506,626.52	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,343,691.02 (123,108,971)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,187,800.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,187,800.00 (56,392,182)	
投資信託受益証券合計			463,076	179,501,153 (179,501,153)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,476,729.33	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	832,882.90	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,446	7,045,464.90	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	700,539.46	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	1,984,686.48	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	572,632.74	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	820,386.63	
		CROWN CASTLE INC	33,305	3,762,132.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,118,865.33	
		EQUINIX INC	7,399	5,155,697.19	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	903,169.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,464	1,795,241.52	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,099,400.10	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,609,442.12	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	866,026.70	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	586,416.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	912,089.75	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	954,921.86	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,499,216.48	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,276,165.46	
KIMCO REALTY CORP	47,897	882,262.74			

	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50,036	395,284.40	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,344,492.90	
	PROLOGIS INC	73,426	9,071,048.04	
	PUBLIC STORAGE	12,022	3,456,325.00	
	REALTY INCOME CORP	49,865	2,996,886.50	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	720,133.16	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	1,977,780.69	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,472	2,652,399.36	
	SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,320,817.05	
	UDR INC	23,815	958,315.60	
	VENTAS INC	31,565	1,404,642.50	
	VICI PROPERTIES INC	75,143	2,336,195.87	
	WELLTOWER INC	35,075	2,671,662.75	
	WP CAREY INC	16,024	1,109,982.48	
	アメリカドル 小計	966,150	69,270,335.79 (9,602,946,650)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	237,996.90	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	313,052.90	
	カナダドル 小計	20,377	551,049.80 (56,587,303)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	238,374.48	
	GECINA SA	3,139	310,761.00	
	KLEPIERRE	17,225	370,682.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	475,597.95	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	346,870.04	
	ユーロ 小計	48,695	1,742,285.47 (260,158,066)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	290,416.99	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	358,110.61	
	SEGRO PLC	103,383	853,116.51	
	イギリスポンド 小計	239,086	1,501,644.11 (258,703,247)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	762,129.00	
	GOODMAN GROUP	133,807	2,709,591.75	
	GPT GROUP	167,884	728,616.56	
	MIRVAC GROUP	266,683	621,371.39	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,067,592.40	
	STOCKLAND	207,412	922,983.40	
	VICINITY CENTERS	305,149	604,195.02	
	オーストラリアドル 小計	1,556,308	7,416,479.52 (679,497,853)	
香港ドル	LINK REIT	170,500	8,405,650.00	

	香港ドル 小計	170,500	8,405,650.00 (148,695,948)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	784,220.88	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	680,443.29	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	470,093.74	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	371,800.00	
	シンガポールドル 小計	1,125,856	2,306,557.91 (237,298,677)	
	投資証券合計	4,126,972	11,243,887,744 (11,243,887,744)	
	合計		11,423,388,897 (11,423,388,897)	

(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 601銘柄	97.6%			71.0%
	投資証券 35銘柄			2.4%	1.7%
カナダドル	株式 85銘柄	99.7%			3.5%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式 222銘柄	99.5%			10.2%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 76銘柄	99.0%			4.5%
	投資証券 3銘柄			1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 43銘柄	100.0%			3.2%
スウェーデンクローナ	株式 45銘柄	100.0%			1.0%
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	93.6%			2.1%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 27銘柄	95.1%			0.7%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.3%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.6%	0.0%

シンガポールドル	株式 16銘柄	88.6%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 11銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,184,761,422
コール・ローン	118,654,575
株式	142,793,886,696
投資信託受益証券	405,053,605
投資証券	111,521,338
派生商品評価勘定	7,322,350
未収入金	314,469
未収配当金	223,295,209
前払金	115,998,653
差入委託証拠金	1,076,563,282
流動資産合計	151,037,371,599
資産合計	151,037,371,599
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	123,308,613
未払解約金	72,521,187
未払利息	203
流動負債合計	195,830,003
負債合計	195,830,003
純資産の部	
元本等	
元本	41,605,821,743
剰余金	
剰余金又は欠損金()	109,235,719,853
元本等合計	150,841,541,596
純資産合計	150,841,541,596
負債純資産合計	151,037,371,599

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 5月24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</p>

2023年 5月24日現在	
	<p>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取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取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。</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 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,605,821,743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 3.6255円 (1万口当たり純資産額) (36,255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 5月24日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2023年 5月24日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2023年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	30,921,081,675円
期中追加設定元本額	11,809,600,737円
期中一部解約元本額	1,124,860,669円
期末元本額	41,605,821,743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	7,834,960,121円
世界経済インデックスファンド	8,775,384,168円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,816,576,747円
DC 世界経済インデックスファンド	6,946,815,628円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	119,646,809円
コア投資戦略ファンド(安定型)	109,036,912円
コア投資戦略ファンド(成長型)	264,234,197円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,017,283,117円
DC 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	745,097,192円
コア投資戦略ファンド(切替型)	122,627,005円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	395,892,927円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,403,207円
SMT インデックスバランス・オープン	97,967,403円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	19,430,412円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	3,781,789,917円
SMT 世界経済インデックス・オープン	219,159,812円

区分	2023年 5月24日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	881,364,951円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	150,981,924円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,008,220円
グローバル経済コア	403,943,409円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	140,632,545円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	100,944,337円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	22,104,370円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	40,912,121円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	40,104,754円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,291,581円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	25,230,764円
10資産分散投資ファンド	13,222,484円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,410,839,528円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	99,825,579円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	79,369,045円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,506,128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）	49,401,926円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,429,604,432	
投資信託受益証券	12,047,793	
投資証券	3,967,296	
合計	6,437,684,929	

(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 5月24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	7,595,457,988	-	7,479,459,335	115,998,653
合計		7,595,457,988	-	7,479,459,335	115,998,653

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 5月24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	37,132,200	-	37,144,590	12,390
	香港ドル	37,132,200	-	37,144,590	12,390

合計	37,132,200	-	37,144,590	12,390
----	------------	---	------------	--------

(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	1.48	207,148.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.15	121,049.50	
	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	66.66	1,049,828.34	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	28.53	1,821,098.43	
	NIO INC - ADR	235,578	8.75	2,061,307.50	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	39.94	1,204,550.46	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	5.72	453,412.96	
	TRIP.COM GROUP LTD	87,657	32.96	2,889,174.72	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	57.93	3,849,564.36	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	29.26	359,400.58	
	IQIYI INC-ADR	59,454	4.73	281,217.42	
	JOYY INC	6,185	28.18	174,293.30	
	KANZHUN LTD	38,815	16.90	655,973.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	7.37	836,841.39	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	16.33	85,716.17	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	16.57	177,729.82	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	61.93	5,014,719.82	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	73,380	14.17	1,039,794.60	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	12,386	66.54	824,164.44	
ZAI LAB LTD-ADR	12,825	33.73	432,587.25		
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.16	468,524.00		
CREDICORP LTD	10,882	133.28	1,450,352.96		
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-		

	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.51	172,340.83
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	14.71	305,276.63
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	117,300	3.31	389,201.40
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	39.74	311,362.90
	KE HOLDINGS INC	113,384	15.51	1,758,585.84
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.71	109,293.74
	アメリカドル 小計	2,214,076		28,504,511.26 (3,951,580,395)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,657,761	11.05	29,368,259.05
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	77.70	37,986,908.40
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,500	251.55	3,647,475.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	38.94	6,952,814.88
	ALFA S.A.B. -A	313,500	11.29	3,539,415.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	102.34	10,438,680.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	498.90	16,750,567.50
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	311.47	18,681,970.60
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	171.64	7,326,453.40
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	590,690	17.12	10,112,612.80
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	71.09	58,811,335.20
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	50,475	172.37	8,700,375.75
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	174.28	54,574,039.20
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	263.15	6,831,374.00
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	91.01	16,545,618.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	37.03	6,732,054.00
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	57.57	8,215,239.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	142.11	58,591,953.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	399,400	40.88	16,327,472.00
AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,298,140	19.16	82,352,362.40	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	14.89	3,292,179.00	
	メキシコペソ 小計	11,536,230		465,779,158.18 (3,594,138,296)
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	15.80	2,561,180.00
	PETRO RIO SA	130,000	36.16	4,700,800.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	638,000	29.45	18,789,100.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	26.25	19,111,050.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	17.25	1,304,100.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	13.11	1,303,134.00
	GERDAU SA-PREF	214,790	25.04	5,378,341.60
	SUZANO SA	121,779	45.86	5,584,784.94
	VALE SA	608,687	66.56	40,514,206.72
	WEG SA	255,844	40.22	10,290,045.68
	CCR SA	248,600	13.75	3,418,250.00

	LOCALIZA RENT A CAR	93,140	63.00	5,867,820.00	
	RUMO SA	244,300	21.01	5,132,743.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	18.62	4,030,243.14	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.66	1,118,130.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	16.98	2,937,540.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	9.88	1,310,088.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	28.09	5,316,875.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	11.57	1,756,326.00	
	AMBEV SA	756,200	14.59	11,032,958.00	
	JBS SA	110,000	16.98	1,867,800.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	13.36	1,340,114.88	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	613,154	3.65	2,238,012.10	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	29.15	2,789,655.00	
	HYPERA SA	54,500	39.35	2,144,575.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.75	4,482,816.25	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	16.05	13,292,321.10	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	44.48	6,961,120.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	26.57	20,732,066.17	
	ITAUSA SA	774,657	8.91	6,902,193.87	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,060,409	13.21	14,008,002.89	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	30.77	3,350,853.00	
	TOTVS SA	57,900	28.82	1,668,678.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	41.69	3,727,086.00	
	TIM SA	96,100	14.17	1,361,737.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	39.54	1,462,980.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	35.83	7,585,211.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.00	2,541,924.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	50.48	2,549,240.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	31.90	867,680.00	
	ENEVA SA	102,200	11.74	1,199,828.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	42.21	1,952,212.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	29.15	4,812,665.00	
	ブラジルリアル 小計	11,648,898		261,296,488.04 (7,282,359,251)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,100.00	551,580,300.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,457.00	198,101,005.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	57,380.00	1,219,382,380.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	58.00	142,748,904.00	
	FALABELLA SA	70,837	1,875.00	132,819,375.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,545.00	473,437,440.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,550.00	48,371,750.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	86.50	655,947,059.50	

	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	24,800.00	153,586,400.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	37.25	430,243,795.25	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	107.10	373,919,836.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	45.70	117,050,404.60	
	チリペソ 小計	28,285,639		4,497,188,649.85 (777,532,437)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	69,778	31,530.00	2,200,100,340.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	26,910.00	1,656,714,150.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	16,140.00	815,247,540.00	
	コロンビアペソ 小計	181,854		4,672,062,030.00 (144,492,862)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	22.44	116,710.44	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	29.46	597,890.70	
	OPAP SA	38,972	16.28	634,464.16	
	JUMBO SA	19,341	22.50	435,172.50	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.38	365,180.18	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.55	665,440.51	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	5.96	439,483.52	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.19	371,877.33	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	9.43	527,061.56	
	TERNA ENERGY SA	13,651	20.00	273,020.00	
	ユーロ 小計	944,528		4,426,300.90 (660,935,250)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	65.60	9,353,904.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	31.00	8,024,908.00	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	25.86	3,441,112.62	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	50.00	5,901,200.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	41.28	4,110,084.48	
	KOC HOLDING AS	89,884	75.10	6,750,288.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	36.36	10,862,477.28	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	413.00	2,965,753.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	134.40	11,641,056.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	525.00	8,594,250.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	134.40	10,917,043.20	
	AKBANK T.A.S.	586,183	14.40	8,441,035.20	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	35.88	7,584,027.36	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	10.37	3,986,881.31	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	8.81	3,269,628.87	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	31.30	4,478,748.30	
	トルコリラ 小計	3,028,377		110,322,398.02 (769,785,564)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	661.00	8,793,283.00	

	MONETA MONEY BANK AS	60,710	78.70	4,777,877.00
	CEZ AS	25,283	1,011.00	25,561,113.00
	チェココルナ 小計	99,296		39,132,273.00 (246,576,365)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,778.00	123,684,894.00
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,200.00	235,676,200.00
	OTP BANK NYRT	40,021	11,150.00	446,234,150.00
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		805,595,244.00 (320,721,967)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	102,979	64.09	6,599,924.11
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	111.00	2,240,646.00
	LPP SA	124	13,220.00	1,639,280.00
	CD PROJEKT SA	6,704	121.00	811,184.00
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	17.56	633,880.88
	ALLEGRO.EU SA	83,795	37.86	3,172,897.67
	PEPCO GROUP NV	22,887	41.76	955,761.12
	DINO POLSKA SA	9,471	422.50	4,001,497.50
	BANK PEKAO SA	27,684	102.60	2,840,378.40
	M BANK SA	1,423	370.00	526,510.00
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	33.74	4,396,220.78
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	351.80	2,583,267.40
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	40.96	3,544,227.84
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	277,921	7.40	2,057,727.08
	ポーランドズロチ 小計	813,441		36,003,402.78 (1,197,883,615)
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 (131)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.93	2,279,970.00

CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	8.39	2,030,380.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,411,400	5.12	22,586,368.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	560,500	27.60	15,469,800.00
PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.40	17,377,200.00
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	286,000	25.65	7,335,900.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.79	1,288,600.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	22.70	5,391,250.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	6.11	3,394,105.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.89	3,559,920.00
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.04	875,520.00
CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.21	3,410,100.00
DONGYUE GROUP	147,000	7.58	1,114,260.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	53.20	2,874,928.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	12.40	2,901,600.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	5.18	1,885,520.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	15.28	1,451,600.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.90	1,972,900.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.06	10,009,300.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	4.10	1,127,500.00
BOC AVIATION LTD	23,800	61.95	1,474,410.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.90	764,400.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	11.08	2,692,440.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	5.58	714,240.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	5.30	3,741,800.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	9.44	4,172,480.00
CITIC LTD	1,038,000	10.22	10,608,360.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	4.84	4,530,240.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.19	1,494,720.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.76	1,385,280.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	10.78	1,724,800.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	408,800	11.56	4,725,728.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	33.15	2,065,245.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.24	1,247,639.76
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	6.58	1,408,120.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.73	1,421,040.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	12.14	2,009,740.58
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.95	2,960,100.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	9.44	4,890,392.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.10	1,278,947.40
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	8.16	2,627,520.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	150.70	2,637,250.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.74	959,688.38

ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	6.42	1,990,200.00
BYD CO LTD-H	129,500	250.00	32,375,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.65	970,900.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	29.85	1,743,240.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.68	9,176,640.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.22	4,552,375.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.74	1,698,550.56
LI AUTO INC-CLASS A	189,942	113.10	21,482,440.20
MINTH GROUP LTD	176,000	21.05	3,704,800.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	36.15	6,042,906.30
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	16.82	3,935,880.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	85.55	17,007,340.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.37	1,476,060.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	303,000	23.70	7,181,100.00
LI NING CO LTD	380,000	48.40	18,392,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	64.15	7,832,715.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	8.60	1,419,000.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	25.65	1,128,600.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	18.22	4,263,480.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	57,000	13.72	782,040.00
MEITUAN-CLASS B	792,750	132.80	105,277,200.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	30.05	7,347,225.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	15.58	2,598,744.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.56	1,150,240.00
BAIDU INC-CLASS A	352,000	122.10	42,979,200.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	144.30	3,838,380.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	31.10	1,604,760.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.76	2,231,680.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	30.05	5,144,560.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	287,000	55.15	15,828,050.00
NETEASE INC	313,630	135.00	42,340,050.00
TENCENT HOLDINGS LTD	992,800	335.60	333,183,680.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,366,388	83.00	196,410,204.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	11.94	1,241,760.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	138.40	1,245,600.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	15.20	3,830,400.00
JD.COM INC - CL A	346,811	138.40	47,998,642.40
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	17.80	1,149,880.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.90	2,829,000.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	31.70	2,916,400.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.89	3,833,760.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	49.90	9,653,155.00

PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	18.50	993,450.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	139.90	2,126,480.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.96	2,797,440.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	538,000	31.15	16,758,700.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	52.75	12,976,500.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.02	742,920.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.30	11,953,980.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	8.55	1,667,250.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	12.46	5,183,360.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	75.40	8,746,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.92	553,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,039,000	5.24	5,444,360.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	18.72	898,560.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	35.70	3,123,750.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	20.50	512,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	51.30	3,868,020.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	14.80	976,800.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	12.62	5,037,904.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.80	2,028,720.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	27.05	5,171,960.00
3SBIO INC	119,000	7.93	943,670.00
AKESO INC	61,000	38.45	2,345,450.00
BEIGENE LTD	92,905	144.50	13,424,772.50
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	12.30	3,038,100.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	7.66	10,633,305.60
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	7.55	2,559,450.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	4.04	1,963,440.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	19.90	2,626,800.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	62.75	320,025.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	13.76	1,678,720.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	40.20	8,160,600.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	31.70	1,060,365.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	22.05	1,609,650.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	4.01	7,903,710.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	71.00	4,521,848.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	574,000	44.85	25,743,900.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	4,735,000	3.07	14,536,450.00
BANK OF CHINA LTD-H	12,416,200	3.21	39,856,002.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	5.17	7,090,525.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.34	6,792,968.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,086,620	5.30	79,959,086.00

CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.52	945,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	38.25	23,788,554.75
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.29	2,218,776.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	4.39	38,318,180.85
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,576,000	5.00	7,880,000.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.93	773,760.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.45	2,149,350.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	203,600	15.90	3,237,240.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	16.08	4,595,262.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.86	1,646,400.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	11.26	997,636.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.33	1,903,876.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	10.04	2,670,640.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,296,000	14.40	18,662,400.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	22.80	8,814,480.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.78	1,615,730.72
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	225,300	21.95	4,945,335.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	3.10	5,821,800.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.96	11,924,988.48
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	53.05	53,262,200.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	23.75	2,757,375.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	4.92	1,357,920.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	10.26	1,299,942.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	11.40	5,620,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	17.08	1,221,220.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	23.20	3,723,600.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	22.90	1,534,300.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.74	534,060.00
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	7.84	9,313,920.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	81.80	9,775,100.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	10.76	25,869,192.00
ZTE CORP-H	82,908	22.65	1,877,866.20
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.91	6,444,620.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	31.75	1,889,125.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.98	1,207,800.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	2.05	2,927,400.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	9.80	4,570,720.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	8.90	4,022,800.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.11	2,071,260.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	197,600	28.10	5,552,560.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	17.96	4,622,904.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	105.80	12,378,600.00

	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	7.06	3,148,760.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.78	3,365,120.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.79	3,720,920.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	22.80	1,459,200.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.83	5,762,670.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	26.00	2,340,000.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	20.60	885,800.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	8.11	7,266,454.57	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	85,000	20.95	1,780,750.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.25	782,375.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	17.50	10,229,450.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	7.78	1,750,500.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.90	17,261,440.90	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	37.10	4,414,900.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	10.86	3,426,330.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,852,654	1.54	2,853,087.16	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	9.65	3,290,650.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	8.30	601,750.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	4.46	802,800.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	17.52	6,018,120.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	9.03	2,895,018.00	
	香港ドル 小計	132,547,622		1,871,376,471.06 (33,104,649,773)	
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	22.34	1,974,856.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.89	2,868,996.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.72	3,575,872.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.15	661,925.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	38,200	4.30	164,260.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.13	716,416.98	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	106,594	7.34	782,399.96	
	MISC BHD	217,540	7.33	1,594,568.20	
	GENTING BHD	271,600	4.43	1,203,188.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.66	983,402.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.60	485,520.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.96	1,070,546.40	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	50,646	22.60	1,144,599.60	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	134.70	969,840.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.10	1,183,028.00	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.64	703,872.00	

	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.48	1,106,766.08	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.90	1,352,870.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	1.21	610,929.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.50	1,052,450.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,204,302	5.01	6,033,553.02	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.80	2,401,581.60	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.50	291,077.50	
	MALAYAN BANKING BHD	716,505	8.61	6,169,108.05	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,503,200	3.91	9,787,512.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.51	1,208,601.97	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.98	1,612,445.22	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.39	2,186,220.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.16	1,114,464.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	4.99	1,355,044.48	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.02	2,525,768.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.56	4,223,369.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.15	590,605.00	
	マレーシアリングット 小計	12,512,105		64,586,767.90 (1,955,500,030)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	8.35	14,305,220.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	148.50	29,818,800.00	
	PTT PCL-NVDR	1,731,900	31.50	54,554,850.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	46.00	13,505,830.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	33.50	6,914,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	37.75	18,351,558.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	42.50	8,614,750.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	337.00	43,944,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	70.50	46,170,450.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.30	6,781,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.70	6,233,150.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.25	4,254,075.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.75	12,242,407.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	43.00	7,834,600.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	14.20	11,929,917.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	21.10	16,719,640.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	38.00	6,748,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	62.25	59,535,900.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	69.50	3,217,850.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	20.10	11,183,640.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	30.25	8,866,275.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	780,600	15.60	12,177,360.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,507,600	28.25	42,589,700.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	234.00	19,351,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	134.50	11,190,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.30	8,465,945.00	
	SCB X PCL-NVDR	185,600	103.50	19,209,600.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	72,600	42.75	3,103,650.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	55.25	5,607,875.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	39.75	3,569,550.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	54.50	4,158,350.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	87.00	43,152,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	213.00	43,409,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	73.25	8,925,512.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.85	13,806,983.30	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	37.50	12,037,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	145.00	10,324,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	66.00	14,513,400.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	59.50	4,057,900.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	48.50	19,540,650.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	36.75	13,084,837.50	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	68.50	25,920,400.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.80	7,673,600.00	
	タイパーツ 小計	21,209,580		737,598,426.30 (2,957,769,689)	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	55.25	13,146,185.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	681.50	37,080,415.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	50.80	29,775,048.40	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	920.00	33,382,200.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	200.60	30,717,878.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	229.00	13,971,290.00	
	MONDE NISSIN CORP	490,500	8.54	4,188,870.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	145.50	13,903,980.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	398,724	103.00	41,068,572.00	
	BDO UNIBANK INC	394,773	137.90	54,439,196.70	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	59.50	9,596,576.50	
	PLDT INC	10,460	1,278.00	13,367,880.00	
	ACEN CORP	821,840	6.20	5,095,408.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	325.60	17,315,408.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	26.10	33,431,490.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	2,074,750	34.50	71,578,875.00	
	フィリピン 小計	6,910,872		422,059,272.60 (1,049,745,822)	
インドネシア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,290.00	4,951,667,000.00	
ピア	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	24,500.00	4,922,050,000.00	

	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,945.00	1,917,381,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	780.00	2,255,923,020.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,525.00	1,837,605,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,970.00	4,821,192,090.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,450.00	1,962,090,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	5,950.00	2,349,678,800.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,600.00	21,630,180,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,860.00	6,116,682,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,845,000	4,960.00	9,151,200,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,175.00	6,698,295,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,950.00	2,982,245,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,450.00	5,150,430,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	2,120.00	8,879,620,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,125.00	79,289,862,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,125.00	31,271,684,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	8,950.00	11,566,085,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,500.00	60,282,211,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,010.00	2,869,006,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,475,800	4,040.00	34,242,232,000.00	
	インドネシアルピア 小計	60,803,404		305,147,319,410.00 (2,868,384,802)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	59,500.00	308,210,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	75,600.00	482,857,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	184,000.00	1,697,216,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	46,700.00	853,489,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	34,950.00	391,055,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	494,000.00	594,776,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	132,900.00	252,244,200.00	
	LG CHEM LTD	8,087	719,000.00	5,814,553,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	371,500.00	325,805,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	175,700.00	406,921,200.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	333,500.00	1,586,793,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	377,000.00	4,442,945,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	87,600.00	204,808,800.00	
	SKC CO LTD	5,430	96,100.00	521,823,000.00	
	CJ CORP	1,230	90,000.00	110,700,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	54,500.00	234,786,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	55,063	16,410.00	903,583,830.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	243,500.00	2,004,492,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	39,650.00	261,412,450.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	118,800.00	251,262,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	9,667	96,400.00	931,898,800.00	

HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	40,200.00	392,673,600.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	76,100.00	219,396,300.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	53,600.00	719,097,600.00
LG CORP	16,658	88,700.00	1,477,564,600.00
LG ENERGY SOLUTION	5,668	574,000.00	3,253,432,000.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	111,200.00	1,324,392,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	30,200.00	559,183,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	6,040.00	574,820,760.00
SK INC	6,394	171,900.00	1,099,128,600.00
S-1 CORPORATION	3,573	56,100.00	200,445,300.00
HMM CO LTD	35,545	18,770.00	667,179,650.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	174,800.00	488,216,400.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	44,008	22,550.00	992,380,400.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,240.00	155,816,640.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	36,450.00	257,555,700.00
HANON SYSTEMS	19,000	9,570.00	181,830,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	228,500.00	2,318,818,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	22,724	207,500.00	4,715,230,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	111,900.00	676,099,800.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	110,000.00	379,390,000.00
KIA CORP	43,979	88,700.00	3,900,937,300.00
COWAY CO LTD	9,036	49,350.00	445,926,600.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	137,800.00	415,742,600.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	114,200.00	1,970,406,800.00
KANGWON LAND INC	28,528	18,980.00	541,461,440.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	9,880	18,500.00	182,780,000.00
HYBE CO LTD	2,474	273,000.00	675,402,000.00
KAKAO CORP	52,020	58,000.00	3,017,160,000.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	39,450.00	119,178,450.00
KRAFTON INC	5,809	199,300.00	1,157,733,700.00
NAVER CORP	21,578	212,000.00	4,574,536,000.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	388,500.00	1,052,446,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	59,700.00	147,160,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	46,300.00	213,211,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	83,500.00	364,310,500.00
LOTTE SHOPPING CO	1,034	82,400.00	85,201,600.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	183,800.00	299,961,600.00
EMART	3,594	87,500.00	314,475,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	324,500.00	596,755,500.00
KT&G CORP	18,829	83,500.00	1,572,221,500.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	128,000.00	402,176,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	118,200.00	444,668,400.00

	LG H&H CO LTD	1,321	585,000.00	772,785,000.00	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	76,500.00	1,175,040,000.00	
	HLB INC	22,765	37,550.00	854,825,750.00	
	SD BIOSENSOR INC	3,909	17,830.00	69,697,470.00	
	CELLTRION INC	17,544	179,500.00	3,149,148,000.00	
	CELLTRION PHARM INC	2,066	89,000.00	183,874,000.00	
	HANMI PHARM CO LTD	1,179	306,000.00	360,774,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	792,000.00	2,118,600,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	72,500.00	231,782,500.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	81,000.00	170,100,000.00	
	YUHAN CORPORATION	13,195	60,000.00	791,700,000.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	51,249	41,800.00	2,142,208,200.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,280.00	291,232,400.00	
	KAKAObANK CORP	18,421	26,200.00	482,630,200.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	49,400.00	3,191,190,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	35,250.00	2,389,174,500.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	12,000.00	924,648,000.00	
	KAKAOPAY CORP	3,065	57,900.00	177,463,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	55,600.00	255,871,200.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	44,950.00	763,026,250.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,330.00	227,339,950.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,620.00	116,469,340.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	36,000.00	574,092,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	79,600.00	801,890,400.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	236,500.00	978,873,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	66,900.00	811,563,900.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	122,800.00	894,475,200.00	
	L&F CO LTD	4,327	264,000.00	1,142,328,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	15,780.00	604,389,780.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	287,500.00	775,100,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	57,000.00	123,462,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	143,900.00	1,328,628,700.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	759,207	68,400.00	51,929,758,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	132,120	57,800.00	7,636,536,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	710,000.00	6,264,330,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	11,220.00	248,242,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	18,630.00	824,191,200.00	
	SK HYNIX INC	87,413	97,900.00	8,557,732,700.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	44,700.00	521,202,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,417,585		170,584,514,310.00 (17,945,490,905)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	223,240	88.20	19,689,768.00	

ASIA CEMENT CORP	454,176	44.65	20,278,958.40
CHINA STEEL	1,779,261	29.90	53,199,903.90
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	70.10	37,998,476.10
FORMOSA PLASTICS CORP	708,824	93.50	66,275,044.00
NAN YA PLASTICS CORP	770,752	80.70	62,199,686.40
TAIWAN CEMENT	913,419	37.90	34,618,580.10
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	1,060.00	19,670,420.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	652,028	32.05	20,897,497.40
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,775.00	15,975,000.00
WALSIN LIHWA CORP	502,213	46.10	23,152,019.30
CHINA AIRLINES LTD	465,000	20.35	9,462,750.00
EVA AIRWAYS CORP	386,000	30.35	11,715,100.00
EVERGREEN MARINE	183,215	151.50	27,757,072.50
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	33.30	15,717,600.00
WAN HAI LINES LIMITED	74,635	60.10	4,485,563.50
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	61.70	13,388,900.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	39.95	7,073,586.95
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	481.00	19,209,697.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	192.00	13,526,016.00
GIANT MANUFACTURING	35,713	199.00	7,106,887.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	359.50	11,144,500.00
POU CHEN	273,780	32.30	8,843,094.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	42,000	829.00	34,818,000.00
MOMO.COM INC	6,000	710.00	4,260,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	287.00	25,412,128.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	75.70	58,773,101.50
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	354.50	8,862,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	18.30	10,861,782.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	24.60	64,974,430.20
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,929,455	26.10	50,358,775.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,605,202	28.15	45,186,436.30
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	22.65	34,390,876.65
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,671,622	36.20	60,512,716.40
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,756,318	17.45	30,647,749.10
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,920,011	18.75	36,000,206.25
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	14.25	11,115,000.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,442,787	28.20	40,686,593.40
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	47.05	32,463,794.25
CHAILEASE HOLDING CO LTD	219,375	213.50	46,836,562.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,814,633	23.65	42,916,070.45
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,310,057	44.80	58,690,553.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	13.30	34,263,805.80

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,270,906	61.40	78,033,628.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.60	16,614,047.60
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	286.00	20,020,000.00
ACER INC	617,803	30.75	18,997,442.25
ADVANTECH CO LTD	69,336	398.00	27,595,728.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	307.00	39,017,244.00
AUO CORP	1,268,072	17.60	22,318,067.20
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	188.00	22,315,600.00
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	13.85	19,252,608.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	26.45	21,312,352.00
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	302.50	91,628,157.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	200.50	28,872,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	102.50	198,670,420.00
INVENTEC CO LTD	280,511	31.00	8,695,841.00
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,225.00	33,464,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	80.20	28,346,850.40
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	158.50	15,850,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	289.00	6,069,000.00
PEGATRON CORP	340,474	73.10	24,888,649.40
QUANTA COMPUTER INC	408,270	107.00	43,684,890.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	65.60	13,257,760.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	167.00	35,237,000.00
WIWYNN CORP	16,000	1,125.00	18,000,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	52.20	13,608,122.40
YAGEO CORPORATION	61,588	493.50	30,393,678.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	112.00	15,447,264.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	126.50	73,915,847.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	77.80	16,804,800.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	104.00	25,500,800.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	110.00	56,574,650.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	1,905.00	22,860,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	491.00	20,622,000.00
MEDIATEK INC	241,804	716.00	173,131,664.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	69.90	18,104,100.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	409.00	39,282,405.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	959.00	7,672,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	30.55	17,596,800.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	373.00	23,105,112.00
SILERGY CORP	53,000	383.50	20,325,500.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,926,389	530.00	2,080,986,170.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,899,000	48.90	92,861,100.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	90.00	16,920,000.00

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	156.50	5,008,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	25.50	8,899,500.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	35.70	11,070,070.20
	新台湾ドル 小計	54,482,981		4,878,248,071.30 (21,994,069,254)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	164,999	366.55	60,480,383.45
	COAL INDIA LTD	295,619	239.30	70,741,626.70
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	263.55	15,661,458.75
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	88.96	53,112,322.56
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	381,562	164.95	62,938,651.90
	PETRONET LNG LTD	83,779	224.85	18,837,708.15
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	485,097	2,454.10	1,190,476,547.70
	ACC LTD	14,288	1,819.30	25,994,158.40
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	427.40	31,428,004.20
	ASIAN PAINTS LTD	64,662	3,118.30	201,635,514.60
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	630.05	18,554,342.45
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,698.25	79,551,124.75
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	243,575	410.20	99,914,465.00
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	520.55	36,320,855.70
	JSW STEEL LTD	99,332	703.55	69,885,028.60
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,375.75	43,199,472.75
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,532.60	73,850,616.00
	SHREE CEMENT LTD	1,387	24,748.15	34,325,684.05
	SRF LTD	19,164	2,471.80	47,369,575.20
	TATA STEEL LTD	1,137,948	105.70	120,281,103.60
	ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	7,655.30	127,766,957.00
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	679.15	47,303,476.65
	VEDANTA LTD	107,173	288.40	30,908,693.20
	ABB LTD INDIA	5,256	3,913.55	20,569,618.80
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	2,632.25	90,212,472.00
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	107.90	54,748,999.50
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	357.40	25,163,104.40
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,249.75	44,573,583.50
	LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,197.15	236,391,368.50
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,410.00	37,595,250.00
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	624.45	14,357,978.85
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	733.55	76,716,126.10
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	661.10	17,489,400.50
	INTERGLOBE AVIATION LTD	14,831	2,274.65	33,735,334.15
	BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,499.95	43,397,517.80
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,405.00	21,238,555.00
	BHARAT FORGE LTD	30,322	769.75	23,340,359.50

EICHER MOTORS LTD	17,872	3,601.30	64,362,433.60
HERO MOTOCORP LTD	22,772	2,710.30	61,718,951.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	128,983	1,268.30	163,589,138.90
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	18,422	9,199.20	169,467,662.40
MRF LTD	432	95,373.55	41,201,373.60
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	186,639	81.38	15,188,681.82
TATA MOTORS LTD	277,381	528.50	146,595,858.50
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,694.40	56,991,948.80
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,260.45	51,998,604.30
PAGE INDUSTRIES LTD	886	41,802.50	37,037,015.00
TITAN CO LTD	56,531	2,682.90	151,667,019.90
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	370.85	61,003,712.45
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	474.70	20,853,571.00
ZOMATO LTD	427,818	63.25	27,059,488.50
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	3,952.60	56,743,525.60
TRENT LTD	37,950	1,503.20	57,046,440.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,432.65	98,146,328.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	14,526	4,520.15	65,659,698.90
ITC LTD	480,447	429.00	206,111,763.00
MARICO LTD	81,711	526.45	43,016,755.95
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	21,392.55	110,086,062.30
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	769.85	71,780,044.15
UNITED SPIRITS LTD	32,483	821.75	26,692,905.25
VARUN BEVERAGES LTD	40,179	1,556.00	62,518,524.00
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,586.10	41,238,600.00
DABUR INDIA LTD	79,726	525.75	41,915,944.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,014.90	64,340,600.40
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,628.15	340,350,681.30
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	19,568	4,551.55	89,064,730.40
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	602.95	21,353,474.25
CIPLA LTD	88,546	930.65	82,405,334.90
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,385.90	74,259,558.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	4,460.10	81,713,492.10
LUPIN LTD	26,552	776.65	20,621,610.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	930.75	135,103,947.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,692.05	20,676,851.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	762.65	22,981,695.10
AXIS BANK LTD	359,795	915.10	329,248,404.50
BANDHAN BANK LTD	74,811	253.90	18,994,512.90
BANK OF BARODA	248,313	183.35	45,528,188.55
ICICI BANK LTD	812,223	952.80	773,886,074.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	88,108	1,921.20	169,273,089.60

	STATE BANK OF INDIA	268,868	581.55	156,360,185.40
	YES BANK LTD	2,352,478	15.58	36,651,607.24
	BAJAJ FINANCE LTD	44,172	6,778.75	299,430,945.00
	BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,437.55	79,065,250.00
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	6,694	6,635.50	44,418,037.00
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,060.90	58,150,050.80
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	274,646	2,705.25	742,986,091.50
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,127.65	14,008,795.95
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,013	887.65	27,528,689.45
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,363.45	52,608,718.25
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	178,719	562.50	100,529,437.50
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,083.95	36,454,322.45
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	89,699	440.10	39,476,529.90
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,165.25	84,755,624.00
	HCL TECHNOLOGIES LTD	161,045	1,107.45	178,349,285.25
	INFOSYS LTD	533,921	1,299.60	693,883,731.60
	LTIMINDTREE LTD	15,699	4,857.25	76,253,967.75
	MPHASIS LTD	19,317	1,942.05	37,514,579.85
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,295.70	471,881,621.70
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,020.70	29,339,505.30
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,091.10	103,433,006.70
	WIPRO LTD	249,294	397.75	99,156,688.50
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	799.30	286,928,717.50
	INDUS TOWERS LTD	90,578	145.30	13,160,983.40
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	989.50	42,132,910.00
	ADANI POWER LTD	85,623	260.40	22,296,229.20
	ADANI TOTAL GAS LTD	33,068	757.40	25,045,703.20
	ADANI TRANSMISSION LTD	59,643	866.60	51,686,623.80
	GAIL INDIA LTD	504,548	107.45	54,213,682.60
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	477.20	12,752,692.80
	NTPC LTD	664,141	174.15	115,660,155.15
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	489,061	234.05	114,464,727.05
	TATA POWER CO LTD	199,512	206.80	41,259,081.60
	DLF LTD	87,983	467.80	41,158,447.40
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,344.95	17,113,143.80
	インドルピー 小計	16,999,206		11,839,671,507.37 (19,890,648,132)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.50	988,581.00
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.95	1,856,372.96
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	2.08	923,364.00
	INDUSTRIES QATAR	282,919	13.00	3,677,947.00
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	6.00	3,188,346.00

	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.72	3,109,234.72
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	98,559	10.07	992,489.13
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	18.09	4,695,530.85
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.73	12,401,982.46
	OOREDOO QSC	72,800	10.89	792,792.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.42	1,681,239.04
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.79	580,764.51
	カタールリアル 小計	4,407,208		34,888,643.67 (1,328,210,664)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	172.72	5,909,960.24
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	215.72	3,164,612.40
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	1,105.00	11,040,055.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	463.44	31,255,783.92
	GOLD FIELDS LTD	144,200	291.75	42,070,350.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	93.14	9,301,053.54
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	168.76	25,456,939.72
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	448.56	2,409,664.32
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	158.50	7,618,936.50
	SASOL LTD	88,115	237.54	20,930,837.10
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	36.10	14,256,756.40
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	241.75	12,160,750.25
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	103.85	4,208,936.65
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	133.96	3,819,199.60
	NASPERS LTD-N SHS	34,919	3,225.15	112,619,012.85
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	15.22	7,238,297.16
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	85.20	3,199,600.80
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	61.30	10,808,170.80
	BID CORP LTD	58,066	399.22	23,181,108.52
	CLICKS GROUP LTD	35,422	244.54	8,662,095.88
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	198.57	16,922,929.68
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	172.05	9,666,113.10
	ABSA GROUP LTD	140,135	161.09	22,574,347.15
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,437.01	20,980,346.00
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	211.88	13,371,958.68
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	156.80	31,927,459.20
	FIRSTRAND LTD	816,636	61.49	50,214,947.64
REINET INVESTMENTS SCA	17,187	414.19	7,118,683.53	
REMGRO LTD	74,679	134.27	10,027,149.33	
DISCOVERY LIMITED	98,821	135.05	13,345,776.05	
OLD MUTUAL LTD	974,656	11.19	10,906,400.64	
OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	32.08	2,314,026.64	
SANLAM LTD	307,490	52.55	16,158,599.50	

	MTN GROUP LTD	255,377	114.79	29,314,725.83
	VODACOM GROUP	129,637	110.77	14,359,890.49
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	63,952	111.21	7,112,101.92
	南アフリカランド 小計	5,368,345		635,627,577.03 (4,589,231,106)
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.25	1,688,849.50
	Q HOLDING PJSC	189,678	2.25	426,775.50
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.12	1,829,370.64
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.18	3,856,297.40
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.70	1,987,856.70
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.26	2,762,257.44
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	13.75	3,716,075.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.22	9,571,531.18
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	22.98	12,835,157.28
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.12	3,716,254.72
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	5.82	6,452,447.76
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	5,723,015		48,842,873.12 (1,847,237,461)
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.60	196,295.30
	BOUBYAN BANK K.S.C	162,047	0.59	96,580.01
	GULF BANK	144,000	0.25	37,152.00
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.70	911,551.60
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,205,064	0.93	1,120,709.52
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.50	150,195.98
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.73	104,241.37
	クウェートディナール 小計	3,566,133		2,616,725.78 (1,182,786,219)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	5.90	865,530.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	30.76	2,737,640.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	11.77	753,280.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	8.53	763,435.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.35	735,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	19.84	1,908,608.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	10.31	820,676.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	19.95	197,505.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	25.11	703,080.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	34.02	704,214.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.42	890,506.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	26.51	780,454.40
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.10	2,253,950.00
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	35.64	745,945.20
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	33.95	699,370.00	

CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	14.57	1,343,354.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	24.42	507,936.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	61.09	629,227.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	65.60	734,720.00
GEM CO LTD-A	289,800	6.78	1,964,844.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	44.50	1,104,757.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	15.51	575,421.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.90	1,017,750.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.31	1,922,151.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	71.81	172,344.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	13.73	137,300.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.83	843,630.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.33	259,800.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.75	262,025.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	90.61	706,758.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	17.16	262,548.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	15.60	734,760.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.00	1,029,600.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	4.13	80,535.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	20.35	968,660.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	12.17	589,636.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	13.19	731,715.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	24.11	174,845.72
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	29.69	532,638.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.14	899,924.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	38.39	623,453.60
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	7.62	835,746.36
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.99	548,226.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	12.98	639,914.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	48.96	528,768.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	600	171.00	102,600.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	20.52	1,023,948.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	7,100	96.95	688,345.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	78.62	896,268.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	12.58	123,284.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	2.92	968,272.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	87.80	3,538,340.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	31.36	462,622.72
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	84.92	999,933.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	71.10	129,402.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	102.82	421,562.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	23.50	878,900.00

ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	49.89	369,684.90
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	13.84	1,790,896.00
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	43,000	17.04	732,720.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	10.67	2,871,297.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	41.10	468,540.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	40.10	621,550.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	24.54	206,136.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	11.25	720,000.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	27.98	1,544,915.70
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.40	1,447,440.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.77	2,017,977.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	6.05	3,402,520.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	225.42	8,967,207.60
CRRC CORP LTD-A	185,800	6.44	1,196,552.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	18.40	794,880.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	67.02	2,645,480.46
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.30	143,640.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	105.52	253,248.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,693	249.13	670,907.09
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	28.09	162,922.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	65.72	414,036.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	31.41	826,711.20
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	5,320	80.83	430,015.60
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	56.03	641,879.68
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.51	637,461.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	16.14	776,334.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.95	1,307,055.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	18.76	679,112.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	27.05	1,893,067.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	137.43	816,334.20
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	52.06	652,520.04
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	61.74	720,814.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	18.58	750,632.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	6.78	1,106,496.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	216.28	595,202.56
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.88	665,372.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.45	2,165,815.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	60.56	1,719,480.08
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	17,900	14.12	252,748.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	114.35	1,143,500.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	16.40	667,480.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	272.87	698,547.20

TBEA CO LTD-A	22,519	22.80	513,433.20
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	11.93	515,376.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.19	1,234,286.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	11.11	223,433.21
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	27.11	856,676.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	47.39	391,441.40
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.51	767,602.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.25	500,625.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	45.35	498,850.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	9.27	240,093.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.88	195,200.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	11.14	2,044,190.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.51	1,205,355.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	49.61	2,634,291.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	48.94	260,311.86
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.33	236,652.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	16.22	903,454.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	11.93	260,551.20
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	69.60	751,680.00
BYD CO LTD -A	17,000	262.93	4,469,810.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	110.82	997,380.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	12.13	525,859.76
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	33.35	616,975.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	17.73	608,139.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	108.42	910,728.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	15.30	448,290.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	56.79	39,753.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	13.66	581,916.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.90	859,662.60
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	74.91	209,748.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	35.05	1,524,675.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	25.17	698,719.20
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	36.20	287,138.40
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	103.41	796,257.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.93	2,318,223.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.66	410,652.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	54.00	432,000.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	48.09	1,259,958.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.79	379,847.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.63	422,852.40
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	28.75	704,375.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.49	455,064.00

FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.59	918,646.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	470.64	1,364,856.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	29.28	477,264.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	17.80	405,840.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.43	333,945.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	136.51	2,828,487.20
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	7.32	808,860.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	18,576	33.38	620,066.88
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	10,140	50.96	516,734.40
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	39.01	417,407.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	280.58	448,928.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	58.86	129,492.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	60.65	1,109,895.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	164.80	494,400.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.79	404,005.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	95.63	755,477.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	24.41	112,286.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	45,048	65.31	2,942,084.88
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.93	546,082.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	49.40	839,800.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	25.34	1,991,217.20
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	30.67	1,052,042.34
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	58.71	1,015,683.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	143.30	1,304,030.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	105.09	588,504.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	36.90	424,350.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	41.15	288,050.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,724.55	19,832,325.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	220.70	4,060,880.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	42.99	1,442,658.42
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	12.07	323,476.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	37.69	1,892,038.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	213.78	2,005,256.40
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	63.56	724,584.00
TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	11.01	1,625,076.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	17.89	682,682.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	174.00	7,221,000.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	41.48	418,948.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.01	79,553.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	22.60	671,220.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	70,574	29.30	2,067,818.20
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	33.85	541,600.00

GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	74.37	211,062.06
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	43.21	420,001.20
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	28.98	357,903.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	16.30	169,520.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	24.50	362,600.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.49	161,211.60
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	30.36	218,865.24
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	15,500	311.38	4,826,390.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	119.00	238,000.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	135.00	37,800.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	58.64	1,665,376.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	7,491	98.28	736,215.48
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	69.89	1,125,229.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	60.25	331,375.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	93.76	850,121.92
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	169.85	373,670.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	64.56	658,512.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	74.65	739,035.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	49.33	1,094,780.69
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	88.30	706,400.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	22.69	427,706.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	495.57	1,030,785.60
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	88,302	49.10	4,335,628.20
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	48.08	534,457.28
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	14.30	395,852.60
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	50.82	969,543.96
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.46	414,086.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	29.35	319,328.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	35.76	250,320.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	30.49	287,825.60
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	32.07	360,210.24
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	30.37	516,290.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	69.18	1,138,979.52
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	55.71	553,757.40
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	3,900	309.40	1,206,660.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.95	170,929.00
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	31.76	2,112,040.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	16.69	581,613.12
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	42.06	407,982.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.50	3,612,350.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.78	277,240.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	13.20	2,077,680.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.74	2,938,306.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	12.51	1,409,877.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.56	1,736,834.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	8.98	1,324,550.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	26.35	1,536,205.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.21	282,555.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.50	811,850.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.19	2,664,607.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	33.60	6,249,600.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.98	1,088,928.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	2.93	904,198.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.92	706,848.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.93	2,852,498.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	16.95	3,483,225.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	12.21	1,457,874.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.33	754,195.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.45	3,257,885.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	4.12	504,700.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	11.04	876,576.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.53	431,694.90
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.85	116,415.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.50	396,950.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.96	400,093.60
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	20.85	2,941,518.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	25.92	624,672.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	15.61	1,833,035.47
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	15.12	916,272.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.84	1,174,284.36
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.26	2,084,426.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.79	1,069,317.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.65	1,011,132.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	161.50	872,100.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.67	430,605.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.22	710,759.40
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	10.02	406,571.52
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.60	953,120.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.99	2,150,124.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.78	430,920.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.13	442,681.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	7.16	2,253,968.00

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	30.10	3,016,020.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	49.90	5,229,520.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	13.36	359,384.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	408.20	1,968,748.60
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	17.82	471,517.20
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	24,820	55.91	1,387,686.20
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.90	384,330.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	42.50	703,885.00
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	59.09	638,172.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	11.32	375,824.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	121.07	363,210.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	7,943	52.30	415,418.90
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	84.17	462,935.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	19.71	259,580.70
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	23.55	892,545.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.92	449,232.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	32.10	645,210.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	30.93	866,040.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.75	374,100.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	93.10	847,210.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	15.23	686,873.00
GOERTEK INC -A	26,900	18.14	487,966.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.24	312,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	62.35	436,450.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	37.40	737,228.80
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.59	194,712.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	27.66	1,284,807.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	93.13	160,928.64
NINESTAR CORP-A	18,543	41.88	776,580.84
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	15.08	366,444.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	73.60	350,336.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	112.52	724,066.20
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	25.92	738,720.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.28	436,160.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	27.42	502,882.80
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	52.11	218,862.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	10.79	445,799.64
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	137.52	646,344.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	11,250	54.33	611,212.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	21.50	651,450.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	87.20	758,640.00
ZTE CORP-A	76,400	31.21	2,384,444.00

CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.85	2,050,580.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.87	1,194,006.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.48	1,322,324.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	23.04	4,144,435.20	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	21.29	1,183,724.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.99	1,259,643.00	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	14.92	1,377,116.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	158.50	1,124,874.50	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	82.03	831,620.14	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	57.58	1,211,022.56	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	107.48	674,114.56	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	15,120	46.60	704,592.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	32.76	245,700.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	88.50	663,750.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	38.74	1,324,985.48	
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	29.50	879,100.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	32.90	3,301,186.00	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	57.70	1,214,873.50	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	291.48	903,588.00	
SG MICRO CORP-A	3,150	113.35	357,052.50	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	103.43	817,097.00	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	225.60	631,680.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	40.19	1,185,605.00	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.42	308,505.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	20.28	455,610.48	
TONGWEI CO LTD-A	31,600	38.45	1,215,020.00	
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	46.50	1,181,937.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	94.26	646,529.34	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	95.19	693,935.10	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	42.05	597,110.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	70.88	1,206,519.36	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	12.87	703,989.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	14.52	779,724.00	
GEMDALE CORP-A	45,500	7.56	343,980.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	13.38	1,094,484.00	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	14.29	182,912.00	
オフショア人民元 小計	24,080,783		364,866,066.01 (7,154,987,067)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	11.18	502,418.02
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	32.10	13,362,395.40
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	45.55	536,351.25
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	15.20	485,305.60

SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	129.20	4,833,759.60	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	37.50	1,771,537.50	
SAUDI ARABIAN MINING CO	140,563	65.80	9,249,045.40	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	90.10	12,968,453.40	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	25.15	2,145,873.45	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.76	1,423,210.56	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	42.90	2,191,289.10	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	195.00	820,365.00	
JARIR MARKETING CO	12,500	166.00	2,075,000.00	
NAHDI MEDICAL CO	6,431	178.00	1,144,718.00	
ALMARAI CO	30,130	57.00	1,717,410.00	
SAVOLA	65,641	37.25	2,445,127.25	
DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	170.60	1,165,709.80	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	280.80	3,290,133.60	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	236.40	1,882,216.80	
AL RAJHI BANK	311,351	74.10	23,071,109.10	
ALINMA BANK	161,322	33.05	5,331,692.10	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	27.10	2,331,440.10	
BANK AL-JAZIRA	97,894	17.80	1,742,513.20	
BANK ALBILAD	89,702	38.95	3,493,892.90	
BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	38.65	3,665,372.75	
RIYAD BANK	200,342	34.05	6,821,645.10	
SAUDI BRITISH BANK	147,895	37.60	5,560,852.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	17.40	1,229,136.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	474,809	37.65	17,876,558.85	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,929	166.60	654,571.40	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	179.60	2,554,450.80	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	296.00	1,307,432.00	
ELM CO	2,436	455.00	1,108,380.00	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	44.50	2,173,558.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	14.20	1,285,213.60	
SAUDI TELECOM CO	242,989	44.05	10,703,665.45	
ACWA POWER CO	9,184	155.00	1,423,520.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	22.62	3,666,905.58	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	15.44	1,559,301.04	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.13	421,687.31	
サウジアラビアリアル 小計	3,719,959		161,993,217.01 (5,979,169,639)	
合計	1,174,139,778		142,793,886,696 (142,793,886,696)	

(2) 株式以外の有価証券

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

投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	14,972,994.40	
	メキシコペソ 小計		97,360	14,972,994.40	(115,537,613)
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	5,189,773.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,359,099.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,663,178.00	
KLABIN SA-UNIT		100,000	2,176,000.00		
ブラジルリアル 小計		383,600	10,388,050.00	(289,515,992)	
投資信託受益証券合計			480,960	405,053,605	(405,053,605)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,220,618.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	9,220,618.00	(71,149,976)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	5,591,601.44	
	南アフリカランド 小計		478,733	5,591,601.44	(40,371,362)
投資証券合計			870,433	111,521,338	(111,521,338)
合計				516,574,943	(516,574,943)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 36銘柄	100.0%			2.8%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.1%			2.5%
	投資信託受益証券 1銘柄		3.1%		0.1%
	投資証券 1銘柄			1.9%	0.0%
ブラジルリアル	株式 43銘柄	96.2%			5.1%
	投資信託受益証券 4銘柄		3.8%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式 16銘柄	100.0%			0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%

ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式	14銘柄	100.0%			0.8%
ロシアルーブル	株式	14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式	192銘柄	100.0%			23.1%
マレーシアリングgit	株式	34銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式	43銘柄	100.0%			2.1%
フィリピンペソ	株式	16銘柄	100.0%			0.7%
インドネシアルピア	株式	21銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式	102銘柄	100.0%			12.5%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%			15.3%
インドルピー	株式	114銘柄	100.0%			13.9%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	36銘柄	99.1%			3.2%
	投資証券	1銘柄			0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	11銘柄	100.0%			1.3%
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	345銘柄	100.0%			5.0%
サウジアラビアリアル	株式	40銘柄	100.0%			4.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	130,431,892
国債証券	535,916,014,440
地方債証券	32,224,005,093
特殊債券	36,888,470,436
社債券	27,844,516,000
未収入金	1,274,459,300
未収利息	1,199,774,127
前払費用	33,913,691
流動資産合計	635,511,584,979
資産合計	635,511,584,979
負債の部	
流動負債	
未払金	1,000,000,000

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
未払解約金	241,768,267
未払利息	223
流動負債合計	1,241,768,490
負債合計	1,241,768,490
純資産の部	
元本等	
元本	463,653,275,174
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	170,616,541,315
元本等合計	634,269,816,489
純資産合計	634,269,816,489
負債純資産合計	635,511,584,979

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24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 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	463,653,275,174口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 100,047,000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 1.3680円 (1万口当たり純資産額) (13,680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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	453,660,085,228円
期中追加設定元本額	34,867,842,720円
期中一部解約元本額	24,874,652,774円
期末元本額	463,653,275,174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）	4,281,817,610円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,977,682円
S M T 国内債券インデックス・オープン	20,203,240,468円
世界経済インデックスファンド	5,441,958,238円
D Cマイセレクション2 5	26,811,512,709円
D Cマイセレクション5 0	31,227,322,829円
D Cマイセレクション7 5	9,368,876,974円
D C日本債券インデックス・オープン	427,645,068円
D C日本債券インデックス・オープンS	91,304,870,945円
D C日本債券インデックス・オープンP	64,915,419,419円
D CマイセレクションS 2 5	14,441,182,962円
D CマイセレクションS 5 0	16,112,700,215円
D CマイセレクションS 7 5	3,808,678,907円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	584,799,468円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	2,485,917,498円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	962,324,806円
D C世界経済インデックスファンド	4,316,329,612円
国内バランス6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,510,762円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	18,217,001円
マイセレクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	7,961,710円
国内バランス6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	65,519,349円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	102,948,955円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	26,835,372円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	22,160,040円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,377,376,083円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	698,564,072円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,962,408,737円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	63,615,683円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	51,466,375円

区分	2023年 5月24日現在
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	895,224,574円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,017,697,602円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,325,195,119円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	116,715,081円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,594,459,340円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,027,408,761円
分散投資コア戦略ファンドA	19,006,137,381円
分散投資コア戦略ファンドS	25,039,704,682円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	252,433,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,714,938,870円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	98,435,414円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	42,364,874円
SMT インデックスバランス・オープン	74,189,634円
SMT 世界経済インデックス・オープン	42,490,608円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	90,974,421円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	144,370,815円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,448,749円
グローバル経済コア	230,184,131円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	38,263,138円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,241,308円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	46,849,794円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	28,819,555円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,236,766円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	9,185,180円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	282,534,205円
10資産分散投資ファンド	290,045,987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)	86,601,242,161円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	39,861,645円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	15,405,234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)	425,725,718円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,946,432,460
地方債証券	553,359,307
特殊債券	589,805,714
社債券	460,254,000
合計	10,549,851,481

(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437回利付国債(2年)	2,920,000,000	2,924,000,400	
	第438回利付国債(2年)	900,000,000	901,287,000	

第 4 3 9 回利付国債（ 2 年）	470,000,000	470,723,800	
第 4 4 0 回利付国債（ 2 年）	1,930,000,000	1,932,933,600	
第 4 4 1 回利付国債（ 2 年）	440,000,000	440,682,000	
第 4 4 2 回利付国債（ 2 年）	400,000,000	400,632,000	
第 4 4 3 回利付国債（ 2 年）	3,300,000,000	3,305,511,000	
第 4 4 4 回利付国債（ 2 年）	1,025,000,000	1,026,640,000	
第 4 4 5 回利付国債（ 2 年）	180,000,000	180,273,600	
第 4 4 6 回利付国債（ 2 年）	1,160,000,000	1,161,740,000	
第 4 4 8 回利付国債（ 2 年）	50,000,000	50,072,500	
第 1 4 0 回利付国債（ 5 年）	5,870,000,000	5,883,794,500	
第 1 4 1 回利付国債（ 5 年）	8,820,000,000	8,845,048,800	
第 1 4 2 回利付国債（ 5 年）	3,910,000,000	3,922,003,700	
第 1 4 3 回利付国債（ 5 年）	4,480,000,000	4,494,649,600	
第 1 4 4 回利付国債（ 5 年）	5,650,000,000	5,669,323,000	
第 1 4 5 回利付国債（ 5 年）	5,120,000,000	5,139,046,400	
第 1 4 6 回利付国債（ 5 年）	4,910,000,000	4,929,590,900	
第 1 4 7 回利付国債（ 5 年）	4,090,000,000	4,096,339,500	
第 1 4 8 回利付国債（ 5 年）	6,170,000,000	6,178,514,600	
第 1 4 9 回利付国債（ 5 年）	4,820,000,000	4,825,591,200	
第 1 5 0 回利付国債（ 5 年）	6,660,000,000	6,664,728,600	
第 1 5 1 回利付国債（ 5 年）	4,510,000,000	4,510,856,900	
第 1 5 2 回利付国債（ 5 年）	210,000,000	210,800,100	
第 1 5 3 回利付国債（ 5 年）	5,160,000,000	5,156,800,800	
第 1 5 4 回利付国債（ 5 年）	4,650,000,000	4,661,997,000	
第 1 5 5 回利付国債（ 5 年）	980,000,000	990,495,800	
第 1 5 6 回利付国債（ 5 年）	3,790,000,000	3,812,436,800	
第 1 5 7 回利付国債（ 5 年）	930,000,000	934,677,900	
第 1 回利付国債（ 4 0 年）	400,000,000	506,316,000	
第 2 回利付国債（ 4 0 年）	1,130,000,000	1,377,164,900	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	650,000,000	791,511,500	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	950,000,000	1,157,793,500	
第 5 回利付国債（ 4 0 年）	1,070,000,000	1,258,683,800	
第 6 回利付国債（ 4 0 年）	1,260,000,000	1,456,887,600	
第 7 回利付国債（ 4 0 年）	1,240,000,000	1,374,850,000	
第 8 回利付国債（ 4 0 年）	1,490,000,000	1,535,623,800	
第 9 回利付国債（ 4 0 年）	2,210,000,000	1,686,473,100	
第 1 0 回利付国債（ 4 0 年）	2,040,000,000	1,820,496,000	
第 1 1 回利付国債（ 4 0 年）	1,525,000,000	1,312,338,750	
第 1 2 回利付国債（ 4 0 年）	1,290,000,000	994,048,200	
第 1 3 回利付国債（ 4 0 年）	2,330,000,000	1,777,324,000	
第 1 4 回利付国債（ 4 0 年）	2,130,000,000	1,733,457,900	
第 1 5 回利付国債（ 4 0 年）	2,850,000,000	2,540,889,000	

第334回利付国債（10年）	5,260,000,000	5,300,607,200	
第335回利付国債（10年）	3,630,000,000	3,659,584,500	
第336回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,221,337,700	
第337回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,817,416,000	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,599,854,400	
第339回利付国債（10年）	3,970,000,000	4,008,270,800	
第340回利付国債（10年）	4,430,000,000	4,477,401,000	
第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	5,065,882,800	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,780,134,800	
第343回利付国債（10年）	2,670,000,000	2,681,481,000	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,925,488,000	
第345回利付国債（10年）	3,780,000,000	3,795,535,800	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,771,907,500	
第347回利付国債（10年）	3,550,000,000	3,561,537,500	
第348回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,270,990,800	
第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	5,128,140,800	
第350回利付国債（10年）	6,670,000,000	6,673,134,900	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	4,833,742,900	
第352回利付国債（10年）	4,330,000,000	4,325,410,200	
第353回利付国債（10年）	4,385,000,000	4,377,720,900	
第354回利付国債（10年）	4,720,000,000	4,709,096,800	
第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,645,973,400	
第356回利付国債（10年）	4,280,000,000	4,262,580,400	
第357回利付国債（10年）	3,330,000,000	3,312,684,000	
第358回利付国債（10年）	4,000,000,000	3,973,080,000	
第359回利付国債（10年）	3,920,000,000	3,887,228,800	
第360回利付国債（10年）	4,840,000,000	4,789,470,400	
第361回利付国債（10年）	4,710,000,000	4,650,559,800	
第362回利付国債（10年）	3,750,000,000	3,696,900,000	
第363回利付国債（10年）	5,650,000,000	5,558,752,500	
第364回利付国債（10年）	5,110,000,000	5,018,837,600	
第365回利付国債（10年）	6,417,000,000	6,293,921,940	
第366回利付国債（10年）	5,370,000,000	5,305,613,700	
第367回利付国債（10年）	4,900,000,000	4,833,213,000	
第368回利付国債（10年）	4,280,000,000	4,214,387,600	
第369回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,711,632,800	
第370回利付国債（10年）	1,610,000,000	1,624,441,700	
第1回利付国債（30年）	110,000,000	128,218,200	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	183,660,800	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	137,362,800	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	131,529,200	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	57,499,000	

第6回利付国債(30年)	350,000,000	410,851,000	
第7回利付国債(30年)	380,000,000	445,721,000	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	962,387,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	262,852,800	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	170,662,400	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	292,580,600	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	221,692,000	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	463,272,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	901,342,500	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	413,066,000	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	243,386,000	
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,365,616,300	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	377,851,950	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	636,789,700	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	588,700,800	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	602,540,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	664,896,600	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	530,632,900	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	964,017,600	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	726,642,000	
第26回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,901,168,000	
第27回利付国債(30年)	1,870,000,000	2,324,821,400	
第28回利付国債(30年)	2,040,000,000	2,541,534,000	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	2,061,448,000	
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,527,283,700	
第31回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,327,128,000	
第32回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,784,645,600	
第33回利付国債(30年)	2,120,000,000	2,493,777,200	
第34回利付国債(30年)	1,665,000,000	2,011,286,700	
第35回利付国債(30年)	2,300,000,000	2,706,456,000	
第36回利付国債(30年)	2,130,000,000	2,507,052,600	
第37回利付国債(30年)	2,255,000,000	2,617,558,900	
第38回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,608,542,100	
第39回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,703,965,200	
第40回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,460,352,000	
第41回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,425,321,000	
第42回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,526,668,000	
第43回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,392,272,000	
第44回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,514,754,000	
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,559,448,000	
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	1,894,830,000	
第47回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,828,506,600	
第48回利付国債(30年)	1,750,000,000	1,857,397,500	

第49回利付国債(30年)	1,620,000,000	1,718,755,200	
第50回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,512,240,800	
第51回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,395,902,900	
第52回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,380,967,400	
第53回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,302,612,000	
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,601,440,400	
第55回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,365,277,200	
第56回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,389,645,000	
第57回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,302,966,900	
第58回利付国債(30年)	2,280,000,000	2,101,567,200	
第59回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,229,684,600	
第60回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,349,539,200	
第61回利付国債(30年)	1,280,000,000	1,139,161,600	
第62回利付国債(30年)	775,000,000	653,247,500	
第63回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,226,385,000	
第64回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,401,284,000	
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,142,841,050	
第66回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,043,558,400	
第67回利付国債(30年)	1,695,000,000	1,442,953,500	
第68回利付国債(30年)	1,490,000,000	1,264,414,000	
第69回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,235,769,200	
第70回利付国債(30年)	1,960,000,000	1,702,338,400	
第71回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,214,752,000	
第72回利付国債(30年)	1,130,000,000	979,506,600	
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,619,363,900	
第74回利付国債(30年)	2,040,000,000	1,909,684,800	
第75回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,411,914,000	
第76回利付国債(30年)	1,960,000,000	2,025,248,400	
第77回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,632,914,000	
第78回利付国債(30年)	470,000,000	485,312,600	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	410,808,000	
第71回利付国債(20年)	200,000,000	204,976,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	648,490,500	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	371,876,400	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	206,914,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	135,162,300	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	279,738,900	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	300,988,100	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	176,927,500	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	281,561,400	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	229,878,000	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	408,688,800	

第82回利付国債(20年)	600,000,000	630,150,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	306,097,900	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	494,881,800	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	307,600,100	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	543,833,400	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,946,241,600	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	450,219,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	374,108,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	676,733,400	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	484,875,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	946,528,000	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	441,315,800	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	658,922,000	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	906,974,200	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,724,529,900	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	983,898,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	479,116,000	
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,650,460,200	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	528,720,000	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	794,436,500	
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,316,927,200	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	444,400,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	176,145,600	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,303,923,600	
第106回利付国債(20年)	380,000,000	421,917,800	
第107回利付国債(20年)	700,000,000	776,503,000	
第108回利付国債(20年)	840,000,000	922,504,800	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	572,988,000	
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,224,795,000	
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,089,959,900	
第112回利付国債(20年)	790,000,000	882,943,500	
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,266,015,800	
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,622,275,200	
第115回利付国債(20年)	700,000,000	792,358,000	
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,884,614,600	
第117回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,218,866,400	
第118回利付国債(20年)	660,000,000	742,315,200	
第119回利付国債(20年)	530,000,000	588,713,400	
第120回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,392,999,500	
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,646,796,900	
第122回利付国債(20年)	900,000,000	1,001,763,000	
第123回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,069,449,200	
第124回利付国債(20年)	610,000,000	689,074,300	

第125回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,412,310,600	
第126回利付国債(20年)	730,000,000	826,703,100	
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,147,306,200	
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,093,587,700	
第129回利付国債(20年)	740,000,000	828,444,800	
第130回利付国債(20年)	1,685,000,000	1,890,233,000	
第131回利付国債(20年)	700,000,000	779,576,000	
第132回利付国債(20年)	660,000,000	736,606,200	
第133回利付国債(20年)	850,000,000	955,757,000	
第134回利付国債(20年)	640,000,000	721,241,600	
第135回利付国債(20年)	630,000,000	704,566,800	
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,165,269,000	
第137回利付国債(20年)	1,000,000,000	1,120,170,000	
第138回利付国債(20年)	680,000,000	749,740,800	
第139回利付国債(20年)	830,000,000	922,428,800	
第140回利付国債(20年)	2,670,000,000	2,995,419,600	
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,797,552,000	
第142回利付国債(20年)	1,335,000,000	1,512,181,200	
第143回利付国債(20年)	1,880,000,000	2,095,109,600	
第144回利付国債(20年)	980,000,000	1,082,870,600	
第145回利付国債(20年)	2,675,000,000	3,010,204,250	
第146回利付国債(20年)	2,760,000,000	3,109,526,400	
第147回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,524,849,400	
第148回利付国債(20年)	2,130,000,000	2,358,293,400	
第149回利付国債(20年)	2,600,000,000	2,878,772,000	
第150回利付国債(20年)	2,680,000,000	2,938,459,200	
第151回利付国債(20年)	2,275,000,000	2,443,850,500	
第152回利付国債(20年)	2,780,000,000	2,985,497,600	
第153回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,625,433,800	
第154回利付国債(20年)	2,775,000,000	2,976,298,500	
第155回利付国債(20年)	3,000,000,000	3,143,940,000	
第156回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,355,361,800	
第157回利付国債(20年)	2,930,000,000	2,771,135,400	
第158回利付国債(20年)	2,510,000,000	2,462,310,000	
第159回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,369,183,100	
第160回利付国債(20年)	2,010,000,000	2,015,065,200	
第161回利付国債(20年)	2,070,000,000	2,043,483,300	
第162回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,211,611,500	
第163回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,151,083,700	
第164回利付国債(20年)	2,000,000,000	1,932,020,000	
第165回利付国債(20年)	2,120,000,000	2,041,305,600	
第166回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,730,837,500	

	第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,115,257,300	
	第168回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,418,207,100	
	第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,832,630,800	
	第170回利付国債(20年)	2,710,000,000	2,485,639,100	
	第171回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,672,839,600	
	第172回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,111,918,400	
	第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,169,684,500	
	第174回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,429,407,200	
	第175回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,893,847,900	
	第176回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,529,600,000	
	第177回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,122,513,500	
	第178回利付国債(20年)	2,120,000,000	1,960,385,200	
	第179回利付国債(20年)	2,495,000,000	2,301,388,000	
	第180回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,321,646,000	
	第181回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,668,266,600	
	第182回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,448,768,000	
	第183回利付国債(20年)	2,450,000,000	2,623,288,500	
	第184回利付国債(20年)	700,000,000	710,990,000	
	国債証券合計	526,502,000,000	535,916,014,440	
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	99,914,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	84,888,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,544,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	120,799,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	118,134,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	114,309,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	112,255,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	219,068,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,973,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,883,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	84,977,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	219,802,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	219,164,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,640,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,744,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,265,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,080,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	298,494,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	196,464,000	
	第830回東京都公募公債	300,000,000	291,228,000	
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,344,000	
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,956,000	

平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,337,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	198,854,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	198,080,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	202,064,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	247,622,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,658,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	221,818,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	111,570,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,608,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,268,000	
第78回神奈川県公募公債（5年）	200,000,000	199,988,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,310,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,880,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,295,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,208,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,080,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,400,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	221,884,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	221,016,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	109,758,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,710,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	152,070,590	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,014,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,010,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,953,200	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,276,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,832,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,418,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,665,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	155,499,200	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	176,523,620	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	193,682,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	111,594,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	110,298,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,001,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	93,944,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	97,023,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	136,956,590	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	109,336,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	100,935,000	

第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,450,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,513,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,469,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	448,228,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,704,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	95,549,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	295,458,000	
第1回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,882,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	106,473,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	89,844,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,695,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,028,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,957,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,121,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,202,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,149,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	304,072,800	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	111,777,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,788,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,891,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,414,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	289,245,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,756,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	88,676,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	196,344,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,115,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	168,928,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	110,909,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	222,608,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,469,777	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,079,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	382,172,700	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	97,863,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	100,193,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	109,135,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	110,489,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	93,985,000	

第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	223,694,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	189,530,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	221,818,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	188,328,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,005,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,900,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,408,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,101,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,767,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	97,477,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	145,071,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,282,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,753,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,960,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	111,812,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,761,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	117,489,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,637,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,616,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,992,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	88,676,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	96,177,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	294,831,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	97,377,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	93,708,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	99,912,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	220,978,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	111,424,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,695,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,666,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,969,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,900,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,199,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,285,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,004,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	128,986,000	

平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,992,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	293,265,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	292,470,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	220,302,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,056,000	
第135回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,705,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,697,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,688,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,738,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,416,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,340,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,954,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,712,938	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,968,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,040,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,028,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,970,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,784,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,652,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,348,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,740,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,166,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,393,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,162,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,961,918	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,101,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,196,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,125,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,588,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	194,568,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	97,883,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	99,309,260	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,095,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,223,000	
第13回回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	223,218,000	
第15回回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	84,104,000	
第22回回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	283,311,000	
第24回回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	97,636,000	
令和3年度第2回回大阪市公募公債	200,000,000	194,846,000	
第1回名古屋市長屋市公募公債（12年）	100,000,000	101,996,000	
第1回名古屋市長屋市公募公債（30年）	100,000,000	120,052,000	
第5回名古屋市長屋市公募公債（30年）	100,000,000	122,554,000	

第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	109,863,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	111,054,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,305,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	294,735,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,332,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	128,944,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	221,170,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	112,284,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	109,854,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	84,072,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	84,366,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	104,351,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	333,411,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	101,014,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,148,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,288,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,806,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,106,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	214,168,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	294,750,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	97,421,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	105,013,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,622,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	110,144,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,127,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	97,690,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,636,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,010,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,942,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	111,275,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	108,254,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,470,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,661,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,134,400	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,039,100	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	540,793,000	
令和2年度第3回広島市公募公債(5年)	300,000,000	299,601,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,190,000	

	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	290,634,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	97,280,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	101,021,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,962,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,174,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	109,351,000	
	地方債証券合計	31,680,430,000	32,224,005,093	
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	99,967,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,977,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,096,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	71,852,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,535,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,063,000	
	第21回道路債券	100,000,000	119,465,000	
	第28回道路債券	200,000,000	241,720,000	
	第33回道路債券	200,000,000	244,410,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,970,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,731,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,513,000	
	第38回道路債券	100,000,000	102,935,000	
	第42回道路債券	200,000,000	207,778,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,840,000	
	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	124,168,000	
	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	222,632,000	
	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	224,230,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,353,000	
	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	118,788,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,536,000	
	第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,259,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,535,000	

第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,655,000	
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	110,986,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,686,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,098,000	
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	108,671,000	
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	109,415,000	
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	109,720,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	576,756,000	
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	111,207,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,817,000	
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	217,588,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,711,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,718,000	
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	108,266,000	
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	216,000,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,781,000	
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	260,882,930	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,548,000	
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	105,400,000	
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	211,986,000	
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	100,704,000	
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	113,033,760	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,394,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,234,000	
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	84,009,000	
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	106,664,020	
	100,000,000	100,449,000	

第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	205,077,900	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,968,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,725,000	
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	100,114,000	
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	200,156,000	
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	100,021,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	119,998,800	
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	199,304,000	
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	289,647,000	
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	213,884,440	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,439,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,142,000	
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	117,394,800	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	350,277,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,662,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	362,499,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	241,990,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	119,149,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	222,138,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	218,238,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	600,042,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	163,108,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,511,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	221,260,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,756,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	546,700,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,121,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,711,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,729,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	422,980,500	

第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,962,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,356,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,826,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,231,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,887,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,882,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,783,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,967,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,193,270	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,176,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,082,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,041,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,025,300	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,403,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,875,200	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,946,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,947,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,651,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,375,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	715,015,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,191,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,086,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,980,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,700,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,053,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,884,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,252,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,912,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,702,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	103,797,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,189,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,381,000	
第19回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,814,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,105,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,469,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,857,620	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,082,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,407,800	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,850,400	

第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,017,600	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,928,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	204,340,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	138,010,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	76,087,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	161,060,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,375,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,114,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	109,170,000	108,631,791	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,828,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	75,022,000	74,955,230	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	107,894,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,254,000	10,315,626	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	129,975,000	128,966,394	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,068,000	10,125,891	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	149,760,000	148,329,792	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	53,648,000	53,232,764	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,632,000	10,749,589	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	187,212,000	186,264,707	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	128,642,000	127,701,626	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,722,000	10,865,996	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,154,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,289,000	14,906,999	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,091,000	14,696,772	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,075,000	16,905,434	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,166,000	19,103,002	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,307,000	20,364,251	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,876,000	20,928,235	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,878,000	42,966,457	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,640,000	19,491,288	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,982,000	19,799,744	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,639,000	19,455,574	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,596,000	18,344,885	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,434,000	10,581,432	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,262,000	38,711,491	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,560,000	20,328,903	

第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,077,000	10,135,950	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,221,000	27,233,392	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,886,000	25,839,133	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,068,000	26,047,406	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,138,000	56,117,285	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,848,000	68,802,635	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,688,000	35,654,060	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,524,000	36,802,508	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,193,000	37,534,312	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,475,000	32,570,330	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,543,000	31,379,878	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,997,000	37,365,965	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	167,800,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,254,000	96,837,502	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	126,676,000	130,100,052	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,001,000	37,887,543	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,441,000	39,373,194	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,110,000	39,935,221	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,620,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,444,000	125,944,975	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,212,000	42,895,412	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,614,000	90,376,615	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,138,000	50,689,016	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,860,000	54,244,021	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	315,903,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,051,000	53,692,386	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,153,000	167,702,962	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,452,000	112,995,610	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,194,000	54,855,708	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,477,000	59,161,765	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,820,000	63,579,993	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,480,000	69,242,371	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,000,000	68,593,000	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,322,000	69,171,532	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,872,000	70,002,400	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,211,000	70,203,364	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,144,000	71,923,226	

第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,405,000	72,244,466	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,239,000	71,876,022	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,252,000	71,886,582	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,979,000	72,610,388	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,590,000	147,445,680	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,080,000	72,668,035	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,610,000	148,993,211	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,463,000	73,977,133	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,146,000	147,961,353	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,277,000	74,768,240	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,058,000	150,602,479	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,208,000	151,684,778	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,429,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,202,000	76,827,990	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,642,000	76,448,642	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,975,000	76,102,820	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,970,000	156,293,821	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,769,000	78,315,237	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,802,000	77,496,520	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,956,000	156,938,603	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,534,000	79,360,567	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,069,000	238,192,156	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,512,000	160,124,720	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,327,000	82,648,585	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,188,000	83,218,823	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,182,000	171,774,405	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,397,000	86,514,840	

第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,332,000	173,469,636	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,208,000	174,923,706	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,924,000	87,035,641	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,842,000	175,718,746	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,658,000	176,248,224	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,903,000	89,057,683	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,201,000	89,658,429	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,090,000	268,417,598	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,432,000	89,952,592	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,681,000	92,285,570	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,266,000	93,895,931	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,030,000	94,788,607	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,906,000	189,908,610	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,459,000	98,022,826	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,134,000	200,593,701	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,856,000	100,961,405	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,909,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,825,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	82,808,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	104,017,000	
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	600,000,000	600,384,000	
い第829号商工債	200,000,000	200,054,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,838,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,893,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,798,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,767,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,350,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,818,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,759,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,646,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	398,016,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	100,678,000	

	第2回信金中金債(10年)	100,000,000	100,934,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	110,011,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,130,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,108,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	490,495,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,401,000	
	第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	500,135,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,710,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,814,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,269,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	202,066,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	599,328,000	
	第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,063,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,149,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,750,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,096,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,709,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	190,840,000	
	特殊債券合計	36,350,238,000	36,888,470,436	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,706,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	300,000,000	298,983,000	
	第2回B・P・C・E・S・A円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	99,713,000	
	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	99,358,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,766,000	
	第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,760,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	397,252,000	
	第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,263,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,271,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,708,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,437,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,925,000	
	第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,433,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,566,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	96,793,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,014,000	
	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	100,128,000	

第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,131,000	
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,127,000	
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	100,127,000	
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	100,747,000	
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	198,686,000	
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	299,793,000	
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	99,980,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,380,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,046,000	
第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	99,218,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,913,000	
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	100,209,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,828,000	
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	199,672,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,806,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,770,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,740,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,936,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,968,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,030,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	97,665,000	
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	99,206,000	
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	198,592,000	
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	199,738,000	
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,313,000	
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	86,693,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,264,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,013,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	197,674,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	286,464,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	100,091,000	

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	99,975,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,350,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,817,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,039,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,435,000	
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,674,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,786,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,931,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,175,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	97,416,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,866,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,165,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第14回株式会社L I X I L 無担保社債	100,000,000	99,893,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,573,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,640,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,913,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,944,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,558,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,874,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	97,859,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,726,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,720,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,060,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	200,226,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,716,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,647,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,664,000	
第22回J A 三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,681,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	195,180,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,490,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	89,910,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	110,422,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	196,798,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,588,000	

第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,370,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,871,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	100,086,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	97,420,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,704,000	
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	111,921,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,711,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,206,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,561,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	300,786,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,023,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,750,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	196,758,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,626,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,744,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,004,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,118,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,903,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,047,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,300,000	
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	99,517,000	
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	99,251,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,179,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,009,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,777,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,747,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,891,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,433,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	198,500,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,249,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,811,000	

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	99,126,000	
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	100,474,000	
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	98,733,000	
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	299,871,000	
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	199,498,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,040,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,950,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,154,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	89,505,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,889,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,814,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,535,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,973,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,923,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,133,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,174,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,677,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,987,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,880,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,941,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,116,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,172,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	220,822,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,275,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,363,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	86,013,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,743,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,402,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,932,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,725,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,856,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,573,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	81,144,000	

第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	89,448,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,175,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,657,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,158,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,886,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,545,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,729,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,392,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,508,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	79,130,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	86,143,000	
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	163,922,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,158,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,388,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	175,534,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,776,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,917,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,608,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	94,868,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	86,646,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,057,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,244,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,724,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,527,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,217,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,698,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,783,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,191,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,979,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,552,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	196,748,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,375,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,215,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,899,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	197,086,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,573,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,072,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,810,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,165,000	

第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,167,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,768,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,768,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,076,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,972,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,238,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,776,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,774,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,703,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,153,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,997,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,950,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	93,063,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,936,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,915,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,195,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,822,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,795,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,361,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,441,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,260,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,025,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	275,598,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,633,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	81,327,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,006,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,042,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	88,135,000	
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	199,938,000	
社債券合計	28,400,000,000	27,844,516,000	
合計		632,873,005,969	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	244,418,250
コール・ローン	1,833,893,049
国債証券	262,895,425,904
派生商品評価勘定	37,733,729
未収入金	87,410,172
未収利息	1,664,624,141
前払金	16,215,056
前払費用	134,427,994
差入委託証拠金	140,101,548
流動資産合計	267,054,249,843
資産合計	267,054,249,843
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,680,645
未払金	536
未払解約金	93,026,146
未払利息	3,139
流動負債合計	109,710,466
負債合計	109,710,466
純資産の部	
元本等	
元本	84,697,279,481
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	182,247,259,896
元本等合計	266,944,539,377
純資産合計	266,944,539,377
負債純資産合計	267,054,249,843

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24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>

2023年 5月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	84,697,279,481口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3,1517円 (31,517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 5月24日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
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 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	101,329,670,845円
期中追加設定元本額	14,646,021,329円
期中一部解約元本額	31,278,412,693円
期末元本額	84,697,279,481円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,216,127,147円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	535,114,789円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,275,353,515円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,437,835円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,737,712,600円
世界経済インデックスファンド	16,613,972,393円
D C マイセレクション 2 5	1,930,541,444円
D C マイセレクション 5 0	1,720,181,642円
D C マイセレクション 7 5	1,198,108,349円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,275,904,570円
D C マイセレクション S 2 5	1,041,266,467円
D C マイセレクション S 5 0	846,961,932円
D C マイセレクション S 7 5	485,504,531円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	21,471,054円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	97,453,829円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	51,441,600円
D C 世界経済インデックスファンド	13,181,106,207円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	379,442,240円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	992,969円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	1,033,203円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	19,661,867円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	32,046,114円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	55,087,701円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	58,753,413円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	55,445,945円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,013,863,407円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	390,788,925円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,593,367,193円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	58,021,628円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	35,849,178円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	382,628,500円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	145,975,185円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	189,592,939円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	671,048,013円
グローバル債券ファンド・シリーズ 1（適格機関投資家専用）	2,580,488,369円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	666,805,053円
外国債券ファンド・シリーズ 1	737,360,272円
分散投資コア戦略ファンド A	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンド S	604,847,674円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	616,670,197円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,189,790,974円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	240,526,432円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,593,055円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,343,306,401円
S M T インデックスバランス・オープン	181,333,204円
S M T 世界経済インデックス・オープン	333,347,160円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	428,150,382円

区分	2023年 5月24日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	679,575,297円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,865,972円
グローバル経済コア	766,546,396円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,966,180円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,120,380円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	24,750,171円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	31,341,285円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	16,992,927円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	24,972,803円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	198,663,170円
10資産分散投資ファンド	26,268,302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）	11,905,272,563円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	188,207,337円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	633,693,735円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	120,812,055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）	56,536,190円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	18,807,105,814	
合計	18,807,105,814	

(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 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引					
	買建	1,374,865,243	-	1,358,650,187	16,215,056	
合計		1,374,865,243	-	1,358,650,187	16,215,056	

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2023年 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	1,754,992,563	-	1,792,146,316	37,153,753	
	アメリカドル	950,681,675	-	978,243,600	27,561,925	
	カナダドル	56,129,429	-	57,342,152	1,212,723	
	ユーロ	588,380,676	-	594,563,067	6,182,391	

	イギリスポンド	86,325,963	-	87,604,383	1,278,420
	デンマーククローネ	418,641	-	417,002	1,639
	オフショア人民元	73,056,179	-	73,976,112	919,933
	売建	39,789,774	-	39,675,387	114,387
	デンマーククローネ	39,789,774	-	39,675,387	114,387
	合計	1,794,782,337	-	1,831,821,703	37,268,140

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,597,292.95	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,563,450.50	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,499,339.85	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,773,335.94	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,742,539.07	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,278,460.92	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,256,093.76	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,416,718.72	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,561,435.70	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,769,101.59	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,737,109.40	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,235,710.95	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,526,131.25	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,734,218.75	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,642,578.12	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,086,035.14	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,726,445.27	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,582,721.08	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,066,464.83	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,083,475.00	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,053,653.89			
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,493,066.42			
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,639,257.85			

T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,388,951.20	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,209,218.72	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,647,991.19	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,802,584.34	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,172,167.97	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,322,374.97	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,397,656.25	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,482,031.28	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,651,308.57	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,635,234.36	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,651,825.19	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,260,578.93	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,290,781.28	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,430,585.96	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,146,484.37	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,434,765.60	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,400,106.27	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,024,199.24	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,077,500.00	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,096,971.68	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,305,351.55	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,476,803.12	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,532,293.76	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,093,750.00	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	3,040,359.37	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,310,937.50	
T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,533,906.24	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,650,624.42	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,343,300.80	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,392,421.84	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,501,529.50	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,798,281.24	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,225,398.46	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,107,362.50	
T 1.375% 11/15/31	11,030,000.00	9,182,905.83	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,973,710.96	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,312,861.32	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,509,804.68	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,624,856.25	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,945,117.15	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,144,062.50	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,402,281.27	

T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,656,542.95
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,250,656.26
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,119,878.52
T 1.625% 05/15/31	4,450,000.00	3,826,217.77
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,973,222.69
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,595,250.00
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,178,273.47
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,425,047.66
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,382,773.46
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	2,002,751.96
T 1.75% 06/30/24	2,400,000.00	2,317,968.74
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,261,466.40
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,670,820.32
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,139,173.46
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,686,611.33
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,264,863.30
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,720,234.36
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,868,666.02
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,784,140.64
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	2,121,281.25
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,090,000.00
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,569,531.28
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,054,190.62
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,409,734.38
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,648,500.00
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,832,226.55
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,238,246.06
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	3,031,332.04
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,147,851.60
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,939,502.75
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,070,846.50
T 2.25% 08/15/46	4,190,000.00	3,018,354.86
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,917,890.62
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,089,097.67
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,804,067.39
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,205,265.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,161,117.18
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,207,203.15
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,252,939.46
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,543,218.75
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,484,269.52
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,056,639.42
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,418,323.80

T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,928,806.66	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,854,980.45	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,001,968.75	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,838,085.95	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,151,955.07	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,863,339.85	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,754,290.98	
T 2.5% 05/15/24	7,900,000.00	7,711,505.44	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,101,037.11	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,519,987.50	
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,142,078.91	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,024,003.87	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,609,934.37	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,257,552.71	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,390,285.14	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,331,992.16	
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,766,617.22	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	7,136,378.92	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,213,105.48	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,685,453.12	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,920,879.71	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,419,388.67	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,889,843.76	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,143,894.52	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,965,629.65	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,456,914.01	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,289,052.72	
T 2.875% 05/15/49	5,570,000.00	4,528,888.68	
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	6,162,234.35	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,714,950.00	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,306,010.96	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,751,868.76	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,879,351.57	
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,035,058.60	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,115,982.05	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,842,929.68	
T 2% 05/31/24	3,310,000.00	3,212,410.47	
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,325,546.87	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,288,550.76	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,220,556.62	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	3,020,636.72	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,503,839.83	

T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	919,406.25
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,735,000.00
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,043,742.99
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,580,100.00
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,899,610.36
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,126,343.79
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,690,500.96
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,696,066.39
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,721,554.71
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,895,937.49
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	737,320.11
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,237,718.74
T 3.625% 02/15/53	800,000.00	752,750.00
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,871,406.24
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,856,679.68
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,465,214.86
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,435,896.48
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,562,263.27
T 3.875% 11/30/29	3,500,000.00	3,523,925.79
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,330,500.00
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	831,171.88
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	832,460.94
T 3% 05/15/45	700,000.00	585,785.15
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,669,190.24
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,723,726.52
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,701,308.61
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,327,171.88
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,089,257.80
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,866,406.25
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,350,031.26
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,137,902.33
T 4.125% 11/15/32	7,550,000.00	7,791,246.05
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	940,148.44
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,911,994.13
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	767,692.19
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,063,964.84
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,005,539.07
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,048,033.20
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	1,014,374.99
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,182,075.19
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	592,130.85
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,827,300.77
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,502,744.52

	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	826,464.84
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,489,208.96
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,294,937.50
	T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,864,593.75
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	453,945.31
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,392,878.90
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,170,822.27
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,785,464.84
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,588,033.19
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,212,380.86
	アメリカドル 小計	1,054,670,000.00	943,632,168.62 (130,815,727,535)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,070,398.59
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,785,167.38
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,565,127.53
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	666,755.94
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,369,818.70
	CAN 1.25% 03/01/27	780,000.00	717,373.62
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,490,354.60
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,391,487.23
	CAN 1.5% 05/01/24	1,590,000.00	1,544,366.92
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	854,428.34
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,488,836.51
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,156,723.21
	CAN 1.5% 12/01/31	2,190,000.00	1,909,608.03
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	2,065,528.02
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	737,674.97
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,407,303.51
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,236,646.96
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	227,345.20
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	481,240.98
	CAN 2.5% 06/01/24	450,000.00	440,859.66
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,164,072.91
	CAN 2.75% 06/01/33	190,000.00	182,287.73
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	822,871.68
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,553,964.90
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	956,210.13
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	414,016.11
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	551,122.97
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	385,978.37
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,374,991.45
	CAN 2% 12/01/51	3,400,000.00	2,612,668.22

	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,164,690.19
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,083,042.16
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	2,013,267.23
	CAN 3% 10/01/25	510,000.00	499,308.79
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,118,437.71
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	808,239.84
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,691,972.88
	CAN 5.75% 06/01/33	1,120,000.00	1,358,612.80
	CAN 5% 06/01/37	890,000.00	1,060,020.84
	カナダドル 小計	56,670,000.00	52,422,822.81 (5,383,299,674)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,312,061.50
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,240,162.40
	MBONO 5.5% 03/04/27	20,300,000.00	17,896,886.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,083,845.06
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	15,972,175.20
	MBONO 7.5% 05/26/33	13,190,000.00	11,961,219.60
	MBONO 7.5% 06/03/27	27,110,000.00	25,564,187.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	38,011,396.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,963,083.30
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,141,823.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	24,700,000.00	24,230,700.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,670,000.00	13,949,262.90
	MBONO 8% 07/31/53	8,850,000.00	7,810,833.00
	MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,420,513.70
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,928,686.00
	メキシコペソ 小計	335,590,000.00	312,486,835.96 (2,411,273,421)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	855,868.00
	BGB 0.35% 06/22/32	1,390,000.00	1,091,833.88
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	308,787.66
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,370,990.12
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	170,172.64
	BGB 0.8% 06/22/25	2,240,000.00	2,147,022.08
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,561,036.10
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,452,832.00
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,458,080.64
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	690,494.22
	BGB 0% 10/22/31	1,480,000.00	1,150,657.37
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	737,170.14
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	632,646.00
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	627,986.08
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	741,236.40

BGB 1.7% 06/22/50	820,000.00	556,941.54
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	533,297.05
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,382,773.30
BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,089,967.34
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	621,746.40
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	500,286.32
BGB 2.6% 06/22/24	950,000.00	944,081.50
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	365,106.00
BGB 3.3% 06/22/54	600,000.00	560,432.40
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	957,927.90
BGB 3% 06/22/33	600,000.00	591,613.61
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	930,555.40
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,031,230.07
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,191,200.25
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,157,232.96
BGB 5.5% 03/28/28	2,190,000.00	2,458,958.28
BGB 5% 03/28/35	1,590,000.00	1,851,742.62
BKO 0.2% 06/14/24	1,060,000.00	1,029,832.40
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,761,608.94
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,375,195.11
BKO 2.5% 03/13/25	1,200,000.00	1,192,814.40
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,425,728.64
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	550,566.74
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,711,256.58
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,762,089.60
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,103,602.50
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,397,697.40
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,041,141.50
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,302,612.72
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	654,681.90
BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,177,848.10
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,806,489.55
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,330,703.14
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,654,656.56
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,025,012.25
BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,143,668.48
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,438,066.50
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	711,072.00
BTPS 1.1% 04/01/27	2,000,000.00	1,820,096.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,801,944.30
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,560,754.35
BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	494,924.50
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,213,947.63

BTPS 1.45% 11/15/24	2,400,000.00	2,331,571.20
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	719,433.50
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,316,925.80
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,019,930.40
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,719,381.30
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,147,155.21
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	926,768.64
BTPS 1.75% 05/30/24	1,910,000.00	1,875,831.32
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	981,045.00
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	436,481.10
BTPS 1.85% 05/15/24	250,000.00	246,134.25
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,613,678.30
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,571,879.08
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,377,720.00
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	317,417.64
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	617,290.74
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,159,999.04
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,591,829.10
BTPS 2.45% 09/01/33	2,640,000.00	2,232,674.40
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	669,381.54
BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,149,508.19
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,908,995.00
BTPS 2.5% 12/01/32	1,350,000.00	1,168,762.50
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,683,717.20
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	804,224.75
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	547,302.14
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,455,488.00
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,350,526.50
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	969,429.00
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,095,826.82
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,103,936.71
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,165,649.30
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	821,020.27
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,820,728.41
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,003,951.20
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,496,383.98
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	908,694.15
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,300,478.44
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,157,241.41
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,282,414.77
BTPS 3.85% 12/15/29	900,000.00	893,572.20
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,065,748.86

BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	403,999.60
BTPS 4.45% 09/01/43	700,000.00	672,713.30
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,130,731.20
BTPS 4.5% 10/01/53	450,000.00	429,840.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,750,853.76
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,504,300.50
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,696,288.10
BTPS 4% 04/30/35	1,150,000.00	1,097,972.88
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,239,752.40
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,785,458.00
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,922,298.69
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,542,779.12
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,210,509.86
BTPS 5% 08/01/34	3,080,000.00	3,229,842.00
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,547,005.30
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	3,014,285.40
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,289,591.94
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,565,333.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,787,667.32
DBR 0.25% 02/15/29	2,410,000.00	2,136,826.50
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,355,087.41
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,960,878.84
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,834,940.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,617,695.08
DBR 0.5% 08/15/27	530,000.00	489,229.75
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,255,180.08
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	941,966.87
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,975,587.32
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,757,751.38
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,596,164.87
DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,167,834.46
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,546,991.65
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,983,588.00
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,251,184.60
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,743,347.24
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,309,277.22
DBR 0% 08/15/52	1,700,000.00	811,542.60
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,173,193.88
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,747,235.92
DBR 1.25% 08/15/48	3,080,000.00	2,335,154.36
DBR 1.5% 05/15/24	2,290,000.00	2,259,346.06
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,972,564.60
DBR 1.8% 08/15/53	1,380,000.00	1,142,019.73

DBR 1% 05/15/38	1,410,000.00	1,121,919.81	
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,954,402.00	
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,340,175.05	
DBR 2.1% 11/15/29	2,710,000.00	2,657,198.36	
DBR 2.3% 02/15/33	1,700,000.00	1,676,021.50	
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,716,343.56	
DBR 2.5% 08/15/46	2,890,000.00	2,837,815.27	
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,986,549.18	
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,823,321.56	
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,288,532.90	
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,588,957.37	
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,588,695.50	
DBR 4.75% 07/04/40	1,640,000.00	2,100,779.32	
DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,444,650.76	
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,686,461.39	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,542,246.25	
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,172,050.48	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,285,302.84	
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,422,203.40	
FRTR 0.5% 05/25/26	3,550,000.00	3,315,621.90	
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,452,027.45	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,698,226.59	
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	359,634.13	
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	843,154.81	
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,275,345.60	
FRTR 0.75% 05/25/28	4,790,000.00	4,339,165.20	
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,508,352.30	
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,578,420.00	
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,246,168.85	
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,127,216.00	
FRTR 0% 02/25/26	3,340,000.00	3,091,654.30	
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,112,618.40	
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,540,249.40	
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,523,914.08	
FRTR 0% 11/25/29	2,930,000.00	2,444,850.60	
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,255,165.50	
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,306,120.50	
FRTR 1.25% 05/25/34	3,840,000.00	3,176,467.20	
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,514,966.00	
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,674,827.74	
FRTR 1.5% 05/25/50	2,490,000.00	1,646,634.51	
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	950,900.00	

FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,360,545.52
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,081,916.80
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,336,143.60
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,090,965.24
FRTR 2.25% 05/25/24	3,340,000.00	3,309,520.83
FRTR 2.5% 05/25/30	4,980,000.00	4,878,617.16
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	449,439.12
FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	889,712.10
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	497,350.00
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,324,768.57
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,172,842.10
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,667,884.00
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,991,234.40
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,818,275.99
FRTR 3% 05/25/33	950,000.00	946,921.05
FRTR 3% 05/25/54	700,000.00	629,609.40
FRTR 4.5% 04/25/41	3,100,000.00	3,559,227.80
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,814,854.76
FRTR 4% 04/25/55	2,020,000.00	2,215,088.57
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,969,446.64
FRTR 4% 10/25/38	3,370,000.00	3,636,364.80
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,767,530.88
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,400,054.78
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,036,372.50
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	605,890.04
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	647,855.52
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	373,675.94
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	448,670.25
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	226,378.80
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	705,311.65
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	671,500.00
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	964,774.90
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	369,630.15
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	423,151.34
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	535,515.20
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	481,694.64
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	950,384.40
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	773,003.15
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	772,269.40
IRISH 3% 10/18/43	340,000.00	322,752.14
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,211,327.10
NETHER 0.25% 07/15/25	1,350,000.00	1,279,389.60
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	821,421.87

NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	940,445.16
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,326,213.82
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	835,157.64
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	833,049.90
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,544,977.00
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,107,108.17
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,670,076.00
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,386,403.83
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	625,056.00
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	792,051.48
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,116,332.55
NETHER 0% 07/15/31	1,410,000.00	1,132,865.91
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	394,230.40
NETHER 2.5% 01/15/33	1,430,000.00	1,395,873.05
NETHER 2.5% 07/15/33	560,000.00	546,369.60
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,797,684.41
NETHER 2% 01/15/54	630,000.00	517,110.30
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,967,881.15
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,892,831.00
NETHER 4% 01/15/37	1,720,000.00	1,920,591.56
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,714,286.20
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,851,692.30
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,186,875.00
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,317,705.20
OBL 0% 10/09/26	2,400,000.00	2,205,357.60
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,753,956.00
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,313,860.28
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,381,144.25
OBL 2.2% 04/13/28	1,900,000.00	1,878,697.20
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	405,948.60
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,233,312.90
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	996,927.64
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	118,199.76
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	798,622.00
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	404,089.58
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,942,570.24
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	90,633.11
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,026,470.67
RAGB 0% 02/20/30	750,000.00	615,930.00
RAGB 0% 02/20/31	1,420,000.00	1,126,528.60
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	974,537.59
RAGB 0% 07/15/24	580,000.00	560,882.21

RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	625,755.27
RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	266,028.46
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,144,692.53
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	762,843.96
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	152,336.70
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	971,435.52
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	343,867.48
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	448,652.19
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	677,753.17
RAGB 2.9% 02/20/33	550,000.00	539,072.05
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	219,695.08
RAGB 3.15% 06/20/44	590,000.00	573,818.07
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	467,766.18
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,711,760.01
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,128,664.89
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,332,819.44
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	295,737.20
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	201,610.18
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	292,652.79
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	180,477.22
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	581,810.48
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	291,803.33
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	490,330.58
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	646,761.75
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	457,758.44
RFGB 0.75% 04/15/31	470,000.00	396,737.34
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	421,179.80
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	404,067.21
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	274,116.00
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	516,863.36
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	301,209.60
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	331,962.40
RFGB 1.375% 04/15/47	490,000.00	344,153.46
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	499,171.80
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	473,395.00
RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	269,854.30
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	548,735.00
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	593,839.20
SPGB 0.1% 04/30/31	1,200,000.00	934,434.00
SPGB 0.25% 07/30/24	2,290,000.00	2,213,443.01
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,289,449.25
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,038,010.00
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,038,022.36

SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,748,128.80	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,223,037.64	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,200,000.00	1,904,918.40	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	987,704.60	
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,167,345.20	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,453,194.30	
SPGB 0% 01/31/27	1,810,000.00	1,617,663.97	
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,104,064.10	
SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,043,159.42	
SPGB 0% 05/31/25	2,310,000.00	2,171,365.35	
SPGB 1.2% 10/31/40	1,960,000.00	1,287,876.80	
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,726,131.97	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,501,345.60	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,000,129.14	
SPGB 1.4% 07/30/28	1,980,000.00	1,816,063.97	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,443,571.79	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,890,000.00	1,761,687.90	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	297,380.82	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,413,837.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,411,406.80	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,793,671.30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,190,000.00	742,931.99	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,230,137.50	
SPGB 1.95% 07/30/30	1,600,000.00	1,466,616.00	
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	539,216.29	
SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	947,379.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,539,535.72	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,150,000.00	1,938,745.30	
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,837,178.64	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,347,372.27	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,344,696.51	
SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	990,658.33	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,632,009.53	
SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,648,441.72	
SPGB 3.45% 07/30/43	530,000.00	486,339.66	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,181,890.16	
SPGB 3.8% 04/30/24	1,720,000.00	1,728,974.96	
SPGB 3.9% 07/30/39	670,000.00	666,793.48	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,038,728.90	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,934,205.64	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	1,863,329.20	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,941,773.27	

	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,444,875.16
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,490,000.00	1,728,468.54
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,388,370.70
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,232,531.18
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,202,155.50
	ユーロ 小計	641,300,000.00	584,318,588.41 (87,250,451,621)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,134,278.46
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,259,340.00
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,755,777.76
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,995,345.90
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,266,723.50
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,651,092.50
	UKT 0.5% 01/31/29	1,930,000.00	1,579,106.70
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	504,739.89
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,305,267.60
	UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,115,302.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	422,829.76
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	785,589.84
	UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,186,509.60
	UKT 0.875% 10/22/29	1,400,000.00	1,155,924.00
	UKT 1.125% 01/31/39	1,950,000.00	1,223,287.65
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	377,338.50
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	849,174.60
	UKT 1.25% 07/31/51	2,620,000.00	1,266,088.80
	UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,171,727.20
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,477,209.60
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	945,829.00
	UKT 1.5% 07/31/53	970,000.00	491,993.70
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	947,943.54
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	697,738.00
	UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	543,508.00
	UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	348,540.00
	UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	827,007.16
	UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,363,124.70
	UKT 1% 01/31/32	3,150,000.00	2,441,376.00
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	909,268.60
	UKT 2.75% 09/07/24	1,690,000.00	1,654,397.78
	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,265,279.24
UKT 3.25% 01/22/44	1,760,000.00	1,456,435.20	
UKT 3.25% 01/31/33	1,410,000.00	1,308,550.50	
UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,685,000.10	
UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,264,545.00	

	UKT 3.75% 01/29/38	900,000.00	833,130.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,154,406.00	
	UKT 3.75% 10/22/53	1,170,000.00	1,018,321.20	
	UKT 4.125% 01/29/27	2,150,000.00	2,134,735.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,640,000.00	1,631,078.40	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,522,980.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,239,659.70	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,460,000.00	1,470,073.12	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,409,458.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,520,135.40	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,110,000.00	1,058,218.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,704,634.80	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,423,832.60	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,800,126.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,529,393.80	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,451,422.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,148,275.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,192,005.32	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,479,459.33	
	イギリスポンド 小計	88,580,000.00	71,354,534.55 (12,292,959,212)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,740,424.48	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,921,842.56	
	SGB 0.75% 11/12/29	4,600,000.00	4,155,853.85	
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,554,230.37	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,552,517.86	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,445,771.35	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,660,373.88	
	SGB 3.5% 03/30/39	3,990,000.00	4,504,350.90	
	スウェーデンクローナ 小計	43,410,000.00	41,535,365.25 (542,451,870)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,122,480.00	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,552,528.24	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,894,743.40	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	4,007,628.90	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,070,353.30	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,880,054.50	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	3,039,970.08	
	NGB 2% 04/26/28	2,370,000.00	2,230,644.00	
	NGB 3% 08/15/33	2,600,000.00	2,520,554.92	
	ノルウェークローネ 小計	36,040,000.00	33,318,957.34 (421,817,999)	

デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,593,138.35
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,232,191.65
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,326,642.00
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,673,321.27
	DGB 0% 11/15/31	5,340,000.00	4,271,220.36
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,386,425.68
	DGB 4.5% 11/15/39	10,720,000.00	13,007,323.18
	デンマーククローネ 小計		44,580,000.00
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,240,000.00	1,024,736.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,233,192.00
	POLGB 0% 07/25/24	1,310,000.00	1,227,404.50
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,009,438.90
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,650,000.00	1,887,462.50
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,738,333.90
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,416,977.60
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,157,384.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,815,588.60
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,001,000.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,814,959.20
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,255,082.00
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	594,210.00
	POLGB 6% 10/25/33	810,000.00	808,420.50
	POLGB 7.5% 07/25/28	730,000.00	774,606.94
	ポーランドズロチ 小計		43,230,000.00
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,662,970.38
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,943,426.28
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,101,513.03
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,996,950.18
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,170,000.00	1,854,291.04
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,670,000.00	1,004,753.71
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,544,833.90
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,252,306.87
	ACGB 1% 12/21/30	2,810,000.00	2,335,418.02
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,402,647.96
	ACGB 2.5% 05/21/30	1,550,000.00	1,452,301.65
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,180,000.00	981,086.31
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,082,011.54
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,879,606.31
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,604,940.32
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,397,777.39
ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,058,979.54	

	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,662,184.49	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	1,021,145.31	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,418,993.99	
	ACGB 3.75% 04/21/37	760,000.00	748,994.09	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,498,027.52	
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,196,949.89	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,733,089.44	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,600,000.00	1,638,495.68	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,878,789.31	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,435,777.51	
	オーストラリアドル 小計	48,730,000.00	44,788,261.66 (4,103,500,533)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	590,000.00	480,138.00	
	NZGB 0.5% 05/15/24	790,000.00	752,166.88	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	592,471.00	
	NZGB 1.5% 05/15/31	590,000.00	474,518.32	
	NZGB 1.75% 05/15/41	390,000.00	251,634.57	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	814,328.28	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	510,297.68	
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	371,796.20	
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	434,719.09	
	NZGB 3.5% 04/14/33	600,000.00	554,187.63	
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	601,192.42	
	NZGB 4.25% 05/15/34	320,000.00	313,096.60	
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	838,355.70	
	NZGB 4.5% 05/15/30	370,000.00	371,126.53	
	ニュージーランドドル 小計	8,340,000.00	7,360,028.90 (637,893,704)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	553,123.83	
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	761,400.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	505,680.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	676,060.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	286,052.80	
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	611,415.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	603,850.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	884,745.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	442,782.30	
	SIGB 2.625% 05/01/28	510,000.00	504,109.50	
	SIGB 2.625% 08/01/32	230,000.00	224,650.20	
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	657,280.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	638,360.10	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	647,075.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	280,000.00	279,076.00	

	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	625,590.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	660,000.00	683,430.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	751,988.00
	SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	256,850.00
	SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	893,890.53
	シンガポールドル 小計	11,790,000.00	11,487,408.26 (1,181,824,561)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,518,778.89
	MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,925,269.63
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,506,775.95
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	699,733.73
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,952,252.47
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,283,101.09
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,752,727.64
	MGS 3.844% 04/15/33	1,670,000.00	1,666,379.75
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,384,763.94
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,179,006.92
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,143,051.04
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,996,352.69
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,504,445.63
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	608,782.86
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,711,635.88
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,292,155.39
	MGS 4.065% 06/15/50	2,390,000.00	2,332,744.84
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,292,846.84
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,559,347.49
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,798,283.20
	MGS 4.392% 04/15/26	1,910,000.00	1,961,318.26
	MGS 4.498% 04/15/30	580,000.00	608,635.06
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	930,377.65
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,134,585.27
MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,049,918.00	
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,449,894.65	
MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,024,331.56	
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,880,654.83	
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,135,540.80	
	マレーシアリンギット 小計	47,320,000.00	48,283,691.95 (1,461,890,169)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,920,987.50
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,030,826.22
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,251,135.30
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	765,410.44

	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,287,653.22
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,174,275.78
	ILGOV 1% 03/31/30	870,000.00	720,725.83
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,498,990.40
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	374,312.65
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,491,825.76
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,487,983.62
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,204,812.48
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,435,739.24
	イスラエルシェケル 小計	22,170,000.00	20,644,678.44 (773,124,627)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,545,598.63
	CGB 2.18% 06/25/24	19,130,000.00	19,134,244.94
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,168,518.41
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,366,151.44
	CGB 2.35% 03/15/25	10,000,000.00	10,019,011.00
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,277,043.78
	CGB 2.46% 02/15/26	23,000,000.00	23,069,975.20
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,594,326.35
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	19,993,446.80
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,073,771.42
	CGB 2.6% 09/01/32	21,800,000.00	21,501,070.11
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	19,934,599.80
	CGB 2.68% 05/21/30	15,030,000.00	14,992,367.13
	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000.00	64,442,785.76
	CGB 2.69% 08/15/32	9,320,000.00	9,258,918.86
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,477,736.70
	CGB 2.75% 06/15/29	12,640,000.00	12,704,386.89
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,078,886.60
	CGB 2.8% 03/24/29	16,280,000.00	16,437,380.38
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,150,256.00
	CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,015,116.80
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	29,954,883.54
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,461,296.20
	CGB 2.89% 11/18/31	8,780,000.00	8,863,988.60
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,690,560.00
	CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,333,499.60
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,143,841.56
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,159,903.44
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,443,752.24
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,153,350.88
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,606,405.32
	CGB 3.32% 04/15/52	5,000,000.00	5,184,897.00

	CGB 3.39% 03/16/50	11,730,000.00	12,252,694.66	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,001,144.29	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,690,000.00	8,520,258.54	
	CGB 3.81% 09/14/50	13,300,000.00	14,908,621.70	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,525,417.60	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,570,712.41	
	オフショア人民元 小計	679,750,000.00	690,010,820.58 (13,531,043,190)	
	合計		262,895,425,904 (262,895,425,904)	

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 203銘柄	100.0%	49.8%
カナダドル	国債証券 39銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 360銘柄	100.0%	33.2%
イギリスポンド	国債証券 55銘柄	100.0%	4.7%
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 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 29銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 38銘柄	100.0%	5.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	159,392,289
コール・ローン	349,264,841
国債証券	65,889,141,300
派生商品評価勘定	153,804,589
未収入金	496,330
未収利息	416,697,951
前払金	3,114,877
前払費用	34,618,768
差入委託証拠金	43,492,197
流動資産合計	67,050,023,142
資産合計	67,050,023,142
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	643,078,425
未払金	3,847,550
未払解約金	840,394
未払利息	597
流動負債合計	647,766,966
負債合計	647,766,966
純資産の部	
元本等	
元本	78,562,074,860
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,159,818,684
元本等合計	66,402,256,176
純資産合計	66,402,256,176
負債純資産合計	67,050,023,142

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24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	(1)派生商品取引等損益

	2023年 5月24日現在
	<p>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 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	78,562,074,860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 12,159,818,684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 (1万口当たり純資産額) 0.8452円 (8,452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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 5月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	72,192,637,350円
期中追加設定元本額	11,553,406,302円
期中一部解約元本額	5,183,968,792円
期末元本額	78,562,074,860円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,018,400,430円
分散投資コア戦略ファンドS	26,727,640,336円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	392,779,204円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	191,490,446円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	44,837,229円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,865,524円
10資産分散投資ファンド	465,689,314円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	6,524,893,200円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	2,590,131,144円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,275,762,777円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,295,598,045円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,278,883,964円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,188,718,267円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,157,183,175円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	3,273,534,438円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,127,667,367円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,368,557,320
合計	1,368,557,320

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 5月24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	340,673,544	-	337,558,667	3,114,877
合計		340,673,544	-	337,558,667	3,114,877

(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 5月24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	66,957,979,688	-	67,444,138,647	486,158,959
	アメリカドル	32,977,513,763	-	33,526,874,678	549,360,915
	カナダドル	1,368,327,524	-	1,396,607,461	28,279,937
	メキシコペソ	606,335,834	-	620,215,031	13,879,197
	ユーロ	22,482,780,927	-	22,349,035,526	133,745,401
	イギリスポンド	3,235,293,576	-	3,253,781,706	18,488,130
	スウェーデンク ローナ	141,601,885	-	139,176,150	2,425,735
	ノルウェークロー ネ	105,837,564	-	104,873,685	963,879
	デンマーククロー ネ	215,964,658	-	214,802,811	1,161,847
	ポーランドズロチ	313,603,901	-	319,769,969	6,166,068
	オーストラリアド ル	1,040,489,739	-	1,055,539,255	15,049,516
	ニュージーランド ドル	162,178,897	-	166,991,142	4,812,245
	シンガポールドル	298,262,620	-	300,324,917	2,062,297
	マレーシアリン ギット	375,501,831	-	375,142,086	359,745
	イスラエルシェケ ル	198,276,521	-	197,774,934	501,587
	オフショア人民元	3,436,010,448	-	3,423,229,296	12,781,152
合計		66,957,979,688	-	67,444,138,647	486,158,959

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカド ル	T 0.25% 05/31/25	1,000,000.00	922,382.81	
		T 0.25% 06/15/24	1,900,000.00	1,807,839.55	
		T 0.25% 06/30/25	1,940,000.00	1,786,505.08	
		T 0.25% 07/31/25	600,000.00	550,769.53	
		T 0.25% 08/31/25	400,000.00	366,156.24	
		T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,142,724.61	

T 0.25% 10/31/25	1,240,000.00	1,129,247.65	
T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,405,868.16	
T 0.375% 04/30/25	1,550,000.00	1,436,989.25	
T 0.375% 07/15/24	1,000,000.00	950,214.84	
T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	867,109.38	
T 0.375% 08/15/24	1,200,000.00	1,136,906.25	
T 0.375% 09/15/24	1,000,000.00	944,804.69	
T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	880,228.12	
T 0.375% 11/30/25	800,000.00	729,125.00	
T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,548,095.70	
T 0.5% 02/28/26	650,000.00	590,205.07	
T 0.5% 03/31/25	1,270,000.00	1,183,183.58	
T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,669,105.46	
T 0.5% 05/31/27	1,350,000.00	1,182,779.29	
T 0.5% 06/30/27	1,920,000.00	1,678,200.00	
T 0.5% 08/31/27	1,150,000.00	1,000,365.23	
T 0.5% 10/31/27	1,200,000.00	1,038,890.62	
T 0.625% 03/31/27	260,000.00	230,160.93	
T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,315,395.70	
T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	901,152.34	
T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,630,873.82	
T 0.625% 10/15/24	3,500,000.00	3,308,867.17	
T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,451,008.20	
T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,187,672.26	
T 0.75% 01/31/28	1,270,000.00	1,105,296.87	
T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	2,010,078.13	
T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	1,957,927.72	
T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,090,570.30	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,850,405.27	
T 0.75% 11/15/24	3,000,000.00	2,834,414.07	
T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	911,347.66	
T 0.875% 09/30/26	2,500,000.00	2,262,744.15	
T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,157,421.87	
T 1.125% 01/15/25	820,000.00	775,957.02	
T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,658,416.42	
T 1.125% 02/28/25	1,300,000.00	1,227,230.47	
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	723,781.24	
T 1.125% 02/29/28	740,000.00	654,668.75	
T 1.125% 05/15/40	870,000.00	558,108.40	
T 1.125% 08/15/40	1,530,000.00	972,536.13	
T 1.125% 08/31/28	1,400,000.00	1,223,687.50	
T 1.125% 10/31/26	2,290,000.00	2,085,599.61	

T 1.25% 03/31/28	1,370,000.00	1,216,891.80
T 1.25% 04/30/28	1,400,000.00	1,241,406.25
T 1.25% 05/15/50	1,800,000.00	986,062.50
T 1.25% 05/31/28	560,000.00	495,687.50
T 1.25% 06/30/28	1,150,000.00	1,015,998.04
T 1.25% 08/15/31	3,750,000.00	3,108,325.20
T 1.25% 08/31/24	380,000.00	363,538.28
T 1.25% 09/30/28	2,330,000.00	2,046,304.30
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,461,124.99
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,185,412.11
T 1.375% 01/31/25	300,000.00	284,871.09
T 1.375% 08/15/50	1,550,000.00	877,082.03
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	405,521.87
T 1.375% 10/31/28	1,100,000.00	971,050.78
T 1.375% 11/15/31	3,160,000.00	2,630,823.42
T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	920,576.37
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	550,980.46
T 1.5% 02/15/25	1,630,000.00	1,549,868.93
T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,538,793.75
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,740,909.36
T 1.5% 09/30/24	260,000.00	249,112.50
T 1.5% 10/31/24	260,000.00	248,670.70
T 1.5% 11/30/24	2,200,000.00	2,100,570.31
T 1.5% 11/30/28	3,160,000.00	2,804,623.42
T 1.625% 02/15/26	1,200,000.00	1,125,140.62
T 1.625% 05/15/26	920,000.00	859,157.81
T 1.625% 05/15/31	3,410,000.00	2,932,000.59
T 1.625% 08/15/29	1,300,000.00	1,150,398.44
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	306,332.81
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	240,987.50
T 1.625% 11/15/50	1,320,000.00	799,321.88
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	370,296.87
T 1.75% 01/31/29	750,000.00	672,846.68
T 1.75% 03/15/25	1,100,000.00	1,049,060.55
T 1.75% 06/30/24	1,210,000.00	1,168,642.57
T 1.75% 07/31/24	260,000.00	250,707.03
T 1.75% 08/15/41	1,340,000.00	933,838.67
T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	934,787.11
T 1.75% 12/31/24	450,000.00	430,567.38
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	835,628.90
T 1.875% 02/15/32	2,260,000.00	1,955,164.84
T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,094,132.81
T 1.875% 02/15/51	1,320,000.00	852,972.66

T 1.875% 06/30/26	100,000.00	93,953.12
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	215,759.76
T 1.875% 08/31/24	660,000.00	636,255.47
T 1.875% 11/15/51	1,690,000.00	1,086,353.12
T 1% 07/31/28	1,820,000.00	1,583,400.00
T 1% 12/15/24	2,000,000.00	1,892,382.82
T 2.125% 05/15/25	280,000.00	268,362.50
T 2.125% 05/31/26	420,000.00	397,802.34
T 2.125% 07/31/24	160,000.00	154,950.00
T 2.125% 09/30/24	650,000.00	628,189.45
T 2.125% 11/30/24	400,000.00	385,585.93
T 2.25% 02/15/27	1,120,000.00	1,057,087.49
T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	916,449.22
T 2.25% 03/31/26	220,000.00	209,670.31
T 2.25% 05/15/41	1,270,000.00	971,078.71
T 2.25% 08/15/27	1,440,000.00	1,352,193.75
T 2.25% 08/15/46	780,000.00	561,889.45
T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	719,467.18
T 2.25% 10/31/24	2,800,000.00	2,706,265.63
T 2.25% 11/15/24	2,910,000.00	2,810,821.29
T 2.25% 11/15/25	1,840,000.00	1,758,565.62
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	599,100.00
T 2.25% 12/31/24	1,860,000.00	1,793,592.18
T 2.375% 02/15/42	1,200,000.00	927,914.06
T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,233,159.37
T 2.375% 04/30/26	310,000.00	296,201.36
T 2.375% 05/15/27	1,740,000.00	1,645,727.33
T 2.375% 05/15/29	1,490,000.00	1,379,937.88
T 2.375% 05/15/51	1,750,000.00	1,273,056.64
T 2.375% 08/15/24	2,650,000.00	2,573,139.63
T 2.375% 11/15/49	1,060,000.00	776,118.75
T 2.5% 01/31/25	330,000.00	319,313.67
T 2.5% 02/15/45	290,000.00	222,087.88
T 2.5% 02/15/46	470,000.00	357,457.03
T 2.5% 02/28/26	1,500,000.00	1,440,058.59
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	326,514.45
T 2.5% 05/31/24	2,100,000.00	2,047,765.20
T 2.625% 01/31/26	290,000.00	279,487.50
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,081,853.51
T 2.625% 03/31/25	330,000.00	319,713.27
T 2.625% 04/15/25	2,600,000.00	2,517,937.50
T 2.625% 05/31/27	4,500,000.00	4,294,335.96

T 2.625% 12/31/25	250,000.00	240,976.56
T 2.75% 02/15/28	2,000,000.00	1,910,703.11
T 2.75% 02/28/25	550,000.00	534,273.43
T 2.75% 05/31/29	1,800,000.00	1,702,195.30
T 2.75% 06/30/25	190,000.00	184,196.09
T 2.75% 08/15/32	800,000.00	740,093.75
T 2.75% 08/15/42	360,000.00	295,298.43
T 2.75% 08/15/47	790,000.00	626,753.91
T 2.75% 08/31/25	230,000.00	222,848.43
T 2.75% 11/15/42	990,000.00	809,247.66
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	674,255.86
T 2.875% 04/30/25	880,000.00	855,765.62
T 2.875% 05/15/28	680,000.00	652,428.12
T 2.875% 05/15/32	3,580,000.00	3,352,054.66
T 2.875% 05/15/43	700,000.00	582,667.96
T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	837,478.51
T 2.875% 05/15/52	1,790,000.00	1,451,368.35
T 2.875% 05/31/25	1,460,000.00	1,419,850.00
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	485,898.44
T 2.875% 08/15/28	1,730,000.00	1,655,799.22
T 2.875% 08/15/45	550,000.00	449,410.15
T 2.875% 11/15/46	550,000.00	447,712.89
T 2.875% 11/30/25	540,000.00	523,947.65
T 2% 02/15/25	1,480,000.00	1,419,817.19
T 2% 02/15/50	1,170,000.00	784,082.81
T 2% 05/31/24	1,120,000.00	1,086,978.77
T 2% 06/30/24	260,000.00	251,753.12
T 2% 08/15/25	650,000.00	619,582.02
T 2% 08/15/51	2,100,000.00	1,396,582.02
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,547,841.80
T 2% 11/15/41	1,650,000.00	1,198,602.53
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	157,612.50
T 3.125% 02/15/43	630,000.00	546,525.00
T 3.125% 05/15/48	760,000.00	646,415.62
T 3.125% 08/15/25	3,400,000.00	3,321,242.19
T 3.125% 08/15/44	770,000.00	661,237.50
T 3.125% 08/31/29	1,920,000.00	1,852,762.50
T 3.125% 11/15/28	3,630,000.00	3,511,741.42
T 3.125% 11/15/41	330,000.00	289,742.57
T 3.25% 05/15/42	530,000.00	471,316.99
T 3.25% 06/30/27	1,300,000.00	1,270,521.48
T 3.375% 05/15/44	410,000.00	367,238.27
T 3.375% 08/15/42	1,000,000.00	903,984.38

T 3.375% 11/15/48	910,000.00	810,682.03	
T 3.5% 02/15/33	800,000.00	786,125.00	
T 3.5% 02/15/39	100,000.00	95,755.85	
T 3.625% 02/15/44	590,000.00	550,105.85	
T 3.625% 08/15/43	570,000.00	533,350.77	
T 3.75% 04/15/26	590,000.00	585,736.32	
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	250,310.93	
T 3.75% 11/15/43	570,000.00	542,769.13	
T 3.875% 02/15/43	300,000.00	291,375.00	
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	386,206.64	
T 3.875% 09/30/29	1,400,000.00	1,408,804.68	
T 3.875% 11/30/29	1,500,000.00	1,510,253.91	
T 3.875% 12/31/27	1,500,000.00	1,504,892.58	
T 3.875% 12/31/29	1,000,000.00	1,007,343.75	
T 3% 02/15/47	730,000.00	607,040.62	
T 3% 02/15/48	710,000.00	590,132.03	
T 3% 02/15/49	1,210,000.00	1,007,277.73	
T 3% 05/15/42	370,000.00	316,718.55	
T 3% 05/15/45	480,000.00	401,681.25	
T 3% 05/15/47	630,000.00	523,859.76	
T 3% 07/15/25	2,000,000.00	1,948,906.24	
T 3% 07/31/24	2,200,000.00	2,152,347.64	
T 3% 08/15/48	1,250,000.00	1,038,964.85	
T 3% 08/15/52	1,500,000.00	1,248,222.66	
T 3% 09/30/25	460,000.00	447,871.09	
T 3% 10/31/25	270,000.00	262,785.93	
T 3% 11/15/44	680,000.00	570,721.87	
T 3% 11/15/45	320,000.00	267,124.99	
T 4.125% 10/31/27	1,600,000.00	1,619,562.49	
T 4.125% 11/15/32	1,900,000.00	1,960,710.92	
T 4.25% 05/15/39	150,000.00	156,691.40	
T 4.25% 10/15/25	3,300,000.00	3,305,736.32	
T 4.25% 11/15/40	200,000.00	207,484.37	
T 4.375% 02/15/38	210,000.00	223,432.61	
T 4.375% 05/15/40	300,000.00	316,664.06	
T 4.375% 05/15/41	800,000.00	840,218.75	
T 4.375% 11/15/39	350,000.00	369,824.21	
T 4.5% 02/15/36	110,000.00	119,291.99	
T 4.5% 05/15/38	110,000.00	118,426.17	
T 4.5% 08/15/39	350,000.00	376,208.98	
T 4.625% 02/15/40	160,000.00	174,231.24	
T 4.75% 02/15/41	150,000.00	165,292.96	

	T 4% 02/28/30	850,000.00	863,015.62
	T 4% 11/15/42	980,000.00	970,582.80
	T 4% 11/15/52	1,650,000.00	1,663,664.06
	T 5.0% 05/15/37	250,000.00	283,715.82
	T 5.25% 11/15/28	150,000.00	160,716.79
	T 5.375% 02/15/31	60,000.00	66,794.53
	T 6.0% 02/15/26	420,000.00	441,114.84
	T 6.25% 05/15/30	90,000.00	103,918.35
	アメリカドル 小計	263,900,000.00	236,215,636.42 (32,746,573,676)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	480,000.00	435,873.38
	CAN 0.5% 09/01/25	860,000.00	795,762.11
	CAN 0.5% 12/01/30	600,000.00	491,663.10
	CAN 0.75% 10/01/24	470,000.00	447,678.99
	CAN 1.25% 03/01/25	50,000.00	47,563.14
	CAN 1.25% 03/01/27	290,000.00	266,715.83
	CAN 1.25% 06/01/30	840,000.00	736,657.74
	CAN 1.5% 04/01/25	490,000.00	467,005.99
	CAN 1.5% 05/01/24	360,000.00	349,667.98
	CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	159,618.48
	CAN 1.5% 06/01/31	940,000.00	826,072.12
	CAN 1.5% 09/01/24	490,000.00	472,328.64
	CAN 1.5% 12/01/31	830,000.00	723,732.72
	CAN 1.75% 12/01/53	760,000.00	543,183.83
	CAN 1% 06/01/27	340,000.00	309,641.34
	CAN 1% 09/01/26	530,000.00	487,497.29
	CAN 2.25% 06/01/25	160,000.00	154,580.87
	CAN 2.25% 06/01/29	270,000.00	255,763.35
	CAN 2.5% 06/01/24	270,000.00	264,515.79
	CAN 2.5% 12/01/32	370,000.00	348,133.46
	CAN 2.75% 06/01/33	200,000.00	191,881.82
	CAN 2.75% 08/01/24	390,000.00	382,047.56
	CAN 2.75% 09/01/27	350,000.00	339,929.82
	CAN 2.75% 12/01/48	250,000.00	227,669.07
	CAN 2.75% 12/01/64	160,000.00	142,225.28
	CAN 2% 06/01/28	150,000.00	141,211.60
	CAN 2% 06/01/32	450,000.00	407,069.84
	CAN 2% 12/01/51	1,000,000.00	768,431.82
	CAN 3.5% 03/01/28	190,000.00	190,768.22
	CAN 3.5% 12/01/45	210,000.00	216,608.43
	CAN 3% 11/01/24	590,000.00	578,647.33
	CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	207,521.04
	CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	249,821.50

	CAN 5.75% 06/01/33	260,000.00	315,392.25	
	CAN 5% 06/01/37	180,000.00	214,386.22	
	カナダドル 小計	14,360,000.00	13,157,267.95 (1,351,119,845)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,633,695.00	
	MBONO 10% 12/05/24	6,060,000.00	5,996,576.70	
	MBONO 5.5% 03/04/27	6,000,000.00	5,289,720.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	10,230,000.00	9,271,734.72	
	MBONO 5% 03/06/25	1,650,000.00	1,507,671.00	
	MBONO 7.5% 05/26/33	2,630,000.00	2,384,989.20	
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,760,000.00	7,317,524.80	
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,970,000.00	10,262,983.50	
	MBONO 7.75% 11/13/42	5,800,000.00	5,060,674.00	
	MBONO 7.75% 11/23/34	2,100,000.00	1,931,958.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	5,340,000.00	5,238,540.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	5,880,000.00	5,591,115.60	
	MBONO 8% 07/31/53	2,190,000.00	1,932,850.20	
	MBONO 8% 09/05/24	9,190,000.00	8,883,326.75	
	MBONO 8% 11/07/47	6,310,000.00	5,624,797.10	
	メキシコペソ 小計	83,610,000.00	77,928,156.57 (601,324,827)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	350,000.00	288,032.50	
	BGB 0.35% 06/22/32	360,000.00	282,777.12	
	BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	121,093.20	
	BGB 0.5% 10/22/24	270,000.00	260,681.22	
	BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	58,013.40	
	BGB 0.8% 06/22/25	450,000.00	431,321.40	
	BGB 0.8% 06/22/27	410,000.00	378,712.90	
	BGB 0.8% 06/22/28	390,000.00	354,127.80	
	BGB 0.9% 06/22/29	390,000.00	348,865.92	
	BGB 0% 10/22/27	280,000.00	247,869.72	
	BGB 0% 10/22/31	160,000.00	124,395.38	
	BGB 1.25% 04/22/33	80,000.00	67,785.76	
	BGB 1.4% 06/22/53	210,000.00	126,529.20	
	BGB 1.45% 06/22/37	140,000.00	109,897.56	
	BGB 1.6% 06/22/47	340,000.00	233,352.20	
	BGB 1.7% 06/22/50	280,000.00	190,175.16	
	BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	172,295.97	
	BGB 1% 06/22/26	370,000.00	350,428.85	
	BGB 1% 06/22/31	450,000.00	386,208.90	
	BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	127,175.40	
BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	119,471.36		

BGB 2.6% 06/22/24	380,000.00	377,632.60
BGB 2.75% 04/22/39	120,000.00	109,531.80
BGB 3.3% 06/22/54	110,000.00	102,745.94
BGB 3.75% 06/22/45	190,000.00	195,705.70
BGB 3% 06/22/33	180,000.00	177,484.08
BGB 3% 06/22/34	210,000.00	205,701.72
BGB 4.25% 03/28/41	450,000.00	494,082.99
BGB 4.5% 03/28/26	320,000.00	334,372.00
BGB 4% 03/28/32	270,000.00	289,308.24
BGB 5.5% 03/28/28	490,000.00	550,177.88
BGB 5% 03/28/35	520,000.00	605,601.36
BKO 0.2% 06/14/24	320,000.00	310,892.80
BKO 0.4% 09/13/24	700,000.00	677,541.90
BKO 2.5% 03/13/25	470,000.00	467,185.64
BTPS 0.25% 03/15/28	330,000.00	280,053.84
BTPS 0.35% 02/01/25	270,000.00	256,298.31
BTPS 0.45% 02/15/29	380,000.00	314,143.72
BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	507,408.00
BTPS 0.5% 07/15/28	510,000.00	432,951.75
BTPS 0.6% 08/01/31	620,000.00	470,434.30
BTPS 0.85% 01/15/27	380,000.00	344,726.12
BTPS 0.9% 04/01/31	710,000.00	559,881.86
BTPS 0.95% 03/01/37	480,000.00	308,085.60
BTPS 0.95% 06/01/32	450,000.00	341,955.90
BTPS 0.95% 08/01/30	590,000.00	477,950.15
BTPS 0.95% 09/15/27	540,000.00	482,268.25
BTPS 0.95% 12/01/31	590,000.00	456,190.36
BTPS 0% 04/01/26	600,000.00	542,413.99
BTPS 0% 08/01/26	510,000.00	455,680.41
BTPS 0% 08/15/24	560,000.00	536,878.16
BTPS 1.1% 04/01/27	430,000.00	391,320.64
BTPS 1.2% 08/15/25	340,000.00	323,403.31
BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	443,555.52
BTPS 1.35% 04/01/30	480,000.00	404,952.48
BTPS 1.45% 03/01/36	290,000.00	205,040.15
BTPS 1.45% 05/15/25	350,000.00	336,905.07
BTPS 1.45% 11/15/24	1,000,000.00	971,488.00
BTPS 1.5% 04/30/45	270,000.00	155,397.63
BTPS 1.5% 06/01/25	500,000.00	480,690.00
BTPS 1.6% 06/01/26	390,000.00	368,308.20
BTPS 1.65% 03/01/32	510,000.00	417,564.03
BTPS 1.65% 12/01/30	540,000.00	456,481.81
BTPS 1.7% 09/01/51	330,000.00	182,043.84

BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	981,045.00	
BTPS 1.8% 03/01/41	410,000.00	271,147.35	
BTPS 1.85% 05/15/24	530,000.00	521,804.61	
BTPS 1.85% 07/01/25	340,000.00	329,129.86	
BTPS 2.05% 08/01/27	470,000.00	441,161.74	
BTPS 2.1% 07/15/26	580,000.00	554,915.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	120,000.00	64,559.52	
BTPS 2.15% 09/01/52	270,000.00	163,400.49	
BTPS 2.2% 06/01/27	350,000.00	331,578.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	440,000.00	341,660.88	
BTPS 2.45% 09/01/33	560,000.00	473,597.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	400,000.00	265,101.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	273,573.77	
BTPS 2.5% 12/01/24	710,000.00	700,131.00	
BTPS 2.5% 12/01/32	440,000.00	380,930.00	
BTPS 2.65% 12/01/27	740,000.00	707,926.55	
BTPS 2.7% 03/01/47	450,000.00	326,037.06	
BTPS 2.8% 03/01/67	220,000.00	145,068.03	
BTPS 2.8% 06/15/29	670,000.00	630,336.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	418,473.00	
BTPS 2.95% 09/01/38	320,000.00	262,896.00	
BTPS 2% 02/01/28	580,000.00	537,867.06	
BTPS 2% 12/01/25	380,000.00	366,303.09	
BTPS 3.1% 03/01/40	280,000.00	229,846.34	
BTPS 3.25% 03/01/38	330,000.00	282,225.71	
BTPS 3.25% 09/01/46	450,000.00	360,937.35	
BTPS 3.35% 03/01/35	410,000.00	367,517.85	
BTPS 3.4% 04/01/28	240,000.00	236,265.36	
BTPS 3.45% 03/01/48	420,000.00	345,319.38	
BTPS 3.5% 01/15/26	380,000.00	379,454.70	
BTPS 3.5% 03/01/30	770,000.00	750,579.83	
BTPS 3.75% 09/01/24	200,000.00	200,673.62	
BTPS 3.8% 04/15/26	270,000.00	271,376.64	
BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	305,336.85	
BTPS 3.85% 12/15/29	320,000.00	317,714.56	
BTPS 3% 08/01/29	620,000.00	590,213.96	
BTPS 4.4% 05/01/33	140,000.00	141,399.86	
BTPS 4.45% 09/01/43	200,000.00	192,203.80	
BTPS 4.5% 03/01/26	610,000.00	624,877.90	
BTPS 4.5% 10/01/53	70,000.00	66,864.00	
BTPS 4.75% 09/01/28	390,000.00	407,921.28	
BTPS 4.75% 09/01/44	370,000.00	371,060.79	

BTPS 4% 02/01/37	730,000.00	690,628.18
BTPS 4% 10/30/31	150,000.00	148,770.28
BTPS 5.0% 08/01/39	590,000.00	613,216.50
BTPS 5.25% 11/01/29	510,000.00	549,952.89
BTPS 5.75% 02/01/33	590,000.00	657,999.86
BTPS 5% 03/01/25	580,000.00	594,918.76
BTPS 5% 08/01/34	650,000.00	681,622.50
BTPS 5% 09/01/40	560,000.00	582,172.64
BTPS 6.5% 11/01/27	500,000.00	558,201.00
BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	542,986.08
DBR 0.25% 02/15/27	540,000.00	497,598.12
DBR 0.25% 02/15/29	470,000.00	416,725.50
DBR 0.25% 08/15/28	530,000.00	474,599.36
DBR 0.5% 02/15/25	610,000.00	586,407.82
DBR 0.5% 02/15/26	680,000.00	642,586.40
DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	640,694.60
DBR 0.5% 08/15/27	540,000.00	498,460.50
DBR 0% 02/15/30	650,000.00	555,011.60
DBR 0% 02/15/31	830,000.00	691,887.17
DBR 0% 02/15/32	850,000.00	691,051.70
DBR 0% 05/15/35	550,000.00	406,203.05
DBR 0% 05/15/36	620,000.00	443,776.78
DBR 0% 08/15/26	590,000.00	544,264.82
DBR 0% 08/15/29	480,000.00	414,425.76
DBR 0% 08/15/30	850,000.00	717,468.00
DBR 0% 08/15/31	780,000.00	642,585.84
DBR 0% 08/15/50	1,110,000.00	559,671.99
DBR 0% 08/15/52	460,000.00	219,593.88
DBR 0% 11/15/27	600,000.00	538,808.40
DBR 0% 11/15/28	560,000.00	491,684.48
DBR 1.25% 08/15/48	840,000.00	636,860.28
DBR 1.5% 05/15/24	130,000.00	128,259.82
DBR 1.7% 08/15/32	620,000.00	583,224.70
DBR 1.8% 08/15/53	250,000.00	206,887.63
DBR 1% 05/15/38	310,000.00	246,663.22
DBR 1% 08/15/24	700,000.00	684,040.70
DBR 1% 08/15/25	390,000.00	375,583.65
DBR 2.1% 11/15/29	540,000.00	529,478.64
DBR 2.3% 02/15/33	490,000.00	483,088.55
DBR 2.5% 07/04/44	710,000.00	693,742.42
DBR 2.5% 08/15/46	730,000.00	716,818.39
DBR 3.25% 07/04/42	450,000.00	488,495.70
DBR 4.0% 01/04/37	590,000.00	682,688.41

DBR 4.25% 07/04/39	430,000.00	517,931.13
DBR 4.75% 07/04/28	570,000.00	633,360.63
DBR 4.75% 07/04/34	530,000.00	644,135.50
DBR 4.75% 07/04/40	500,000.00	640,481.50
DBR 5.5% 01/04/31	560,000.00	679,226.91
DBR 5.625% 01/04/28	380,000.00	432,565.81
DBR 6.25% 01/04/30	490,000.00	604,560.53
DBR 6.5% 07/04/27	240,000.00	277,283.04
FRTR 0.25% 11/25/26	1,040,000.00	952,289.52
FRTR 0.5% 05/25/25	1,380,000.00	1,315,498.80
FRTR 0.5% 05/25/26	830,000.00	775,201.74
FRTR 0.5% 05/25/29	1,100,000.00	961,324.10
FRTR 0.5% 05/25/40	560,000.00	353,534.16
FRTR 0.5% 05/25/72	250,000.00	90,816.70
FRTR 0.5% 06/25/44	400,000.00	227,879.67
FRTR 0.75% 02/25/28	940,000.00	855,069.12
FRTR 0.75% 05/25/28	1,520,000.00	1,376,937.60
FRTR 0.75% 05/25/52	800,000.00	410,436.00
FRTR 0.75% 05/25/53	730,000.00	364,635.00
FRTR 0.75% 11/25/28	1,100,000.00	986,459.10
FRTR 0% 02/25/25	1,050,000.00	997,132.50
FRTR 0% 02/25/26	1,180,000.00	1,092,261.10
FRTR 0% 02/25/27	1,250,000.00	1,127,362.50
FRTR 0% 03/25/25	1,620,000.00	1,535,533.20
FRTR 0% 05/25/32	770,000.00	592,504.22
FRTR 0% 11/25/29	1,280,000.00	1,068,057.60
FRTR 0% 11/25/30	1,240,000.00	1,002,523.88
FRTR 0% 11/25/31	1,310,000.00	1,025,639.61
FRTR 1.25% 05/25/34	940,000.00	777,572.70
FRTR 1.25% 05/25/36	1,190,000.00	939,957.20
FRTR 1.25% 05/25/38	70,000.00	52,892.84
FRTR 1.5% 05/25/31	1,340,000.00	1,211,657.48
FRTR 1.5% 05/25/50	810,000.00	535,652.19
FRTR 1.75% 05/25/66	390,000.00	250,575.00
FRTR 1.75% 06/25/39	670,000.00	541,632.02
FRTR 1.75% 11/25/24	1,030,000.00	1,010,666.90
FRTR 1% 05/25/27	1,200,000.00	1,119,004.80
FRTR 1% 11/25/25	550,000.00	525,708.15
FRTR 2.25% 05/25/24	520,000.00	515,254.74
FRTR 2.5% 05/25/30	1,300,000.00	1,273,534.60
FRTR 2.5% 05/25/43	200,000.00	172,861.20
FRTR 2.5% 09/24/26	130,000.00	128,513.97

FRTR 2.75% 10/25/27	1,110,000.00	1,108,256.19
FRTR 2% 05/25/48	700,000.00	531,814.50
FRTR 2% 11/25/32	1,000,000.00	919,960.00
FRTR 3.25% 05/25/45	710,000.00	689,537.80
FRTR 3.5% 04/25/26	1,200,000.00	1,222,395.60
FRTR 3% 05/25/33	100,000.00	99,675.90
FRTR 4.5% 04/25/41	960,000.00	1,102,212.48
FRTR 4.75% 04/25/35	680,000.00	784,467.72
FRTR 4% 04/25/55	570,000.00	625,049.74
FRTR 4% 04/25/60	410,000.00	453,636.58
FRTR 4% 10/25/38	700,000.00	755,328.00
FRTR 5.5% 04/25/29	1,040,000.00	1,188,890.56
FRTR 5.75% 10/25/32	940,000.00	1,152,103.48
IRISH 0.2% 05/15/27	180,000.00	162,776.43
IRISH 0.2% 10/18/30	280,000.00	232,563.52
IRISH 0.35% 10/18/32	90,000.00	71,554.96
IRISH 0.4% 05/15/35	130,000.00	95,618.25
IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	62,883.00
IRISH 0.9% 05/15/28	180,000.00	164,878.04
IRISH 0% 10/18/31	40,000.00	31,600.00
IRISH 1.1% 05/15/29	230,000.00	209,337.95
IRISH 1.3% 05/15/33	130,000.00	111,748.65
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	216,077.28
IRISH 1.5% 05/15/50	190,000.00	127,184.86
IRISH 1.7% 05/15/37	140,000.00	116,271.12
IRISH 1% 05/15/26	270,000.00	256,603.78
IRISH 2.4% 05/15/30	190,000.00	185,912.15
IRISH 2% 02/18/45	260,000.00	204,887.80
IRISH 3% 10/18/43	90,000.00	85,434.39
IRISH 5.4% 03/13/25	270,000.00	281,946.82
NETHER 0.25% 07/15/25	410,000.00	388,555.36
NETHER 0.25% 07/15/29	220,000.00	190,224.01
NETHER 0.5% 01/15/40	300,000.00	204,444.60
NETHER 0.5% 07/15/26	390,000.00	364,241.81
NETHER 0.5% 07/15/32	350,000.00	286,573.70
NETHER 0.75% 07/15/27	350,000.00	323,963.85
NETHER 0.75% 07/15/28	370,000.00	336,259.70
NETHER 0% 01/15/26	420,000.00	390,744.06
NETHER 0% 01/15/27	420,000.00	381,213.00
NETHER 0% 01/15/29	370,000.00	318,614.53
NETHER 0% 01/15/38	210,000.00	136,731.00
NETHER 0% 01/15/52	330,000.00	150,216.66
NETHER 0% 07/15/30	300,000.00	248,073.90

NETHER 0% 07/15/31	290,000.00	233,000.79
NETHER 2.5% 01/15/30	70,000.00	68,990.32
NETHER 2.5% 01/15/33	380,000.00	370,931.30
NETHER 2.5% 07/15/33	140,000.00	136,592.40
NETHER 2.75% 01/15/47	500,000.00	488,501.20
NETHER 2% 01/15/54	200,000.00	164,162.00
NETHER 2% 07/15/24	340,000.00	336,220.90
NETHER 3.75% 01/15/42	490,000.00	545,580.70
NETHER 4% 01/15/37	410,000.00	457,815.43
NETHER 5.5% 01/15/28	350,000.00	392,156.97
OBL 0% 04/10/26	760,000.00	705,956.40
OBL 0% 04/11/25	760,000.00	721,620.00
OBL 0% 04/16/27	790,000.00	718,034.16
OBL 0% 10/09/26	880,000.00	808,631.12
OBL 0% 10/10/25	1,060,000.00	994,798.34
OBL 0% 10/18/24	520,000.00	499,256.16
OBL 1.3% 10/15/27	990,000.00	942,910.65
OBL 2.2% 04/13/28	200,000.00	197,757.60
RAGB 0.25% 10/20/36	130,000.00	87,955.53
RAGB 0.5% 02/20/29	470,000.00	411,104.30
RAGB 0.5% 04/20/27	330,000.00	301,822.13
RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	29,549.94
RAGB 0.75% 02/20/28	270,000.00	245,031.75
RAGB 0.75% 03/20/51	200,000.00	109,213.40
RAGB 0.75% 10/20/26	470,000.00	438,946.16
RAGB 0.85% 06/30/20	110,000.00	43,346.27
RAGB 0.9% 02/20/32	270,000.00	225,322.83
RAGB 0% 02/20/30	310,000.00	254,584.40
RAGB 0% 02/20/31	320,000.00	253,865.60
RAGB 0% 04/20/25	230,000.00	217,615.19
RAGB 0% 07/15/24	300,000.00	290,111.46
RAGB 0% 10/20/40	120,000.00	67,922.16
RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	336,674.27
RAGB 1.5% 02/20/47	260,000.00	183,647.62
RAGB 1.5% 11/02/86	40,000.00	22,568.40
RAGB 1.65% 10/21/24	230,000.00	225,687.04
RAGB 1.85% 05/23/49	100,000.00	74,753.80
RAGB 2.1% 09/20/17	170,000.00	117,339.80
RAGB 2.4% 05/23/34	180,000.00	167,117.22
RAGB 2.9% 02/20/33	170,000.00	166,622.27
RAGB 3.15% 06/20/44	160,000.00	155,611.68
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	100,235.61

RAGB 4.15% 03/15/37	390,000.00	425,214.27
RAGB 4.85% 03/15/26	200,000.00	210,965.40
RAGB 6.25% 07/15/27	220,000.00	248,491.76
RFGB 0.125% 04/15/36	110,000.00	73,934.30
RFGB 0.125% 04/15/52	110,000.00	48,211.13
RFGB 0.125% 09/15/31	180,000.00	142,371.63
RFGB 0.25% 09/15/40	90,000.00	54,143.16
RFGB 0.5% 04/15/26	170,000.00	159,528.68
RFGB 0.5% 04/15/43	150,000.00	89,327.55
RFGB 0.5% 09/15/27	130,000.00	118,042.54
RFGB 0.5% 09/15/28	140,000.00	124,036.50
RFGB 0.5% 09/15/29	110,000.00	95,006.47
RFGB 0.75% 04/15/31	130,000.00	109,735.86
RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	67,005.87
RFGB 0% 09/15/24	80,000.00	76,965.17
RFGB 0% 09/15/26	110,000.00	100,509.20
RFGB 0% 09/15/30	210,000.00	169,595.79
RFGB 1.125% 04/15/34	120,000.00	97,689.60
RFGB 1.375% 04/15/27	90,000.00	85,361.76
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	70,235.40
RFGB 1.5% 09/15/32	60,000.00	52,544.40
RFGB 2.625% 07/04/42	140,000.00	127,452.50
RFGB 2.75% 04/15/38	40,000.00	37,221.28
RFGB 2.75% 07/04/28	150,000.00	149,655.00
RFGB 4% 07/04/25	180,000.00	184,294.91
SPGB 0.1% 04/30/31	490,000.00	381,560.55
SPGB 0.25% 07/30/24	340,000.00	328,633.46
SPGB 0.5% 04/30/30	550,000.00	457,889.85
SPGB 0.5% 10/31/31	600,000.00	475,800.00
SPGB 0.6% 10/31/29	630,000.00	536,027.94
SPGB 0.7% 04/30/32	530,000.00	421,140.12
SPGB 0.8% 07/30/27	690,000.00	628,645.89
SPGB 0.8% 07/30/29	520,000.00	450,253.44
SPGB 0.85% 07/30/37	310,000.00	209,718.10
SPGB 0% 01/31/25	530,000.00	503,812.70
SPGB 0% 01/31/26	540,000.00	498,016.89
SPGB 0% 01/31/27	560,000.00	500,492.72
SPGB 0% 01/31/28	580,000.00	502,204.60
SPGB 0% 05/31/24	380,000.00	367,962.36
SPGB 0% 05/31/25	510,000.00	479,392.35
SPGB 1.2% 10/31/40	430,000.00	282,544.40
SPGB 1.25% 10/31/30	660,000.00	572,485.98
SPGB 1.3% 10/31/26	590,000.00	556,903.36

SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	460,859.25	
SPGB 1.4% 07/30/28	420,000.00	385,225.69	
SPGB 1.45% 04/30/29	620,000.00	563,202.42	
SPGB 1.45% 10/31/27	550,000.00	512,660.50	
SPGB 1.45% 10/31/71	150,000.00	67,586.55	
SPGB 1.5% 04/30/27	460,000.00	433,576.68	
SPGB 1.6% 04/30/25	600,000.00	584,030.40	
SPGB 1.85% 07/30/35	580,000.00	477,215.30	
SPGB 1.9% 10/31/52	310,000.00	193,536.89	
SPGB 1.95% 04/30/26	400,000.00	387,850.00	
SPGB 1.95% 07/30/30	460,000.00	421,652.10	
SPGB 1% 07/30/42	170,000.00	102,996.37	
SPGB 1% 10/31/50	500,000.00	251,962.50	
SPGB 2.15% 10/31/25	500,000.00	490,298.00	
SPGB 2.35% 07/30/33	420,000.00	378,731.64	
SPGB 2.55% 10/31/32	530,000.00	491,770.04	
SPGB 2.7% 10/31/48	410,000.00	323,054.17	
SPGB 2.75% 10/31/24	530,000.00	527,917.88	
SPGB 2.9% 10/31/46	480,000.00	399,675.79	
SPGB 3.15% 04/30/33	440,000.00	426,655.50	
SPGB 3.45% 07/30/43	130,000.00	119,290.86	
SPGB 3.45% 07/30/66	320,000.00	274,061.48	
SPGB 3.8% 04/30/24	490,000.00	492,556.82	
SPGB 3.9% 07/30/39	60,000.00	59,712.84	
SPGB 4.2% 01/31/37	570,000.00	595,936.14	
SPGB 4.65% 07/30/25	510,000.00	526,917.21	
SPGB 4.7% 07/30/41	540,000.00	591,881.04	
SPGB 4.9% 07/30/40	490,000.00	549,982.02	
SPGB 5.15% 10/31/28	1,010,000.00	1,108,064.94	
SPGB 5.15% 10/31/44	360,000.00	417,616.56	
SPGB 5.75% 07/30/32	610,000.00	722,694.45	
SPGB 5.9% 07/30/26	800,000.00	867,002.40	
ユーロ 小計	161,430,000.00	146,615,240.56 (21,892,587,720)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	230,000.00	207,050.83
	UKT 0.125% 01/31/28	280,000.00	233,520.00
	UKT 0.25% 01/31/25	670,000.00	623,774.02
	UKT 0.25% 07/31/31	630,000.00	463,862.70
	UKT 0.375% 10/22/26	540,000.00	474,430.50
	UKT 0.375% 10/22/30	490,000.00	376,295.50
	UKT 0.5% 01/31/29	300,000.00	245,457.00
	UKT 0.5% 10/22/61	450,000.00	130,536.18

UKT 0.625% 06/07/25	180,000.00	167,820.12
UKT 0.625% 07/31/35	540,000.00	354,272.40
UKT 0.625% 10/22/50	300,000.00	118,550.40
UKT 0.875% 01/31/46	440,000.00	213,370.08
UKT 0.875% 07/31/33	400,000.00	291,168.00
UKT 0.875% 10/22/29	310,000.00	255,954.60
UKT 1.125% 01/31/39	400,000.00	250,930.80
UKT 1.125% 10/22/73	240,000.00	86,248.80
UKT 1.25% 07/22/27	170,000.00	151,957.56
UKT 1.25% 07/31/51	580,000.00	280,279.20
UKT 1.25% 10/22/41	470,000.00	280,975.40
UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	369,302.40
UKT 1.5% 07/22/47	400,000.00	222,548.00
UKT 1.5% 07/31/53	320,000.00	162,307.20
UKT 1.625% 10/22/28	390,000.00	345,512.13
UKT 1.625% 10/22/54	330,000.00	171,831.00
UKT 1.625% 10/22/71	340,000.00	156,604.00
UKT 1.75% 01/22/49	240,000.00	139,416.00
UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	233,258.43
UKT 1.75% 09/07/37	440,000.00	317,341.20
UKT 1% 01/31/32	880,000.00	682,035.20
UKT 2.5% 07/22/65	350,000.00	224,115.50
UKT 2.75% 09/07/24	340,000.00	332,837.42
UKT 2% 09/07/25	550,000.00	523,488.90
UKT 3.25% 01/22/44	500,000.00	413,760.00
UKT 3.25% 01/31/33	170,000.00	157,768.50
UKT 3.5% 01/22/45	430,000.00	367,791.90
UKT 3.5% 07/22/68	380,000.00	314,070.00
UKT 3.5% 10/22/25	280,000.00	273,559.41
UKT 3.75% 01/29/38	220,000.00	203,654.00
UKT 3.75% 07/22/52	330,000.00	288,601.50
UKT 3.75% 10/22/53	180,000.00	156,664.80
UKT 4.125% 01/29/27	600,000.00	595,740.00
UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	387,878.40
UKT 4.25% 06/07/32	490,000.00	497,506.80
UKT 4.25% 09/07/39	340,000.00	331,877.40
UKT 4.25% 12/07/27	540,000.00	543,725.67
UKT 4.25% 12/07/40	390,000.00	379,095.60
UKT 4.25% 12/07/46	390,000.00	372,863.40
UKT 4.25% 12/07/49	350,000.00	333,672.50
UKT 4.25% 12/07/55	390,000.00	373,487.40
UKT 4.5% 09/07/34	350,000.00	358,519.00
UKT 4.5% 12/07/42	400,000.00	400,028.00

	UKT 4.75% 12/07/30	460,000.00	481,863.80
	UKT 4.75% 12/07/38	420,000.00	435,426.60
	UKT 4% 01/22/60	300,000.00	275,586.00
	UKT 5% 03/07/25	370,000.00	373,764.38
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	493,153.11
イギリスポンド 小計		22,160,000.00	17,897,109.64 (3,083,314,048)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,560,000.00	1,305,383.04
	SGB 0.75% 05/12/28	1,400,000.00	1,289,359.19
	SGB 0.75% 11/12/29	1,790,000.00	1,617,169.21
	SGB 1.75% 11/11/33	600,000.00	567,606.75
	SGB 1% 11/12/26	2,020,000.00	1,911,790.23
	SGB 2.25% 06/01/32	880,000.00	869,742.06
	SGB 2.5% 05/12/25	1,850,000.00	1,833,336.56
	SGB 3.5% 03/30/39	1,010,000.00	1,140,199.10
スウェーデンクローナ 小計		11,110,000.00	10,534,586.14 (137,581,694)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	690,000.00	585,465.00
	NGB 1.375% 08/19/30	1,320,000.00	1,155,641.78
	NGB 1.5% 02/19/26	980,000.00	933,214.80
	NGB 1.75% 02/17/27	1,060,000.00	1,004,275.80
	NGB 1.75% 03/13/25	1,410,000.00	1,367,284.05
	NGB 1.75% 09/06/29	960,000.00	876,435.84
	NGB 2.125% 05/18/32	910,000.00	823,325.23
	NGB 2% 04/26/28	850,000.00	800,020.00
	NGB 3% 08/15/33	620,000.00	601,055.40
ノルウェークローネ 小計		8,800,000.00	8,146,717.90 (103,137,448)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,340,000.00	672,109.35
	DGB 0.5% 11/15/27	1,540,000.00	1,401,105.86
	DGB 0.5% 11/15/29	1,470,000.00	1,283,633.40
	DGB 0% 11/15/24	820,000.00	784,407.15
	DGB 0% 11/15/31	1,670,000.00	1,335,756.18
	DGB 1.75% 11/15/25	1,940,000.00	1,888,668.56
	DGB 4.5% 11/15/39	2,590,000.00	3,142,627.51
デンマーククローネ 小計		11,370,000.00	10,508,308.01 (210,691,575)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	740,000.00	611,536.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	680,000.00	617,576.00
	POLGB 0% 07/25/24	630,000.00	590,278.50
	POLGB 1.25% 10/25/30	850,000.00	616,391.10
	POLGB 1.75% 04/25/32	810,000.00	576,922.50

	POLGB 2.25% 10/25/24	820,000.00	780,008.60
	POLGB 2.5% 07/25/26	980,000.00	883,395.52
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,230,000.00	1,074,282.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,210,000.00	1,046,124.86
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,400,000.00	1,166,900.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	960,000.00	908,774.40
	POLGB 3.75% 05/25/27	290,000.00	265,843.00
	POLGB 6% 10/25/33	120,000.00	119,766.00
	POLGB 7.5% 07/25/28	180,000.00	190,998.97
	ポーランドズロチ 小計	10,900,000.00	9,448,797.45 (314,374,719)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	650,000.00	618,189.55
	ACGB 0.25% 11/21/25	410,000.00	379,430.84
	ACGB 0.5% 09/21/26	580,000.00	527,997.98
	ACGB 1.25% 05/21/32	630,000.00	515,605.99
	ACGB 1.5% 06/21/31	480,000.00	410,165.76
	ACGB 1.75% 06/21/51	450,000.00	270,742.01
	ACGB 1.75% 11/21/32	780,000.00	662,071.67
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	599,534.92
	ACGB 1% 12/21/30	250,000.00	207,777.40
	ACGB 2.25% 05/21/28	420,000.00	398,048.74
	ACGB 2.5% 05/21/30	480,000.00	449,745.02
	ACGB 2.75% 05/21/41	340,000.00	282,685.88
	ACGB 2.75% 06/21/35	240,000.00	216,402.30
	ACGB 2.75% 11/21/27	510,000.00	496,683.53
	ACGB 2.75% 11/21/28	310,000.00	299,717.77
	ACGB 2.75% 11/21/29	310,000.00	296,788.35
	ACGB 3.25% 04/21/25	530,000.00	527,178.33
	ACGB 3.25% 04/21/29	500,000.00	494,697.76
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	209,699.48
	ACGB 3.5% 12/21/34	330,000.00	322,943.46
	ACGB 3.75% 04/21/37	340,000.00	335,076.30
	ACGB 3.75% 05/21/34	370,000.00	371,993.41
	ACGB 3% 03/21/47	320,000.00	264,154.46
ACGB 3% 11/21/33	410,000.00	386,177.54	
ACGB 4.25% 04/21/26	470,000.00	481,308.10	
ACGB 4.5% 04/21/33	620,000.00	663,512.77	
ACGB 4.75% 04/21/27	500,000.00	524,952.05	
	オーストラリアドル 小計	12,200,000.00	11,213,281.37 (1,027,360,839)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	120,000.00	97,655.18
	NZGB 0.5% 05/15/24	190,000.00	180,900.89
	NZGB 0.5% 05/15/26	150,000.00	132,642.76

	NZGB 1.5% 05/15/31	210,000.00	168,896.35	
	NZGB 1.75% 05/15/41	100,000.00	64,521.68	
	NZGB 2.75% 04/15/25	210,000.00	201,186.98	
	NZGB 2.75% 04/15/37	130,000.00	105,299.52	
	NZGB 2.75% 05/15/51	120,000.00	85,799.12	
	NZGB 2% 05/15/32	120,000.00	98,426.96	
	NZGB 3.5% 04/14/33	110,000.00	101,601.06	
	NZGB 3% 04/20/29	190,000.00	175,733.17	
	NZGB 4.25% 05/15/34	120,000.00	117,411.22	
	NZGB 4.5% 04/15/27	190,000.00	189,628.07	
	NZGB 4.5% 05/15/30	150,000.00	150,456.70	
	ニュージーランドドル 小計	2,110,000.00	1,870,159.66 (162,086,737)	
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	160,000.00	149,999.68	
	SIGB 1.25% 11/01/26	70,000.00	65,800.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	210,000.00	189,630.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	280,000.00	245,840.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	230,000.00	223,215.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	180,000.00	167,220.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	220,000.00	216,271.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	65,946.30	
	SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	69,191.50	
	SIGB 2.625% 08/01/32	60,000.00	58,604.40	
	SIGB 2.75% 03/01/46	170,000.00	174,590.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	140,000.00	141,857.80	
	SIGB 2.875% 07/01/29	160,000.00	159,280.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	130,000.00	129,090.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	180,000.00	186,390.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	325,184.00	
SIGB 3% 08/01/72	60,000.00	70,050.00		
SIGB 3% 09/01/24	230,000.00	228,438.69		
	シンガポールドドル 小計	2,940,000.00	2,866,598.37 (294,915,640)	
マレーシアリンギット	MGS 3.478% 06/14/24	90,000.00	90,247.01	
	MGS 3.502% 05/31/27	470,000.00	468,996.48	
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	594,480.87	
	MGS 3.757% 05/22/40	910,000.00	880,348.30	
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	495,120.80	
	MGS 3.844% 04/15/33	290,000.00	289,371.33	
	MGS 3.882% 03/14/25	360,000.00	363,879.57	
	MGS 3.885% 08/15/29	650,000.00	655,719.67	
	MGS 3.892% 03/15/27	430,000.00	434,966.32	
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	425,618.34	

	MGS 3.9% 11/30/26	370,000.00	375,159.87
	MGS 3.906% 07/15/26	410,000.00	416,001.62
	MGS 3.955% 09/15/25	570,000.00	577,297.31
	MGS 4.059% 09/30/24	530,000.00	535,033.09
	MGS 4.065% 06/15/50	210,000.00	204,969.20
	MGS 4.181% 07/15/24	370,000.00	373,713.54
	MGS 4.232% 06/30/31	940,000.00	966,179.37
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	616,554.24
	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	277,254.41
	MGS 4.498% 04/15/30	480,000.00	503,697.98
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	406,371.84
	MGS 4.696% 10/15/42	150,000.00	162,083.61
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	257,122.77
	MGS 4.762% 04/07/37	260,000.00	279,373.95
	MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	341,055.86
	MGS 4.921% 07/06/48	810,000.00	906,744.29
	MGS 4.935% 09/30/43	320,000.00	352,789.37
	マレーシアリングット 小計	11,930,000.00	12,250,151.01 (370,899,047)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	430,000.00	406,480.45
	ILGOV 0.5% 02/27/26	290,000.00	264,548.32
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	613,945.99
	ILGOV 1.3% 04/30/32	160,000.00	128,911.23
	ILGOV 1.5% 05/31/37	410,000.00	298,269.94
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	482,968.26
	ILGOV 1% 03/31/30	730,000.00	604,746.96
	ILGOV 2.25% 09/28/28	440,000.00	407,242.88
	ILGOV 2.8% 11/29/52	140,000.00	104,807.54
	ILGOV 2% 03/31/27	360,000.00	335,660.79
	ILGOV 3.75% 03/31/47	600,000.00	557,011.26
	ILGOV 5.5% 01/31/42	480,000.00	562,930.84
	ILGOV 6.25% 10/30/26	440,000.00	471,436.76
	イスラエルシェケル 小計	5,650,000.00	5,238,961.22 (196,194,382)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	7,480,000.00	7,434,955.96
	CGB 1.99% 09/15/24	5,000,000.00	4,986,588.40
	CGB 2.18% 06/25/24	1,450,000.00	1,450,321.75
	CGB 2.18% 08/25/25	3,500,000.00	3,485,851.95
	CGB 2.24% 05/25/25	3,000,000.00	2,996,110.86
	CGB 2.26% 02/24/25	10,120,000.00	10,113,453.97
	CGB 2.28% 11/25/25	2,200,000.00	2,196,252.16
	CGB 2.29% 12/25/24	4,300,000.00	4,303,589.21

CGB 2.37% 01/20/27	6,900,000.00	6,875,083.06	
CGB 2.44% 10/15/27	3,500,000.00	3,491,360.56	
CGB 2.47% 09/02/24	3,260,000.00	3,271,474.87	
CGB 2.48% 04/15/27	4,660,000.00	4,658,473.10	
CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,503,881.80	
CGB 2.6% 09/01/32	3,000,000.00	2,958,862.86	
CGB 2.62% 09/25/29	4,450,000.00	4,435,448.45	
CGB 2.64% 01/15/28	3,210,000.00	3,228,446.58	
CGB 2.68% 05/21/30	3,920,000.00	3,910,184.90	
CGB 2.69% 08/12/26	7,500,000.00	7,563,707.25	
CGB 2.69% 08/15/32	3,000,000.00	2,980,338.69	
CGB 2.75% 02/17/32	5,250,000.00	5,241,939.15	
CGB 2.75% 06/15/29	2,500,000.00	2,512,734.75	
CGB 2.76% 05/15/32	2,940,000.00	2,938,119.69	
CGB 2.79% 12/15/29	5,400,000.00	5,432,768.28	
CGB 2.8% 03/24/29	3,100,000.00	3,129,968.01	
CGB 2.8% 03/25/30	2,000,000.00	2,015,025.60	
CGB 2.8% 11/15/32	3,250,000.00	3,262,282.40	
CGB 2.85% 06/04/27	2,850,000.00	2,891,006.37	
CGB 2.89% 11/18/31	2,750,000.00	2,776,306.22	
CGB 2.91% 10/14/28	3,790,000.00	3,853,672.00	
CGB 2.94% 10/17/24	2,000,000.00	2,021,435.60	
CGB 3.01% 05/13/28	4,920,000.00	5,037,201.28	
CGB 3.02% 05/27/31	3,780,000.00	3,859,092.72	
CGB 3.02% 10/22/25	4,500,000.00	4,576,695.30	
CGB 3.03% 03/11/26	6,730,000.00	6,858,837.77	
CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,330,469.92	
CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,111,527.26	
CGB 3.25% 11/22/28	3,500,000.00	3,636,310.30	
CGB 3.27% 11/19/30	1,380,000.00	1,441,113.02	
CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,211,161.88	
CGB 3.32% 04/15/52	2,730,000.00	2,830,953.76	
CGB 3.39% 03/16/50	4,370,000.00	4,564,729.38	
CGB 3.53% 10/18/51	2,800,000.00	3,007,141.48	
CGB 3.72% 04/12/51	2,380,000.00	2,636,959.08	
CGB 3.81% 09/14/50	2,200,000.00	2,466,087.80	
CGB 3.86% 07/22/49	1,470,000.00	1,659,629.70	
CGB 4.08% 10/22/48	2,640,000.00	3,080,207.59	
オフショア人民元 小計	170,700,000.00	173,227,762.69 (3,396,979,103)	
合計		65,889,141,300 (65,889,141,300)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 226銘柄	100.0%	49.7%
カナダドル	国債証券 35銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 351銘柄	100.0%	33.2%
イギリスポンド	国債証券 56銘柄	100.0%	4.7%
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 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 27銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 46銘柄	100.0%	5.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	622,284,654
コール・ローン	1,345,216,471
国債証券	98,815,439,849
未収利息	1,786,499,996
前払費用	144,460,546
流動資産合計	102,713,901,516
資産合計	102,713,901,516
負債の部	
流動負債	
未払解約金	42,679,147
未払利息	2,303
流動負債合計	42,681,450
負債合計	42,681,450

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	52,278,352,105
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	50,392,867,961
元本等合計	102,671,220,066
純資産合計	102,671,220,066
負債純資産合計	102,713,901,516

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,278,352,105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 1.9639円 (1万口当たり純資産額) (19,639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 5月24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 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	46,806,253,157円
期中追加設定元本額	11,462,282,104円
期中一部解約元本額	5,990,183,156円
期末元本額	52,278,352,105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	4,889,988,561円
世界経済インデックスファンド	17,223,120,158円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,550,146,743円
DC世界経済インデックスファンド	13,663,436,262円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	11,555,982円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	494,740,113円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	639,250,545円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,342,898,438円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	249,294,304円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	107,389,189円
SMT インデックスバランス・オープン	187,957,504円
SMT 世界経済インデックス・オープン	430,315,324円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	552,760,810円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	877,495,679円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,801,076円
グローバル経済コア	795,012,188円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	41,693,036円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	37,285,223円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	16,879,528円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	21,248,935円
My SMT 新興国債券インデックス (ノーロード)	65,325,103円
10資産分散投資ファンド	43,010,445円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	244,570,141円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	155,921,023円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	10,315,423円
SMTAM海外バランスファンド2020-01 (適格機関投資家専用)	252,421,427円
SMTAM海外バランスファンド2020-08 (適格機関投資家専用)	244,878,189円
SMTAM海外バランスファンド2020-11 (適格機関投資家専用)	243,636,550円
SMTAM海外バランスファンド2021-04 (適格機関投資家専用)	245,711,535円
SMTAM海外バランスファンド2021-07 (適格機関投資家専用)	243,276,298円

区分	2023年 5月24日現在
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	157,879,265円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,813,560,041
合計		2,813,560,041

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,634,334.00			
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,347,316.98			
		MBONO 5.5% 03/04/27	72,000,000.00	63,476,640.00			
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	158,879,286.12			
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	52,540,050.00			
		MBONO 7.5% 05/26/33	38,000,000.00	34,459,920.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	131,074,220.00			
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	164,750,355.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	73,728,785.00			
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	25,851,438.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	92,100,000.00	90,350,100.00			
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	93,470,521.00			
		MBONO 8% 07/31/53	46,000,000.00	40,598,680.00			
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,115,250.91			
		MBONO 8% 11/07/47	84,600,000.00	75,413,286.00			
		MBONO 8% 12/07/23	72,000,000.00	70,760,880.00			
		メキシコペソ 小計			1,409,950,000.00	1,319,451,063.01 (10,181,412,182)	
		ブラジルレアル		BLTN 0% 01/01/24	95,100,000.00	88,201,010.42	
				BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	57,795,254.28	
BLTN 0% 07/01/24	51,250,000.00			45,064,844.54			
BLTN 0% 07/01/25	46,400,000.00			36,973,301.28			
BNTNF 10% 01/01/25	32,300,000.00			31,501,299.65			
BNTNF 10% 01/01/27	65,400,000.00			63,049,895.78			

	BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000.00	29,719,594.64	
	BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	12,751,052.01	
	BNTNF 10% 01/01/33	9,500,000.00	8,592,640.89	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,357,230.00	
	BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,855,540.00	
	ブラジルリアル 小計	425,300,000.00	376,861,663.49 (10,503,172,247)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	526,506,421.25	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,753,950,776.37	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	2,060,000,000.00	1,956,781,302.16	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,160,000,000.00	2,047,536,493.92	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,147,554,551.61	
	BTPCL 5% 10/01/28	820,000,000.00	787,130,977.32	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,900,000,000.00	2,055,691,986.90	
	BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	551,821,418.89	
	チリペソ 小計	13,250,000,000.00	12,826,973,928.42 (2,217,694,003)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	61,290,927,396.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	15,200,000,000.00	13,781,374,576.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	48,100,000,000.00	35,692,863,297.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	32,600,000,000.00	21,010,013,444.00	
	コロンビアペソ 小計	161,200,000,000.00	131,775,178,713.00 (4,075,410,952)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	3,923,868.41	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	6,350,000.00	5,375,589.32	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,672,767.96	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,700,000.00	9,234,444.13	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,614,613.14	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,350,000.00	8,191,621.04	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	9,550,000.00	9,032,896.81	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,250,000.00	11,008,214.77	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	7,050,000.00	7,422,737.16	
	ペルーソル 小計	69,200,000.00	65,476,752.74 (2,461,041,966)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	22,628,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	15,963,000.00	
	ウルグアイペソ 小計	42,000,000.00	38,591,000.00 (138,040,007)	
ドミニカペソ	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	38,512,839.36	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	41,000,000.00	40,180,000.00	
	ドミニカペソ 小計	73,000,000.00	78,692,839.36 (199,989,981)	
	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,327,050.00	

チェココルナ	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	58,170,904.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	53,606,267.00	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	22,044,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	75,928,440.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	54,606,123.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,437,200.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	40,594,875.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	13,500,000.00	9,848,250.00	
	CZGB 1% 06/26/26	53,800,000.00	47,552,744.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	70,841,876.80	
	CZGB 2.5% 08/25/28	78,700,000.00	70,244,472.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	71,727,110.00	
	CZGB 2% 10/13/33	74,500,000.00	58,558,862.50	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	19,761,500.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,070,665.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	28,000,000.00	28,966,000.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,215,594.00	
	CZGB 5% 09/30/30	45,000,000.00	45,697,500.00	
	CZGB 6% 02/26/26	39,500,000.00	40,527,000.00	
	チェココルナ 小計		1,009,800,000.00	880,726,433.30
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	486,354,825.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	402,359,200.00	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	672,634,250.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	457,210,800.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	157,644,800.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	578,000,000.00	507,231,529.60	
	HGB 2.75% 12/22/26	580,500,000.00	464,393,614.50	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	290,079,400.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	593,450,200.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	214,048,450.00	
	HGB 3% 06/26/24	292,500,000.00	263,409,412.50	
	HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	457,842,900.00	
	HGB 3% 10/27/27	822,000,000.00	647,736,000.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	229,368,000.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	493,000,000.00	413,723,628.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	430,000,000.00	341,935,686.10	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	594,778,800.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	706,058,782.00	
ハンガリーフォロント 小計		10,131,500,000.00	7,900,260,277.70	(3,145,235,821)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,288,400.00	

	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	12,987,260.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	13,560,604.20	
	POLGB 1.75% 04/25/32	24,800,000.00	17,663,800.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,025,808.50	
	POLGB 2.5% 04/25/24	24,500,000.00	23,795,625.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	19,200,331.20	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	15,371,840.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,155,886.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	21,754,350.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	21,820,052.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	19,342,370.00	
	POLGB 6% 10/25/33	3,000,000.00	2,994,150.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	6,600,000.00	7,003,295.64	
	ポーランドズロチ 小計	259,500,000.00	226,963,772.54 (7,551,402,461)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,534,810.13	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	7,300,000.00	7,102,425.50	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	5,923,943.28	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	4,000,000.00	3,733,607.80	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	9,852,736.08	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,014,392.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,641,438.70	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,087,769.09	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,208,446.67	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	4,500,000.00	3,391,110.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,158,783.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,367,800.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	5,858,064.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,491,461.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	6,995,118.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	10,100,000.00	9,785,435.50	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,479,080.00	
ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,645,449.66		
ROMGB 8.25% 09/29/32	5,500,000.00	5,913,282.65		
	ルーマニアレイ 小計	129,800,000.00	119,185,153.06 (3,577,080,161)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000.00	31,572,191.65	
	MGS 3.478% 06/14/24	9,650,000.00	9,676,485.39	
	MGS 3.502% 05/31/27	9,650,000.00	9,629,395.99	
	MGS 3.582% 07/15/32	13,500,000.00	13,304,796.34	
	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	19,144,299.30	
	MGS 3.757% 05/22/40	30,350,000.00	29,361,067.10	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,119,981.20	

	MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,363,804.32	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,478,629.85	
	MGS 3.899% 11/16/27	15,500,000.00	15,707,343.50	
	MGS 3.9% 11/30/26	17,450,000.00	17,693,350.72	
	MGS 3.906% 07/15/26	9,100,000.00	9,233,206.71	
	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	29,067,426.01	
	MGS 4.059% 09/30/24	15,450,000.00	15,596,719.38	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,250,000.00	12,932,581.27	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,191,333.06	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,603,187.52	
	MGS 4.504% 04/30/29	8,100,000.00	8,447,406.57	
	MGS 4.696% 10/15/42	8,800,000.00	9,508,905.12	
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,514,597.76	
	MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,731,611.72	
	マレーシアリングット 小計	329,750,000.00	330,878,320.48 (10,018,035,997)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,181,108.92	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	139,057,537.84	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	182,467,246.88	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,619,122.11	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,718,789.48	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	99,100,000.00	94,722,547.86	
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	155,733,368.72	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	202,965,998.68	
	THAIGB 2.4% 12/17/23	123,000,000.00	123,325,433.40	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	96,399,905.04	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	201,000,000.00	207,221,372.10	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	67,149,503.26	
	THAIGB 2% 12/17/31	58,000,000.00	56,258,997.18	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	156,480,058.35	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	71,000,000.00	76,078,495.10	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	167,998,382.40	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	142,500,000.00	155,285,798.25	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	198,554,958.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	109,959,930.74	
THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	136,936,938.10		
	タイバーツ 小計	2,505,800,000.00	2,538,115,492.41 (10,177,843,124)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,340,251.70	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	29,340,251.70 (72,975,074)	
	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,985,686,800.00	

インドネシア アルピア	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,298,750,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	61,272,540,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	50,000,000,000.00	49,545,500,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	16,031,360,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,422,640,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	61,844,380,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,731,487,100.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	26,500,000,000.00	26,852,450,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	62,917,500,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	50,621,500,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	20,228,200,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	16,000,000,000.00	16,665,040,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	29,174,470,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	13,500,000,000.00	14,048,910,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	34,000,000,000.00	36,369,460,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	21,072,105,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	43,700,000,000.00	46,602,991,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,620,288,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	50,000,000,000.00	52,101,000,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,917,804,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	55,000,000,000.00	57,109,250,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,810,880,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	34,260,408,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	38,013,600,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,976,510,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	35,600,000,000.00	36,315,204,000.00	
INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	50,069,800,000.00		
INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,548,328,000.00		
INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	42,943,090,000.00		
INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	27,043,833,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,424,690,160.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	32,550,966,000.00		
インドネシアアルピア 小計		1,045,700,000,000.00	1,094,390,621,060.00 (10,287,271,837)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	210,400,000.00	213,810,584.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	44,002,290.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	64,100,000.00	36,464,502.90	
	SAGB 7% 02/28/31	104,700,000.00	80,242,080.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000.00	133,194,400.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	136,700,000.00	100,221,605.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	104,000,000.00	73,689,200.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	127,344,445.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	118,678,450.00	

	SAGB 8% 01/31/30	182,600,000.00	155,456,510.00	
	SAGB 9% 01/31/40	130,300,000.00	96,838,960.00	
	南アフリカランド 小計	1,503,200,000.00	1,179,943,026.90 (8,519,188,654)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,518,101.75	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,158,768.54	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	2,998,059.48	
	CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	20,948,163.38	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,048,678.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,398,230.63	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,003,583.20	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,668,260.77	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	4,983,649.95	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,000,000.00	10,057,466.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,231,644.89	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,084,943.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	9,934,462.30	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,688,177.42	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	10,955,523.51	
	CGB 2.76% 05/15/32	4,500,000.00	4,497,121.98	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,072,818.40	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,116,005.20	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	9,937,414.08	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,778,306.93	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,664,742.88	
	CGB 2.88% 02/25/33	5,000,000.00	5,071,370.00	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,076,527.20	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,100,800.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,246,509.40	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,033,449.72	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,677,854.00	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,424,416.82	
	CGB 3.03% 03/11/26	7,500,000.00	7,643,578.50	
	CGB 3.12% 10/25/52	1,800,000.00	1,809,375.48	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,468,768.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,549,110.39	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,348,731.28	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,111,824.96	
CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,596,714.80		
CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,701,141.74		
CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,974,265.60		
CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,041,256.67		

	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,788,323.04	
	CGB 3.32% 04/15/52	3,200,000.00	3,318,334.08	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,451,016.08	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,417,711.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,495,658.50	
	オフショア人民元 小計	507,600,000.00	517,090,859.95 (10,140,100,054)	
	合計		98,815,439,849 (98,815,439,849)	

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%	10.3%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	10.6%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.2%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.1%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.5%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 20銘柄	100.0%	5.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.2%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.6%
ルーマニアレイ	国債証券 19銘柄	100.0%	3.6%
マレーシアリンギット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 20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%	10.4%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	8.6%
オフショア人民元	国債証券 43銘柄	100.0%	10.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

貸借対照表

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,529,848
コール・ローン	19,620,828
国債証券	1,813,872,157
派生商品評価勘定	3,241,999
未収利息	4,496,690
前払費用	317,639
流動資産合計	1,844,079,161
資産合計	1,844,079,161
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,937,926
未払解約金	75,097
未払利息	33
流動負債合計	15,013,056
負債合計	15,013,056
純資産の部	
元本等	
元本	1,985,563,482
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	156,497,377
元本等合計	1,829,066,105
純資産合計	1,829,066,105
負債純資産合計	1,844,079,161

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,985,563,482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 156,497,377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 0.9212円 (1万口当たり純資産額) (9,212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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	9,382,969,444円
期中追加設定元本額	1,240,220,718円
期中一部解約元本額	8,637,626,680円
期末元本額	1,985,563,482円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	81,045,193円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,380,974,415円
私募世界物価連動債パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	523,543,874円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		36,114,818
合計		36,114,818

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 5月24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	1,842,963,737	-	1,854,659,664	11,695,927
	アメリカドル	984,211,455	-	995,336,873	11,125,418
	カナダドル	31,570,964	-	32,083,532	512,568
	ユーロ	372,350,926	-	369,531,253	2,819,673
	イギリスポンド	409,685,933	-	412,698,240	3,012,307
	スウェーデンクローナ	12,912,155	-	12,647,636	264,519
	デンマーククローネ	2,682,477	-	2,663,258	19,219
	オーストラリアドル	19,721,971	-	19,667,297	54,674
	ニュージーランドドル	9,827,856	-	10,031,575	203,719
	合計	1,842,963,737	-	1,854,659,664	11,695,927

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	TII 0.125% 01/15/30	200,000.00	214,681.55	
		TII 0.125% 01/15/31	170,000.00	178,341.46	
		TII 0.125% 01/15/32	260,000.00	253,100.41	

TII 0.125% 02/15/51	90,000.00	68,865.96	
TII 0.125% 02/15/52	100,000.00	71,224.56	
TII 0.125% 04/15/25	170,000.00	190,717.54	
TII 0.125% 04/15/26	210,000.00	229,602.63	
TII 0.125% 04/15/27	180,000.00	180,942.38	
TII 0.125% 07/15/24	190,000.00	234,809.04	
TII 0.125% 07/15/26	160,000.00	191,837.43	
TII 0.125% 07/15/30	180,000.00	193,363.89	
TII 0.125% 07/15/31	160,000.00	162,379.17	
TII 0.125% 10/15/24	90,000.00	102,593.38	
TII 0.125% 10/15/25	120,000.00	133,829.45	
TII 0.125% 10/15/26	140,000.00	146,689.01	
TII 0.25% 01/15/25	180,000.00	221,641.15	
TII 0.25% 02/15/50	50,000.00	40,704.27	
TII 0.25% 07/15/29	150,000.00	164,747.26	
TII 0.375% 01/15/27	130,000.00	154,694.63	
TII 0.375% 07/15/25	180,000.00	221,581.97	
TII 0.375% 07/15/27	180,000.00	211,722.33	
TII 0.5% 01/15/28	180,000.00	209,538.86	
TII 0.625% 01/15/26	160,000.00	196,457.09	
TII 0.625% 02/15/43	90,000.00	96,981.13	
TII 0.625% 07/15/32	190,000.00	184,022.35	
TII 0.75% 02/15/42	100,000.00	113,430.67	
TII 0.75% 02/15/45	100,000.00	105,761.26	
TII 0.75% 07/15/28	150,000.00	173,987.78	
TII 0.875% 01/15/29	140,000.00	161,463.16	
TII 0.875% 02/15/47	100,000.00	104,520.66	
TII 1.125% 01/15/33	180,000.00	177,211.14	
TII 1.25% 04/15/28	60,000.00	59,499.07	
TII 1.375% 02/15/44	110,000.00	134,113.54	
TII 1.5% 02/15/53	30,000.00	29,399.53	
TII 1.625% 10/15/27	190,000.00	194,206.53	
TII 1.75% 01/15/28	50,000.00	72,505.66	
TII 1% 02/15/46	90,000.00	99,259.71	
TII 1% 02/15/48	80,000.00	83,859.83	
TII 1% 02/15/49	60,000.00	61,496.33	
TII 2.125% 02/15/40	60,000.00	90,191.26	
TII 2.125% 02/15/41	110,000.00	163,402.28	
TII 2.375% 01/15/25	130,000.00	208,086.16	
TII 2.375% 01/15/27	100,000.00	152,929.16	
TII 2.5% 01/15/29	60,000.00	88,619.70	
TII 2% 01/15/26	110,000.00	167,435.76	

	TII 3.375% 04/15/32	20,000.00	39,332.73
	TII 3.625% 04/15/28	90,000.00	183,802.18
	TII 3.875% 04/15/29	100,000.00	207,388.14
アメリカドル 小計		6,130,000.00	7,126,971.14 (988,012,009)
カナダドル	CANI 0.25% 12/01/54	10,000.00	7,938.21
	CANI 0.5% 12/01/50	30,000.00	28,263.73
	CANI 1.25% 12/01/47	30,000.00	35,944.03
	CANI 1.5% 12/01/44	30,000.00	40,115.40
	CANI 2% 12/01/41	30,000.00	45,036.87
	CANI 3% 12/01/36	40,000.00	71,159.80
	CANI 4.25% 12/01/26	20,000.00	38,602.50
	CANI 4% 12/01/31	20,000.00	41,143.61
カナダドル 小計		210,000.00	308,204.15 (31,649,484)
ユーロ	BTPS 1.3% 05/15/28	70,000.00	83,723.25
	BTPS 0.1% 05/15/33	40,000.00	36,914.24
	BTPS 0.15% 05/15/51	30,000.00	20,951.10
	BTPS 0.4% 05/15/30	80,000.00	84,923.25
	BTPS 0.65% 05/15/26	40,000.00	45,325.66
	BTPS 1.25% 09/15/32	50,000.00	57,077.21
	BTPS 2.35% 09/15/24	60,000.00	74,759.08
	BTPS 2.35% 09/15/35	70,000.00	103,911.32
	BTPS 2.55% 09/15/41	60,000.00	82,942.55
	BTPS 3.1% 09/15/26	60,000.00	82,128.12
	DBRI 0.1% 04/15/26	70,000.00	85,172.29
	DBRI 0.1% 04/15/33	70,000.00	81,738.20
	DBRI 0.1% 04/15/46	50,000.00	62,629.27
	DBRI 0.5% 04/15/30	90,000.00	113,675.63
	FRTRI 0.1% 03/01/25	60,000.00	69,301.88
	FRTRI 0.1% 03/01/26	50,000.00	57,604.74
	FRTRI 0.1% 03/01/28	50,000.00	57,835.00
	FRTRI 0.1% 03/01/29	50,000.00	57,483.56
	FRTRI 0.1% 03/01/32	30,000.00	32,923.04
	FRTRI 0.1% 03/01/36	30,000.00	31,381.62
	FRTRI 0.1% 07/25/31	90,000.00	101,842.47
	FRTRI 0.1% 07/25/36	50,000.00	55,384.60
	FRTRI 0.1% 07/25/38	30,000.00	31,226.59
	FRTRI 0.1% 07/25/47	50,000.00	52,641.48
	FRTRI 0.1% 07/25/53	20,000.00	19,321.34
	FRTRI 0.25% 07/25/24	80,000.00	99,005.54
	FRTRI 0.7% 07/25/30	60,000.00	74,928.29
	FRTRI 1.8% 07/25/40	60,000.00	97,756.40

	FRTRI 1.85% 07/25/27	90,000.00	124,719.18
	FRTRI 3.15% 07/25/32	40,000.00	74,533.98
	FRTRI 3.4% 07/25/29	40,000.00	69,709.60
	SPGBEI 0.65% 11/30/27	50,000.00	60,197.06
	SPGBEI 0.7% 11/30/33	70,000.00	79,277.45
	SPGBEI 1.8% 11/30/24	60,000.00	74,514.39
	SPGBEI 1% 11/30/30	90,000.00	109,097.94
	ユーロ 小計	1,990,000.00	2,446,557.32 (365,319,939)
イギリスポ ンド	UKTI 0.125% 03/22/26	60,000.00	83,702.40
	UKTI 0.125% 03/22/29	50,000.00	75,202.89
	UKTI 0.125% 03/22/39	40,000.00	43,278.06
	UKTI 0.125% 03/22/44	70,000.00	86,208.15
	UKTI 0.125% 03/22/46	60,000.00	67,542.20
	UKTI 0.125% 03/22/51	30,000.00	28,246.14
	UKTI 0.125% 03/22/58	50,000.00	51,777.51
	UKTI 0.125% 03/22/68	50,000.00	51,376.19
	UKTI 0.125% 03/22/73	20,000.00	17,331.35
	UKTI 0.125% 08/10/28	90,000.00	115,709.08
	UKTI 0.125% 08/10/31	50,000.00	60,787.60
	UKTI 0.125% 08/10/41	50,000.00	55,664.60
	UKTI 0.125% 08/10/48	40,000.00	41,234.45
	UKTI 0.125% 11/22/36	60,000.00	77,066.91
	UKTI 0.125% 11/22/56	40,000.00	40,386.01
	UKTI 0.125% 11/22/65	40,000.00	39,689.21
	UKTI 0.25% 03/22/52	60,000.00	71,042.93
	UKTI 0.375% 03/22/62	50,000.00	61,335.44
	UKTI 0.5% 03/22/50	60,000.00	87,482.08
	UKTI 0.625% 03/22/40	60,000.00	95,778.97
	UKTI 0.625% 11/22/42	60,000.00	95,825.39
	UKTI 0.75% 03/22/34	60,000.00	95,202.96
	UKTI 0.75% 11/22/47	50,000.00	80,405.59
	UKTI 1.125% 11/22/37	60,000.00	112,462.46
	UKTI 1.25% 11/22/27	60,000.00	116,963.77
	UKTI 1.25% 11/22/32	70,000.00	125,876.23
	UKTI 1.25% 11/22/55	40,000.00	79,336.46
UKTI 2.5% 07/17/24	30,000.00	112,320.06	
UKTI 2% 01/26/35	40,000.00	94,240.00	
UKTI 4.125% 07/22/30	20,000.00	66,735.20	
	イギリスポンド 小計	1,520,000.00	2,230,210.29 (384,220,628)
スウェーデ ンクローナ	SGBI 0.125% 06/01/26	130,000.00	161,802.13
	SGBI 0.125% 06/01/30	90,000.00	103,071.11

	SGBI 0.125% 06/01/32	100,000.00	123,139.75	
	SGBI 0.125% 06/01/39	20,000.00	21,134.66	
	SGBI 0.125% 12/01/27	130,000.00	159,062.75	
	SGBI 1% 06/01/25	150,000.00	190,077.60	
	SGBI 3.5% 12/01/28	120,000.00	215,543.38	
	スウェーデンクローナ 小計	740,000.00	973,831.38	(12,718,237)
デンマーククローネ	DGBI 0.1% 11/15/30	80,000.00	90,025.21	
	DGBI 0.1% 11/15/34	40,000.00	42,646.65	
	デンマーククローネ 小計	120,000.00	132,671.86	(2,660,070)
オーストラリアドル	ACGBI 0.25% 11/21/32	40,000.00	40,249.20	
	ACGBI 0.75% 11/21/27	20,000.00	23,510.60	
	ACGBI 1.25% 08/21/40	20,000.00	23,223.90	
	ACGBI 1% 02/21/50	10,000.00	9,854.20	
	ACGBI 2.5% 09/20/30	30,000.00	44,915.25	
	ACGBI 2% 08/21/35	20,000.00	27,255.30	
	ACGBI 3% 09/20/25	30,000.00	44,348.25	
	オーストラリアドル 小計	170,000.00	213,356.70	(19,547,740)
ニュージーランドドル	NZGBI 2.5% 09/20/35	40,000.00	49,653.64	
	NZGBI 2.5% 09/20/40	20,000.00	24,090.36	
	NZGBI 2% 09/20/25	20,000.00	25,410.25	
	NZGBI 3% 09/20/30	10,000.00	13,272.78	
	ニュージーランドドル 小計	90,000.00	112,427.03	(9,744,050)
	合計		1,813,872,157	(1,813,872,157)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 48銘柄	100.0%	54.5%
カナダドル	国債証券 8銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	国債証券 35銘柄	100.0%	20.1%
イギリスポンド	国債証券 30銘柄	100.0%	21.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.7%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.1%
オーストラリアドル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.1%
ニュージーランドドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年 5月24日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,075,078,321
投資証券	129,992,995,900
派生商品評価勘定	98,953,800
未収入金	159,385,475
未収配当金	680,990,860
差入委託証拠金	205,376,000
流動資産合計	134,212,780,356
資産合計	134,212,780,356
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	390,000
前受金	98,563,800
未払金	134,998,338
未払解約金	93,823,255
未払利息	5,264
流動負債合計	327,780,657
負債合計	327,780,657
純資産の部	
元本等	
元本	64,195,508,562
剰余金	
剰余金又は欠損金()	69,689,491,137
元本等合計	133,884,999,699
純資産合計	133,884,999,699
負債純資産合計	134,212,780,356

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 5月24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>

2023年 5月24日現在	
3. 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)派生商品取引等損益 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 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	64,195,508,562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) 2.0856円 (20,856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 5月24日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 5月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	54,376,403,459円
期中追加設定元本額	14,788,560,826円
期中一部解約元本額	4,969,455,723円
期末元本額	64,195,508,562円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,767,632,400円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,343,350円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,822,940,051円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	34,186,967,919円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,164,268,574円
分散投資コア戦略ファンドA	1,060,652,310円
分散投資コア戦略ファンドS	1,788,340,764円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,021,696,978円
SMT インデックスバランス・オープン	24,610,600円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	247,976,186円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,058,370円
グローバル経済コア	270,514,373円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,195,286円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	637,380,154円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	138,407,315円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	351,036,450円
10資産分散投資ファンド	23,278,646円
FOfs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	511,873,013円
FOfs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,041,828円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	584,437,025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）	94,259,238円
J-REIT バッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	519,296,588円
J-REIT バッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	250,949,273円
J-REIT バッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	286,169,593円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	5,846,395,599
合計	5,846,395,599

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2023年 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益(円)
			(円)	
市場取引	不動産投信指数先物取引			
	買建	3,775,393,200	-	3,873,957,000
合計		3,775,393,200	-	3,873,957,000

(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	2,532	288,648,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,990	336,756,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	6,195	830,749,500	
	東海道リート投資法人	2,071	242,928,300	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,300	2,773,500,000	
	森ヒルズリート投資法人	14,645	2,154,279,500	
	産業ファンド投資法人	19,002	2,911,106,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,452	4,358,200,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,133	1,915,190,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,575	2,643,150,000	
	G L P 投資法人	41,987	6,155,294,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,955	1,980,037,500	
	日本プロロジスリート投資法人	20,992	6,381,568,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,178	1,489,752,000	
	O n e リート投資法人	2,172	506,076,000	
	イオンリート投資法人	14,297	2,228,902,300	
	ヒューリックリート投資法人	11,652	1,816,546,800	
	日本リート投資法人	4,045	1,326,760,000	
	積水ハウス・リート投資法人	37,423	3,016,293,800	
	トーセイ・リート投資法人	2,763	354,769,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	5,414	1,329,137,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	3,071	500,265,900	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,237	373,549,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	40,273	6,560,471,700	
	いちごホテルリート投資法人	2,063	208,363,000	
	ラサルロジポート投資法人	15,246	2,440,884,600	
	スターアジア不動産投資法人	15,550	901,900,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,902	243,646,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,920	2,455,080,000	
	大江戸温泉リート投資法人	2,010	133,263,000	
	投資法人みらい	15,130	689,171,500	
	三菱地所物流リート投資法人	4,279	1,812,156,500	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,336	991,428,800	
ザイマックス・リート投資法人	2,020	221,190,000		

タカラレーベン不動産投資法人	5,871	537,783,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,428	745,264,400	
日本ビルファンド投資法人	14,528	7,946,816,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,771	6,768,630,000	
日本都市ファンド投資法人	62,837	6,114,040,100	
オリックス不動産投資法人	24,814	4,330,043,000	
日本プライムリアルティ投資法人	8,517	2,921,331,000	
N T T 都市開発リート投資法人	11,972	1,555,162,800	
東急リアル・エステート投資法人	8,350	1,579,820,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	9,165	970,573,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	27,858	4,270,631,400	
森トラストリート投資法人	23,179	1,599,351,000	
インヴィンシブル投資法人	54,815	3,108,010,500	
フロンティア不動産投資法人	4,621	2,227,322,000	
平和不動産リート投資法人	8,511	1,314,949,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,397	2,645,055,000	
福岡リート投資法人	6,441	1,030,560,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,247	2,171,925,900	
いちごオフィスリート投資法人	10,205	905,183,500	
大和証券オフィス投資法人	2,580	1,483,500,000	
阪急阪神リート投資法人	5,625	817,875,000	
スターツプロシード投資法人	2,159	495,922,300	
大和ハウスリート投資法人	18,772	5,492,687,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,161	3,080,348,700	
大和証券リビング投資法人	17,258	1,955,331,400	
ジャパンエクセレント投資法人	11,425	1,353,862,500	
合計	758,317	129,992,995,900	

(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 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	354,222,299
コール・ローン	30,530,373
投資証券	87,714,562,802
未収入金	3,409,922
未収配当金	160,722,579

	2023年 5月24日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	88,263,447,975
資産合計	88,263,447,975
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,320
未払解約金	67,615,917
未払利息	52
流動負債合計	67,676,289
負債合計	67,676,289
純資産の部	
元本等	
元本	36,697,065,105
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	51,498,706,581
元本等合計	88,195,771,686
純資産合計	88,195,771,686
負債純資産合計	88,263,447,975

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月24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 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,697,065,105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 2.4033円 (1万口当たり純資産額) (24,033円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 5月24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 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月30日
期首元本額	39,267,097,419円
期中追加設定元本額	7,031,240,786円
期中一部解約元本額	9,601,273,100円
期末元本額	36,697,065,105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	58,177,468円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	100,877,861円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,722,924,362円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,330,545円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,366,358,018円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	14,568,519,404円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円

区分	2023年 5月24日現在
分散投資コア戦略ファンドA	1,144,609,846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）	510,318,247円
SMT インデックスバランス・オープン	114,472,223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	8,595,915円
グローバル経済コア	229,255,238円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,465,727円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	75,795,635円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	127,511,468円
10資産分散投資ファンド	12,883,589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）	1,098,746,667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）	187,558,868円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	80,885,377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）	58,561,688円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	37,328,194円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	101,254,666円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	98,602,587円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	98,102,805円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	98,563,944円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	97,589,221円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	73,288,532円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	63,576,431円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		409,449,335
合計		409,449,335

(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 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	70,041,660	-	70,101,980	60,320
	アメリカドル	58,847,750	-	58,906,777	59,027
	イギリスポンド	11,193,910	-	11,195,203	1,293
合計		70,041,660	-	70,101,980	60,320

(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	48,737	642,353.66	
		AGREE REALTY CORP	45,524	2,973,172.44	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,043	673,643.67	
		ALEXANDER'S INC	886	146,508.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	81,088	9,577,303.68	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	91,029.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,042	568,932.78	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	157,003	5,236,050.05	
		AMERICOLD REALTY TRUST	138,091	4,097,159.97	
		APARTMENT INCOME REIT CO	76,539	2,692,642.02	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	82,564	694,363.24	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	111,651	1,664,716.41	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	365,060.89	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	71,570.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	71,947	12,600,797.58	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	32,016.00	
		BOSTON PROPERTIES	72,121	3,668,074.06	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	116,235.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	311,061.11	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	154,056	3,128,877.36	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	89,237	1,420,653.04	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	91,500.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	56,619	5,994,253.53	
		CARETRUST REIT INC	52,232	1,007,032.96	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	270,210.10	
		CENTERSPACE	7,349	443,438.66	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	243,350.24	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	77,713.84	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	41,464.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	377,136.50	
		CORPORATE OFFICE PPTYS	59,276	1,362,162.48	
		COUSINS PROPERTIES INC	79,585	1,659,347.25	
		CTO REALTY GROWTH INC	8,400	136,164.00	
CUBESMART	115,579	5,212,612.90			
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	112,866	892,770.06			
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	77,778.00			

DIGITAL REALTY TRUST INC	147,837	13,368,899.91	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	135,488.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	92,232	1,088,337.60	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	49,311	681,971.13	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,044	3,549,524.88	
ELME COMMUNITIES	47,484	744,549.12	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	62,623	408,928.19	
EPR PROPERTIES	38,177	1,607,633.47	
EQUINIX INC	47,501	33,099,171.81	
EQUITY COMMONWEALTH	57,330	1,219,409.10	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	88,639	5,681,759.90	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	173,593	10,577,021.49	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	71,351	1,726,694.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	32,982	6,966,458.04	
EXTRA SPACE STORAGE INC	68,920	10,206,362.80	
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	259,130.34	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	37,551	3,356,308.38	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	66,879	3,457,644.30	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,562	1,100,653.32	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	76,315.18	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	131,492	6,293,207.12	
GETTY REALTY CORP	20,690	705,322.10	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	232,732.50	
GLADSTONE LAND CORP	15,061	236,457.70	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,431	228,892.46	
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	518,327.04	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	197,113	3,802,309.77	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	279,377	5,629,446.55	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	114,305.45	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,689	1,135,522.35	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	365,400	6,146,028.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	305,115.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	111,216	1,899,569.28	
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	156,031.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	63,678.72	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,642	1,024,793.58	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	36,629	790,453.82	
INVITATION HOMES INC	298,980	9,959,023.80	
IRON MOUNTAIN INC	148,319	8,114,532.49	
JBG SMITH PROPERTIES	47,111	714,202.76	

KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	113,091.00
KILROY REALTY CORPORATION	52,622	1,479,204.42
KIMCO REALTY CORP	316,025	5,821,180.50
KITE REALTY GROUP TRUST	113,033	2,295,700.23
LIFE STORAGE INC	43,413	5,671,908.45
LTC PROPERTIES INC	22,125	717,071.25
LXP INDUSTRIAL TRUST	144,466	1,482,221.16
MACERICH CO/THE	112,250	1,089,947.50
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	146,153.70
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	307,972	2,432,978.80
MID-AMERICA APARTMENT COMM	59,199	8,656,077.78
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,098	1,605,831.48
NATL HEALTH INVESTORS INC	23,139	1,209,938.31
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	307,859.68
NETSTREIT CORP	27,610	497,532.20
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490	160,786.20
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	451,798.86
NNN REIT INC	93,928	4,022,936.24
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	162,630.42
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	120,243	3,483,439.71
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	176,107.52
ORION OFFICE REIT INC	34,844	214,290.60
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	372,037.20
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	116,585	1,542,419.55
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	69,186	941,621.46
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	61,353	1,806,845.85
PHYSICIANS REALTY TRUST	114,135	1,608,162.15
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	395,449.24
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	22,286	488,954.84
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	103,530.00
PRIME US REIT	295,000	69,325.00
PROLOGIS INC	473,632	58,512,497.28
PUBLIC STORAGE	81,188	23,341,550.00
REALTY INCOME CORP	322,210	19,364,821.00
REGENCY CENTERS CORP	78,817	4,536,706.52
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,925	835,893.25
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	96,677	5,237,959.86
RLJ LODGING TRUST	86,772	922,386.36
RPT REALTY	48,829	453,133.12
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	28,409	2,598,855.32
SABRA HEALTH CARE REIT INC	117,928	1,292,490.88

	SAFEHOLD INC	21,624	563,953.92	
	SAUL CENTERS INC	6,846	241,800.72	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	89,293	724,166.23	
	SIMON PROPERTY GROUP	168,006	17,494,464.78	
	SITE CENTERS CORP	96,171	1,153,090.29	
	SL GREEN REALTY CORP	34,909	815,125.15	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,857	2,818,231.54	
	STAG INDUSTRIAL INC	91,717	3,127,549.70	
	STAR HOLDINGS	6,183	98,989.83	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	353,309.90	
	SUN COMMUNITIES INC	63,518	8,203,349.70	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	110,585	1,127,967.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	54,827	1,095,443.46	
	TERRENO REALTY CORP	37,611	2,273,208.84	
	UDR INC	157,960	6,356,310.40	
	UMH PROPERTIES INC	25,129	392,514.98	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,281	280,321.03	
	URBAN EDGE PROPERTIES	63,105	872,742.15	
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	297,388.00	
	VENTAS INC	205,929	9,163,840.50	
	VERIS RESIDENTIAL INC	43,050	710,755.50	
	VICI PROPERTIES INC	515,853	16,037,869.77	
	VORNADO REALTY TRUST	80,077	1,121,878.77	
	WELLTOWER INC	242,809	18,494,761.53	
	WHITESTONE REIT	23,074	205,820.08	
	WP CAREY INC	107,467	7,444,239.09	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	61,932	753,712.44	
	アメリカドル 小計	13,158,265	484,887,498.50 (67,219,953,917)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	676,384.41	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	212,916.60	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	133,680.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,093	671,681.15	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	163,305.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	65,600.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	41,675	2,029,572.50	
	CHOICE PROPERTIES REIT	82,975	1,150,863.25	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	399,718.08	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	425,100.90	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	66,102	926,750.04	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	200,942.80	

	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	71,461.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	56,200	839,628.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,396,845.20
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	633,251.84
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	30,798.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	451,434.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,096	508,889.04
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	169,608.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	119,782.32
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	144,295.15
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	460,379.04
	PRIMARIS REIT	22,050	286,209.00
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	86,080.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	77,217	1,560,555.57
	SLATE GROCERY REIT	18,345	239,585.70
	SLATE OFFICE REI	17,000	34,850.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,154	902,403.18
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	68,112.00
	カナダドル 小計	906,652	15,060,682.17 (1,546,581,452)
ユーロ	AEDIFICA	20,737	1,419,447.65
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	38,736.00
	ALTAREA	1,959	229,203.00
	CARE PROPERTY INVEST	17,887	236,108.40
	CARMILA	26,392	368,960.16
	COFINIMMO	15,860	1,238,666.00
	COVIVIO(FP)	23,172	1,113,182.88
	CROMWELL REIT EUR	170,400	264,120.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,490	442,584.00
	GECINA SA	27,979	2,769,921.00
	HAMBORNER REIT AG	37,000	248,270.00
	ICADE	17,300	678,160.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	87,009.25
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,184	865,489.60
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	195,052.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	215,040.00
	KLEPIERRE	99,985	2,151,677.20
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	174,760.00
	MERCIALYS	36,384	282,157.92

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	166,888	1,314,243.00	
	MONTEA NV	6,890	514,683.00	
	NSI NV	7,359	153,435.15	
	RETAIL ESTATES	5,335	347,308.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	54,433	2,476,157.17	
	VASTNED RETAIL	10,650	222,585.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,388	2,105,501.68	
	WERELDHAVE NV	22,376	316,396.64	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,191	358,415.40	
	ユーロ 小計	1,330,329	20,827,270.60 (3,109,928,045)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	60,437.82	
	AEW UK REIT PLC	68,000	67,592.00	
	ASSURA PLC	1,556,822	782,303.05	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	295,908.80	
	BIG YELLOW GROUP PLC	87,773	1,033,965.94	
	BRITISH LAND CO PLC	489,072	1,788,536.30	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	263,723.53	
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	103,470.04	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	214,362.54	
	DERWENT LONDON PLC	59,125	1,322,035.00	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	67,760.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	285,804.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	136,263	701,073.13	
	HAMMERSON PLC	2,172,686	565,332.89	
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	162,293	160,994.65	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	382,234	2,431,772.70	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	499,236	938,563.68	
	LXI REIT PLC	904,608	933,555.45	
	NEWRIVER REIT PL	126,000	107,730.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	207,164.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	690,955	724,811.79	
	PRS REIT PLC/THE	260,002	223,341.71	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	117,216.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	114,346	1,100,008.52	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	93,740.00	
SEGRO PLC	623,944	5,148,785.88		
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	950,577	1,173,962.59		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	675,749	556,817.17		

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	111,400.72	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	981,018	1,435,229.33	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	215,165.16	
	UNITE GROUP PLC	208,384	1,919,216.64	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	315,023.61	
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	251,672.80	
	WORKSPACE GROUP PLC	65,316	314,300.59	
	イギリス債券 小計	15,444,381	26,184,444.82 (4,511,056,153)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	194,329	503,312.11	
	ARENA REIT	192,648	707,018.16	
	BWP TRUST	269,026	1,006,157.24	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	348,575	618,720.62	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	305,296	964,735.36	
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	292,638.11	
	CHARTER HALL GROUP	242,299	2,793,707.47	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	330,964	1,443,003.04	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	275,874	1,031,768.76	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	467,040.64	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	378,233.60	
	DEXUS	558,206	4,521,468.60	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	325,440.00	
	GDI PROPERTY GROUP	185,597	132,701.85	
	GOODMAN GROUP	881,096	17,842,194.00	
	GPT GROUP	994,249	4,315,040.66	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	448,356.30	
	HEALTHCO REIT	137,130	188,553.75	
	HMC CAPITAL LTD	92,191	407,484.22	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	832,883	1,011,952.84	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	355,362.76	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	760,569.48	
	MIRVAC GROUP	2,057,126	4,793,103.58	
	NATIONAL STORAGE REIT	603,590	1,545,190.40	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	126,775.60	
	REGION RE GROUP	588,421	1,465,168.29	
RURAL FUNDS GROUP	181,331	336,369.00		
SCENTRE GROUP	2,668,931	7,473,006.80		
STOCKLAND	1,232,160	5,483,112.00		
VICINITY CENTERS	1,970,762	3,902,108.76		
WAYPOINT REIT LTD	336,956	899,672.52		
	オーストラリアドル 小計	17,229,595	66,539,966.52 (6,096,391,732)	
	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	459,005.80	

ニュージーランドドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	556,435	1,215,810.47	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	676,815.23	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	651,295	801,092.85	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	396,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	241,387	552,776.23	
ニュージーランドドル 小計		2,910,148	4,101,500.58	(355,477,055)
香港ドル	CHAMPION REIT	927,000	2,623,410.00	
	FORTUNE REIT	735,000	4,468,800.00	
	LINK REIT	1,297,300	63,956,890.00	
	PROSPERITY REIT	492,000	861,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,683,000.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	2,482,654.00	
香港ドル 小計		5,318,960	76,075,754.00	(1,345,780,088)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	363,000.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,707,118	4,711,645.68	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,047,977	1,142,294.93	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	688,246.47	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,619,744	5,265,685.44	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	469,522.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	185,546.00	
	EC WORLD REIT	180,000	54,000.00	
	ESR-LOGOS REIT	3,029,264	999,657.12	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	332,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	137,215.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	529,862	1,176,293.64	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,448,796	1,782,019.08	
	KEPPEL DC REIT	661,303	1,368,897.21	
	KEPPEL REIT	1,047,300	905,914.50	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	1,027,350	683,187.75	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,029,063	2,346,263.64	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,642,585	2,726,691.10	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,207,573	2,040,798.37	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	420,302.52	
	PARAGON REIT	519,600	488,424.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	197,500	754,450.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	221,850.00	
STARHILL GLOBAL REIT	663,000	344,760.00		
SUNTEC REIT	1,134,100	1,508,353.00		

シンガポールドル 小計		23,984,200	31,117,117.95 (3,201,329,094)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	94,462,800.00
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	69,168,000.00
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	340,001,200.00
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	54,014,400.00
	JR REIT XXVII	76,683	343,156,425.00
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	141,153,150.00
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	281,584,800.00
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	183,611,250.00
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	54,190,125.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	225,192,200.00
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	50,626,565.00
	SK REITS CO LTD	39,229	200,852,480.00
韓国ウォン 小計		456,338	2,038,013,395.00 (214,399,009)
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	552,600.00
	REIT 1 LTD	103,500	1,628,055.00
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	854,565.00
イスラエルシェケル 小計		578,500	3,035,220.00 (113,666,257)
合計		81,317,368	87,714,562,802 (87,714,562,802)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 145銘柄	100.0%	76.6%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券 37銘柄	100.0%	5.1%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.0%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	投資証券 25銘柄	100.0%	3.6%
韓国ウォン	投資証券 12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。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2023年5月25日から2023年11月24日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【10 資産分散投資ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期中間計算期間 (2023年11月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,085,368	16,936,083
親投資信託受益証券	1,623,873,177	1,740,292,174
未収入金	2,814,060	4,377,723
流動資産合計	1,642,772,605	1,761,605,980
資産合計	1,642,772,605	1,761,605,980
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,574,662	99,567
未払受託者報酬	156,598	283,646
未払委託者報酬	678,591	1,229,095
未払利息	27	9
その他未払費用	26,055	47,211
流動負債合計	2,435,933	1,659,528
負債合計	2,435,933	1,659,528
純資産の部		
元本等		
元本	1,607,741,633	1,661,807,432
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	32,595,039	98,139,020
(分配準備積立金)	45,271,760	44,071,385
元本等合計	1,640,336,672	1,759,946,452
純資産合計	1,640,336,672	1,759,946,452
負債純資産合計	1,642,772,605	1,761,605,980

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2022年 6月30日 至 2022年12月29日	第2期中間計算期間 自 2023年 5月25日 至 2023年11月24日
営業収益		
受取利息	-	43
有価証券売買等損益	14,736	64,812,930
営業収益合計	14,736	64,812,973
営業費用		
支払利息	-	4,946
受託者報酬	33	283,646
委託者報酬	357	1,229,095
その他費用	-	47,211
営業費用合計	390	1,564,898
営業利益又は営業損失（ ）	15,126	63,248,075
経常利益又は経常損失（ ）	15,126	63,248,075
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,126	63,248,075
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	676,747
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	32,595,039
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,900,679
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,900,679
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	928,026
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	928,026
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,126	98,139,020

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期中間計算期間 (2023年11月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,607,741,633口	1,661,807,432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) 1.0203円 (10,203円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0591円 (10,591円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第2期中間計算期間 (2023年11月24日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日	第2期中間計算期間 自 2023年 5月25日 至 2023年11月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	1,607,741,633円
期中追加設定元本額	1,627,950,903円	98,251,916円
期中一部解約元本額	20,709,270円	44,186,117円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,434,534,823
株式	589,347,290,620
派生商品評価勘定	330,067,700
未収配当金	4,903,510,750
差入委託証拠金	378,195,336
流動資産合計	597,393,599,229
資産合計	597,393,599,229
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	697,650
前受金	329,471,800
未払解約金	313,083,261
未払利息	1,382
流動負債合計	643,254,093
負債合計	643,254,093
純資産の部	
元本等	
元本	243,316,520,616
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	353,433,824,520
元本等合計	596,750,345,136
純資産合計	596,750,345,136
負債純資産合計	597,393,599,229

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,316,520,616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 2.4526円 (1万口当たり純資産額) (24,526円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

2023年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	255,830,605,457円
期中追加設定元本額	12,649,554,643円
期中一部解約元本額	25,163,639,484円
期末元本額	243,316,520,616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)	311,505,178円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,450,864,305円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,123,646円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,067,252,003円
世界経済インデックスファンド	5,151,349,937円
日本株式インデックス・オープン	2,981,502,253円
DCマイセレクション25	5,376,566,480円
DCマイセレクション50	17,333,262,980円
DCマイセレクション75	18,583,973,627円
DC日本株式インデックス・オープン	6,014,857,689円
DCマイセレクションS25	3,178,764,225円
DCマイセレクションS50	9,555,863,544円
DCマイセレクションS75	8,201,309,554円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,151,189,092円
DCターゲット・イヤーフンド2025	91,694,118円
DCターゲット・イヤーフンド2035	618,748,422円
DCターゲット・イヤーフンド2045	484,820,539円
DC世界経済インデックスファンド	3,771,124,503円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	878,661,812円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,789,509円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,000,727円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,704,323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)	146,069,642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)	16,387,263円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	46,566,578円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	513,347,471円

区分	2023年11月24日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	322,196,016円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,163,870,685円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	29,983,810円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,709,949円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	336,182,278円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	183,827,439円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	250,352,850円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	20,204,568円
F O F s用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	420,074,222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	1,922,550,335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)	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	592,168,361円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	406,093,881円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,225,158,969円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	200,500,568円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,794,984円
S M T インデックスバランス・オープン	49,343,969円
国内株式S M T Bセレクション(S M A専用)	19,637,402,945円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,816,957円
S M T 世界経済インデックス・オープン	52,045,044円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	214,789,523円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	37,126,352円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	12,022,309円
グローバル経済コア	217,198,118円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	33,761,547円
M y S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	1,229,895,155円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,773,899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)	242,306,554円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	52,560,580円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,023,647円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,582,300円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	24,406,225円
10資産分散投資ファンド	92,843,016円
グローバル10資産バランスファンド	3,010,223円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	20,340円
F O F s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)	42,070,000,028円
F O F s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)	496,300,393円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,279,696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)	21,067,410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)	437,099,410円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	46,747,872,243円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,819,934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)	210,751,123円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年11月24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	6,406,098,200	-	6,735,570,000	329,471,800
合計		6,406,098,200	-	6,735,570,000	329,471,800

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,250,972,398
コール・ローン	300,808,523
株式	606,164,303,962
投資信託受益証券	158,865,302
投資証券	11,828,604,304
派生商品評価勘定	736,123,255
未収入金	5,056,883
未収配当金	873,703,450
差入委託証拠金	4,774,956,587
流動資産合計	635,093,394,664
資産合計	635,093,394,664
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,563,836
前受金	720,556,710
未払解約金	315,112,475
未払利息	170
流動負債合計	1,051,233,191
負債合計	1,051,233,191
純資産の部	
元本等	
元本	116,305,239,011
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	517,736,922,462
元本等合計	634,042,161,473
純資産合計	634,042,161,473
負債純資産合計	635,093,394,664

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24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</p>

2023年11月24日現在	
	<p>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>
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取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取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。</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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,305,239,011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 5.4515円 (1万口当たり純資産額) (54,515円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2023年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

2023年11月24日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、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>

（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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	121,801,757,578円
期中追加設定元本額	7,419,418,381円
期中一部解約元本額	12,915,936,948円
期末元本額	116,305,239,011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）	1,578,677,951円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,026,183円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,701,506,453円
世界経済インデックスファンド	12,991,865,387円
外国株式インデックス・オープン	881,632,544円
D C マイセレクション 2 5	640,645,909円
D C マイセレクション 5 0	3,483,640,950円
D C マイセレクション 7 5	4,332,011,459円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,698,959,283円
D C マイセレクション S 2 5	410,902,517円
D C マイセレクション S 5 0	1,904,300,874円
D C マイセレクション S 7 5	1,913,025,427円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	20,760,338円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	140,091,960円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	109,773,486円
D C 世界経済インデックスファンド	9,506,709,434円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,008,840,248円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,773,301円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,142,957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）	21,893,215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）	7,602,496円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	21,595,270円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	160,245,813円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	131,534,924円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	997,759,753円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	68,523,807円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	17,431,747円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	114,632,304円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	37,007,623円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	787,426,934円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	850,581,797円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,180,407,120円
コア投資戦略ファンド（安定型）	135,892,093円
コア投資戦略ファンド（成長型）	319,464,712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	7,339,764,093円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,478,490,783円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,012,186,821円

区分	2023年11月24日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	143,320,748円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	493,916,444円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,692,465円
SMT インデックスバランス・オープン	122,984,586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）	5,089,073,963円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,484,967円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,033,644,600円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	179,668,647円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,479,176円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,256,359,451円
グローバル経済コア	535,481,795円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,441,274円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,987,438円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,458,335円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,671,774円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	142,822,008円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	135,156,099円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	59,016,451円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	66,409,951円
10資産分散投資ファンド	51,438,971円
グローバル10資産バランスファンド	1,372,162円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271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）	57,881,541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）	200,349,746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）	618,572,828円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,456,012,944円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	99,880,394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）	69,905,701円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	86,849,283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）	81,444,025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）	180,617,821円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	179,700,011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）	116,188,483円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年11月24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	15,193,361,816	-	15,913,918,526	720,556,710
合計		15,193,361,816	-	15,913,918,526	720,556,710

(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11月24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	64,297,900	-	64,300,609	2,709
	アメリカドル	64,297,900	-	64,300,609	2,709
合計		64,297,900	-	64,300,609	2,709

(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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

2023年11月24日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,749,307,191
コール・ローン	78,158,622
株式	158,990,869,979
投資信託受益証券	505,311,771
投資証券	137,621,332
派生商品評価勘定	171,868,066
未収配当金	247,774,094
差入委託証拠金	1,314,546,035
流動資産合計	169,195,457,090
資産合計	169,195,457,090
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,952,415
前受金	161,242,784
未払解約金	105,491,317
未払利息	44
流動負債合計	277,686,560
負債合計	277,686,560
純資産の部	
元本等	
元本	42,022,994,717
剰余金	
剰余金又は欠損金()	126,894,775,813
元本等合計	168,917,770,530
純資産合計	168,917,770,530
負債純資産合計	169,195,457,090

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

2023年11月24日現在	
	<p>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。 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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,022,994,717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) 4.0197円 (40,197円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2023年11月24日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

2023年11月24日現在	
	(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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	41,605,821,743円
期中追加設定元本額	3,608,740,701円
期中一部解約元本額	3,191,567,727円
期末元本額	42,022,994,717円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,733,027,059円
世界経済インデックスファンド	10,018,517,661円
D C 新興国株式インデックス・オープン	6,046,477,723円
D C 世界経済インデックスファンド	7,260,981,224円
新興国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	93,633,169円
コア投資戦略ファンド (安定型)	60,817,634円
コア投資戦略ファンド (成長型)	142,991,154円
分散投資コア戦略ファンド A	310,316,270円
分散投資コア戦略ファンド S	1,419,462,050円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,152,336,766円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	781,072,014円
コア投資戦略ファンド (切替型)	64,979,797円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	383,128,682円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,835,996円
S M T インデックスバランス・オープン	94,316,871円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	35,711,445円
外国株式 S M T B セレクション (S M A 専用)	2,297,972,872円
S M T 世界経済インデックス・オープン	242,331,147円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,016,699,525円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	173,290,693円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,685,296円
グローバル経済コア	417,842,742円
M y S M T 新興国株式インデックス (ノーロード)	234,434,766円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	57,500,179円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	14,175,859円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 3 0	95,941,720円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 4 0	90,788,730円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 5 0	39,641,779円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 6 0	44,586,310円
1 0 資産分散投資ファンド	13,146,689円
グローバル 1 0 資産バランスファンド	1,847,772円
D C 世界経済インデックスファンド (株式特化型)	43,544円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,441,350,750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)	96,736,628円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	82,357,674円

区分	2023年11月24日現在
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	12,215,701円
F O F s 用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	26,798,826円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年11月24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	9,141,014,908	-	9,302,257,692	161,242,784
合計		9,141,014,908	-	9,302,257,692	161,242,784

(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11月24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	125,605,200	-	125,610,492	5,292
	アメリカドル	125,605,200	-	125,610,492	5,292
	売建	37,057,500	-	37,389,925	332,425
	アメリカドル	37,057,500	-	37,389,925	332,425
合計		162,662,700	-	163,000,417	327,133

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	364,215,195
国債証券	539,083,769,660
地方債証券	32,883,276,705
特殊債券	38,144,133,288
社債券	29,669,103,000
未収入金	1,097,527,200

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
未収利息	1,278,240,920
前払費用	37,907,839
流動資産合計	642,558,173,807
資産合計	642,558,173,807
負債の部	
流動負債	
未払金	1,105,186,800
未払解約金	122,140,096
未払利息	206
流動負債合計	1,227,327,102
負債合計	1,227,327,102
純資産の部	
元本等	
元本	482,305,909,625
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,024,937,080
元本等合計	641,330,846,705
純資産合計	641,330,846,705
負債純資産合計	642,558,173,807

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	482,305,909,625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 99,296,000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 1.3297円 (1万口当たり純資産額) (13,297円)

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	2023年11月24日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	463,653,275,174円
期中追加設定元本額	33,326,290,425円
期中一部解約元本額	14,673,655,974円
期末元本額	482,305,909,625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）	5,351,193,961円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,630,573円
S M T 国内債券インデックス・オープン	17,952,794,742円
世界経済インデックスファンド	6,252,489,724円
D Cマイセレクション25	28,382,979,455円
D Cマイセレクション50	34,236,887,100円
D Cマイセレクション75	10,820,069,188円
D C日本債券インデックス・オープン	408,872,535円
D C日本債券インデックス・オープンS	89,523,272,346円
D C日本債券インデックス・オープンP	63,506,344,971円
D CマイセレクションS25	16,305,477,389円
D CマイセレクションS50	18,999,361,372円
D CマイセレクションS75	4,809,276,150円
D Cターゲット・イヤーフンド2025	476,944,987円
D Cターゲット・イヤーフンド2035	2,781,117,183円
D Cターゲット・イヤーフンド2045	1,103,792,551円
D C世界経済インデックスファンド	4,517,657,973円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,674,031円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,621,963円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,474,766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）	27,399,059円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,711,694円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,159,730,423円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	724,426,844円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,088,546,608円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	62,697,056円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	48,723,356円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	905,639,987円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	999,625,124円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,332,083,051円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	96,453,068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	18,673,641,091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
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	286,173,858円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,800,671,395円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	94,894,360円

区分	2023年11月24日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,482,810円
SMT インデックスバランス・オープン	71,230,779円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,169,945円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	104,232,443円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	166,766,986円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,338,251円
グローバル経済コア	238,623,503円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	43,016,380円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	34,436,205円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	130,716,381円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	72,680,339円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,542,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	14,409,937円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	669,262,833円
10資産分散投資ファンド	315,006,091円
グローバル10資産バランスファンド	37,301,202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）	93,794,911,192円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	38,460,829円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,025,662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）	461,778,133円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	848,730,876
コール・ローン	1,959,821,313
国債証券	296,980,143,264
派生商品評価勘定	9,964,601
未収入金	4,819,427
未収利息	1,961,763,396
前払費用	155,988,184
差入委託証拠金	210,747,528
流動資産合計	302,131,978,589
資産合計	302,131,978,589
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,897,600
前受金	5,950,712
未払金	1,266,790
未払解約金	100,640,874
未払利息	1,113
流動負債合計	112,757,089
負債合計	112,757,089
純資産の部	
元本等	
元本	88,846,300,958
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	213,172,920,542
元本等合計	302,019,221,500
純資産合計	302,019,221,500
負債純資産合計	302,131,978,589

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24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、最初の利払日までには個別法）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。 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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,846,300,958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 3.3993円 (1万口当たり純資産額) (33,993円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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>

（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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	84,697,279,481円
期中追加設定元本額	7,567,373,180円
期中一部解約元本額	3,418,351,703円
期末元本額	88,846,300,958円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,153,009,219円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	522,426,900円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	341,382,731円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,469,678,472円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,224,653円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,669,964,335円
世界経済インデックスファンド	18,908,948,031円
DCマイセクション25	1,968,307,417円
DCマイセクション50	1,770,990,626円
DCマイセクション75	1,361,228,396円
DC外国債券インデックス・オープン	2,250,516,369円
DCマイセクションS25	1,059,352,606円
DCマイセクションS50	965,157,408円
DCマイセクションS75	533,594,368円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,225,349円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	99,587,076円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,630,462円
DC世界経済インデックスファンド	13,755,959,502円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	646,261,287円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	913,708円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,011,151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）	15,967,931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）	54,953,177円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,048,914円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	851,034,675円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	382,737,228円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,559,113,788円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,388,370円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	31,095,201円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	364,358,474円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	132,701,308円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	180,554,443円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	641,969,049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）	1,501,508,777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	781,056,250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）	694,002,629円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,384,242,539円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	232,742,245円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,914,743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）	1,297,422,816円
SMT インデックスバランス・オープン	174,754,063円
SMT 世界経済インデックス・オープン	367,519,236円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	486,040,670円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	777,373,925円

区分	2023年11月24日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,656,517円
グローバル経済コア	792,215,639円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,555,468円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,595,340円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	53,312,418円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	71,539,915円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	35,362,566円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	43,543,309円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	390,405,149円
10資産分散投資ファンド	26,120,580円
グローバル10資産バランスファンド	2,148,092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）	12,257,759,581円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	182,497,160円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	488,925,566円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	125,243,069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）	127,991,047円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年11月24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	1,652,208,417	-	1,658,159,129	5,950,712
合計		1,652,208,417	-	1,658,159,129	5,950,712

（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11月24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	1,832,108,152	-	1,831,224,441	883,711
	アメリカドル	912,329,884	-	909,740,580	2,589,304
	カナダドル	74,109,325	-	74,073,692	35,633
	ユーロ	596,080,242	-	595,932,546	147,696
	イギリスポンド	102,175,941	-	102,912,040	736,099
	オフショア人民元	147,412,760	-	148,565,583	1,152,823
合計		1,832,108,152	-	1,831,224,441	883,711

（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はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	212,630,355
コール・ローン	391,465,104
国債証券	67,506,791,285
派生商品評価勘定	275,557,488
未収入金	3,955,214
未収利息	455,964,209
前払費用	39,532,039
差入委託証拠金	36,610,717
流動資産合計	68,922,506,411
資産合計	68,922,506,411
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	752,444,894
前受金	3,187,540
未払金	4,690,507
未払解約金	282,073
未払利息	222
流動負債合計	760,605,236
負債合計	760,605,236
純資産の部	
元本等	
元本	83,187,891,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,025,990,216
元本等合計	68,161,901,175
純資産合計	68,161,901,175
負債純資産合計	68,922,506,411

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24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>

2023年11月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	83,187,891,391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 15,025,990,216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 0.8194円 (1万口当たり純資産額) (8,194円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2023年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	78,562,074,860円
期中追加設定元本額	8,108,262,560円
期中一部解約元本額	3,482,446,029円
期末元本額	83,187,891,391円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,252,480,457円
分散投資コア戦略ファンドS	28,235,905,835円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	1,183,181,849円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	528,417,286円

区分	2023年11月24日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	116,326,237円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	27,301,796円
10資産分散投資ファンド	517,246,029円
グローバル10資産バランスファンド	8,701,564円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	6,892,342,043円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	2,546,629,087円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,491,298,990円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,534,104,399円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,516,144,509円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,398,707,865円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,365,017,160円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	3,300,519,205円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,273,567,080円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	318,568,586	-	321,756,126	3,187,540
	合計	318,568,586	-	321,756,126	3,187,540

（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11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	66,258,897,551	-	66,738,972,497	480,074,946
	アメリカドル	31,981,479,563	-	31,709,289,169	272,190,394
	カナダドル	1,300,459,868	-	1,307,015,767	6,555,899
	メキシコペソ	587,949,450	-	615,549,480	27,600,030
	ユーロ	21,553,689,525	-	22,030,253,107	476,563,582
	イギリスポンド	3,265,646,722	-	3,344,907,817	79,261,095
	スウェーデンクローナ	129,892,216	-	137,236,489	7,344,273
	ノルウェークローネ	113,553,826	-	116,824,088	3,270,262
	デンマーククローネ	212,187,172	-	217,063,806	4,876,634
	ポーランドズロチ	335,701,480	-	350,287,343	14,585,863
	オーストラリアドル	945,552,017	-	972,269,100	26,717,083

	ニュージーランド ドル	149,956,092	-	155,169,300	5,213,208
	シンガポールドル	283,022,107	-	286,666,500	3,644,393
	マレーシアリン ギット	347,352,751	-	350,537,821	3,185,070
	イスラエルシェケ ル	190,695,946	-	204,104,342	13,408,396
	オフショア人民元	4,861,758,816	-	4,941,798,368	80,039,552
	合計	66,258,897,551	-	66,738,972,497	480,074,946

(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。

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11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,958,764,007
コール・ローン	989,844,589
国債証券	121,777,135,076
未収利息	1,933,853,896
前払費用	203,370,188
流動資産合計	126,862,967,756
資産合計	126,862,967,756
負債の部	
流動負債	
未払金	1,322,257,706
未払解約金	29,707,533
未払利息	562
流動負債合計	1,351,965,801
負債合計	1,351,965,801
純資産の部	
元本等	
元本	57,068,137,122
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,442,864,833
元本等合計	125,511,001,955
純資産合計	125,511,001,955
負債純資産合計	126,862,967,756

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月24日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)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。

2023年11月24日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,068,137,122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) 2.1993円 (21,993円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2023年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	52,278,352,105円
期中追加設定元本額	5,860,267,527円
期中一部解約元本額	1,070,482,510円
期末元本額	57,068,137,122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	5,239,757,481円
世界経済インデックスファンド	19,505,015,401円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,807,176,457円
DC世界経済インデックスファンド	14,237,508,222円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,851,174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)	716,677,197円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,532,005,663円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	241,549,253円

区分	2023年11月24日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,663,073円
SMT インデックスバランス・オープン	181,402,124円
SMT 世界経済インデックス・オープン	472,716,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	624,486,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	998,530,810円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,039,295円
グローバル経済コア	820,460,552円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	93,261,205円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	79,029,639円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	32,709,166円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	35,183,936円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	155,517,739円
10資産分散投資ファンド	42,774,873円
グローバル10資産バランスファンド	3,356,149円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	237,609,804円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	161,353,966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）	22,227,442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）	220,416,015円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	219,295,696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）	141,790,532円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,998,378
コール・ローン	3,728,181
国債証券	1,834,587,818
派生商品評価勘定	8,329,349
未収入金	361,587
未収利息	4,805,159
前払費用	264,018
流動資産合計	1,856,074,490
資産合計	1,856,074,490
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,724,187
未払金	59,548
未払解約金	15,116
未払利息	2
流動負債合計	18,798,853
負債合計	18,798,853
純資産の部	
元本等	
元本	2,065,662,629
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	228,386,992
元本等合計	1,837,275,637
純資産合計	1,837,275,637
負債純資産合計	1,856,074,490

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取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取場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,065,662,629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 228,386,992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 (1万口当たり純資産額) 0.8894円 (8,894円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	1,985,563,482円
期中追加設定元本額	90,584,544円
期中一部解約元本額	10,485,397円
期末元本額	2,065,662,629円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	80,536,170円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,462,197,866円
私募世界物価連動債バッシュファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	522,928,593円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年11月24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	1,782,661,492	-	1,793,056,330	10,394,838
	アメリカドル	977,913,454	-	969,584,105	8,329,349
	カナダドル	29,536,285	-	29,685,288	149,003
	ユーロ	362,931,371	-	370,938,155	8,006,784
	イギリスポンド	367,759,844	-	376,685,141	8,925,297
	スウェーデンクローナ	12,688,345	-	13,405,543	717,198
	デンマーククローネ	2,733,312	-	2,796,098	62,786
	オーストラリアドル	19,546,210	-	20,098,128	551,918
	ニュージーランドドル	9,552,671	-	9,863,872	311,201
合計		1,782,661,492	-	1,793,056,330	10,394,838

（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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,666,708,825
投資証券	114,925,389,000
派生商品評価勘定	3,035,200
未収入金	73,770,098

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
未収配当金	684,922,913
前払金	9,875,220
差入委託証拠金	197,489,282
流動資産合計	118,561,190,538
資産合計	118,561,190,538
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,914,380
未払解約金	213,388,092
未払利息	1,514
流動負債合計	226,303,986
負債合計	226,303,986
純資産の部	
元本等	
元本	55,963,740,733
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,371,145,819
元本等合計	118,334,886,552
純資産合計	118,334,886,552
負債純資産合計	118,561,190,538

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,963,740,733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 2.1145円 (1万口当たり純資産額) (21,145円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月24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11月24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。</p>

(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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	64,195,508,562円
期中追加設定元本額	6,605,194,477円
期中一部解約元本額	14,836,962,306円
期末元本額	55,963,740,733円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,920,975,716円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,936,812円
SMT J-REITインデックス・オープン	17,678,416,284円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	26,717,008,959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)	764,413,759円
SMT インデックスバランス・オープン	23,680,269円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	211,531,584円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,451,230円
グローバル経済コア	280,132,420円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,420,966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)	132,020,059円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	512,705,093円
10資産分散投資ファンド	23,141,001円
グローバル10資産バランスファンド	3,367,475円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	349,917,923円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	8,742,120円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	420,963,439円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	69,920,512円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	508,771,557円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	280,460,857円

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2023年11月24日現在)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,400,907,220	-	3,391,032,000	9,875,220
合計		3,400,907,220	-	3,391,032,000	9,875,220

(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。

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11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	108,188,063
コール・ローン	45,610,412
投資証券	109,437,607,301
未収入金	230,944,580
未収配当金	207,531,490
流動資産合計	110,029,881,846
資産合計	110,029,881,846
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	978,628
未払解約金	139,552,943
未払利息	25
流動負債合計	140,531,596
負債合計	140,531,596
純資産の部	
元本等	
元本	42,396,247,727
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,493,102,523
元本等合計	109,889,350,250
純資産合計	109,889,350,250
負債純資産合計	110,029,881,846

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月24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> <p>為替予約取引</p>

2023年11月24日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,396,247,727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) 2,5920円 (25,920円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2023年11月24日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	36,697,065,105円
期中追加設定元本額	8,243,166,979円
期中一部解約元本額	2,543,984,357円
期末元本額	42,396,247,727円
期末元本額の内訳	

区分	2023年11月24日現在
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）	1,576,653,273円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,824,491円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,728,090,205円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,820,761,003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
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）	633,426,707円
SMT インデックスバランス・オープン	110,086,481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	9,956,087円
グローバル経済コア	237,306,140円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,497,088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）	171,181,596円
10資産分散投資ファンド	12,807,918円
グローバル10資産バランスファンド	2,878,205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）	1,646,536,126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）	239,677,252円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	78,248,921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）	61,280,541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）	50,516,427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）	92,759,157円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,287,825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）	59,670,797円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年11月24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	124,335,025	-	125,313,653	978,628
	アメリカドル	41,504,400	-	41,876,716	372,316
	オーストラリアドル	60,779,375	-	61,382,812	603,437
	香港ドル	22,051,250	-	22,054,125	2,875
合計		124,335,025	-	125,313,653	978,628

（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。

2【ファンドの現況】

【10資産分散投資ファンド】

【純資産額計算書】

(2023年12月29日現在)

資産総額	1,797,970,242円
負債総額	396,407円
純資産総額(-)	1,797,573,835円
発行済口数	1,678,459,872口
1口当たり純資産額(/)	1.0710円
(1万口当たり純資産額)	(10,710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12月29日現在)

資産総額	594,166,725,557円
負債総額	287,749,566円
純資産総額(-)	593,878,975,991円
発行済口数	244,296,624,247口
1口当たり純資産額(/)	2.4310円
(1万口当たり純資産額)	(24,310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12月29日現在)

資産総額	634,263,010,203円
負債総額	463,467,182円
純資産総額(-)	633,799,543,021円
発行済口数	116,009,010,515口
1口当たり純資産額(/)	5.4634円
(1万口当たり純資産額)	(54,634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12月29日現在)

資産総額	168,122,356,183円
負債総額	229,415,845円
純資産総額(-)	167,892,940,338円
発行済口数	42,510,882,266口

1口当たり純資産額（ / ）	3.9494円
（1万口当たり純資産額）	（39,494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12月29日現在）

資産総額	656,697,328,362円
負債総額	6,940,305,719円
純資産総額（ - ）	649,757,022,643円
発行済口数	484,133,624,230口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3421円
（1万口当たり純資産額）	（13,421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12月29日現在）

資産総額	302,074,794,805円
負債総額	205,827,710円
純資産総額（ - ）	301,868,967,095円
発行済口数	89,034,389,708口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3905円
（1万口当たり純資産額）	（33,905円）

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2023年12月29日現在）

資産総額	71,946,223,873円
負債総額	15,783,249円
純資産総額（ - ）	71,930,440,624円
発行済口数	84,651,163,913口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8497円
（1万口当たり純資産額）	（8,497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12月29日現在）

資産総額	124,902,319,014円
負債総額	5,851,385円
純資産総額（ - ）	124,896,467,629円
発行済口数	57,718,061,151口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1639円

（1万口当たり純資産額）	（21,639円）
--------------	-----------

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

純資産額計算書

（2023年12月29日現在）

資産総額	1,897,489,665円
負債総額	168,491円
純資産総額（ - ）	1,897,321,174円
発行済口数	2,057,743,582口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9220円
（1万口当たり純資産額）	（9,220円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2023年12月29日現在）

資産総額	117,902,813,870円
負債総額	74,840,108円
純資産総額（ - ）	117,827,973,762円
発行済口数	56,250,418,817口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0947円
（1万口当たり純資産額）	（20,947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12月29日現在）

資産総額	116,456,858,864円
負債総額	322,411,710円
純資産総額（ - ）	116,134,447,154円
発行済口数	41,616,415,795口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7906円
（1万口当たり純資産額）	（27,906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、
- 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、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、
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

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、）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12月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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

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

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

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

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発送します。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 2月22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12月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	63	218,373
単体型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

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期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の中間財務諸表について、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
	其他有価証券 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、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年3月31日）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金	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)

	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 2月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（2023年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2023年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023年3月末日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することが

あります。

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人

は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. 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8月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている10資産分散投資ファンドの2022年6月30日から2023年5月24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、10資産分散投資ファンドの2023年5月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年2月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている10資産分散投資ファンドの2023年5月25日から2023年11月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、10資産分散投資ファンドの2023年11月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年5月25日から2023年11月24日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

2. 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。