

## 【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4月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【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】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【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】	分散投資コア戦略ファンドA 10兆円を上限とします。 分散投資コア戦略ファンドS 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】

分散投資コア戦略ファンドA

分散投資コア戦略ファンドS

（以下、上記を総称して「分散投資コア戦略ファンド」又は「分散投資コアラップ」ということ、あるいは総称して又は個別に「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

愛称として、分散投資コア戦略ファンドAは「コアラップA」、分散投資コア戦略ファンドSは「コアラップS」という名称を用いることがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて、10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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 4月11日から2024年10月10日までとします。

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

( 8 ) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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 >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

###### <信託金限度額>

各ファンドにつき上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド  ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり (部分ヘッ ジ)  なし	日経225  TOPIX  その他 ( )	ブル・ベア 型  条件付運用 型  ロング・ ショート型/ 絶対収益追 求型  その他 ( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニア				
不動産投信	その他 ( )	中南米  アフリカ				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信、その他 資産(バンク ローン、デリバ ティブ、為替予 約取引等))資 産配分変更 型))		中近東 (中東)  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特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

## (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

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

ない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

## <ファンドの特色>

### 1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることで中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

### 2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
  - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド<sup>#1</sup>等に投資し、オルタナティブ運用<sup>#2</sup>を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格連動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

### 3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

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

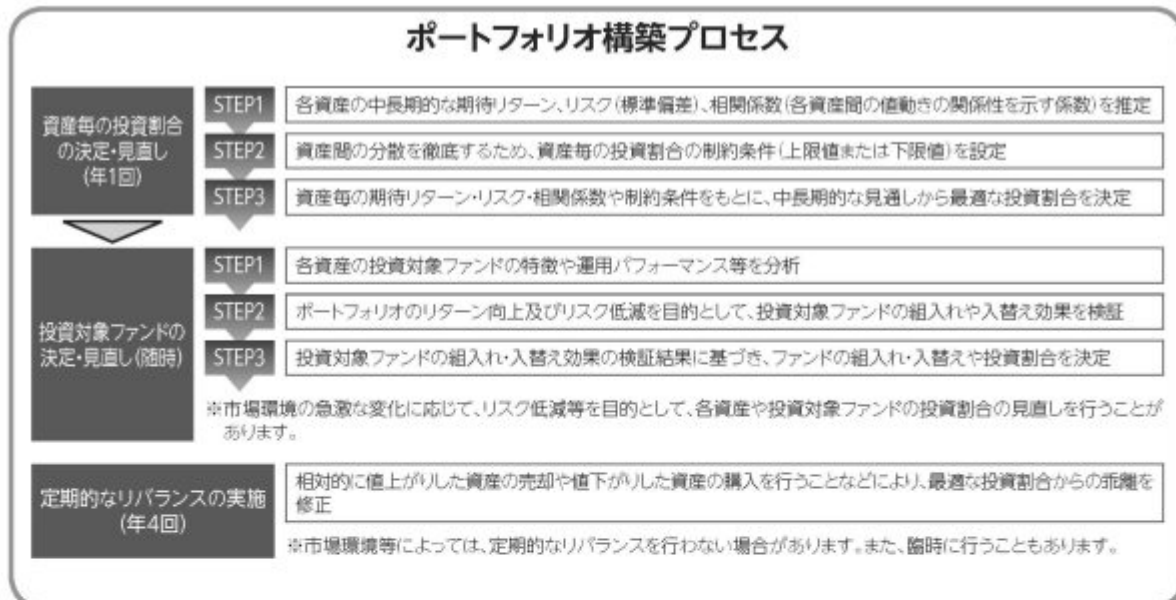
### 4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への投資割合の合計 <sup>#3</sup>	運用の特徴
分散投資コア戦略ファンドA 愛称:コアラップA	原則50%未満	安定性を重視
分散投資コア戦略ファンドS 愛称:コアラップS	原則75%未満	安定性と収益性のバランスを重視

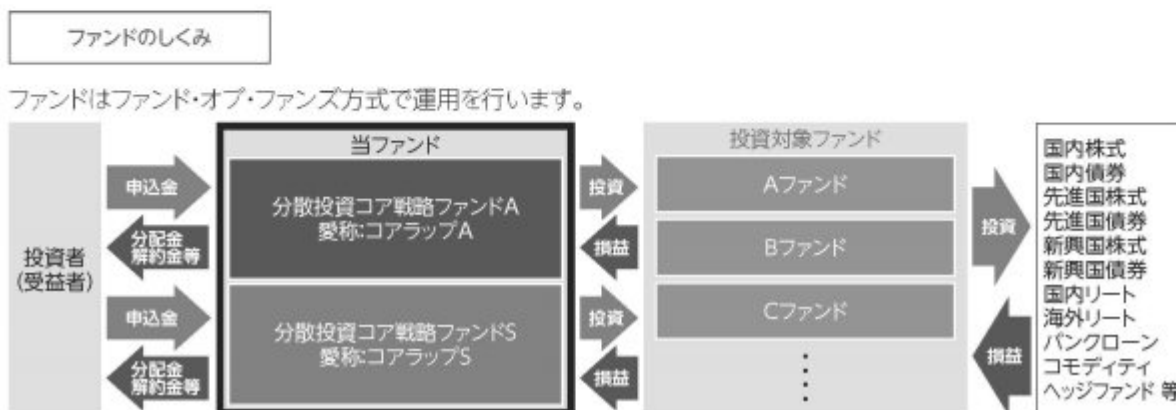
3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。

ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3 投資リスク (1)ファンドのリスク ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



#### ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

### 分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として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。
  - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

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

### 〈ご参考情報〉

#### バンクローン

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

#### コモディティ

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

#### ヘッジファンド

ヘッジとは元々“回避する”という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド\*などがあります。

※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

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

## (2)【ファンドの沿革】

2013年3月29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（2024年 1月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

## 投資対象

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

## 投資態度

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

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

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

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

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

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、以下の割合とします。

分散投資コア戦略ファンドA	分散投資コア戦略ファンドS
50%未満	75%未満

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

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

は、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等
2. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

### （参考）投資対象ファンドの概要

- ・全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
- ・投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2024年 1月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記

載内容が変更となることがあります。

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

#### 1. 国内株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、T O P I X (東証株価指数)(配当込み) ( )と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している株式
投資態度	<p>原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、T O P I X (東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>



主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）(配当込み)
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

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

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

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

## 2. 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

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

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）
決算日	年1回：1月22日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年4月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI 日本株最小分散インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本の株式市場に上場する日本株を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、指数値の変動幅を一定の制約条件下で最小化することを目指します。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。MSCI 日本株最小分散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 日本株最小分散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. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

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

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

#### 4. 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年1月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### 5. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

主要投資対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)を構成している国の株式
投資態度	<p>原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>

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

「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

## 6. 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------



運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界の主要国の株式
投資態度	主としてわが国を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）（配当込み、円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。 株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：5月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年7月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）」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に上場する銘柄を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、対円の為替変動を含めた指数値の変動幅を、一定の制約条件下で最小化することを目指します。「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コクサイ最小分散インデックス（JPY）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コクサイ最小分散インデックス（JPY）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。

## 7. 外国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------

運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

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

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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。

#### 8. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）

投資態度	<p>主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限

受託会社	三井住友信託銀行株式会社
------	--------------

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCI エマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCI エマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 9.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建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。

#### 10. J-REITインデックス マザーファンド

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

投資態度	<p>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。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新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。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

J P Xは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X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。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

## 11. グローバルREITインデックス マザーファンド

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



<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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&amp;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&amp;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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>S&amp;P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2008年1月9日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>(R)</sup>及びS&P<sup>(R)</sup>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<sup>(R)</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社

又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追隨する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

## 12. グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド

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

投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）及び「ブルームバーグ（Bloomberg<sup>(R)</sup>）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBS は、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index<sup>SM</sup>）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も保証するものではありません。

### 13. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2024年1月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares

投資態度	<p>主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。</p> <p>投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	<p>LBMA金価格（円ヘッジベース）（ ）（2024年1月31日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
決算日	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

#### 14. HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本国債及び国内外の上場投資信託証券を主要投資対象とし、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主として日本国債及び国内外の上場投資信託証券に投資し、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を組み合わせることで、HFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）（ ）の騰落率と概ね同程度の投資成果を目指します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、計量手法に基づいてHFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）の値動きを分析し、日本国債及び上場投資信託証券や上場投資証券の投資割合、株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引の取引量等を決定します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p> <p>なお、当該為替ヘッジとは別に、為替予約取引を活用することで収益の獲得を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年10月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

HFRI 総合指数（円ヘッジ・円ベース）（HFRI Weighted Composite Index JPY）は、HFRI Fund Weighted Composite Index の日本円ヘッジバージョンであり、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）が月次為替予約のコストを適用して算出します。

HFRI Fund Weighted Composite Indexは、HFRのデータベースに登録されたヘッジファンドを対象とするグローバルな等加重インデックスです。データベースへの登録条件は、運用会社がHFRからの質問項目に回答すること、5,000万米ドル以上の運用資産残高を有するか、12か月間以上の運用実績と1,000万米ドル以上の運用資産残高を有すること、毎月、手数料控除後の米ドルベースのパフォーマンスと運用資産残高をHFRに対して報告することとなっています。なお、ファンド・オブ・ヘッジファンドは対象としていません。

「HFRI Weighted Composite Index JPY」及び「HFRI」は、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）の商標です。その使用については、ライセンス契約に基づいてHFRから三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、その関連会社、又はそれらの金融商品とは一切関係ありません。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社のいかなる金融商品の組成にも関与しておらず、それらの金融商品への投資を支持、承認、推奨するものではありません。また、それらの当該金融商品に関連するいかなる種類又は性質の損害に対しても責任を負いません。

#### 15. G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------

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



## 16.F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社(SPC)の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます）に投資し、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

## 17.FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてUBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する円建債券（以下「円建債券」といいます。）に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」（以下「MAN AHL ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>MAN AHLファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。なお、MAN AHLファンドは、組入外貨建資産について対円での為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>円建債券への実質投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）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、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として、2016年1月20日から2025年10月10日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 18. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
------	-------------------------

運用の基本方針	この投資信託は、わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」といいます。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」といいます。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引に係る実質投資額は原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.88%（税抜 0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2013年4月2日
信託期間	2013年4月2日から2026年3月26日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

## 19. ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）

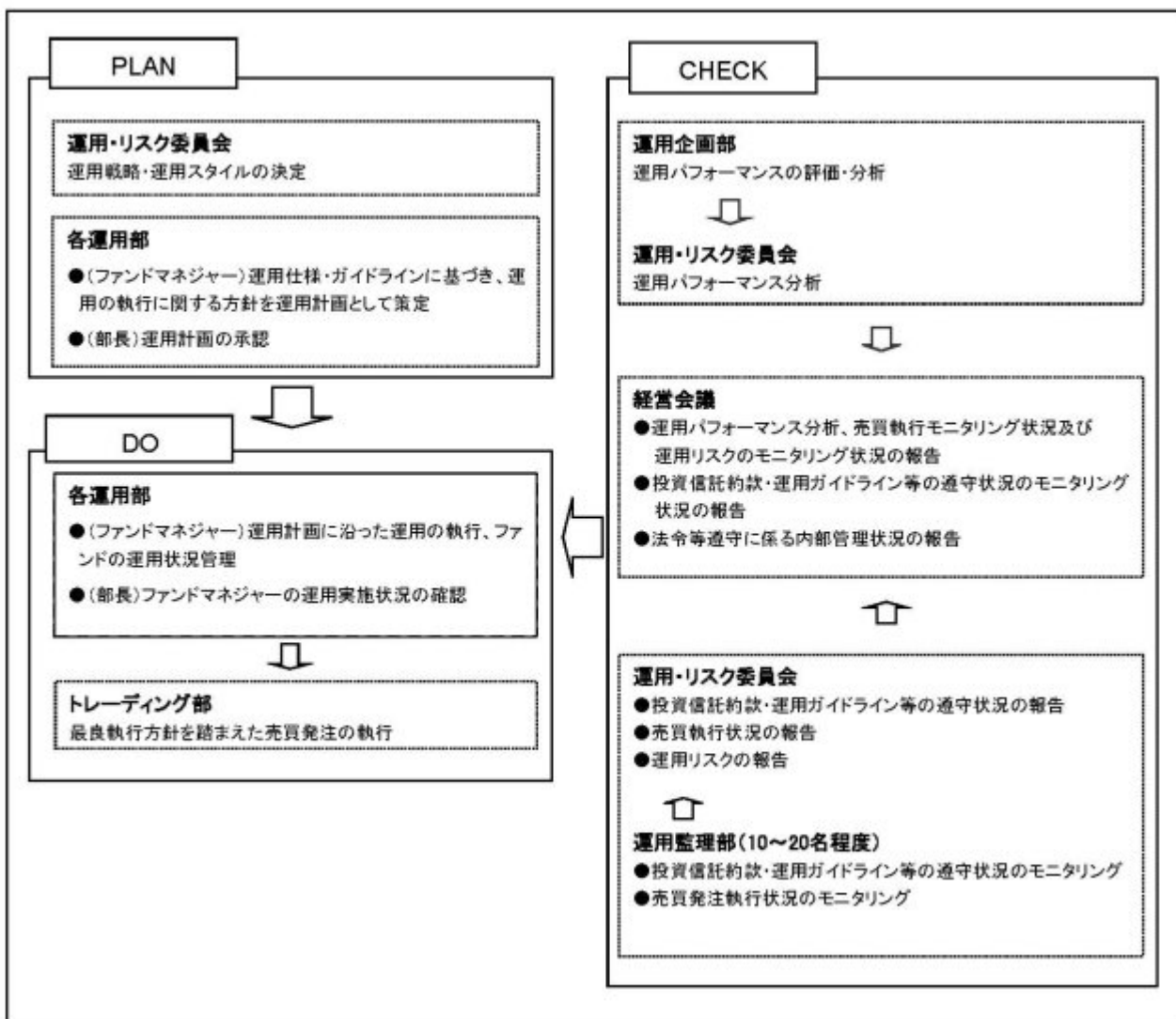
運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
------	--------------------------

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

収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.418%（税抜 0.38%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。 投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年7月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

##### イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

##### ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

##### ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

##### ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

##### ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

##### ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

##### ト．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる



場合には、制約されることがあります。

#### チ．外国為替予約取引の指図

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

#### リ．資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

#### <その他の投資制限>

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

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

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。

### 金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

### 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。

### 商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

### 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。

### 信用リスク

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

### 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。

### 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。

### 資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

す。

#### ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

#### 仕組み債券に係るリスク

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

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

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

#### ブローカーの信用リスク

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

#### 有価証券の貸付等に係るリスク

投資対象ファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻し

に相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短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

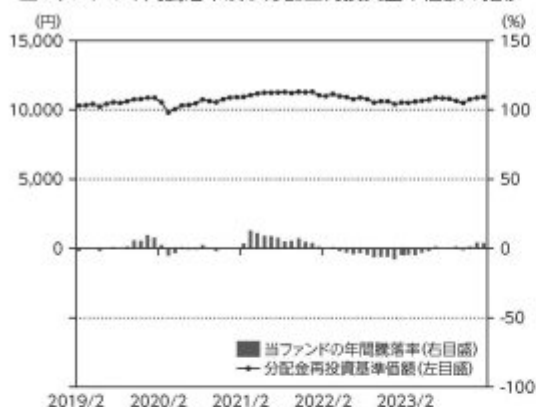
### 委託会社におけるリスク管理体制

- ・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。

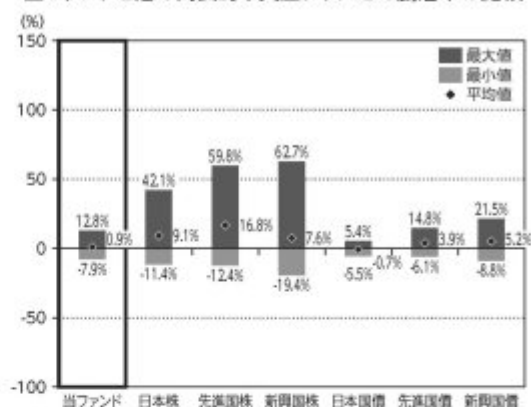
## 【参考情報】

## 分散投資コア戦略ファンドA

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

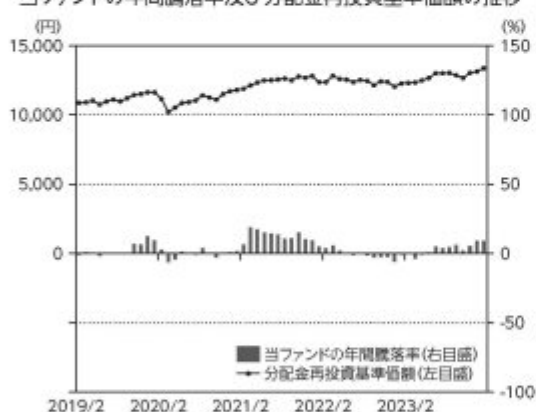


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

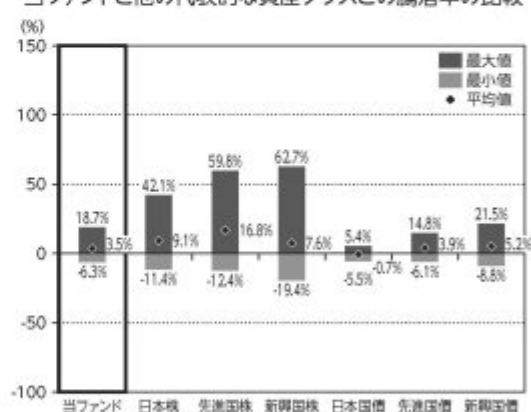


## 分散投資コア戦略ファンドS

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*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。

\*2019年2月～2024年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

\*各資産クラスの詳細については、後掲「各資産クラスの指数について」をご覧ください。

## 【参考情報】

### 各資産クラスの指数について

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

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

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

### (2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．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 0.935%（税抜 0.85%）を乗じて得た額（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 0.495% (税抜 0.45%)	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 0.385% (税抜 0.35%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

ロ．投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合は、マザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年 4月11日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

各投資対象ファンドの信託報酬（投資信託財産の純資産総額に対する年率）は下記の通りです。

当該信託報酬は、投資対象とする投資信託証券に係る信託財産の運用、基準価額の計算、運用財産の管理等の対価として、投資対象ファンドから支払われます。

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
H F リターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
F0Fs用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）

マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.88%	（税抜 0.8%）
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.418%	（税抜 0.38%）

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

実質的な信託報酬率：年率0.935%～1.42646%程度（税抜 0.85%～1.3145%程度）

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

品貸料の額は運用状況等によって変動するため、品貸料及び品貸料に対する信託報酬の額については、上記「実質的な信託報酬率」及び「投資対象とする投資信託証券」では考慮しておりません。

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用（ ）は、受益者の負担とし、日々投資信託財産で負担します（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》



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

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.25%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドにおいては、運用報酬（Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの純資産総額に対して年率1.0%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

## ・ FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

## ・ グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド

主要投資対象である米ドル建て債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 米ドル建て債券の評価額に対して年率上限1%程度（投資比率による加重平均）の発行・管理手数料等がかかります。
- ・ ETF、ETN、米ドル建てMMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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、2024年1月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 【参考情報】ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
分散投資コア 戦略ファンドA	1.04%	0.95%	0.09%
分散投資コア 戦略ファンドS	1.02%	0.95%	0.07%

※対象期間は2022年7月12日～2023年7月10日です。

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

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

※ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

以下は、2024年1月31日現在の状況について記載してあります。

## 【分散投資コア戦略ファンドA】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	11,243,953,656	12.58
親投資信託受益証券	日本	76,786,768,523	85.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,332,230,349	1.49
合計(純資産総額)		89,362,952,528	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	18,505,094,073	1.3615	25,194,731,572	1.3324	24,656,187,342	27.59
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)	20,252,480,457	0.8311	16,831,836,508	0.8350	16,910,821,181	18.92
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	1,507,038,928	5.0176	7,561,718,526	5.7975	8,737,058,185	9.78
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	1,869,978,613	2.2939	4,289,543,941	2.6208	4,900,839,948	5.48
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	3,766,660,315	0.9782	3,684,742,986	0.9803	3,692,457,106	4.13
日本	親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	3,027,614,598	1.1649	3,526,919,791	1.1066	3,350,358,314	3.75
日本	親投資信託受益証券	HFRリターン・ターゲット・マザーファンド(為替ヘッジあり)	3,497,633,373	0.8913	3,117,440,626	0.8939	3,126,534,472	3.50
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバースファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,696,217,407	1.2251	3,303,258,382	1.1301	3,046,995,291	3.41
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	1,006,149,778	2.5486	2,564,273,325	2.7672	2,784,217,665	3.12

日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	2,114,521,968	1.2433	2,629,045,860	1.2645	2,673,813,028	2.99
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	1,209,811,504	1.8303	2,214,317,996	2.0437	2,472,491,770	2.77
日本	投資信託受益証券	F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	2,306,207,307	1.0199	2,352,100,832	1.0302	2,375,854,767	2.66
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	2,557,239,900	0.8952	2,289,241,158	0.8324	2,128,646,492	2.38
日本	親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	1,017,119,866	2.1013	2,137,273,975	2.0928	2,128,628,455	2.38
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	518,368,608	3.2548	1,687,202,501	3.4506	1,788,682,718	2.00
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	310,316,270	3.7792	1,172,770,506	3.9411	1,222,987,451	1.37
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	721,928,779	1.3974	1,008,823,276	1.6033	1,157,468,411	1.30
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	395,863,625	2.0754	821,582,660	2.2146	876,679,583	0.98

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	12.58
親投資信託受益証券	85.93
合計	98.51

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3)【運用実績】

##### 【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第2期計算期間末	（2014年 7月10日）	16,628,969,770	16,628,969,770	10,208	10,208
第3期計算期間末	（2015年 7月10日）	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
第4期計算期間末	（2016年 7月11日）	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末	（2017年 7月10日）	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末	（2018年 7月10日）	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末	（2019年 7月10日）	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533
第8期計算期間末	（2020年 7月10日）	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末	（2021年 7月12日）	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
第10期計算期間末	（2022年 7月11日）	83,363,228,383	83,363,228,383	10,759	10,759
第11期計算期間末	（2023年 7月10日）	87,419,162,186	87,419,162,186	10,781	10,781
	2023年 1月末日	83,942,018,109		10,532	

2月末日	83,471,512,918		10,515
3月末日	84,929,769,174		10,596
4月末日	85,226,547,023		10,666
5月末日	86,769,502,129		10,723
6月末日	88,275,597,024		10,876
7月末日	88,190,505,431		10,837
8月末日	87,599,508,376		10,811
9月末日	87,035,337,384		10,659
10月末日	85,847,005,104		10,503
11月末日	87,833,682,161		10,765
12月末日	88,383,316,117		10,865
2024年 1月末日	89,362,952,528		10,932

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	4.0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	4.5
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0.2
第12期中間計算期間	2023年 7月11日～2024年 1月10日	0.8

(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2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	16,300,810,769	274,885,382	16,289,750,554
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	10,745,359,555	4,666,858,341	77,480,101,954
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	9,056,644,310	5,449,171,076	81,087,575,188
第12期中間計算期間	2023年 7月11日～2024年 1月10日	3,981,346,466	3,337,442,921	81,731,478,733

(注)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。

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

### (1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	28,321,180,737	13.88
親投資信託受益証券	日本	172,221,190,559	84.43
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,429,134,066	1.68
合計（純資産総額）		203,971,505,362	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### (2) 【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	7,002,050,964	5.0106	35,084,476,561	5.7975	40,594,390,463	19.90
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	26,151,867,452	1.3612	35,600,290,410	1.3324	34,844,748,193	17.08
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）	28,235,905,835	0.8311	23,466,861,340	0.8350	23,576,981,372	11.56
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	6,134,390,087	2.2821	13,999,291,618	2.6208	16,077,009,540	7.88
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	5,584,662,372	1.8299	10,219,373,675	2.0437	11,413,374,489	5.60
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	8,778,633,595	1.2211	10,719,648,019	1.1301	9,920,733,825	4.86
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	7,673,402,803	1.2442	9,547,407,706	1.2645	9,703,017,844	4.76
日本	親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）	6,382,953,534	1.1626	7,421,013,514	1.1066	7,063,376,380	3.46
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	7,817,123,298	0.8892	6,951,117,738	0.8324	6,506,973,433	3.19

日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	6,069,986,913	0.9783	5,938,599,836	0.9803	5,950,408,170	2.92
日本	投資信託受益証券	F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	5,768,846,156	1.0199	5,883,665,800	1.0302	5,943,065,309	2.91
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	1,419,462,050	3.7791	5,364,423,277	3.9411	5,594,241,885	2.74
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	1,368,649,263	3.2595	4,461,241,380	3.4506	4,722,661,146	2.32
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	1,578,869,574	2.5486	4,023,906,996	2.7672	4,369,047,885	2.14
日本	親投資信託受益証券	H Fリターン・ターゲット・マザーファンド(為替ヘッジあり)	4,681,330,813	0.8915	4,173,796,111	0.8939	4,184,641,613	2.05
日本	親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	1,879,598,173	2.1032	3,953,177,581	2.0928	3,933,623,056	1.93
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,391,852,241	1.3917	3,328,740,764	1.6033	3,834,856,697	1.88
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	1,042,725,547	2.0772	2,166,002,566	2.2146	2,309,219,996	1.13

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	13.88
親投資信託受益証券	84.43
合計	98.32

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3)【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	9,560,643,872	9,560,643,872	10,451	10,451
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
第10期計算期間末 (2022年 7月11日)	177,910,582,335	177,910,582,335	12,378	12,378
第11期計算期間末 (2023年 7月10日)	194,020,660,452	194,020,660,452	12,871	12,871
2023年 1月末日	178,805,211,389		12,270	
2月末日	181,819,948,071		12,309	

3月末日	184,362,226,350		12,347
4月末日	185,767,340,437		12,490
5月末日	189,997,113,663		12,662
6月末日	196,246,824,574		13,004
7月末日	196,745,070,257		13,012
8月末日	196,324,338,692		13,031
9月末日	195,056,230,015		12,861
10月末日	192,611,015,541		12,665
11月末日	197,810,238,338		13,038
12月末日	199,219,442,703		13,136
2024年 1月末日	203,971,505,362		13,372

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	5.4
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	1.4
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	4.0
第12期中間計算期間	2023年 7月11日～2024年 1月10日	2.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）

第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	9,258,266,615	164,756,557	9,148,260,389
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	17,903,179,345	10,752,318,272	143,734,318,300
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	20,898,235,211	13,888,973,046	150,743,580,465
第12期中間計算期間	2023年 7月11日～2024年 1月10日	7,694,151,096	5,993,090,179	152,444,641,382

(注)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	631,937,949,060	99.31
新株予約権証券	日本	7,416,600	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,363,866,236	0.69
合計(純資産総額)		636,309,231,896	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	3,983,460,000	0.63

(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	9,591,500	1,949.30	18,696,777,691	3,000.00	28,774,500,000	4.52
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,235,600	13,269.36	16,395,625,672	14,695.00	18,157,142,000	2.85
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,477,000	937.25	9,819,586,911	1,395.00	14,615,415,000	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,800	68,425.93	11,960,852,811	66,580.00	11,638,184,000	1.83
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,700	19,788.63	7,315,860,127	27,865.00	10,301,690,500	1.62



日本	株式	日立製作所	電気機器	847,900	8,178.23	6,934,324,874	11,675.00	9,899,232,500	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,111,700	163.02	8,495,732,000	186.30	9,708,409,710	1.53
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,223,200	5,692.47	6,963,034,634	7,700.00	9,418,640,000	1.48
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,662,100	2,005.56	7,344,564,183	2,565.00	9,393,286,500	1.48
日本	株式	信越化学工業	化学	1,586,600	4,422.30	7,016,436,431	5,875.00	9,321,275,000	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,800	5,934.04	6,544,066,304	8,310.00	9,164,268,000	1.44
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,500	4,709.00	6,557,290,389	6,031.00	8,398,167,500	1.32
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,242,300	5,002.25	6,214,307,124	6,752.00	8,388,009,600	1.32
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,329,400	4,457.15	5,925,346,796	5,927.00	7,879,353,800	1.24
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,259,700	1,347.78	5,741,177,085	1,675.50	7,137,127,350	1.12
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,550,500	4,530.99	7,025,314,811	4,362.00	6,763,281,000	1.06
日本	株式	第一三共	医薬品	1,526,200	4,532.60	6,917,654,880	4,423.00	6,750,382,600	1.06
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,700,500	3,122.76	5,310,259,360	3,930.00	6,682,965,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,800	4,361.40	5,904,468,686	4,897.00	6,629,558,600	1.04
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,139.04	5,894,116,380	18,945.00	6,515,185,500	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,322,200	2,087.53	4,847,672,632	2,702.00	6,274,584,400	0.99
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	864,200	5,568.12	4,811,970,587	6,460.00	5,582,732,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,819,400	1,517.14	4,277,444,429	1,963.50	5,535,891,900	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	950,300	5,369.65	5,102,787,574	5,502.00	5,228,550,600	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,600	26,672.84	5,617,302,040	23,885.00	5,030,181,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,589,300	2,752.52	4,374,587,204	3,015.00	4,791,739,500	0.75
日本	株式	S M C	機械	52,800	74,502.90	3,933,753,244	82,910.00	4,377,648,000	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,963,600	1,826.03	3,585,600,132	2,203.00	4,325,810,800	0.68
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,045,100	3,094.89	3,234,478,926	3,895.00	4,070,664,500	0.64
日本	株式	丸紅	卸売業	1,540,900	2,119.48	3,265,916,628	2,541.50	3,916,197,350	0.62

(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	3.29
		繊維製品	0.38
		パルプ・紙	0.16
		化学	5.86
		医薬品	4.49
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.67

鉄鋼	0.97
非鉄金属	0.66
金属製品	0.52
機械	5.35
電気機器	17.35
輸送用機器	8.55
精密機器	2.34
その他製品	2.41
電気・ガス業	1.37
陸運業	2.69
海運業	0.90
空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.58
卸売業	7.22
小売業	4.16
銀行業	7.10
証券、商品先物取引業	0.86
保険業	2.43
その他金融業	1.15
不動産業	1.92
サービス業	4.69
小計	99.31
新株予約権証券	0.00
合計	99.31

(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	156円		3,926,284,700	3,983,460,000	0.63

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

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

#### 日本株式最小分散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	4,966,283,950	99.48

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		26,192,481	0.52
合計(純資産総額)		4,992,476,431	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	25,535,000	0.51

(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	任天堂	その他製品	10,500	8,103.00	85,081,500	8,310.00	87,255,000	1.75
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	40,800	1,990.50	81,212,400	1,963.50	80,110,800	1.60
日本	株式	キヤノン	電気機器	19,400	3,770.00	73,138,000	4,080.00	79,152,000	1.59
日本	株式	積水ハウス	建設業	23,500	3,485.00	81,897,500	3,347.00	78,654,500	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	11,600	6,647.00	77,105,200	6,752.00	78,323,200	1.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	56,000	1,308.00	73,248,000	1,395.00	78,120,000	1.56
日本	株式	中外製薬	医薬品	14,600	5,598.00	81,730,800	5,347.00	78,066,200	1.56
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	12,100	6,347.00	76,798,700	6,444.00	77,972,400	1.56
日本	株式	京セラ	電気機器	35,700	2,219.50	79,236,150	2,182.50	77,915,250	1.56
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	25,700	2,982.00	76,637,400	3,000.00	77,100,000	1.54
日本	株式	日本郵政	サービス業	54,400	1,391.50	75,697,600	1,416.00	77,030,400	1.54
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	16,800	4,614.00	77,515,200	4,584.00	77,011,200	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	412,000	191.20	78,774,400	186.30	76,755,600	1.54
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	13,100	5,861.00	76,779,100	5,824.00	76,294,400	1.53
日本	株式	KDDI	情報・通信業	15,500	5,070.00	78,585,000	4,897.00	75,903,500	1.52
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	27,900	2,587.50	72,191,250	2,702.00	75,385,800	1.51
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	8,900	8,465.00	75,338,500	8,441.00	75,124,900	1.50
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	20,300	3,714.00	75,394,200	3,693.00	74,967,900	1.50
日本	株式	村田製作所	電気機器	24,800	3,051.00	75,664,800	3,015.00	74,772,000	1.50
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	19,000	3,831.00	72,789,000	3,930.00	74,670,000	1.50
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	48,600	1,504.50	73,118,700	1,535.50	74,625,300	1.49
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	17,100	4,381.00	74,915,100	4,362.00	74,590,200	1.49
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	19,000	3,801.00	72,219,000	3,895.00	74,005,000	1.48
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	9,600	7,373.00	70,780,800	7,700.00	73,920,000	1.48

日本	株式	日本マクドナルドホールディングス	小売業	11,200	6,740.00	75,488,000	6,560.00	73,472,000	1.47
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	4,900	14,800.00	72,520,000	14,695.00	72,005,500	1.44
日本	株式	セコム	サービス業	6,700	11,130.00	74,571,000	10,720.00	71,824,000	1.44
日本	株式	麒麟ホールディングス	食料品	33,000	2,108.00	69,564,000	2,123.00	70,059,000	1.40
日本	株式	花王	化学	11,700	5,757.00	67,356,900	5,863.00	68,597,100	1.37
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	39,500	1,710.00	67,545,000	1,725.00	68,137,500	1.36

(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	建設業	4.45
		食料品	7.00
		繊維製品	0.19
		パルプ・紙	0.30
		化学	5.78
		医薬品	9.91
		石油・石炭製品	0.84
		ゴム製品	1.56
		ガラス・土石製品	0.18
		鉄鋼	0.05
		機械	0.58
		電気機器	10.69
		輸送用機器	3.14
		精密機器	1.48
		その他製品	3.01
		電気・ガス業	3.66
		陸運業	7.12
		海運業	0.26
		空運業	0.64
		情報・通信業	10.65
		卸売業	3.81
		小売業	5.39
		銀行業	7.46
保険業	3.88		
その他金融業	0.50		
不動産業	1.80		
サービス業	5.13		
	小計	99.48	
合計		99.48	

(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。

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	ミニTOPIX先物	買建	10円		25,465,088	25,535,000	0.51

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	553,664,125,760	84.52
地方債証券	日本	32,813,231,063	5.01
特殊債券	日本	36,998,838,429	5.65
	国際機関	299,508,000	0.05
	小計	37,298,346,429	5.69
社債券	日本	28,302,170,000	4.32
	フランス	1,393,900,000	0.21
	韓国	99,535,000	0.02
	小計	29,795,605,000	4.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,520,729,227	0.23
合計(純資産総額)		655,092,037,479	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)	6,570,000,000	100.04	6,572,628,000	99.54	6,540,369,300	0.100	2028/3/20	1.00
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,970,000,000	100.15	5,978,955,000	99.85	5,961,462,900	0.005	2026/6/20	0.91
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	100.07	5,904,602,000	0.100	2026/9/20	0.90
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	99.98	5,809,007,400	99.57	5,785,539,900	0.005	2027/6/20	0.88
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.98	5,749,080,000	0.100	2027/3/20	0.88
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,680,000,000	100.05	5,683,361,000	99.82	5,670,287,200	0.005	2026/9/20	0.87
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	100.94	5,400,664,500	0.800	2033/9/20	0.82
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,550,000,000	98.02	5,440,214,200	96.59	5,361,133,500	0.200	2032/9/20	0.82

日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	5,310,000,000	100.08	5,314,248,000	99.76	5,297,733,900	0.005	2026/12/20	0.81
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	97.25	5,174,019,200	0.100	2031/6/20	0.79
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	5,157,416,000	0.100	2025/6/20	0.79
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,200,000,000	100.68	5,235,469,600	98.90	5,143,112,000	0.500	2032/12/20	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	99.67	5,143,075,200	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	99.78	5,078,954,700	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.47	5,043,594,000	0.300	2025/12/20	0.77
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	99.88	5,034,103,200	0.005	2026/3/20	0.77
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	5,020,000,000	100.37	5,038,574,000	100.13	5,026,526,000	0.100	2025/9/20	0.77
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,160,000,000	98.51	5,083,325,000	97.16	5,013,610,800	0.200	2032/3/20	0.77
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	5,077,000,000	97.85	4,968,275,600	96.67	4,908,088,210	0.100	2031/12/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	4,970,000,000	98.68	4,904,523,900	98.09	4,875,222,100	0.100	2030/9/20	0.74
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	96.95	4,847,600,000	0.100	2031/9/20	0.74
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,980,000,000	98.37	4,898,853,100	96.88	4,824,873,000	0.200	2032/6/20	0.74
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	4,930,000,000	97.58	4,810,730,100	97.53	4,808,229,000	0.400	2033/6/20	0.73
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	99.39	4,805,651,550	0.100	2028/6/20	0.73
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	100.09	4,804,512,000	0.100	2025/12/20	0.73
日本	国債証券	第370回利付国債（10年）	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	98.66	4,795,070,400	0.500	2033/3/20	0.73
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	100.08	4,764,046,000	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	97.58	4,732,727,000	0.100	2031/3/20	0.72
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	4,810,000,000	98.55	4,740,410,400	97.85	4,707,017,900	0.100	2030/12/20	0.72
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	100.85	4,599,124,800	100.49	4,582,389,600	0.400	2025/3/20	0.70

(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	84.52
地方債証券	5.01
特殊債券	5.69
社債券	4.55
合計	99.77

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	34,382,290,892	48.44
	フランス	5,966,448,796	8.41
	中国	5,773,922,959	8.13
	イタリア	5,313,380,989	7.49
	ドイツ	4,625,088,037	6.52
	イギリス	3,795,091,357	5.35
	スペイン	3,511,077,621	4.95
	カナダ	1,471,663,819	2.07
	ベルギー	1,267,124,531	1.79
	オランダ	1,074,456,357	1.51
	オーストラリア	1,007,029,530	1.42
	オーストリア	851,233,832	1.20
	メキシコ	623,315,232	0.88
	アイルランド	412,982,590	0.58
	ポーランド	382,086,752	0.54
	フィンランド	372,603,880	0.52
	マレーシア	363,944,093	0.51
	シンガポール	306,378,418	0.43
	イスラエル	230,243,652	0.32
	デンマーク	198,922,658	0.28
ニュージーランド	174,613,789	0.25	
スウェーデン	148,136,663	0.21	
ノルウェー	127,824,209	0.18	
	小計	72,379,860,656	101.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,397,793,872	1.97
合計(純資産総額)		70,982,066,784	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	148,864,115	0.21
	買建	ドイツ	198,058,857	0.28

(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		73,987,635,257	104.23

(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	12,965.37	653,455,147	13,162.78	663,404,393	1.250	2028/4/30	0.93
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	3,800,000	13,920.99	528,997,871	14,148.08	537,627,244	3.500	2033/2/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	3,700,000	14,350.96	530,985,765	14,452.69	534,749,730	3.125	2025/8/15	0.75
アメリカ	国債証券	T 4.25% 10/15/25	3,300,000	14,622.14	482,530,860	14,706.00	485,298,290	4.250	2025/10/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 4.875% 10/31/30	2,900,000	15,594.72	452,247,038	15,478.91	448,888,597	4.875	2030/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/15/26	2,890,000	14,708.89	425,086,939	14,811.77	428,060,216	4.375	2026/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 4.125% 10/31/27	2,800,000	14,791.69	414,167,538	14,780.93	413,866,219	4.125	2027/10/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	2,930,000	13,905.14	407,420,792	14,087.27	412,757,261	2.875	2028/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	2,730,000	14,368.05	392,247,836	14,365.66	392,182,625	2.750	2025/8/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	11,989.87	382,477,122	12,216.39	389,702,864	1.125	2031/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	2,780,000	13,965.01	388,227,376	13,994.19	389,038,629	3.375	2033/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 3.625% 05/15/26	2,640,000	14,597.57	385,375,959	14,552.69	384,191,149	3.625	2026/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.625% 04/15/25	2,600,000	14,305.43	371,941,274	14,403.12	374,481,322	2.625	2025/4/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	2,500,000	14,612.06	365,301,524	14,840.30	371,007,558	4.125	2032/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	2,730,000	13,324.45	363,757,668	13,547.51	369,847,042	2.875	2032/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/31/27	2,500,000	14,132.23	353,305,881	14,288.43	357,210,770	3.125	2027/8/31	0.50
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	2,130,000	16,284.81	346,866,542	16,307.57	347,351,283	3.500	2026/4/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	2,350,000	13,995.05	328,883,905	14,187.27	333,401,041	3.125	2028/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	2,620,000	11,929.07	312,541,676	12,160.19	318,597,104	1.375	2031/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	2,630,000	11,810.34	310,611,943	12,041.75	316,698,062	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	2,390,000	13,022.72	311,243,206	13,124.45	313,674,524	3.625	2053/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	2,290,000	13,439.73	307,769,821	13,599.09	311,419,290	1.125	2026/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.75% 03/31/26	2,200,000	13,542.32	297,931,116	13,691.89	301,221,596	0.750	2026/3/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	2,150,000	13,494.48	290,131,424	13,651.83	293,514,414	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	2,000,000	14,335.98	286,719,621	14,438.28	288,765,726	3.000	2025/7/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.25% 06/30/29	2,030,000	14,003.41	284,269,368	14,210.04	288,463,911	3.250	2029/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 4% 02/28/30	1,950,000	14,527.91	283,294,272	14,731.65	287,267,314	4.000	2030/2/28	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	2,260,000	12,355.00	279,223,158	12,582.96	284,374,902	1.875	2032/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	2,020,000	13,771.71	278,188,695	13,915.80	281,099,349	1.625	2026/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	2,000,000	13,872.86	277,457,399	14,046.35	280,927,132	2.750	2028/2/15	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率



種類	投資比率（％）
国債証券	101.97
合計	101.97

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	4	アメリカドル	432,722.14	63,848,151	431,531.24	63,672,434	0.09
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	3	アメリカドル	336,052.49	49,584,545	334,875	49,410,806	0.07
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	2	アメリカドル	246,536.85	36,376,512	242,500	35,780,875	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	2	ユーロ	212,204.2	33,946,306	211,930	33,902,442	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	3	ユーロ	354,344.2	56,684,441	353,520	56,552,594	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	5	ユーロ	678,248.4	108,499,397	672,650	107,603,821	0.15

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	237,833,000.00	33,457,010,815	35,059,771,161	49.39
	カナダドル	売建	13,735,000.00	1,460,375,764	1,510,395,369	2.13
	メキシコペソ	売建	74,921,000.00	618,349,005	643,301,673	0.91
	ユーロ	売建	150,060,000.00	23,397,643,954	23,988,336,497	33.79
	イギリスポンド	売建	21,294,000.00	3,820,379,492	3,985,436,145	5.61
	スウェーデンクローナ	売建	10,705,000.00	150,991,884	151,600,998	0.21
	ノルウェークローネ	売建	9,284,000.00	128,121,056	131,160,638	0.18
	デンマーククローネ	売建	9,500,000.00	198,744,750	203,732,250	0.29
	ポーランドズロチ	売建	10,588,000.00	379,541,288	388,900,415	0.55
	オーストラリアドル	売建	10,549,000.00	1,015,279,389	1,024,177,091	1.44
	ニュージーランドドル	売建	1,980,000.00	176,680,350	178,969,428	0.25
	シンガポールドル	売建	2,846,000.00	304,151,617	313,331,793	0.44
	マレーシアリングット	売建	11,739,000.00	360,408,430	365,944,542	0.52
	イスラエルシェケル	売建	5,871,000.00	228,120,053	236,623,609	0.33
	オフショア人民元	売建	283,162,000.00	5,624,860,040	5,805,953,648	8.18

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

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

## 外国株式インデックス 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	468,405,705,091	70.11
	イギリス	25,383,785,975	3.80
	カナダ	22,425,375,011	3.36
	スイス	20,823,440,313	3.12
	フランス	20,241,518,713	3.03
	ドイツ	15,611,026,295	2.34
	オランダ	12,866,658,159	1.93
	オーストラリア	12,487,210,617	1.87
	アイルランド	12,134,785,043	1.82
	デンマーク	6,312,925,552	0.94
	スウェーデン	5,624,189,119	0.84
	スペイン	4,635,111,683	0.69
	イタリア	3,621,837,134	0.54
	香港	2,768,402,803	0.41
	シンガポール	2,002,484,794	0.30
	フィンランド	1,957,838,604	0.29
	ジャージー	1,647,330,326	0.25
	ベルギー	1,369,044,702	0.20
	イスラエル	1,334,639,163	0.20
	ノルウェー	1,165,718,642	0.17
	バミューダ	882,382,632	0.13
	キュラソー	803,064,992	0.12
	ケイマン	794,574,111	0.12
	ニュージーランド	520,479,683	0.08
	リベリア	385,491,987	0.06
	ルクセンブルク	360,461,086	0.05
	オーストリア	353,160,771	0.05
ポルトガル	320,371,462	0.05	
パナマ	174,508,964	0.03	
マン島	89,011,277	0.01	
	小計	647,502,534,704	96.92
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	67,652,935	0.01
	香港	56,587,356	0.01
	小計	124,240,291	0.02
投資証券	アメリカ	10,879,921,350	1.63
	オーストラリア	790,574,269	0.12

	フランス	265,442,656	0.04
	シンガポール	247,198,830	0.04
	イギリス	198,321,181	0.03
	香港	124,086,478	0.02
	カナダ	56,874,622	0.01
	ベルギー	55,778,020	0.01
	小計	12,618,197,406	1.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,848,909,389	1.17
合計(純資産総額)		668,093,881,790	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	5,588,478,382	0.84
	買建	カナダ	197,751,405	0.03
	買建	ドイツ	1,003,358,296	0.15
	買建	イギリス	444,659,601	0.07
	買建	オーストラリア	349,224,617	0.05

(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		92,942,136	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	25,867.06	31,317,695,367	27,745.30	33,591,708,802	5.03
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	546,594	49,157.59	26,869,244,438	60,287.45	32,952,760,905	4.93
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	191,277	57,718.06	11,040,138,365	92,623.03	17,716,656,648	2.65
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	719,107	17,797.62	12,798,394,204	23,460.44	16,870,573,818	2.53

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	459,452	18,396.54	8,452,330,051	22,347.92	10,267,797,918	1.54
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	172,117	38,923.39	6,699,378,671	59,028.85	10,159,869,092	1.52
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	405,242	18,500.01	7,496,984,981	22,582.52	9,151,388,609	1.37
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	28,791.44	6,369,098,594	28,269.10	6,253,549,952	0.94
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	117,145.34	4,025,934,010	178,264.00	6,126,399,163	0.92
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	63,702.25	3,986,487,021	95,166.79	5,955,538,281	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	20,219.51	4,529,313,691	26,008.63	5,826,117,084	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	101,297	47,524.29	4,814,068,080	57,123.98	5,786,488,055	0.87
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	72,060	71,301.26	5,137,969,447	74,307.65	5,354,609,655	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,044	33,218.92	4,120,608,544	40,893.48	5,072,591,143	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	309,867	15,498.57	4,802,497,723	15,470.61	4,793,833,833	0.72
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	22,753.62	4,255,747,155	23,426.51	4,381,601,379	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	55,202.83	3,581,007,844	65,687.78	4,261,166,581	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	183,167	21,496.03	3,937,364,492	23,237.64	4,256,370,546	0.64
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	12,275.65	3,106,095,742	16,056.37	4,062,727,751	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	43,156.27	3,325,924,461	52,690.10	4,060,668,322	0.61
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,384	108,453.91	3,403,717,797	128,183.96	4,022,925,432	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,608	75,252.98	2,604,355,243	103,394.18	3,578,266,024	0.54
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	16,348.48	3,239,566,475	17,950.93	3,557,103,030	0.53
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	207,970	19,087.11	3,969,547,446	16,950.96	3,525,292,212	0.53
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	20,351.06	2,807,042,269	24,333.94	3,356,405,506	0.50
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	35,550	62,133.38	2,208,841,740	92,655.49	3,293,902,954	0.49
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	126,574	18,573.65	2,350,941,572	25,387.45	3,213,391,476	0.48
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	31,711.27	2,367,627,174	42,454.56	3,169,742,471	0.47

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,373	22,713.57	3,233,799,193	22,150.20	3,153,591,279	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	321,355	8,866.65	2,849,343,921	8,838.24	2,840,214,222	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.56
		素材	3.76
		資本財	6.71
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.70
		耐久消費財・アパレル	1.51
		消費者サービス	2.09
		メディア・娯楽	6.29
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.61
		生活必需品流通・小売り	1.70
		食品・飲料・タバコ	3.42
		家庭用品・パーソナル用品	1.62
		ヘルスケア機器・サービス	4.23
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
		銀行	5.37
		金融サービス	6.70
		保険	3.04
		エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	10.59
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.48		
電気通信サービス	1.19		
公益事業	2.51		
半導体・半導体製造装置	7.10		
不動産管理・開発	0.33		
		小計	96.92
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.89
合計			98.83

(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	153	アメリカドル	36,192,848.65	5,340,254,818	37,875,150	5,588,478,382	0.84
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	7	カナダドル	1,736,739.5	191,145,549	1,796,760	197,751,405	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	15	スイスフラン	1,667,125	285,361,786	1,704,900	291,827,733	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	95	ユーロ	4,339,874	694,249,644	4,447,900	711,530,563	0.11
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	19	オーストラリアドル	3,520,483	342,050,128	3,594,325	349,224,617	0.05
	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	31	イギリスポンド	2,363,861.25	442,822,128	2,373,670	444,659,601	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。

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	630,000.00	92,817,900	92,942,136	0.01

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

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

## 外国株式最小分散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	11,808,841,065	64.96
	スイス	1,488,193,631	8.19
	カナダ	1,465,331,781	8.06
	ドイツ	591,688,299	3.25
	フランス	298,684,815	1.64
	オランダ	284,576,194	1.57
	アイルランド	248,812,986	1.37
	香港	245,894,370	1.35
	スペイン	243,475,418	1.34
	オーストラリア	233,262,088	1.28
	シンガポール	205,157,251	1.13
	フィンランド	161,195,221	0.89
	イスラエル	105,023,509	0.58
	イタリア	55,144,216	0.30
	イギリス	54,921,132	0.30
ベルギー	53,054,332	0.29	

	ノルウェー	47,019,176	0.26
	デンマーク	34,541,466	0.19
	ニュージーランド	28,826,157	0.16
	バミューダ	23,604,459	0.13
	スウェーデン	16,701,622	0.09
	ケイマン	10,013,177	0.06
	小計	17,703,962,365	97.39
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	28,383,499	0.16
投資証券	アメリカ	48,436,644	0.27
	香港	8,996,083	0.05
	小計	57,432,727	0.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		388,561,768	2.14
合計(純資産総額)		18,178,340,359	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	146,104,010	0.80
	買建	カナダ	113,000,803	0.62

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	11,131	18,477.68	205,675,128	27,720.21	308,553,752	1.70
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	17,683	15,141.69	267,750,650	15,848.63	280,251,330	1.54
アメリカ	株式	WASTE MANAGEMENT INC	商業・専門サービス	10,037	24,966.93	250,593,132	27,608.08	277,102,304	1.52
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	35,593	6,998.29	249,090,367	7,708.01	274,351,271	1.51
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	4,755	47,934.56	227,928,873	57,123.98	271,624,537	1.49
アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	ソフトウェア・サービス	3,275	69,881.15	228,860,784	82,859.65	271,365,365	1.49

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	14,985	17,111.37	256,413,932	17,950.93	268,994,731	1.48
ドイツ	株式	DEUTSCHE TELEKOM	電気通信サービス	72,642	3,420.15	248,447,161	3,659.31	265,819,869	1.46
アメリカ	株式	MOTOROLA SOLUTIONS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,205	42,374.88	220,561,274	48,325.57	251,534,623	1.38
アメリカ	株式	REPUBLIC SERVICES INC	商業・専門サービス	9,456	21,664.76	204,862,033	25,508.44	241,207,847	1.33
カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	10,308	21,011.12	216,582,625	23,113.70	238,256,097	1.31
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	5,480	43,311.82	237,348,812	43,475.60	238,246,329	1.31
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	3,183	72,534.10	230,876,054	74,307.65	236,521,267	1.30
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	37,678	5,534.60	208,532,678	6,266.44	236,107,247	1.30
アメリカ	株式	T-MOBILE US INC	電気通信サービス	9,745	21,099.64	205,616,089	23,858.83	232,504,347	1.28
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	9,248	28,509.61	263,656,883	25,027.43	231,453,682	1.27
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	9,687	23,662.59	229,219,543	23,426.51	226,932,636	1.25
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	12,740	19,927.61	253,877,769	16,950.96	215,955,295	1.19
アメリカ	株式	CENCORA INC	ヘルスケア機器・サービス	6,573	27,581.52	181,293,340	32,539.20	213,880,171	1.18
アメリカ	株式	MARSH & MCLENNAN COS	保険	7,180	26,542.76	190,577,085	28,481.57	204,497,719	1.12
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,808	48,355.52	232,493,364	42,227.63	203,030,488	1.12
アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	公益事業	14,730	14,548.43	214,298,374	13,379.83	197,084,955	1.08
アメリカ	株式	MCKESSON CORP	ヘルスケア機器・サービス	2,627	57,880.91	152,053,161	72,302.45	189,938,539	1.04
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	7,231	21,872.69	158,161,480	25,982.32	187,878,209	1.03
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	7,498	24,513.95	183,805,649	23,910.47	179,280,760	0.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2,961	45,626.88	135,101,211	60,287.45	178,511,153	0.98
アメリカ	株式	GENERAL MILLS INC	食品・飲料・タバコ	18,192	13,084.73	238,037,481	9,642.39	175,414,404	0.96
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	7,064	22,558.91	159,356,207	24,432.80	172,593,331	0.95
カナダ	株式	BARRICK GOLD CORP	素材	74,336	2,858.25	212,471,482	2,312.36	171,891,638	0.95
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,333	22,631.21	165,954,729	23,237.64	170,401,684	0.94

(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	0.92
		素材	5.01
		資本財	1.63
		商業・専門サービス	6.16
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	0.17
		耐久消費財・アパレル	0.17
		消費者サービス	2.22
		メディア・娯楽	1.05
		一般消費財・サービス流通・小売り	2.70
		生活必需品流通・小売り	1.67
		食品・飲料・タバコ	7.88
		家庭用品・パーソナル用品	2.13
		ヘルスケア機器・サービス	4.86
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	11.96
		銀行	1.04
		金融サービス	4.15
		保険	5.89
		ソフトウェア・サービス	11.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.94
電気通信サービス	8.92		
公益事業	7.24		
半導体・半導体製造装置	1.94		
不動産管理・開発	0.53		
	小計	97.39	
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.16
投資証券			0.32
合計			97.86

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	4	アメリカドル	941,018.2	138,847,235	990,200	146,104,010	0.80
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	4	カナダドル	987,998	108,739,060	1,026,720	113,000,803	0.62

(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	144,396,917,652	46.35
	フランス	25,040,656,252	8.04
	中国	24,226,373,814	7.78
	イタリア	22,293,001,189	7.16
	ドイツ	19,477,754,395	6.25
	イギリス	15,939,273,171	5.12
	スペイン	14,721,005,382	4.73
	カナダ	6,156,993,563	1.98
	ベルギー	5,310,235,191	1.70
	オランダ	4,507,007,331	1.45
	オーストラリア	4,222,023,801	1.36
	オーストリア	3,569,610,247	1.15
	メキシコ	2,604,205,638	0.84
	アイルランド	1,738,105,759	0.56
	ポーランド	1,587,703,404	0.51
	フィンランド	1,561,106,394	0.50
	マレーシア	1,526,301,685	0.49
	シンガポール	1,274,565,808	0.41
	イスラエル	964,079,626	0.31
	デンマーク	832,116,734	0.27
ニュージーランド	721,908,175	0.23	
スウェーデン	623,205,614	0.20	
ノルウェー	536,905,565	0.17	
	小計	303,831,056,390	97.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,722,450,540	2.48
合計(純資産総額)		311,553,506,930	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	1,929,808,737	0.62
	買建	ドイツ	1,777,960,169	0.57

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,337,979,019	1.39

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	14,949.85	2,092,979,096	14,840.30	2,077,642,328	4.125	2032/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,070.17	1,917,765,043	13,994.19	1,907,408,820	3.375	2033/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,549.51	1,747,887,628	13,378.63	1,725,843,934	2.750	2032/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,846.35	1,618,639,150	13,976.90	1,633,900,103	2.375	2027/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	14,355.90	1,600,683,038	14,438.28	1,609,868,920	3.000	2025/7/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,000.69	1,568,078,329	14,148.08	1,584,585,562	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,195.78	1,534,229,134	12,160.19	1,529,752,510	1.375	2031/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,618.96	1,466,762,249	13,915.80	1,498,732,670	1.625	2026/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,748.28	1,474,828,559	14,848.08	1,484,808,325	4.500	2026/7/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,665.95	1,484,450,177	12,582.96	1,474,722,943	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,259.37	1,454,456,007	14,452.69	1,474,174,933	3.125	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,806.59	1,410,887,939	11,892.18	1,421,116,005	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	14,035.44	1,411,965,609	14,087.27	1,417,180,222	2.875	2028/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,712.92	1,385,005,740	13,547.51	1,368,298,580	2.875	2032/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	14,077.16	1,295,098,736	14,831.08	1,364,459,403	4.125	2030/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,993.91	1,337,321,292	12,041.75	1,342,655,286	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	13,350.39	1,268,287,353	13,651.83	1,296,924,161	0.750	2026/4/30	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	14,131.69	1,271,852,412	14,359.32	1,292,339,148	2.875	2025/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,679.21	1,217,204,508	12,940.01	1,242,241,897	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,846.36	1,220,404,203	13,029.93	1,237,843,639	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,534.21	1,245,695,144	11,296.22	1,219,991,819	2.875	2052/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	14,094.48	1,192,393,285	14,337.28	1,212,934,067	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,869.98	1,178,948,993	14,197.24	1,206,765,956	1.125	2025/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	14,156.44	1,189,141,179	14,187.27	1,191,731,381	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,627.19	1,189,191,264	14,642.03	1,190,397,203	3.875	2029/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,879.15	1,159,124,240	13,111.48	1,180,034,005	1.250	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	13,806.10	1,134,861,954	14,056.15	1,155,415,924	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,615.23	1,089,218,715	13,997.36	1,119,789,222	0.375	2025/4/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	12,132.81	1,119,859,058	12,123.30	1,118,981,268	1.250	2031/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 03/31/28	8,480,000	12,988.43	1,101,419,253	13,193.90	1,118,843,524	1.250	2028/3/31	0.36

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.52
合計	97.52

(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	50	アメリカドル	5,404,155.68	797,383,171	5,394,140.5	795,905,431	0.26
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	33	アメリカドル	3,686,358.09	543,922,136	3,683,625	543,518,869	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	33	アメリカドル	4,015,686.15	592,514,491	4,001,250	590,384,437	0.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	19	ユーロ	2,015,784.9	322,465,111	2,013,335	322,073,200	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	27	ユーロ	3,192,446.7	510,695,698	3,181,680	508,973,349	0.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	44	ユーロ	5,959,942.4	953,411,985	5,919,320	946,913,620	0.30

(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	14,570,000.00	2,132,852,191	2,143,171,236	0.69
	カナダドル	買建	1,510,000.00	164,493,475	165,722,047	0.05
	ユーロ	買建	8,940,000.00	1,427,967,370	1,426,802,544	0.46
	イギリスポンド	買建	1,270,000.00	236,493,648	237,199,678	0.08
	オフショア人民元	買建	17,830,000.00	363,908,765	365,083,514	0.12

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

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

### 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	28,818,560,433	16.94
	台湾	26,420,580,438	15.53
	ケイマン	22,780,668,310	13.39
	韓国	19,898,598,841	11.70

	中国	16,229,988,021	9.54
	ブラジル	8,787,719,952	5.17
	サウジアラビア	7,084,573,890	4.17
	南アフリカ	4,559,960,715	2.68
	メキシコ	4,293,621,050	2.52
	インドネシア	3,145,986,856	1.85
	タイ	2,816,758,250	1.66
	マレーシア	2,235,530,607	1.31
	アラブ首長国連邦	2,101,529,866	1.24
	カタール	1,437,650,105	0.85
	ポーランド	1,426,519,934	0.84
	香港	1,354,498,910	0.80
	クウェート	1,349,393,679	0.79
	トルコ	1,151,411,793	0.68
	フィリピン	1,009,816,050	0.59
	ギリシャ	840,631,911	0.49
	チリ	763,871,774	0.45
	バミューダ	642,846,826	0.38
	アメリカ	536,735,840	0.32
	ハンガリー	434,964,203	0.26
	チェコ	246,470,299	0.14
	ルクセンブルク	221,541,458	0.13
	イギリス	180,000,073	0.11
	コロンビア	166,776,817	0.10
	エジプト	153,909,493	0.09
	ペルー	37,919,966	0.02
	シンガポール	26,182,880	0.02
	オランダ	18,262,488	0.01
	ロシア	125	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	161,173,481,853	94.75
投資信託受益証券	ブラジル	373,932,784	0.22
	メキシコ	134,020,704	0.08
	小計	507,953,488	0.30
投資証券	メキシコ	172,206,902	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,243,016,865	4.85
合計(純資産総額)		170,096,659,108	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	8,254,816,069	4.85

(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		604,856,299	0.36

(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	2,640.42	10,507,285,981	3,040.76	12,100,401,914	7.11
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	7,804.00	6,022,079,494	8,239.87	6,358,419,284	3.74
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,083,100	5,797.93	6,279,739,229	5,166.60	5,595,950,959	3.29
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	1,547.53	4,091,055,103	1,342.60	3,549,282,571	2.09
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	494,885	4,139.77	2,048,710,486	5,038.58	2,493,518,406	1.47
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	16,178.60	1,581,943,838	18,485.06	1,807,469,558	1.06
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,461.51	1,310,753,678	2,954.93	1,573,495,380	0.93
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	847,011	1,678.00	1,421,285,037	1,819.17	1,540,862,930	0.91
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	84.16	1,279,371,380	87.74	1,333,873,748	0.78
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	14,195.20	1,240,234,624	15,182.21	1,326,469,688	0.78
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,662.08	1,228,300,714	2,585.11	1,192,786,371	0.70
ブラジル	株式	VALE SA	素材	550,487	2,104.32	1,158,401,717	2,049.28	1,128,105,492	0.66
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	4,286.44	1,036,478,821	4,561.15	1,102,905,088	0.65
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	2,790.22	858,084,397	3,472.02	1,067,757,562	0.63
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	152,359	6,010.05	915,686,406	6,800.38	1,036,100,468	0.61
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	833,450	2,155.03	1,796,116,141	1,234.09	1,028,558,978	0.60

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	464.68	955,515,014	483.11	993,399,729	0.58
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	3,336.21	1,046,337,424	2,877.67	902,525,210	0.53
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	6,310.21	839,428,306	6,631.81	882,211,119	0.52
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	1,039.24	756,610,200	1,201.32	874,613,626	0.51
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	84.58	792,560,394	90.71	849,907,345	0.50
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	490,774	1,381.34	677,926,464	1,659.16	814,273,081	0.48
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	634,100	1,118.86	709,469,940	1,256.44	796,712,863	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	70.05	760,208,960	71.89	780,166,415	0.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	30,591	25,352.28	775,551,643	25,006.88	764,985,512	0.45
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	871.19	679,780,770	966.24	753,942,899	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	52.76	709,076,583	55.66	748,001,894	0.44
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	358,975	1,668.81	599,063,582	2,073.35	744,283,329	0.44
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	379,500	1,991.78	755,883,936	1,951.15	740,464,461	0.44
インド	株式	LARSEN & TOUBRO LTD	資本財	107,590	5,414.75	582,572,953	6,503.78	699,742,336	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.31
		素材	7.00
		資本財	4.39
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.99
		自動車・自動車部品	3.45
		耐久消費財・アパレル	1.15
		消費者サービス	1.95
		メディア・娯楽	5.57
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.02
		生活必需品流通・小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	3.35
		家庭用品・パーソナル用品	0.71
		ヘルスケア機器・サービス	0.98
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.45
		銀行	16.61
金融サービス	2.64		
保険	2.43		

		ソフトウェア・サービス	2.67
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.59
		電気通信サービス	2.74
		公益事業	2.65
		半導体・半導体製造装置	10.19
		不動産管理・開発	1.41
		小計	94.75
投資信託受益証券			0.30
投資証券			0.10
合計			95.15

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	1,134	アメリカドル	56,445,086	8,328,472,439	55,945,890	8,254,816,069	4.85

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,100,000.00	604,092,100	604,856,299	0.36

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

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

#### 新興国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	中国	12,863,657,443	9.93
	ブラジル	12,828,838,328	9.91
	メキシコ	12,628,057,463	9.75
	マレーシア	12,622,285,448	9.75
	インドネシア	12,581,711,196	9.72
	タイ	12,291,046,056	9.49
	南アフリカ	10,401,059,414	8.03
	ポーランド	9,642,192,346	7.45
	チェコ	7,903,981,411	6.10
	コロンビア	5,750,389,709	4.44



	ルーマニア	4,896,267,334	3.78
	ハンガリー	3,932,048,966	3.04
	ペルー	2,884,248,617	2.23
	チリ	2,286,080,481	1.77
	ウルグアイ	248,765,743	0.19
	ドミニカ共和国	206,162,789	0.16
	フィリピン	72,807,497	0.06
	小計	124,039,600,241	95.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,459,641,323	4.22
合計(純資産総額)		129,499,241,564	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,404,020,409	1.86

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.58	2,342,702,597	3.65	2,388,002,474	9.850	2027/6/28	1.84
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000	2,937.99	2,006,651,951	2,979.33	2,034,887,720	10.000	2027/1/1	1.57
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,395.43	1,832,508,048	2,490.59	1,905,305,496	0.000	2026/1/1	1.47
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,274.66	1,774,234,934	2,376.24	1,853,473,451	0.000	2026/7/1	1.43
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	203,200,000	816.79	1,659,722,360	819.57	1,665,385,036	10.500	2026/12/21	1.29
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000	2,947.16	1,629,783,005	2,973.89	1,644,562,622	10.000	2025/1/1	1.27
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	48,100,000,000	2.88	1,388,402,106	3.17	1,526,804,705	7.250	2034/10/18	1.18
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,856.91	1,468,456,755	2,942.78	1,512,591,540	10.000	2029/1/1	1.17
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	47,600,000	3,128.35	1,489,097,712	3,157.64	1,503,037,071	3.885	2029/8/15	1.16
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	200,100,000	702.99	1,406,695,190	723.61	1,447,949,613	8.000	2030/1/31	1.12
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	772.04	1,359,575,413	793.16	1,396,759,708	7.750	2031/5/29	1.08
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	780.82	1,368,794,728	793.83	1,391,588,203	5.750	2026/3/5	1.07
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	186,500,000	662.11	1,234,835,886	683.22	1,274,214,159	8.250	2032/3/31	0.98
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	45,110,000,000	2.49	1,126,816,056	2.79	1,262,547,919	7.250	2050/10/26	0.97
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	58,000,000	2,115.57	1,227,032,147	2,144.81	1,243,991,887	0.000	2027/7/1	0.96

マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	38,200,000	3,108.07	1,187,283,631	3,136.92	1,198,307,073	3.733	2028/6/15	0.93
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	45,300,000	2,524.76	1,143,716,893	2,611.41	1,182,970,078	0.000	2025/7/1	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	818.65	1,142,846,489	837.12	1,168,623,988	8.500	2029/5/31	0.90
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	798.35	1,109,720,300	814.04	1,131,523,845	7.500	2027/6/3	0.87
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	569.04	1,033,957,491	576.03	1,046,651,961	8.750	2048/2/28	0.81
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.91	997,955,318	0.92	1,009,108,048	5.500	2026/4/15	0.78
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	639.77	966,060,250	660.89	997,946,165	8.875	2035/2/28	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	116,900,000	839.36	981,222,331	843.97	986,604,258	8.000	2024/9/5	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000	755.29	906,354,416	768.96	922,760,347	5.500	2027/3/4	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000	713.67	881,387,933	738.20	911,684,248	7.750	2042/11/13	0.70
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,148.31	903,566,102	3,146.16	902,949,913	3.955	2025/9/15	0.70
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	595.65	867,873,706	611.63	891,148,917	8.500	2037/1/31	0.69
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000	0.95	862,609,894	0.96	867,818,340	7.000	2033/2/15	0.67
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	3,212.81	838,543,548	3,260.36	850,955,816	2.750	2029/10/25	0.66
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	410.50	833,744,361	414.31	841,470,445	2.125	2026/12/17	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.78
合計	95.78

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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	メキシコペソ	買建	43,240,000.00	368,619,811	369,446,884	0.29
	チェココルナ	買建	35,930,000.00	231,606,183	231,065,830	0.18
	ハンガリーフォリント	買建	281,480,000.00	117,017,504	115,847,876	0.09
	ポーランドズロチ	買建	7,700,000.00	281,412,113	282,083,340	0.22
	マレーシアリングギット	買建	11,830,000.00	369,332,573	368,245,423	0.28
	タイバーツ	買建	85,520,000.00	354,313,374	355,173,112	0.27
	南アフリカランド	買建	39,260,000.00	304,383,478	306,836,530	0.24
	オフショア人民元	買建	18,330,000.00	373,357,932	375,321,414	0.29

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

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

## J-REITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	113,853,655,400	96.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,241,794,200	3.59
合計(純資産総額)		118,095,449,600	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	4,223,890,000	3.58

(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	12,962	608,188.76	7,883,342,710	597,000	7,738,314,000	6.55
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,413	563,544.01	6,431,727,885	566,000	6,459,758,000	5.47
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	35,931	166,756.97	5,991,744,782	161,400	5,799,263,400	4.91
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	53,258	98,088.94	5,224,021,071	100,200	5,336,451,600	4.52
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	31,975	161,432.78	5,161,813,386	160,200	5,122,395,000	4.34
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,356	275,142.04	5,325,649,386	262,600	5,082,885,600	4.30
日本	投資証券	GLP投資法人	37,532	136,676.52	5,129,743,291	131,700	4,942,964,400	4.19
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	16,748	271,614.17	4,548,994,232	260,700	4,366,203,600	3.70
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,139	170,862.79	3,782,731,512	170,600	3,776,913,400	3.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	24,854	149,782.74	3,722,700,456	149,400	3,713,187,600	3.14
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,901	325,100.12	3,543,916,464	325,000	3,542,825,000	3.00
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	53,797	57,036.11	3,068,371,984	60,700	3,265,477,900	2.77
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,194	66,789.4	2,484,165,106	75,900	2,823,024,600	2.39
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,599	347,887.79	2,643,599,321	353,500	2,686,246,500	2.27
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	33,388	78,238.09	2,612,213,547	78,500	2,620,958,000	2.22
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,837	608,016.07	2,332,957,668	614,000	2,355,918,000	1.99
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,829	400,114.92	2,332,269,872	402,000	2,343,258,000	1.98
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	16,953	136,275.35	2,310,276,050	133,600	2,264,920,800	1.92
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,203	149,986.6	2,130,259,719	149,400	2,121,928,200	1.80
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	4,621	467,444.92	2,160,062,992	442,500	2,044,792,500	1.73

日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,117	284,796	2,026,893,191	272,800	1,941,517,600	1.64
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,629	142,836.78	1,946,722,605	138,900	1,893,068,100	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,122	452,163.59	1,863,818,329	436,000	1,797,192,000	1.52
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,066	139,031.59	1,816,586,796	137,200	1,792,655,200	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,362	108,976.06	1,783,066,408	106,100	1,736,008,200	1.47
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,464	317,892.46	1,736,964,453	309,500	1,691,108,000	1.43
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,395	150,949.1	1,569,115,917	155,300	1,614,343,500	1.37
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	21,417	73,213	1,568,002,827	74,900	1,604,133,300	1.36
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	2,302	652,633.15	1,502,361,515	629,000	1,447,958,000	1.23
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,837	377,509.4	1,448,503,587	369,500	1,417,771,500	1.20

(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	96.41
合計	96.41

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,365	円	4,225,858,260	4,223,890,000	3.58

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

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

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	84,564,936,192	77.32
	オーストラリア	7,424,027,623	6.79
	イギリス	5,220,209,612	4.77
	シンガポール	3,754,945,921	3.43
	フランス	1,981,844,648	1.81
	カナダ	1,691,670,602	1.55
	ベルギー	1,222,875,880	1.12
	香港	1,161,239,790	1.06
	スペイン	446,955,019	0.41
	ニュージーランド	322,467,959	0.29

	ガーンジー	311,604,036	0.28
	韓国	190,516,283	0.17
	オランダ	188,318,779	0.17
	イスラエル	132,305,514	0.12
	アイルランド	38,834,317	0.04
	ドイツ	38,650,352	0.04
	イタリア	11,837,796	0.01
	小計	108,703,240,323	99.39
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		671,839,107	0.61
合計（純資産総額）		109,375,079,430	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建		81,139,960	0.07
	売建		20,650,630	0.02

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

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

### 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	512,535	15,238.96	7,810,502,413	18,669.50	9,568,772,951	8.75
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	52,078	111,696.82	5,816,947,278	124,175.12	6,466,792,368	5.91
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	307,232	12,488.63	3,836,907,386	12,826.52	3,940,717,853	3.60
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	461,882	7,413.90	3,424,348,238	8,141.80	3,760,555,025	3.44
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	181,167	16,789.71	3,041,742,207	20,544.86	3,722,051,014	3.40
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	87,878	36,387.30	3,197,643,633	42,016.33	3,692,311,751	3.38
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	168,025	18,828.85	3,163,718,446	21,279.66	3,575,515,040	3.27
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	573,865	4,153.53	2,383,566,928	4,461.91	2,560,535,130	2.34
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	117,140	17,425.65	2,041,241,227	21,477.37	2,515,860,059	2.30
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	958,670	2,184.15	2,093,885,600	2,456.20	2,354,689,856	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,745	24,547.89	1,933,023,873	26,328.82	2,073,263,088	1.90
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	191,391	7,924.91	1,516,756,546	8,749.71	1,674,616,704	1.53
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	161,627	8,686.26	1,403,935,518	10,071.76	1,627,868,838	1.49
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	318,406	4,605.03	1,466,270,933	4,880.95	1,554,125,039	1.42
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	86,585	13,955.27	1,208,317,832	17,883.05	1,548,404,750	1.42
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	222,769	6,208.90	1,383,151,336	6,934.85	1,544,869,600	1.41
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	68,803	16,878.24	1,161,273,857	18,337.51	1,261,675,976	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,043	17,673.53	1,149,539,998	19,177.07	1,247,334,392	1.14

アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,477	30,626.95	1,086,552,430	34,596.04	1,227,364,013	1.12
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,217	2,397.68	942,811,486	2,903.78	1,141,817,233	1.04
イギリス	投資証券	SEGO PLC	684,274	1,455.55	995,997,827	1,642.13	1,123,670,134	1.03
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	121,890	8,016.39	977,117,960	9,199.74	1,121,356,613	1.03
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	370,680	2,610.15	967,533,923	3,020.34	1,119,582,782	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	1,418,800	745.55	1,057,791,589	743.47	1,054,846,586	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	103,898	9,589.27	996,306,442	10,017.16	1,040,763,877	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	148,838	6,638.27	988,027,500	6,763.69	1,006,694,390	0.92
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	117,668	6,589.58	775,383,053	7,849.66	923,653,793	0.84
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	177,285	5,087.52	901,941,693	5,207.03	923,129,998	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	168,680	4,720.12	796,190,600	5,382.62	907,941,016	0.83
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	91,570	8,765.94	802,697,629	9,322.20	853,634,678	0.78

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.39
合計	99.39

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	550,000.00	81,031,500	81,139,960	0.07
	アメリカドル	売建	140,000.00	20,650,000	20,650,630	0.02

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

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

#### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	28,113,547,618	98.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		517,306,102	1.81
合計(純資産総額)		28,630,853,720	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		29,349,089,760	102.51

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	4,947,695	5,392.95	26,682,684,119	5,682.15	28,113,547,618	98.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.19
合計	98.19

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

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

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	199,942,214.30	29,312,344,634	29,349,089,760	102.51

(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。

### H F リターン・ターゲット・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	日本	2,801,411,200	38.32
投資信託受益証券	アメリカ	1,073,302,774	14.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,436,287,715	47.00
合計(純資産総額)		7,311,001,689	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	1,976,289,126	27.03

	買建	ドイツ	1,614,780,122	22.09
	売建	アメリカ	693,994,047	9.49
	売建	ドイツ	409,699,167	5.60
	売建	イギリス	487,691,175	6.67
債券先物取引	売建	アメリカ	1,647,026,875	22.53

(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		320,087,876	4.38
	売建		3,005,250,790	41.11

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

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

## 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1189回国庫短期証券	2,800,000,000	100.05	2,801,503,600	100.05	2,801,411,200		2024/10/21	38.32
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	74,710	12,614.04	942,395,638	13,005.05	971,607,808			13.29
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GSCI COMMODITY DYNAM	25,941	4,233.20	109,813,688	3,845.15	99,747,114			1.36
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD SHARES ETF	70	27,106.34	1,897,444	27,826.45	1,947,852			0.03

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	38.32
投資信託受益証券	14.68
合計	53.00

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

## 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 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	売建	19	アメリカドル	4,426,912.6	653,190,954	4,703,450	693,994,047	9.49



株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	RUSSELL EMIN	買建	106	アメリカドル	10,084,626.7	1,487,986,669	10,631,270	1,568,643,888	21.46
	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	56	アメリカドル	2,773,597.4	409,244,296	2,762,760	407,645,238	5.58
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	83	スイスフラン	9,210,696.75	1,576,594,962	9,433,780	1,614,780,122	22.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DAX INDEX FU	売建	6	ユーロ	2,550,434.7	407,993,039	2,561,100	409,699,167	5.60
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	売建	34	イギリスポンド	2,578,660.3	483,060,434	2,603,380	487,691,175	6.67
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	100	アメリカドル	10,920,809	1,611,365,368	11,162,500	1,647,026,875	22.53

(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	カナダドル	買建	578,000.00	62,168,061	63,489,138	0.87
	ユーロ	買建	1,426,000.00	224,663,448	227,745,461	3.12
	スウェーデンクローナ	買建	2,039,000.00	28,675,884	28,853,277	0.39
	アメリカドル	売建	18,395,000.00	2,647,027,623	2,708,321,603	37.04
	イギリスポンド	売建	484,000.00	88,564,498	90,478,476	1.24
	スイスフラン	売建	1,207,000.00	204,503,820	206,450,711	2.82

(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。

## GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	11,703,986,800	58.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,221,746,987	41.26
合計(純資産総額)		19,925,733,787	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	9,067,500,000	45.51
	売建	アメリカ	279,994,568	1.41
	売建	ドイツ	9,727,385,373	48.82
	売建	イギリス	9,243,072,009	46.39

(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		6,083,515,262	30.53
	売建		6,891,300,415	34.58

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第1152回国庫短期証券	7,000,000,000	100.14	7,010,097,500	100.03	7,002,170,000		2024/4/22	35.14
日本	国債証券	第1189回国庫短期証券	2,000,000,000	100.05	2,001,114,000	100.05	2,001,008,000		2024/10/21	10.04
日本	国債証券	第1145回国庫短期証券	1,700,000,000	100.15	1,702,679,200	100.02	1,700,363,800		2024/3/21	8.53
日本	国債証券	第1183回国庫短期証券	1,000,000,000	100.03	1,000,388,000	100.04	1,000,445,000		2024/9/20	5.02

(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	58.74
合計	58.74

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	買建	62	円	9,062,880,460	9,062,880,460	9,067,500,000	9,067,500,000	45.51
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	17	アメリカドル	1,904,921.18	281,071,119	1,897,625	279,994,568	1.41
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	452	ユーロ	61,103,660.8	9,774,752,618	60,807,560	9,727,385,373	48.82
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	売建	499	イギリスポンド	49,954,472.5	9,357,971,333	49,341,120	9,243,072,009	46.39

(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	20,685,000.00	3,007,846,358	3,045,009,886	15.28
	カナダドル	買建	7,892,000.00	863,742,284	866,756,261	4.35
	ユーロ	買建	4,284,000.00	689,232,178	684,114,955	3.43
	ノルウェークローネ	買建	33,612,000.00	473,921,998	474,231,708	2.38
	ニュージーランドドル	買建	11,226,000.00	1,011,949,808	1,013,402,452	5.09
	イギリスポンド	売建	8,622,000.00	1,613,835,635	1,611,546,642	8.09
	スイスフラン	売建	28,848,000.00	4,921,226,809	4,934,032,101	24.76
	スウェーデンクローナ	売建	15,414,000.00	217,563,736	218,097,308	1.09
	オーストラリアドル	売建	1,316,000.00	127,542,810	127,624,364	0.64

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

当初設定日：2013年3月29日

作成基準日：2024年1月31日

**分散投資コア戦略ファンドA****基準価額・純資産の推移**

基準価額 10,932円

純資産総額 893.63億円

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

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

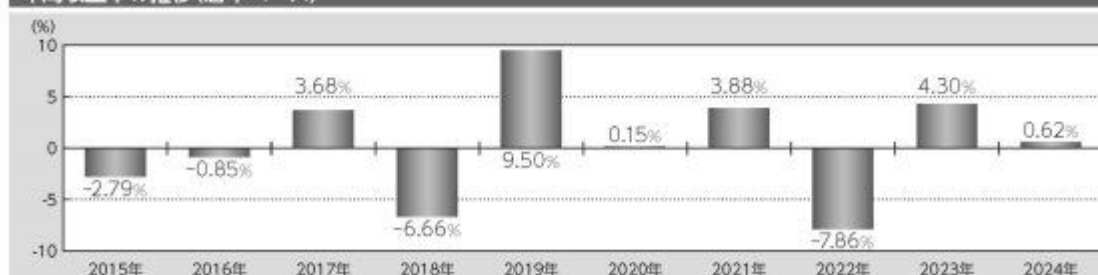
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

**主要な資産の状況**

投資信託証券	投資比率
国内債券インデックス マザーファンド	27.6%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	18.9%
外国株式インデックス マザーファンド	9.8%
国内株式インデックス マザーファンド	5.5%
マルチストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4.1%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	3.7%
HFリターン・ターゲット・マザーファンド(為替ヘッジあり)	3.5%
FOFs 用MAN AHL ダイバーシファイド リングファンド(適格機関投資家専用)	3.4%
グローバルREITインデックス マザーファンド	3.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

当初設定日：2013年3月29日

作成基準日：2024年1月31日

## 分散投資コア戦略ファンドS

## 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 13,372円

純資産総額 2,039.72億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

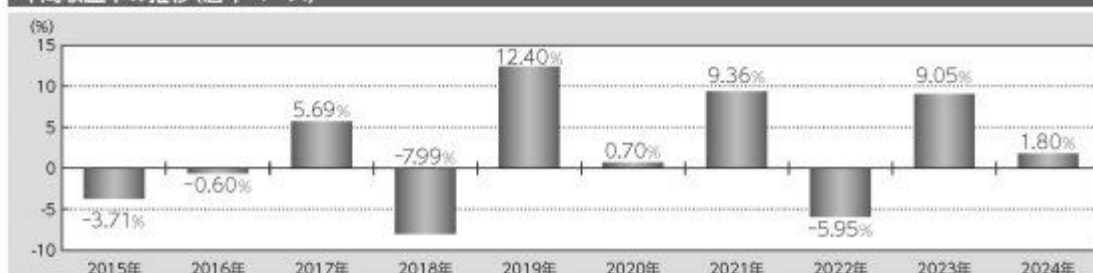
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	19.9%
国内債券インデックス マザーファンド	17.1%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	11.6%
国内株式インデックス マザーファンド	7.9%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	5.6%
FOFs 用MAN AHL ダイバーシファイド リングファンド(適格機関投資家専用)	4.9%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	4.8%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	3.5%
ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	3.2%
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	2.9%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## &lt; 申込手続 &gt;

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

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

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠

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ないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3 【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >



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

- イ．内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法  
計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。
- ロ．外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法  
原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。
- ハ．外国投資信託証券の評価方法  
原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。
- ニ．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。
- ホ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法
  - （イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）  
原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。
  - （ロ）外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）  
原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。
  - （ハ）公社債等（仕組債を含みます。）  
計算日（ ）における次のa. からc. までに掲げるいずれかの価額で評価します。
    - a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
    - b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
    - c. 価格情報会社の提供する価額外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。
  - （ニ）株価指数先物取引  
原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。
  - （ホ）債券先物取引  
原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。
- ヘ．外貨建資産等の円換算  
外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2013年 3月29日設定）

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

#### （4）【計算期間】

原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年3月29日から2013年7月10日までとします。

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

#### （5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合は除きます。）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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 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ます。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1【財務諸表】

## 【分散投資コア戦略ファンドA】

(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11期計算期間(2022年7月12日から2023年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2022年 7月11日現在)	第11期 (2023年 7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,475,945,530	1,691,547,846
投資信託受益証券	12,531,431,872	11,490,926,176
親投資信託受益証券	69,783,677,062	74,727,756,164
流動資産合計	83,791,054,464	87,910,230,186
資産合計	83,791,054,464	87,910,230,186
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	53,084,744	97,415,463
未払受託者報酬	21,987,576	23,099,293
未払委託者報酬	351,801,239	369,588,638
未払利息	451	1,410
その他未払費用	952,071	963,196
流動負債合計	427,826,081	491,068,000
負債合計	427,826,081	491,068,000
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	77,480,101,954	81,087,575,188
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,883,126,429	6,331,586,998
(分配準備積立金)	5,976,709,617	5,946,356,278
元本等合計	83,363,228,383	87,419,162,186
純資産合計	83,363,228,383	87,419,162,186
負債純資産合計	83,791,054,464	87,910,230,186

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期		第11期	
	自	2021年 7月13日	自	2022年 7月12日
	至	2022年 7月11日	至	2023年 7月10日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		44,687,624		-
受取利息		13,277		3,677
有価証券売買等損益		2,959,454,268		1,010,320,542
その他収益		-		1,783,758
営業収益合計		2,914,753,367		1,012,107,977
<b>営業費用</b>				
支払利息		660,260		657,627
受託者報酬		44,547,618		46,239,722
委託者報酬		746,352,353		739,835,440
その他費用		1,926,148		1,943,078
営業費用合計		793,486,379		788,675,867
営業利益又は営業損失（ ）		3,708,239,746		223,432,110
経常利益又は経常損失（ ）		3,708,239,746		223,432,110
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,708,239,746		223,432,110
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（ ）		73,996,715		48,236,343
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,012,509,142		5,883,126,429
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,092,293,410		586,607,908
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,092,293,410		586,607,908
剰余金減少額又は欠損金増加額		587,433,092		409,815,792
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		587,433,092		409,815,792
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,883,126,429		6,331,586,998



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他	(2)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。  ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2022年7月12日から2023年7月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第10期 (2022年7月11日現在)	第11期 (2023年7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,480,101,954口	81,087,575,188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) 1.0759円 (10,759円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0781円 (10,781円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2021年7月13日 至 2022年7月11日			第11期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	38,905,568円	費用控除後の配当等収益額	A	366,556,406円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円
収益調整金額	C	3,876,389,288円	収益調整金額	C	4,738,879,092円
分配準備積立金額	D	5,937,804,049円	分配準備積立金額	D	5,579,799,872円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,853,098,905円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,685,235,370円
当ファンドの期末残存口数	F	77,480,101,954口	当ファンドの期末残存口数	F	81,087,575,188口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,271円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,317円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	-円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 (2023年7月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第11期 (2023年 7月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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)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>

## ( 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10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第11期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	71,401,600,740円	77,480,101,954円
期中追加設定元本額	10,745,359,555円	9,056,644,310円
期中一部解約元本額	4,666,858,341円	5,449,171,076円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	第10期 (2022年 7月11日現在)	第11期 (2023年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	71,528,941	155,343,701
親投資信託受益証券	2,555,925,789	1,157,074,381
合計	2,627,454,730	1,001,730,680

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	2,557,239,900	2,289,241,158	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	4,392,104,162	4,295,917,080	
	FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,620,364,307	2,672,509,556	
	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	1,815,214,486	2,233,258,382	
投資信託受益証券合計		11,384,922,855	11,490,926,176	
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,060,652,310	2,228,748,699	

グローバルREITインデックス マザーファンド	1,144,609,846	2,917,152,653	
新興国株式インデックス マザーファンド	309,401,097	1,169,350,506	
国内株式インデックス マザーファンド	1,671,155,657	3,809,065,089	
外国株式インデックス マザーファンド	1,605,994,046	8,047,314,965	
国内債券インデックス マザーファンド	19,225,644,223	26,183,404,867	
外国債券インデックス マザーファンド	276,386,697	892,922,501	
新興国債券インデックス マザーファンド	227,137,108	470,582,660	
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	2,034,630,620	2,529,045,860	
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	689,179,869	958,993,787	
HFRリターン・ターゲット・マザーファンド (為替ヘッジあり)	3,927,125,252	3,498,283,174	
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	1,279,705,734	2,341,733,522	
外国債券インデックスマザーファンド(為替 ヘッジあり)	20,705,134,236	17,212,178,090	
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	2,121,663,480	2,468,979,791	
親投資信託受益証券合計	56,278,420,175	74,727,756,164	
合計		86,218,682,340	

(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。

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

(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11期計算期間(2022年7月12日から2023年7月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2022年 7月11日現在)	第11期 (2023年 7月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,827,903,189	3,328,847,911
投資信託受益証券	28,139,073,200	27,393,031,393
親投資信託受益証券	147,616,246,741	163,999,236,670
未収入金	350,000,000	400,000,000
流動資産合計	178,933,223,130	195,121,115,974
資産合計	178,933,223,130	195,121,115,974
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	212,826,500	243,540,244
未払受託者報酬	47,565,031	50,333,942
未払委託者報酬	761,040,550	805,343,022
未払利息	864	2,775
その他未払費用	1,207,850	1,235,539
流動負債合計	1,022,640,795	1,100,455,522
負債合計	1,022,640,795	1,100,455,522
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	143,734,318,300	150,743,580,465
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	34,176,264,035	43,277,079,987
(分配準備積立金)	19,403,362,850	22,355,544,166
元本等合計	177,910,582,335	194,020,660,452
純資産合計	177,910,582,335	194,020,660,452
負債純資産合計	178,933,223,130	195,121,115,974

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期		第11期	
	自 至	2021年 7月13日 2022年 7月11日	自 至	2022年 7月12日 2023年 7月10日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		58,666,172		-
受取利息		20,907		8,309
有価証券売買等損益		881,945,628		9,105,754,444
その他収益		-		2,146,963
営業収益合計		823,258,549		9,107,909,716
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,340,748		1,519,699
受託者報酬		95,940,216		100,202,693
委託者報酬		1,606,736,754		1,603,243,004
その他費用		2,440,078		2,482,699
営業費用合計		1,706,457,796		1,707,448,095
営業利益又は営業損失（ ）		2,529,716,345		7,400,461,621
経常利益又は経常損失（ ）		2,529,716,345		7,400,461,621
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,529,716,345		7,400,461,621
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（ ）		1,366,445		64,825,513
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		34,882,768,887		34,176,264,035
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,570,297,066		5,064,249,405
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,570,297,066		5,064,249,405
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,748,452,018		3,299,069,561
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,748,452,018		3,299,069,561
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,176,264,035		43,277,079,987

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他	(2)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。  ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2022年7月12日から2023年7月10日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第10期 (2022年7月11日現在)	第11期 (2023年7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	143,734,318,300口	150,743,580,465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) 1.2378円 (12,378円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2871円 (12,871円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2021年7月13日 至 2022年7月11日			第11期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	368,395,273円	費用控除後の配当等収益額	A	2,198,277,965円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	-円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,501,515,539円
収益調整金額	C	14,772,901,185円	収益調整金額	C	20,921,535,821円
分配準備積立金額	D	19,034,967,577円	分配準備積立金額	D	17,655,750,662円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	34,176,264,035円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	43,277,079,987円
当ファンドの期末残存口数	F	143,734,318,300口	当ファンドの期末残存口数	F	150,743,580,465口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,377円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,870円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	-円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第11期 (2023年7月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第11期 (2023年 7月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(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)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>

## ( 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10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第11期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	136,583,457,227円	143,734,318,300円
期中追加設定元本額	17,903,179,345円	20,898,235,211円
期中一部解約元本額	10,752,318,272円	13,888,973,046円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	第10期 (2022年 7月11日現在)	第11期 (2023年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	687,110,674	491,140,400
親投資信託受益証券	646,424,433	9,313,587,742
合計	40,686,241	8,822,447,342

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS ( 適格機関投資家専用 )	7,094,635,543	6,351,117,738	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,662,611,018	5,538,599,836	
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド ( 適格機関投資家専用 )	5,670,816,551	5,783,665,800	
	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド ( 適格機関投資家専用 )	7,900,225,977	9,719,648,019	
投資信託受益証券合計		26,328,289,089	27,393,031,393	
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	1,827,718,193	3,840,584,238	

グローバルREITインデックス マザーファンド	1,578,869,574	4,023,906,996	
新興国株式インデックス マザーファンド	1,517,431,406	5,734,980,255	
国内株式インデックス マザーファンド	6,232,800,431	14,206,422,022	
外国株式インデックス マザーファンド	7,989,687,127	40,034,724,255	
国内債券インデックス マザーファンド	25,755,853,956	35,076,897,502	
外国債券インデックス マザーファンド	604,847,674	1,954,081,380	
新興国債券インデックス マザーファンド	494,740,113	1,025,002,566	
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	7,439,587,857	9,247,407,706	
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,540,332,159	3,534,872,199	
HFRリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	4,203,453,201	3,744,436,111	
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	6,282,702,829	11,496,717,906	
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	27,771,514,520	23,086,460,020	
GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）	6,009,060,337	6,992,743,514	
親投資信託受益証券合計	100,248,599,377	163,999,236,670	
合計		191,392,268,063	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,282,019,730
株式	553,511,905,010
新株予約権証券	5,236,000
派生商品評価勘定	18,175,150
未収入金	4,967,981,358
未収配当金	782,472,770
差入委託証拠金	74,960,000
流動資産合計	569,642,750,018
資産合計	569,642,750,018
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,807,000
前受金	7,394,000



	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
未払解約金	8,633,344,245
未払利息	8,572
流動負債合計	8,651,553,817
負債合計	8,651,553,817
純資産の部	
元本等	
元本	246,129,288,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	314,861,907,758
元本等合計	560,991,196,201
純資産合計	560,991,196,201
負債純資産合計	569,642,750,018

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>(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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	246,129,288,443口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2793円 (1万口当たり純資産額) (22,793円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2023年 7月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	263,755,440,320円
期中追加設定元本額	19,919,508,116円
期中一部解約元本額	37,545,659,993円
期末元本額	246,129,288,443円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	334,440,574円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,478,966,595円
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,888,614円
S M T T O P I Xインデックス・オープン	11,425,697,173円
世界経済インデックスファンド	4,730,848,532円
日本株式インデックス・オープン	3,057,723,990円
D Cマイセレクション2 5	5,522,026,302円
D Cマイセレクション5 0	17,754,209,408円
D Cマイセレクション7 5	18,472,400,144円
D C日本株式インデックス・オープン	6,021,294,867円
D CマイセレクションS 2 5	3,250,318,721円
D CマイセレクションS 5 0	9,440,815,037円

区分	2023年 7月10日現在
DCマイセレクションS75	8,016,312,204円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,988,629,087円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	130,862,339円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	680,289,988円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	520,094,999円
DC世界経済インデックスファンド	3,696,348,044円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	991,965,622円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,668,401円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,750,591円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	159,175,190円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,122,651円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	20,132,476円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	76,818,281円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	17,211,066円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,507,405円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	621,508,074円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	336,463,328円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,265,797,256円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	31,476,423円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	14,199,279円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	352,186,015円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	203,127,329円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	261,403,222円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	22,312,988円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	448,363,056円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,690,339,794円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,864,861円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,224,394,382円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,775,115,228円
分散投資コア戦略ファンドA	1,671,155,657円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	564,183,861円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	399,385,889円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,306,047,151円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,253,478円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,567,282円
SMT インデックスバランス・オープン	50,643,883円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	23,675,515,033円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	283,531,608円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,491,712円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	199,373,314円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,041,665円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,353,371円
グローバル経済コア	211,593,399円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,074,251円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	754,779,953円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	28,119,531円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	966,086,171円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	215,887,042円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	54,123,858円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	49,045,377円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	19,918,462円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	20,893,114円
10資産分散投資ファンド	93,062,081円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,053,572,413円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	578,742,860円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	292,392,888円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,954,754円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	690,518,488円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	45,194,817,771円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,017,043円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	214,149,302円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

(2023年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,320,646,000	-		2,328,040,000	7,394,000
	合計	2,320,646,000	-		2,328,040,000	7,394,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,200	3,620.00	33,304,000	
ニッセイ	242,100	644.00	155,912,400	
マルハニチロ	35,900	2,441.50	87,649,850	
雪国まいたけ	20,600	936.00	19,281,600	
カネコ種苗	7,400	1,400.00	10,360,000	
サカタのタネ	27,600	4,120.00	113,712,000	
ホクト	21,500	1,834.00	39,431,000	
ホクリヨウ	2,700	884.00	2,386,800	
住石ホールディングス	29,300	353.00	10,342,900	
日鉄鉱業	9,700	4,510.00	43,747,000	
三井松島ホールディングス	11,000	2,722.00	29,942,000	
I N P E X	895,600	1,616.50	1,447,737,400	
石油資源開発	28,100	4,425.00	124,342,500	
K & O エナジーグループ	11,000	2,235.00	24,585,000	
ショーボンドホールディングス	33,000	5,625.00	185,625,000	

ミライト・ワン	80,100	1,799.00	144,099,900
タマホーム	15,200	3,320.00	50,464,000
サンヨーホームズ	2,300	721.00	1,658,300
日本アクア	7,900	878.00	6,936,200
ファーストコーポレーション	4,800	808.00	3,878,400
ベストテラ	4,100	1,142.00	4,682,200
Robot Home	41,200	188.00	7,745,600
キャンディル	3,400	591.00	2,009,400
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,378.00	5,236,400
第一カッター興業	6,200	1,398.00	8,667,600
安藤・間	140,300	1,066.00	149,559,800
東急建設	69,000	736.00	50,784,000
コムシスホールディングス	77,300	2,764.50	213,695,850
ビーアールホールディングス	38,500	387.00	14,899,500
高松コンストラクショングループ	15,700	2,524.00	39,626,800
東建コーポレーション	7,000	7,360.00	51,520,000
ソネック	2,000	971.00	1,942,000
ヤマウラ	12,300	1,141.00	14,034,300
オリエンタル白石	87,000	299.00	26,013,000
大成建設	158,500	5,047.00	799,949,500
大林組	605,800	1,230.00	745,134,000
清水建設	480,300	897.60	431,117,280
飛鳥建設	18,700	1,283.00	23,992,100
長谷工コーポレーション	174,800	1,788.50	312,629,800
松井建設	15,800	711.00	11,233,800
銭高組	1,700	3,125.00	5,312,500
鹿島建設	375,600	2,156.00	809,793,600
不動テトラ	11,700	1,842.00	21,551,400
大末建設	4,800	1,338.00	6,422,400
鉄建建設	12,100	2,032.00	24,587,200
西松建設	28,700	3,540.00	101,598,000
三井住友建設	136,600	372.00	50,815,200
大豊建設	7,000	3,845.00	26,915,000
佐田建設	8,400	463.00	3,889,200
ナカノフドー建設	9,400	388.00	3,647,200
奥村組	27,500	4,075.00	112,062,500
東鉄工業	23,300	2,618.00	60,999,400
イチケン	3,000	1,965.00	5,895,000
富士ピー・エス	5,900	450.00	2,655,000
浅沼組	13,600	3,325.00	45,220,000
戸田建設	208,400	774.00	161,301,600
熊谷組	28,400	3,085.00	87,614,000

北野建設	2,500	3,020.00	7,550,000
植木組	3,700	1,396.00	5,165,200
矢作建設工業	23,000	1,237.00	28,451,000
ピーエス三菱	21,500	775.00	16,662,500
日本ハウスホールディングス	33,600	366.00	12,297,600
新日本建設	23,800	1,227.00	29,202,600
東亜道路工業	6,700	4,605.00	30,853,500
日本道路	3,400	8,850.00	30,090,000
東亜建設工業	14,500	3,100.00	44,950,000
日本国土開発	48,200	577.00	27,811,400
若築建設	7,500	3,000.00	22,500,000
東洋建設	56,200	1,031.00	57,942,200
五洋建設	240,100	759.10	182,259,910
世紀東急工業	21,800	1,425.00	31,065,000
福田組	6,400	4,760.00	30,464,000
住友林業	130,800	3,303.00	432,032,400
日本基礎技術	8,000	503.00	4,024,000
巴コーポレーション	14,700	500.00	7,350,000
大和ハウス工業	468,400	3,690.00	1,728,396,000
ライト工業	31,400	1,982.00	62,234,800
積水ハウス	513,600	2,861.50	1,469,666,400
日特建設	16,200	1,079.00	17,479,800
北陸電気工事	11,600	930.00	10,788,000
ユアテック	37,300	869.00	32,413,700
日本リーテック	14,900	1,360.00	20,264,000
四電工	7,100	2,204.00	15,648,400
中電工	26,300	2,314.00	60,858,200
関電工	92,800	1,181.00	109,596,800
きんでん	119,200	1,976.50	235,598,800
東京エネシス	16,800	954.00	16,027,200
トーエネック	5,600	3,605.00	20,188,000
住友電設	16,100	3,155.00	50,795,500
日本電設工業	27,800	2,033.00	56,517,400
エクシオグループ	78,000	2,835.00	221,130,000
新日本空調	9,400	2,319.00	21,798,600
九電工	41,200	3,982.00	164,058,400
三機工業	37,600	1,510.00	56,776,000
日揮ホールディングス	167,500	1,802.50	301,918,750
中外炉工業	5,500	1,991.00	10,950,500
ヤマト	11,000	910.00	10,010,000
太平電業	10,500	4,215.00	44,257,500
高砂熱学工業	40,800	2,441.00	99,592,800

三晃金属工業	1,600	4,455.00	7,128,000
朝日工業社	7,000	2,371.00	16,597,000
明星工業	29,100	953.00	27,732,300
大気社	19,500	4,005.00	78,097,500
ダイダン	11,100	2,792.00	30,991,200
日比谷総合設備	14,500	2,145.00	31,102,500
フィル・カンパニー	3,000	930.00	2,790,000
テスホールディングス	18,700	690.00	12,903,000
インフロニア・ホールディングス	177,500	1,332.00	236,430,000
東洋エンジニアリング	22,400	564.00	12,633,600
レイズネクスト	24,500	1,456.00	35,672,000
ニッポン	45,800	1,837.00	84,134,600
日清製粉グループ本社	157,300	1,718.50	270,320,050
日東富士製粉	3,000	4,590.00	13,770,000
昭和産業	14,800	2,639.00	39,057,200
鳥越製粉	10,600	616.00	6,529,600
中部飼料	23,500	1,075.00	25,262,500
フィード・ワン	24,900	746.00	18,575,400
東洋精糖	2,500	1,723.00	4,307,500
日本甜菜製糖	9,900	1,891.00	18,720,900
D M三井製糖ホールディングス	16,900	2,729.00	46,120,100
塩水港精糖	15,800	217.00	3,428,600
ウェルネオシュガー	8,800	2,041.00	17,960,800
森永製菓	31,100	4,556.00	141,691,600
中村屋	4,200	3,070.00	12,894,000
江崎グリコ	48,600	3,706.00	180,111,600
名糖産業	6,700	1,633.00	10,941,100
井村屋グループ	9,300	2,228.00	20,720,400
不二家	11,700	2,431.00	28,442,700
山崎製パン	113,800	1,991.50	226,632,700
第一屋製パン	2,500	391.00	977,500
モロゾフ	5,500	3,735.00	20,542,500
亀田製菓	10,800	4,270.00	46,116,000
寿スピリッツ	18,100	10,020.00	181,362,000
カルビー	77,900	2,724.00	212,199,600
森永乳業	30,900	4,728.00	146,095,200
六甲バター	12,500	1,303.00	16,287,500
ヤクルト本社	121,500	8,805.00	1,069,807,500
明治ホールディングス	208,500	3,264.00	680,544,000
雪印メグミルク	41,100	1,941.00	79,775,100
プリマハム	22,800	2,185.00	49,818,000
日本ハム	66,500	3,937.00	261,810,500

林兼産業	4,000	491.00	1,964,000	
丸大食品	17,100	1,481.00	25,325,100	
S Foods	18,800	3,135.00	58,938,000	
柿安本店	6,600	2,340.00	15,444,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	129,900	718.00	93,268,200	
サッポロホールディングス	56,000	3,609.00	202,104,000	
アサヒグループホールディングス	393,000	5,452.00	2,142,636,000	
キリンホールディングス	767,400	2,075.00	1,592,355,000	
宝ホールディングス	116,100	1,141.00	132,470,100	
オエノンホールディングス	50,800	335.00	17,018,000	
養命酒製造	5,600	1,861.00	10,421,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	133,200	1,533.50	204,262,200	
サントリー食品インターナショナル	119,700	5,068.00	606,639,600	
ダイトーグループホールディングス	9,600	5,010.00	48,096,000	
伊藤園	57,600	3,859.00	222,278,400	
キーコーヒー	19,100	2,053.00	39,212,300	
ユニカフェ	4,400	916.00	4,030,400	
ジャパンフーズ	2,100	1,073.00	2,253,300	
日清オイリオグループ	24,000	3,630.00	87,120,000	
不二製油グループ本社	39,600	1,986.50	78,665,400	
かどや製油	1,600	3,435.00	5,496,000	
J - オイルミルズ	17,300	1,609.00	27,835,700	
キッコーマン	112,700	7,886.00	888,752,200	
味の素	410,600	5,615.00	2,305,519,000	
ブルドックソース	9,000	1,924.00	17,316,000	
キューピー	91,400	2,462.50	225,072,500	
ハウス食品グループ本社	52,100	3,286.00	171,200,600	
カゴメ	79,200	3,126.00	247,579,200	
焼津水産化学工業	5,200	823.00	4,279,600	
アリアケジャパン	14,800	5,287.00	78,247,600	
ピエトロ	1,900	1,821.00	3,459,900	
エバラ食品工業	4,600	2,886.00	13,275,600	
やまみ	1,300	1,324.00	1,721,200	
ニチレイ	77,900	3,046.00	237,283,400	
東洋水産	85,900	6,105.00	524,419,500	
イトアンドホールディングス	7,300	2,146.00	15,665,800	
大冷	1,600	1,958.00	3,132,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	862.00	9,309,600	
日清食品ホールディングス	59,800	11,905.00	711,919,000	
永谷園ホールディングス	8,300	2,132.00	17,695,600	
一正蒲鉾	5,700	739.00	4,212,300	
フジッコ	17,500	1,888.00	33,040,000	



ロック・フィールド	19,000	1,476.00	28,044,000
日本たばこ産業	1,119,500	3,051.00	3,415,594,500
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,314.00	15,373,800
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,655.00	33,187,500
なとり	10,700	1,952.00	20,886,400
イフジ産業	2,300	1,109.00	2,550,700
ファーマフーズ	24,400	1,898.00	46,311,200
ユーグレナ	109,900	889.00	97,701,100
紀文食品	13,300	1,031.00	13,712,300
ピクルスホールディングス	10,000	1,288.00	12,880,000
ミヨシ油脂	4,700	1,029.00	4,836,300
理研ビタミン	14,700	2,027.00	29,796,900
片倉工業	16,300	1,605.00	26,161,500
ゲンゼ	12,400	4,355.00	54,002,000
東洋紡	75,300	1,111.00	83,658,300
ユニチカ	54,800	234.00	12,823,200
富士紡ホールディングス	7,000	3,195.00	22,365,000
倉敷紡績	13,200	2,264.00	29,884,800
シキボウ	7,500	1,027.00	7,702,500
日本毛織	46,200	1,023.00	47,262,600
トーア紡コーポレーション	5,300	455.00	2,411,500
帝国繊維	19,900	1,649.00	32,815,100
帝人	166,600	1,476.50	245,984,900
東レ	1,159,900	796.90	924,324,310
住江織物	2,900	2,381.00	6,904,900
日本フェルト	8,900	417.00	3,711,300
イチカワ	2,100	1,351.00	2,837,100
日東製網	1,400	1,406.00	1,968,400
アツギ	8,400	416.00	3,494,400
ダイニック	3,500	764.00	2,674,000
セーレン	33,600	2,418.00	81,244,800
ソトー	4,600	765.00	3,519,000
東海染工	1,500	1,095.00	1,642,500
小松マテーレ	25,400	680.00	17,272,000
ワコールホールディングス	31,600	2,919.00	92,240,400
ホギメディカル	23,300	3,095.00	72,113,500
T S Iホールディングス	58,500	803.00	46,975,500
マツオカコーポレーション	3,800	1,267.00	4,814,600
ワールド	22,400	1,709.00	38,281,600
三陽商会	5,100	1,956.00	9,975,600
ナイガイ	5,300	293.00	1,552,900
オンワードホールディングス	112,700	530.00	59,731,000

ルックホールディングス	3,900	2,542.00	9,913,800
ゴールドウイン	30,700	11,835.00	363,334,500
デサント	29,900	4,015.00	120,048,500
キング	6,300	615.00	3,874,500
ヤマトインターナショナル	11,400	296.00	3,374,400
特種東海製紙	7,700	3,235.00	24,909,500
王子ホールディングス	720,700	525.90	379,016,130
日本製紙	90,100	1,200.00	108,120,000
三菱製紙	16,200	576.00	9,331,200
北越コーポレーション	109,300	807.00	88,205,100
中越パルプ工業	5,400	1,376.00	7,430,400
巴川製紙所	4,200	715.00	3,003,000
大王製紙	76,400	1,113.50	85,071,400
阿波製紙	3,200	574.00	1,836,800
レンゴー	157,600	861.70	135,803,920
トモク	10,000	2,077.00	20,770,000
ザ・パック	12,900	3,105.00	40,054,500
北の達人コーポレーション	72,900	277.00	20,193,300
クラレ	275,000	1,384.00	380,600,000
旭化成	1,080,400	973.90	1,052,201,560
共和レザー	7,800	595.00	4,641,000
レゾナック・ホールディングス	167,200	2,313.00	386,733,600
住友化学	1,283,400	437.80	561,872,520
住友精化	7,200	4,440.00	31,968,000
日産化学	81,700	6,222.00	508,337,400
ラサ工業	6,700	2,109.00	14,130,300
クレハ	14,800	8,290.00	122,692,000
多木化学	6,700	4,125.00	27,637,500
テイカ	11,600	1,368.00	15,868,800
石原産業	31,300	1,269.00	39,719,700
片倉コープアグリ	2,800	1,226.00	3,432,800
日本曹達	18,600	5,160.00	95,976,000
東ソー	231,000	1,728.00	399,168,000
トクヤマ	55,900	2,355.00	131,644,500
セントラル硝子	27,800	3,060.00	85,068,000
東亜合成	86,700	1,299.50	112,666,650
大阪ソーダ	10,400	5,580.00	58,032,000
関東電化工業	33,500	979.00	32,796,500
デンカ	62,900	2,734.00	171,968,600
信越化学工業	1,438,100	4,591.00	6,602,317,100
日本カーバイド工業	5,100	1,424.00	7,262,400
堺化学工業	13,200	1,911.00	25,225,200

第一稀元素化学工業	15,800	973.00	15,373,400
エア・ウォーター	163,200	1,933.00	315,465,600
日本酸素ホールディングス	167,800	3,070.00	515,146,000
日本化学工業	5,800	1,919.00	11,130,200
東邦アセチレン	2,800	1,416.00	3,964,800
日本パーカラライジング	85,600	1,065.00	91,164,000
高压ガス工業	25,100	733.00	18,398,300
チタン工業	1,600	1,388.00	2,220,800
四国化成ホールディングス	20,500	1,431.00	29,335,500
戸田工業	3,900	2,227.00	8,685,300
ステラ ケミファ	10,200	3,085.00	31,467,000
保土谷化学工業	4,900	3,420.00	16,758,000
日本触媒	26,400	5,357.00	141,424,800
大日精化工業	12,000	2,138.00	25,656,000
カネカ	39,500	4,053.00	160,093,500
三菱瓦斯化学	129,200	2,164.50	279,653,400
三井化学	142,600	4,152.00	592,075,200
J S R	161,500	4,095.00	661,342,500
東京応化工業	30,300	8,700.00	263,610,000
大阪有機化学工業	13,000	2,834.00	36,842,000
三菱ケミカルグループ	1,167,400	849.40	991,589,560
K Hネオケム	28,800	2,291.00	65,980,800
ダイセル	240,900	1,296.00	312,206,400
住友ベークライト	25,600	5,652.00	144,691,200
積水化学工業	350,700	2,018.00	707,712,600
日本ゼオン	103,800	1,371.00	142,309,800
アイカ工業	43,700	3,128.00	136,693,600
U B E	89,200	2,493.50	222,420,200
積水樹脂	24,000	2,250.00	54,000,000
タキロンシーアイ	37,800	574.00	21,697,200
旭有機材	11,500	4,365.00	50,197,500
ニチバン	10,700	1,892.00	20,244,400
リケンテクノス	37,300	644.00	24,021,200
大倉工業	8,000	2,191.00	17,528,000
積水化成成品工業	24,300	446.00	10,837,800
群栄化学工業	4,100	2,887.00	11,836,700
タイガースポリマー	6,100	695.00	4,239,500
ミライアル	4,100	1,600.00	6,560,000
ダイキアクシス	4,900	715.00	3,503,500
ダイキョーニシカワ	38,200	785.00	29,987,000
竹本容器	4,500	825.00	3,712,500
森六ホールディングス	8,800	2,079.00	18,295,200

恵和	11,200	1,099.00	12,308,800
日本化薬	132,100	1,206.50	159,378,650
カーリットホールディングス	15,500	805.00	12,477,500
日本精化	9,800	2,986.00	29,262,800
扶桑化学工業	16,100	4,505.00	72,530,500
トリケミカル研究所	23,100	2,691.00	62,162,100
A D E K A	60,300	2,755.00	166,126,500
日油	53,500	5,957.00	318,699,500
新日本理化	18,500	242.00	4,477,000
ハリマ化成グループ	9,400	874.00	8,215,600
花王	421,300	5,371.00	2,262,802,300
第一工業製薬	6,200	1,833.00	11,364,600
石原ケミカル	7,900	1,645.00	12,995,500
日華化学	5,400	851.00	4,595,400
ニイタカ	2,400	2,081.00	4,994,400
三洋化成工業	10,600	4,215.00	44,679,000
有機合成薬品工業	9,900	305.00	3,019,500
大日本塗料	21,100	934.00	19,707,400
日本ペイントホールディングス	765,500	1,160.00	887,980,000
関西ペイント	158,500	2,078.50	329,442,250
神東塗料	11,200	124.00	1,388,800
中国塗料	28,400	1,175.00	33,370,000
日本特殊塗料	8,500	1,116.00	9,486,000
藤倉化成	23,200	457.00	10,602,400
太陽ホールディングス	26,300	2,670.00	70,221,000
D I C	67,600	2,633.00	177,990,800
サカタインクス	38,500	1,237.00	47,624,500
東洋インキＳＣホールディングス	33,900	2,149.00	72,851,100
T & K T O K A	15,400	1,178.00	18,141,200
富士フイルムホールディングス	332,400	8,271.00	2,749,280,400
資生堂	361,700	6,272.00	2,268,582,400
ライオン	207,800	1,343.00	279,075,400
高砂香料工業	11,700	2,696.00	31,543,200
マンダム	37,400	1,388.00	51,911,200
ミルボン	25,700	4,965.00	127,600,500
ファンケル	75,800	2,560.00	194,048,000
コーセー	35,200	13,490.00	474,848,000
コタ	16,000	1,608.00	25,728,000
シーボン	1,700	1,553.00	2,640,100
ポーラ・オルビスホールディングス	88,800	2,123.00	188,522,400
ノエビアホールディングス	15,400	5,470.00	84,238,000
アジュバンホールディングス	3,300	939.00	3,098,700

新日本製薬	9,900	1,405.00	13,909,500
アクシージア	8,800	1,322.00	11,633,600
エステー	13,400	1,500.00	20,100,000
アグロ カネショウ	6,900	1,620.00	11,178,000
コニシ	28,900	2,207.00	63,782,300
長谷川香料	33,100	3,440.00	113,864,000
星光P M C	6,900	576.00	3,974,400
小林製薬	50,400	7,591.00	382,586,400
荒川化学工業	14,700	996.00	14,641,200
メック	14,300	3,650.00	52,195,000
日本高純度化学	4,300	2,556.00	10,990,800
タカラバイオ	46,700	1,622.00	75,747,400
J C U	19,300	3,315.00	63,979,500
新田ゼラチン	8,300	738.00	6,125,400
O A Tアグリオ	5,500	1,951.00	10,730,500
デクセリアルズ	47,300	3,109.00	147,055,700
アース製薬	15,700	5,030.00	78,971,000
北興化学工業	17,400	898.00	15,625,200
大成ラミック	5,500	2,948.00	16,214,000
クミアイ化学工業	68,800	1,077.00	74,097,600
日本農薬	31,800	702.00	22,323,600
アキレス	10,900	1,445.00	15,750,500
有沢製作所	28,200	1,104.00	31,132,800
日東電工	125,700	10,070.00	1,265,799,000
レック	24,700	845.00	20,871,500
三光合成	21,800	701.00	15,281,800
きもと	19,800	193.00	3,821,400
藤森工業	13,700	3,535.00	48,429,500
前澤化成工業	11,200	1,500.00	16,800,000
未来工業	6,200	2,679.00	16,609,800
ウェーブロックホールディングス	4,000	603.00	2,412,000
J S P	12,200	1,911.00	23,314,200
エフピコ	32,800	2,882.50	94,546,000
天馬	14,100	2,562.00	36,124,200
信越ポリマー	32,000	1,455.00	46,560,000
東リ	30,200	341.00	10,298,200
ニフコ	62,500	4,042.00	252,625,000
バルカー	14,500	3,830.00	55,535,000
ユニ・チャーム	360,900	5,334.00	1,925,040,600
ショーエイコーポレーション	3,900	594.00	2,316,600
協和キリン	209,300	2,601.50	544,493,950
武田薬品工業	1,533,000	4,408.00	6,757,464,000

アステラス製薬	1,636,300	2,038.00	3,334,779,400
住友ファーマ	128,500	667.80	85,812,300
塩野義製薬	218,400	5,788.00	1,264,099,200
わかもと製薬	12,600	232.00	2,923,200
日本新薬	40,800	5,446.00	222,196,800
中外製薬	542,200	3,828.00	2,075,541,600
科研製薬	29,700	3,532.00	104,900,400
エーザイ	210,700	9,247.00	1,948,342,900
ロート製薬	167,800	3,062.00	513,803,600
小野薬品工業	334,200	2,517.00	841,181,400
久光製薬	38,500	3,755.00	144,567,500
持田製薬	19,900	3,200.00	63,680,000
参天製薬	315,600	1,186.00	374,301,600
扶桑薬品工業	5,500	1,977.00	10,873,500
日本ケミファ	1,300	1,929.00	2,507,700
ツムラ	54,500	2,659.50	144,942,750
キッセイ薬品工業	26,800	3,010.00	80,668,000
生化学工業	33,000	745.00	24,585,000
栄研化学	28,100	1,544.00	43,386,400
鳥居薬品	9,300	3,555.00	33,061,500
JCRファーマ	58,600	1,221.50	71,579,900
東和薬品	26,600	1,727.00	45,938,200
富士製薬工業	12,800	1,125.00	14,400,000
ゼリア新薬工業	24,000	2,346.00	56,304,000
そーせいグループ	59,500	1,516.00	90,202,000
第一三共	1,509,000	4,005.00	6,043,545,000
杏林製薬	37,600	1,719.00	64,634,400
大幸薬品	33,700	349.00	11,761,300
ダイト	12,100	2,203.00	26,656,300
大塚ホールディングス	396,300	5,181.00	2,053,230,300
大正製薬ホールディングス	38,500	5,291.00	203,703,500
ペプチドリーム	84,000	1,947.50	163,590,000
あすか製薬ホールディングス	17,800	1,433.00	25,507,400
サワイグループホールディングス	39,600	3,616.00	143,193,600
日本コークス工業	156,200	118.00	18,431,600
ニチレキ	20,500	1,901.00	38,970,500
ユシロ化学工業	9,000	1,064.00	9,576,000
ビーピー・カストロール	5,200	873.00	4,539,600
富士石油	35,300	278.00	9,813,400
MORESCO	4,400	1,175.00	5,170,000
出光興産	192,400	2,881.50	554,400,600
Eneosホールディングス	2,938,300	495.00	1,454,458,500

コスモエネルギーホールディングス	68,500	3,918.00	268,383,000
横浜ゴム	98,600	3,053.00	301,025,800
TOYO TIRE	99,500	1,860.00	185,070,000
ブリヂストン	553,200	5,730.00	3,169,836,000
住友ゴム工業	169,900	1,386.00	235,481,400
藤倉コンポジット	9,500	968.00	9,196,000
オカモト	9,400	3,885.00	36,519,000
フコク	9,100	1,433.00	13,040,300
ニッタ	17,600	3,130.00	55,088,000
住友理工	33,600	831.00	27,921,600
三ツ星ベルト	25,300	4,470.00	113,091,000
バンドー化学	27,400	1,470.00	40,278,000
日東紡績	19,600	2,311.00	45,295,600
A G C	176,300	4,918.00	867,043,400
日本板硝子	88,300	635.00	56,070,500
石塚硝子	2,300	1,599.00	3,677,700
日本山村硝子	5,300	1,098.00	5,819,400
日本電気硝子	70,800	2,509.00	177,637,200
オハラ	8,400	1,416.00	11,894,400
住友大阪セメント	24,500	3,641.00	89,204,500
太平洋セメント	110,400	2,763.00	305,035,200
日本ヒューム	15,500	736.00	11,408,000
日本コンクリート工業	34,300	328.00	11,250,400
三谷セキサン	7,300	4,475.00	32,667,500
アジアパイルホールディングス	27,500	609.00	16,747,500
東海カーボン	145,500	1,279.00	186,094,500
日本カーボン	10,000	4,235.00	42,350,000
東洋炭素	10,900	5,270.00	57,443,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,700	5,500.00	47,850,000
T O T O	114,400	4,198.00	480,251,200
日本碍子	201,600	1,687.50	340,200,000
日本特殊陶業	132,000	2,909.50	384,054,000
M A R U W A	6,400	21,990.00	140,736,000
品川リフラクトリーズ	4,900	5,730.00	28,077,000
黒崎播磨	3,600	9,060.00	32,616,000
ヨータイ	9,500	1,455.00	13,822,500
東京窯業	13,000	347.00	4,511,000
ニッカトー	6,400	653.00	4,179,200
フジインコーポレーテッド	41,500	3,455.00	143,382,500
クニミネ工業	4,200	1,012.00	4,250,400
エーアンドエーマテリアル	2,700	1,111.00	2,999,700
ニチアス	43,900	2,910.00	127,749,000

ニチハ	21,800	3,095.00	67,471,000
日本製鉄	797,900	2,972.00	2,371,358,800
神戸製鋼所	358,400	1,373.00	492,083,200
中山製鋼所	36,700	853.00	31,305,100
合同製鐵	8,900	3,645.00	32,440,500
J F E ホールディングス	476,200	1,992.50	948,828,500
東京製鐵	50,100	1,305.00	65,380,500
共英製鋼	20,300	1,955.00	39,686,500
大和工業	29,400	6,124.00	180,045,600
東京鐵鋼	8,500	3,190.00	27,115,000
大阪製鐵	8,200	1,376.00	11,283,200
淀川製鋼所	20,300	3,270.00	66,381,000
中部鋼板	14,700	1,913.00	28,121,100
丸一鋼管	54,300	3,210.00	174,303,000
モリ工業	3,200	3,400.00	10,880,000
大同特殊鋼	22,500	5,930.00	133,425,000
日本高周波鋼業	4,800	359.00	1,723,200
日本冶金工業	13,000	4,165.00	54,145,000
山陽特殊製鋼	17,600	2,735.00	48,136,000
愛知製鋼	10,300	3,175.00	32,702,500
日本金属	3,000	945.00	2,835,000
大平洋金属	12,700	1,552.00	19,710,400
新日本電工	106,500	281.00	29,926,500
栗本鐵工所	8,500	2,301.00	19,558,500
虹技	1,700	1,210.00	2,057,000
三菱製鋼	11,200	1,454.00	16,284,800
日亜鋼業	14,200	317.00	4,501,400
日本精線	2,400	4,855.00	11,652,000
エンビプロ・ホールディングス	9,600	536.00	5,145,600
シンニッタン	15,100	255.00	3,850,500
新家工業	3,000	2,349.00	7,047,000
大紀アルミニウム工業所	25,400	1,467.00	37,261,800
日本輕金属ホールディングス	48,100	1,457.00	70,081,700
三井金属鋳業	51,900	3,238.00	168,052,200
東邦亜鉛	10,600	1,705.00	18,073,000
三菱マテリアル	118,900	2,496.00	296,774,400
住友金属鋳山	206,600	4,581.00	946,434,600
D O W A ホールディングス	40,100	4,530.00	181,653,000
古河機械金属	26,200	1,529.00	40,059,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	2,990.00	78,338,000
東邦チタニウム	32,300	1,665.00	53,779,500
U A C J	25,000	2,707.00	67,675,000



C Kサンエツ	4,300	4,165.00	17,909,500
古河電気工業	59,400	2,558.00	151,945,200
住友電気工業	615,400	1,704.00	1,048,641,600
フジクラ	191,200	1,174.50	224,564,400
S W C C	20,000	1,929.00	38,580,000
タツタ電線	36,400	707.00	25,734,800
カナレ電気	2,200	1,361.00	2,994,200
平河ヒューテック	10,300	1,571.00	16,181,300
リヨービ	19,000	2,217.00	42,123,000
アーレスティ	15,500	694.00	10,757,000
A R Eホールディングス	72,100	1,923.00	138,648,300
稲葉製作所	9,300	1,613.00	15,000,900
宮地エンジニアリンググループ	4,900	4,005.00	19,624,500
トーカロ	47,400	1,448.00	68,635,200
アルファC o	5,100	1,273.00	6,492,300
S U M C O	339,300	1,978.00	671,135,400
川田テクノロジーズ	4,200	5,770.00	24,234,000
R S Technologies	11,900	3,025.00	35,997,500
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,229.00	4,235,100
信和	7,700	764.00	5,882,800
東洋製罐グループホールディングス	106,300	2,112.50	224,558,750
ホッカンホールディングス	9,600	1,379.00	13,238,400
コロナ	9,900	906.00	8,969,400
横河ブリッジホールディングス	22,300	2,572.00	57,355,600
駒井ハルテック	2,200	1,893.00	4,164,600
高田機工	1,100	2,711.00	2,982,100
三和ホールディングス	164,100	1,856.00	304,569,600
文化シャッター	51,300	1,082.00	55,506,600
三協立山	20,400	812.00	16,564,800
アルインコ	13,600	996.00	13,545,600
東洋シャッター	3,200	630.00	2,016,000
L I X I L	259,600	1,816.00	471,433,600
日本フィルコン	9,000	472.00	4,248,000
ノーリツ	26,200	1,682.00	44,068,400
長府製作所	17,900	2,494.00	44,642,600
リンナイ	96,900	3,043.00	294,866,700
ダイニチ工業	6,900	738.00	5,092,200
日東精工	25,800	605.00	15,609,000
三洋工業	1,600	1,990.00	3,184,000
岡部	28,700	732.00	21,008,400
ジーテクト	19,900	1,768.00	35,183,200
東プレ	31,400	1,560.00	48,984,000

高周波熱錬	27,500	983.00	27,032,500
東京製綱	10,500	1,162.00	12,201,000
サンコール	12,300	533.00	6,555,900
モリテック スチール	10,200	295.00	3,009,000
パイオラックス	24,600	2,186.00	53,775,600
エイチワン	18,300	841.00	15,390,300
日本発條	157,600	1,030.50	162,406,800
中央発條	13,200	698.00	9,213,600
アドバネクス	1,700	997.00	1,694,900
立川ブラインド工業	8,000	1,246.00	9,968,000
三益半導体工業	13,800	3,000.00	41,400,000
日本ドライケミカル	3,300	1,761.00	5,811,300
日本製鋼所	48,100	2,982.50	143,458,250
三浦工業	72,900	3,604.00	262,731,600
タクマ	53,700	1,445.00	77,596,500
ツガミ	38,900	1,321.00	51,386,900
オークマ	17,500	7,327.00	128,222,500
芝浦機械	17,500	4,780.00	83,650,000
アマダ	278,400	1,392.00	387,532,800
アイダエンジニアリング	36,000	952.00	34,272,000
TAKISAWA	3,600	1,389.00	5,000,400
FUJI	75,800	2,605.00	197,459,000
牧野フライス製作所	19,300	5,470.00	105,571,000
オーエスジー	83,400	1,924.00	160,461,600
ダイジェット工業	1,500	884.00	1,326,000
旭ダイヤモンド工業	48,900	882.00	43,129,800
DMG森精機	105,800	2,410.00	254,978,000
ソディック	46,100	712.00	32,823,200
ディスコ	84,000	22,525.00	1,892,100,000
日東工器	8,500	1,921.00	16,328,500
日進工具	14,600	1,106.00	16,147,600
パンチ工業	12,400	488.00	6,051,200
富士ダイス	6,400	656.00	4,198,400
豊和工業	7,600	807.00	6,133,200
東洋機械金属	9,500	682.00	6,479,000
エンシュウ	3,000	813.00	2,439,000
島精機製作所	27,800	1,814.00	50,429,200
オプトラン	25,800	2,265.00	58,437,000
NCホールディングス	2,800	2,195.00	6,146,000
イワキポンプ	11,700	1,379.00	16,134,300
フリュー	18,300	1,282.00	23,460,600
ヤマシンフィルタ	41,900	300.00	12,570,000

日阪製作所	17,000	922.00	15,674,000
やまびこ	28,500	1,552.00	44,232,000
野村マイクロ・サイエンス	5,900	6,330.00	37,347,000
平田機工	8,300	8,200.00	68,060,000
P E G A S U S	19,400	575.00	11,155,000
マルマエ	7,600	1,765.00	13,414,000
タツモ	9,600	2,249.00	21,590,400
ナブテスコ	109,500	3,107.00	340,216,500
三井海洋開発	21,900	1,527.00	33,441,300
レオン自動機	18,400	1,400.00	25,760,000
S M C	56,600	76,110.00	4,307,826,000
ホソカワミクロン	11,200	3,490.00	39,088,000
ユニオンツール	7,700	3,285.00	25,294,500
瑞光	12,600	1,169.00	14,729,400
オイレス工業	24,400	1,930.00	47,092,000
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,055.00	28,385,000
サトーホールディングス	24,900	1,905.00	47,434,500
技研製作所	16,400	1,962.00	32,176,800
日本エアーテック	8,900	1,212.00	10,786,800
カワタ	4,000	1,132.00	4,528,000
日精樹脂工業	13,100	982.00	12,864,200
オカダアイヨン	4,200	2,306.00	9,685,200
ワイエイシイホールディングス	5,800	2,700.00	15,660,000
小松製作所	817,400	3,714.00	3,035,823,600
住友重機械工業	103,200	3,360.00	346,752,000
日立建機	69,500	3,887.00	270,146,500
日工	26,100	659.00	17,199,900
巴工業	7,500	2,792.00	20,940,000
井関農機	16,400	1,239.00	20,319,600
T O W A	17,800	2,460.00	43,788,000
丸山製作所	2,300	1,947.00	4,478,100
北川鉄工所	7,000	1,125.00	7,875,000
ローツェ	9,100	11,620.00	105,742,000
タカキタ	4,000	479.00	1,916,000
クボタ	923,200	2,024.00	1,868,556,800
荏原実業	8,400	2,835.00	23,814,000
三菱化工機	5,700	2,693.00	15,350,100
月島ホールディングス	23,700	1,250.00	29,625,000
帝国電機製作所	12,300	2,607.00	32,066,100
新東工業	35,400	1,058.00	37,453,200
澁谷工業	16,400	2,549.00	41,803,600
アイチ コーポレーション	24,500	855.00	20,947,500

小森コーポレーション	40,600	1,003.00	40,721,800
鶴見製作所	13,400	2,678.00	35,885,200
日本ギア工業	4,700	368.00	1,729,600
酒井重工業	2,200	5,120.00	11,264,000
荏原製作所	71,400	6,823.00	487,162,200
石井鐵工所	1,600	2,467.00	3,947,200
西島製作所	15,100	1,856.00	28,025,600
北越工業	17,600	1,442.00	25,379,200
ダイキン工業	208,200	28,745.00	5,984,709,000
オルガノ	24,000	4,075.00	97,800,000
トーヨーカネツ	6,700	3,560.00	23,852,000
栗田工業	97,600	5,392.00	526,259,200
椿本チエイン	24,800	3,730.00	92,504,000
大同工業	5,600	740.00	4,144,000
木村化工機	13,500	698.00	9,423,000
アネスト岩田	29,700	1,179.00	35,016,300
ダイフク	269,900	2,934.50	792,021,550
サムコ	4,700	5,420.00	25,474,000
加藤製作所	6,500	1,193.00	7,754,500
油研工業	2,100	2,043.00	4,290,300
タダノ	92,100	1,117.00	102,875,700
フジテック	61,200	3,529.00	215,974,800
C K D	48,300	2,250.00	108,675,000
平和	58,000	2,434.00	141,172,000
理想科学工業	14,000	2,315.00	32,410,000
S A N K Y O	34,300	5,665.00	194,309,500
日本金銭機械	19,200	1,145.00	21,984,000
マースグループホールディングス	10,300	2,741.00	28,232,300
フクシマガリレイ	12,800	4,770.00	61,056,000
オーイズミ	5,200	498.00	2,589,600
ダイコク電機	9,600	3,945.00	37,872,000
竹内製作所	31,700	4,495.00	142,491,500
アマノ	49,500	2,984.00	147,708,000
J U K I	27,100	581.00	15,745,100
ジャノメ	17,800	643.00	11,445,400
マックス	21,500	2,654.00	57,061,000
グローリー	41,900	2,790.00	116,901,000
新晃工業	17,600	2,003.00	35,252,800
大和冷機工業	26,800	1,370.00	36,716,000
セガサミーホールディングス	140,200	2,985.50	418,567,100
日本ピストンリング	4,600	1,693.00	7,787,800
リケン	6,900	3,280.00	22,632,000

T P R	20,000	1,763.00	35,260,000
ツバキ・ナカシマ	43,100	813.00	35,040,300
ホシザキ	112,300	5,056.00	567,788,800
大豊工業	15,200	896.00	13,619,200
日本精工	320,500	896.10	287,200,050
N T N	343,900	302.80	104,132,920
ジェイテクト	155,300	1,312.00	203,753,600
不二越	12,900	4,150.00	53,535,000
日本トムソン	42,900	592.00	25,396,800
T H K	100,700	2,828.50	284,829,950
ユーシン精機	13,900	706.00	9,813,400
前澤給装工業	12,300	1,120.00	13,776,000
イーグル工業	19,300	1,772.00	34,199,600
前澤工業	7,800	804.00	6,271,200
日本ピラー工業	16,200	4,445.00	72,009,000
キッツ	64,300	1,066.00	68,543,800
マキタ	217,000	3,927.00	852,159,000
三井E & S	82,600	513.00	42,373,800
日立造船	143,100	919.00	131,508,900
三菱重工業	305,100	6,529.00	1,991,997,900
I H I	109,900	3,857.00	423,884,300
スター精密	33,000	1,777.00	58,641,000
日清紡ホールディングス	142,000	1,203.00	170,826,000
イビデン	100,100	8,073.00	808,107,300
コニカミノルタ	390,300	497.40	194,135,220
ブラザー工業	233,300	2,074.50	483,980,850
ミネベアミツミ	303,600	2,492.00	756,571,200
日立製作所	848,300	8,842.00	7,500,668,600
東芝	335,700	4,504.00	1,511,992,800
三菱電機	1,802,900	1,997.50	3,601,292,750
富士電機	106,100	5,945.00	630,764,500
東洋電機製造	4,400	948.00	4,171,200
安川電機	206,700	6,003.00	1,240,820,100
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,692.00	32,486,400
明電舎	26,500	2,044.00	54,166,000
オリジン	3,000	1,297.00	3,891,000
山洋電気	7,600	7,480.00	56,848,000
デンヨー	13,300	1,992.00	26,493,600
P H C ホールディングス	24,600	1,490.00	36,654,000
ソシオネクスト	24,500	16,470.00	403,515,000
東芝テック	26,100	3,900.00	101,790,000
芝浦メカトロニクス	3,000	22,220.00	66,660,000

マブチモーター	43,400	3,819.00	165,744,600
ニデック	424,500	7,463.00	3,168,043,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,400	543.00	7,276,200
トレックス・セミコンダクター	8,400	2,315.00	19,446,000
東光高岳	10,700	2,126.00	22,748,200
ダブル・スコープ	57,100	1,320.00	75,372,000
ダイヘン	15,800	5,470.00	86,426,000
ヤーマン	30,500	1,034.00	31,537,000
JVCケンウッド	159,700	464.00	74,100,800
ミマキエンジニアリング	17,000	893.00	15,181,000
I - P E X	10,000	1,318.00	13,180,000
大崎電気工業	41,400	543.00	22,480,200
オムロン	159,900	8,562.00	1,369,063,800
日東工業	23,500	3,535.00	83,072,500
I D E C	25,800	3,150.00	81,270,000
正興電機製作所	5,500	1,050.00	5,775,000
不二電機工業	3,000	1,182.00	3,546,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,400	2,817.00	161,695,800
サクサホールディングス	2,800	2,188.00	6,126,400
メルコホールディングス	4,500	3,175.00	14,287,500
テクノメディカ	4,400	1,965.00	8,646,000
日本電気	246,700	6,848.00	1,689,401,600
富士通	173,800	18,010.00	3,130,138,000
沖電気工業	78,900	881.00	69,510,900
岩崎通信機	5,900	785.00	4,631,500
電気興業	7,000	2,316.00	16,212,000
サンケン電気	16,200	12,180.00	197,316,000
ナカヨ	2,200	1,157.00	2,545,400
アイホン	10,600	2,449.00	25,959,400
ルネサスエレクトロニクス	1,138,300	2,624.50	2,987,468,350
セイコーエプソン	223,800	2,191.00	490,345,800
ワコム	133,300	600.00	79,980,000
アルバック	41,400	5,837.00	241,651,800
アクセル	5,300	1,666.00	8,829,800
E I Z O	12,800	4,655.00	59,584,000
日本信号	39,700	1,038.00	41,208,600
京三製作所	36,500	513.00	18,724,500
能美防災	23,800	1,740.00	41,412,000
ホーチキ	13,200	1,733.00	22,875,600
星和電機	6,100	539.00	3,287,900
エレコム	41,900	1,492.00	62,514,800
パナソニック ホールディングス	2,060,500	1,688.50	3,479,154,250

シャープ	210,000	786.40	165,144,000
アンリツ	122,900	1,239.00	152,273,100
富士通ゼネラル	49,400	3,120.00	154,128,000
ソニーグループ	1,221,800	12,830.00	15,675,694,000
T D K	276,300	5,321.00	1,470,192,300
帝国通信工業	8,100	1,638.00	13,267,800
タムラ製作所	74,800	627.00	46,899,600
アルプスアルパイン	156,100	1,220.50	190,520,050
池上通信機	4,300	692.00	2,975,600
日本電波工業	21,200	1,197.00	25,376,400
鈴木	9,700	938.00	9,098,600
メイコー	19,200	2,584.00	49,612,800
日本トリム	4,000	3,250.00	13,000,000
ローランド ディー . ジー .	9,700	3,570.00	34,629,000
フォスター電機	16,100	911.00	14,667,100
S M K	4,200	2,482.00	10,424,400
ヨコオ	14,100	1,847.00	26,042,700
ホシデン	40,900	1,724.00	70,511,600
ヒロセ電機	28,100	18,295.00	514,089,500
日本航空電子工業	35,800	3,060.00	109,548,000
T O A	19,800	972.00	19,245,600
マクセル	35,500	1,588.00	56,374,000
古野電気	23,000	1,073.00	24,679,000
スミダコーポレーション	18,900	1,484.00	28,047,600
アイコム	6,700	2,803.00	18,780,100
リオン	7,400	1,892.00	14,000,800
横河電機	190,800	2,642.50	504,189,000
新電元工業	6,700	3,210.00	21,507,000
アズビル	120,700	4,419.00	533,373,300
東亜ディーケーケー	6,700	849.00	5,688,300
日本光電工業	79,900	3,687.00	294,591,300
チノー	7,200	2,406.00	17,323,200
共和電業	12,600	364.00	4,586,400
日本電子材料	11,400	1,815.00	20,691,000
堀場製作所	38,500	8,089.00	311,426,500
アドバンテスト	136,100	19,470.00	2,649,867,000
小野測器	5,800	465.00	2,697,000
エスペック	14,000	2,331.00	32,634,000
キーエンス	172,800	65,390.00	11,299,392,000
日置電機	9,100	8,880.00	80,808,000
シスメックス	149,000	9,542.00	1,421,758,000
日本マイクロニクス	28,600	2,084.00	59,602,400

メガチップス	14,300	3,705.00	52,981,500
O B A R A G R O U P	9,500	4,095.00	38,902,500
澤藤電機	1,900	1,251.00	2,376,900
原田工業	6,400	820.00	5,248,000
コーセル	21,100	1,224.00	25,826,400
イリソ電子工業	16,000	3,995.00	63,920,000
オブテックスグループ	31,900	1,949.00	62,173,100
千代田インテグレ	6,200	2,387.00	14,799,400
レーザーテック	79,200	20,485.00	1,622,412,000
スタンレー電気	123,000	2,669.50	328,348,500
ウシオ電機	87,900	1,921.50	168,899,850
岡谷電機産業	11,700	276.00	3,229,200
ハリオス テクノ ホールディング	12,800	622.00	7,961,600
エノモト	3,600	1,746.00	6,285,600
日本セラミック	17,700	2,633.00	46,604,100
遠藤照明	6,300	1,234.00	7,774,200
古河電池	13,100	1,006.00	13,178,600
双信電機	6,400	357.00	2,284,800
山一電機	14,300	2,286.00	32,689,800
図研	15,100	3,805.00	57,455,500
日本電子	43,300	4,805.00	208,056,500
カシオ計算機	128,700	1,175.00	151,222,500
ファナック	842,200	4,747.00	3,997,923,400
日本シイエムケイ	37,300	536.00	19,992,800
エンプラス	5,100	5,400.00	27,540,000
大真空	21,600	646.00	13,953,600
ローム	79,900	13,410.00	1,071,459,000
浜松ホトニクス	138,600	6,838.00	947,746,800
三井ハイテック	17,900	9,150.00	163,785,000
新光電気工業	61,200	5,782.00	353,858,400
京セラ	268,300	7,485.00	2,008,225,500
太陽誘電	84,200	4,143.00	348,840,600
村田製作所	523,800	7,954.00	4,166,305,200
双葉電子工業	33,600	496.00	16,665,600
北陸電気工業	5,300	1,213.00	6,428,900
ニチコン	35,500	1,450.00	51,475,000
日本ケミコン	17,400	1,248.00	21,715,200
K O A	26,300	1,829.00	48,102,700
市光工業	25,600	522.00	13,363,200
小糸製作所	207,800	2,496.00	518,668,800
ミツバ	32,400	818.00	26,503,200
S C R E E Nホールディングス	29,500	15,385.00	453,857,500



キヤノン電子	19,300	1,908.00	36,824,400
キヤノン	947,600	3,735.00	3,539,286,000
リコー	433,000	1,218.50	527,610,500
象印マホービン	51,800	2,098.00	108,676,400
MUTOHホールディングス	2,000	1,777.00	3,554,000
東京エレクトロン	365,500	19,900.00	7,273,450,000
イノテック	11,700	1,612.00	18,860,400
トヨタ紡織	72,800	2,544.50	185,239,600
芦森工業	2,500	1,891.00	4,727,500
ユニプレス	31,100	1,131.00	35,174,100
豊田自動織機	126,300	10,085.00	1,273,735,500
モリタホールディングス	30,400	1,531.00	46,542,400
三櫻工業	26,500	846.00	22,419,000
デンソー	356,200	9,453.00	3,367,158,600
東海理化電機製作所	48,700	2,127.00	103,584,900
川崎重工業	130,100	3,670.00	477,467,000
名村造船所	34,500	602.00	20,769,000
日本車輛製造	6,600	1,991.00	13,140,600
三菱ロジスネクスト	27,600	1,207.00	33,313,200
近畿車輛	1,900	1,634.00	3,104,600
日産自動車	2,453,500	581.90	1,427,691,650
いすゞ自動車	502,100	1,742.50	874,909,250
トヨタ自動車	9,483,700	2,260.00	21,433,162,000
日野自動車	222,700	596.00	132,729,200
三菱自動車工業	673,800	499.10	336,293,580
エフテック	9,400	933.00	8,770,200
レシップホールディングス	5,300	540.00	2,862,000
GMB	2,700	1,541.00	4,160,700
ファルテック	2,300	612.00	1,407,600
武蔵精密工業	42,200	1,753.00	73,976,600
日産車体	30,500	939.00	28,639,500
新明和工業	54,300	1,323.00	71,838,900
極東開発工業	28,500	1,714.00	48,849,000
トピー工業	14,000	2,289.00	32,046,000
ティラド	4,400	1,837.00	8,082,800
曙ブレーキ工業	105,400	144.00	15,177,600
タチエス	27,400	1,555.00	42,607,000
NOK	67,100	2,068.00	138,762,800
フタバ産業	46,400	545.00	25,288,000
KYB	16,600	4,965.00	82,419,000
大同メタル工業	33,900	546.00	18,509,400
プレス工業	77,300	617.00	47,694,100

ミクニ	15,600	507.00	7,909,200
太平洋工業	39,700	1,307.00	51,887,900
アイシン	133,200	4,527.00	602,996,400
マツダ	571,300	1,346.50	769,255,450
今仙電機製作所	8,600	647.00	5,564,200
本田技研工業	1,403,900	4,217.00	5,920,246,300
スズキ	317,200	5,362.00	1,700,826,400
S U B A R U	546,500	2,565.00	1,401,772,500
安永	5,900	956.00	5,640,400
ヤマハ発動機	271,400	4,033.00	1,094,556,200
T B K	13,500	408.00	5,508,000
エクセディ	28,300	2,394.00	67,750,200
豊田合成	50,400	2,769.00	139,557,600
愛三工業	28,600	1,145.00	32,747,000
盟和産業	2,000	1,015.00	2,030,000
日本プラスト	10,700	460.00	4,922,000
ヨロズ	16,300	935.00	15,240,500
エフ・シー・シー	30,600	1,885.00	57,681,000
シマノ	70,100	23,675.00	1,659,617,500
テイ・エス テック	79,100	1,837.50	145,346,250
ジャムコ	7,300	1,531.00	11,176,300
テルモ	531,200	4,296.00	2,282,035,200
クリエートメディック	4,400	882.00	3,880,800
日機装	40,300	880.00	35,464,000
日本エム・ディ・エム	10,300	978.00	10,073,400
島津製作所	210,400	4,375.00	920,500,000
J M S	16,000	569.00	9,104,000
長野計器	12,600	2,118.00	26,686,800
ブイ・テクノロジー	8,500	2,403.00	20,425,500
東京計器	13,300	1,301.00	17,303,300
愛知時計電機	6,700	1,560.00	10,452,000
インターアクション	8,200	1,415.00	11,603,000
オーバル	11,900	401.00	4,771,900
東京精密	37,900	7,740.00	293,346,000
マニー	69,100	1,637.00	113,116,700
ニコン	249,700	1,810.00	451,957,000
トプコン	90,900	2,035.50	185,026,950
オリンパス	1,063,100	2,221.50	2,361,676,650
理研計器	10,700	5,500.00	58,850,000
タムロン	12,900	3,920.00	50,568,000
H O Y A	365,900	16,025.00	5,863,547,500
シード	6,900	576.00	3,974,400

ノーリツ銅機	16,400	2,256.00	36,998,400
A & Dホロンホールディングス	25,200	1,778.00	44,805,600
朝日インテック	193,000	2,720.00	524,960,000
シチズン時計	189,900	879.00	166,922,100
リズム	4,200	1,558.00	6,543,600
大研医器	10,100	510.00	5,151,000
メニコン	59,400	2,417.00	143,569,800
シンシア	1,300	575.00	747,500
松風	7,800	2,231.00	17,401,800
セイコーグループ	26,800	2,619.00	70,189,200
ニプロ	144,000	1,010.00	145,440,000
K Y O R I T S U	19,900	183.00	3,641,700
中本パックス	4,100	1,679.00	6,883,900
スノーピーク	29,600	1,787.00	52,895,200
パラマウントベッドホールディングス	39,900	2,290.00	91,371,000
トランザクション	11,400	1,855.00	21,147,000
粧美堂	3,600	428.00	1,540,800
ニホンフラッシュ	16,200	951.00	15,406,200
前田工織	14,600	3,020.00	44,092,000
永大産業	14,300	218.00	3,117,400
アートネイチャー	17,800	767.00	13,652,600
バンダイナムコホールディングス	473,200	3,110.00	1,471,652,000
アイフィスジャパン	3,700	615.00	2,275,500
S H O E I	39,000	2,559.00	99,801,000
フランスベッドホールディングス	19,800	1,140.00	22,572,000
パイロットコーポレーション	27,000	4,573.00	123,471,000
萩原工業	11,500	1,498.00	17,227,000
フジシールインターナショナル	35,000	1,518.00	53,130,000
タカラトミー	79,400	1,752.00	139,108,800
広済堂ホールディングス	9,000	2,252.00	20,268,000
エステールホールディングス	3,100	626.00	1,940,600
タカノ	5,000	826.00	4,130,000
プロネクサス	14,300	1,003.00	14,342,900
ホクシン	10,300	145.00	1,493,500
ウッドワン	4,400	1,240.00	5,456,000
大建工業	10,500	2,296.00	24,108,000
凸版印刷	212,300	3,058.00	649,213,400
大日本印刷	188,800	3,965.00	748,592,000
共同印刷	4,900	3,170.00	15,533,000
N I S S H A	32,800	1,702.00	55,825,600
光村印刷	1,100	1,214.00	1,335,400
T A K A R A & C O M P A N Y	11,000	2,311.00	25,421,000

アシックス	159,400	4,248.00	677,131,200
ツツミ	3,000	2,305.00	6,915,000
ローランド	12,700	4,100.00	52,070,000
小松ウオール工業	6,300	2,651.00	16,701,300
ヤマハ	108,900	5,253.00	572,051,700
河合楽器製作所	4,700	3,525.00	16,567,500
クリナップ	19,300	728.00	14,050,400
ピジョン	110,000	2,021.00	222,310,000
キングジム	15,200	877.00	13,330,400
リンテック	34,700	2,305.00	79,983,500
イトーキ	35,400	1,041.00	36,851,400
任天堂	1,090,400	6,305.00	6,874,972,000
三菱鉛筆	24,500	1,687.00	41,331,500
タカラスタANDARD	31,800	1,877.00	59,688,600
コクヨ	83,200	2,010.00	167,232,000
ナカバヤシ	18,600	511.00	9,504,600
グローブライド	14,000	2,223.00	31,122,000
オカムラ	52,000	1,949.00	101,348,000
美津濃	17,200	3,695.00	63,554,000
東京電力ホールディングス	1,556,900	515.30	802,270,570
中部電力	636,400	1,703.50	1,084,107,400
関西電力	666,900	1,762.00	1,175,077,800
中国電力	275,100	965.90	265,719,090
北陸電力	163,000	761.10	124,059,300
東北電力	422,200	883.50	373,013,700
四国電力	147,400	970.50	143,051,700
九州電力	398,100	906.60	360,917,460
北海道電力	166,900	574.50	95,884,050
沖縄電力	40,400	1,148.00	46,379,200
電源開発	130,100	2,159.50	280,950,950
エフオン	11,200	540.00	6,048,000
イーレックス	30,700	1,128.00	34,629,600
レノバ	46,000	1,505.00	69,230,000
東京瓦斯	365,100	3,112.00	1,136,191,200
大阪瓦斯	349,900	2,132.00	745,986,800
東邦瓦斯	68,000	2,437.50	165,750,000
北海道瓦斯	10,300	2,302.00	23,710,600
広島ガス	36,400	370.00	13,468,000
西部ガスホールディングス	16,200	2,023.00	32,772,600
静岡ガス	39,400	1,062.00	41,842,800
メタウォーター	20,700	1,792.00	37,094,400
SBSホールディングス	15,400	3,260.00	50,204,000

東武鉄道	189,700	3,649.00	692,215,300
相鉄ホールディングス	57,100	2,488.50	142,093,350
東急	484,300	1,692.00	819,435,600
京浜急行電鉄	195,900	1,297.00	254,082,300
小田急電鉄	261,800	1,877.50	491,529,500
京王電鉄	91,300	4,283.00	391,037,900
京成電鉄	111,400	5,818.00	648,125,200
富士急行	21,300	5,370.00	114,381,000
東日本旅客鉄道	292,900	7,836.00	2,295,164,400
西日本旅客鉄道	220,600	5,826.00	1,285,215,600
東海旅客鉄道	133,100	17,595.00	2,341,894,500
西武ホールディングス	208,900	1,491.50	311,574,350
鴻池運輸	29,400	1,742.00	51,214,800
西日本鉄道	46,100	2,449.00	112,898,900
ハマキョウレックス	13,500	3,755.00	50,692,500
サカイ引越センター	8,200	4,990.00	40,918,000
近鉄グループホールディングス	172,400	4,713.00	812,521,200
阪急阪神ホールディングス	229,900	4,584.00	1,053,861,600
南海電気鉄道	82,400	3,063.00	252,391,200
京阪ホールディングス	95,000	3,676.00	349,220,000
神戸電鉄	4,700	2,972.00	13,968,400
名古屋鉄道	190,600	2,246.00	428,087,600
山陽電気鉄道	13,000	2,182.00	28,366,000
アルプス物流	13,700	1,551.00	21,248,700
ヤマトホールディングス	220,800	2,598.50	573,748,800
山九	43,900	4,776.00	209,666,400
丸運	6,500	240.00	1,560,000
丸全昭和運輸	10,700	3,960.00	42,372,000
センコーグループホールディングス	91,300	1,017.00	92,852,100
トナミホールディングス	3,800	4,870.00	18,506,000
ニッコンホールディングス	55,200	2,857.00	157,706,400
日本石油輸送	1,400	2,836.00	3,970,400
福山通運	13,100	3,970.00	52,007,000
セイノーホールディングス	107,300	2,146.00	230,265,800
エスライングループ本社	3,800	876.00	3,328,800
神奈川中央交通	4,900	3,125.00	15,312,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,600	2,016.00	83,865,600
C & F ロジホールディングス	16,600	1,242.00	20,617,200
九州旅客鉄道	121,900	3,085.00	376,061,500
S Gホールディングス	330,900	2,070.50	685,128,450
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	64,400	8,069.00	519,643,600
日本郵船	461,600	3,260.00	1,504,816,000

商船三井	304,300	3,581.00	1,089,698,300
川崎汽船	129,800	3,801.00	493,369,800
N S ユナイテッド海運	9,600	3,500.00	33,600,000
飯野海運	64,500	874.00	56,373,000
共栄タンカー	3,700	857.00	3,170,900
乾汽船	22,700	1,282.00	29,101,400
日本航空	423,500	3,117.00	1,320,049,500
A N A ホールディングス	469,200	3,396.00	1,593,403,200
パスコ	2,600	1,826.00	4,747,600
ランコム	5,000	6,900.00	34,500,000
日新	13,100	2,501.00	32,763,100
三菱倉庫	37,100	3,456.00	128,217,600
三井倉庫ホールディングス	16,100	3,490.00	56,189,000
住友倉庫	46,500	2,372.00	110,298,000
澁澤倉庫	6,900	2,796.00	19,292,400
東陽倉庫	17,800	270.00	4,806,000
日本トランスシティ	34,700	630.00	21,861,000
ケイヒン	2,400	1,777.00	4,264,800
中央倉庫	8,300	1,080.00	8,964,000
川西倉庫	2,200	1,036.00	2,279,200
安田倉庫	11,800	992.00	11,705,600
ファイズホールディングス	2,400	1,184.00	2,841,600
東洋埠頭	3,800	1,379.00	5,240,200
上組	82,700	3,222.00	266,459,400
サンリツ	3,000	744.00	2,232,000
キムラユニティー	6,400	1,298.00	8,307,200
キューソー流通システム	8,000	927.00	7,416,000
東海運	7,800	288.00	2,246,400
エーアイティー	10,800	1,845.00	19,926,000
内外トランスライン	6,200	2,554.00	15,834,800
日本コンセプト	5,400	1,917.00	10,351,800
N E C ネットエスアイ	57,900	1,922.00	111,283,800
クロスキャット	9,900	1,121.00	11,097,900
システナ	291,400	283.00	82,466,200
デジタルアーツ	11,000	5,690.00	62,590,000
日鉄ソリューションズ	29,600	3,885.00	114,996,000
キューブシステム	10,300	1,192.00	12,277,600
コア	7,700	1,717.00	13,220,900
手間いらず	2,900	3,815.00	11,063,500
ラクーンホールディングス	14,400	690.00	9,936,000
ソリトンシステムズ	9,000	1,211.00	10,899,000
ソフトクリエイティブホールディングス	14,300	1,719.00	24,581,700

T I S	189,500	3,569.00	676,325,500
J N S ホールディングス	6,200	566.00	3,509,200
グリー	46,500	614.00	28,551,000
G M O ペパボ	2,500	1,731.00	4,327,500
コーエーテクモホールディングス	108,600	2,339.50	254,069,700
三菱総合研究所	8,500	5,320.00	45,220,000
電算	1,600	1,596.00	2,553,600
A G S	5,700	734.00	4,183,800
ファインデックス	13,800	605.00	8,349,000
ブレインパッド	13,000	950.00	12,350,000
K L a b	34,500	323.00	11,143,500
ポルトゥウィンホールディングス	29,600	742.00	21,963,200
ネクソン	441,200	2,596.00	1,145,355,200
アイスタイル	50,400	522.00	26,308,800
エムアップホールディングス	21,300	1,142.00	24,324,600
エイチーム	10,300	704.00	7,251,200
エニグモ	22,200	406.00	9,013,200
テクノスジャパン	11,100	665.00	7,381,500
コロプラ	67,300	632.00	42,533,600
ブロードリーフ	101,300	434.00	43,964,200
クロス・マーケティンググループ	8,200	825.00	6,765,000
デジタルハーツホールディングス	10,800	1,275.00	13,770,000
システム情報	13,800	756.00	10,432,800
メディアドゥ	6,900	1,456.00	10,046,400
じげん	50,600	749.00	37,899,400
ブイキューブ	20,900	467.00	9,760,300
エンカレッジ・テクノロジー	3,200	511.00	1,635,200
サイバーリンクス	4,400	732.00	3,220,800
フィックスターズ	19,600	1,404.00	27,518,400
C A R T A H O L D I N G S	8,200	1,222.00	10,020,400
オブティム	14,300	969.00	13,856,700
セレス	7,000	1,013.00	7,091,000
S H I F T	11,500	25,375.00	291,812,500
ティーガイア	18,100	1,726.00	31,240,600
セック	1,900	3,095.00	5,880,500
テクマトリックス	31,700	1,726.00	54,714,200
プロシップ	7,600	1,374.00	10,442,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	50,700	2,655.00	134,608,500
G M O ペイメントゲートウェイ	34,600	10,620.00	367,452,000
ザッパラス	3,800	343.00	1,303,400
システムリサーチ	5,400	2,652.00	14,320,800
インターネットイニシアティブ	94,600	2,561.00	242,270,600

さくらインターネット	19,500	1,199.00	23,380,500
ヴィンクス	4,000	1,327.00	5,308,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	3,010.00	15,953,000
SRAホールディングス	8,900	3,165.00	28,168,500
システムインテグレータ	4,100	439.00	1,799,900
朝日ネット	18,700	643.00	12,024,100
eBASE	24,400	713.00	17,397,200
アバントグループ	21,900	1,389.00	30,419,100
アドソル日進	7,300	1,653.00	12,066,900
ODKソリューションズ	3,100	561.00	1,739,100
フリービット	9,100	1,328.00	12,084,800
コムチュア	22,900	1,939.00	44,403,100
サイバーコム	2,200	1,402.00	3,084,400
アステリア	13,600	792.00	10,771,200
アイル	8,100	2,692.00	21,805,200
マークライنز	9,400	2,435.00	22,889,000
メディカル・データ・ビジョン	25,900	708.00	18,337,200
gumi	25,600	703.00	17,996,800
ショーケース	3,200	387.00	1,238,400
モバイルファクトリー	2,900	843.00	2,444,700
テラスカイ	7,500	2,575.00	19,312,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,571.00	15,710,000
PCIホールディングス	5,200	1,154.00	6,000,800
アイビーシー	2,200	581.00	1,278,200
ネオジャパン	5,800	1,055.00	6,119,000
PR TIMES	4,400	1,439.00	6,331,600
ラクス	82,000	2,270.00	186,140,000
ランドコンピュータ	3,300	1,262.00	4,164,600
ダブルスタンダード	7,000	2,420.00	16,940,000
オープンドア	12,200	1,263.00	15,408,600
アカツキ	8,200	2,025.00	16,605,000
ベネフィットジャパン	800	1,219.00	975,200
Ubicomホールディングス	5,400	1,466.00	7,916,400
カナミックネットワーク	18,800	452.00	8,497,600
ノムラシステムコーポレーション	13,000	124.00	1,612,000
チェンジホールディングス	42,400	2,137.00	90,608,800
シンクロ・フード	8,600	683.00	5,873,800
オークネット	8,600	1,732.00	14,895,200
キャピタル・アセット・プランニング	2,700	811.00	2,189,700
セグエグループ	3,800	1,082.00	4,111,600
エイトレッド	2,100	1,434.00	3,011,400
マクロミル	34,000	808.00	27,472,000



ビーグリー	2,300	1,113.00	2,559,900
オロ	5,200	1,933.00	10,051,600
ユーザーローカル	6,300	2,415.00	15,214,500
テモナ	3,300	296.00	976,800
ニーズウェル	7,400	775.00	5,735,000
マネーフォワード	41,900	5,550.00	232,545,000
サインポスト	5,200	537.00	2,792,400
Sun Asterisk	12,300	1,182.00	14,538,600
電算システムホールディングス	8,400	3,105.00	26,082,000
Appier Group	65,700	1,658.00	108,930,600
ソルクシーズ	11,000	427.00	4,697,000
フェイス	3,800	511.00	1,941,800
プロトコーポレーション	21,700	1,189.00	25,801,300
ハイマックス	5,400	1,398.00	7,549,200
野村総合研究所	345,100	3,841.00	1,325,529,100
サイバネットシステム	14,600	825.00	12,045,000
CEホールディングス	7,000	651.00	4,557,000
日本システム技術	5,600	2,413.00	13,512,800
インテージホールディングス	19,600	1,628.00	31,908,800
東邦システムサイエンス	3,800	1,208.00	4,590,400
ソースネクスト	88,300	192.00	16,953,600
インフォコム	22,300	2,230.00	49,729,000
シンプレクス・ホールディングス	29,600	2,579.00	76,338,400
HEROZ	5,800	2,053.00	11,907,400
ラクスル	41,600	1,492.00	62,067,200
メルカリ	104,300	3,428.00	357,540,400
IPS	5,600	2,302.00	12,891,200
FIG	15,700	276.00	4,333,200
システムサポート	6,700	2,024.00	13,560,800
イーソル	11,100	856.00	9,501,600
アルテリア・ネットワークス	16,200	1,976.00	32,011,200
東海ソフト	2,000	1,112.00	2,224,000
ウイングアーク1st	17,900	2,269.00	40,615,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,489.00	6,998,300
サーバーワークス	3,500	2,885.00	10,097,500
東名	1,000	2,686.00	2,686,000
ヴィッツ	1,400	1,451.00	2,031,400
トビラシステムズ	3,400	933.00	3,172,200
Sansan	56,700	1,547.50	87,743,250
Link-U	3,300	1,011.00	3,336,300
ギフトィ	18,900	1,764.00	33,339,600
メドレー	23,300	5,160.00	120,228,000

ベース	5,900	5,240.00	30,916,000
J M D C	28,500	5,396.00	153,786,000
フォーカスシステムズ	12,700	1,022.00	12,979,400
クレスコ	13,400	1,950.00	26,130,000
フジ・メディア・ホールディングス	166,400	1,533.50	255,174,400
オービック	57,900	22,515.00	1,303,618,500
ジャストシステム	24,900	3,989.00	99,326,100
T D C ソフト	14,600	1,745.00	25,477,000
Zホールディングス	2,465,300	369.20	910,188,760
トレンドマイクロ	100,100	6,781.00	678,778,100
I Dホールディングス	11,700	1,260.00	14,742,000
日本オラクル	33,100	9,963.00	329,775,300
アルファシステムズ	5,500	3,305.00	18,177,500
フューチャー	43,100	1,733.00	74,692,300
C A C H o l d i n g s	10,600	1,672.00	17,723,200
S Bテクノロジー	7,400	2,647.00	19,587,800
トーセ	3,900	762.00	2,971,800
オービックビジネスコンサルタント	34,100	5,180.00	176,638,000
伊藤忠テクノソリューションズ	93,000	3,498.00	325,314,000
アイティフォー	22,900	1,076.00	24,640,400
東計電算	2,400	6,050.00	14,520,000
エクスネット	1,900	1,018.00	1,934,200
大塚商会	98,200	5,501.00	540,198,200
サイボウズ	23,900	2,239.00	53,512,100
電通国際情報サービス	21,100	5,120.00	108,032,000
A C C E S S	20,500	928.00	19,024,000
デジタルガレージ	30,800	4,095.00	126,126,000
E Mシステムズ	28,900	825.00	23,842,500
ウェザーニューズ	5,400	6,660.00	35,964,000
C I J	28,800	555.00	15,984,000
ビジネスエンジニアリング	2,900	3,030.00	8,787,000
日本エンタープライズ	14,300	142.00	2,030,600
WOWOW	13,100	1,132.00	14,829,200
スカラ	16,100	743.00	11,962,300
インテリジェント ウェイブ	7,200	748.00	5,385,600
I M A G I C A G R O U P	14,500	678.00	9,831,000
ネットワンシステムズ	64,600	2,966.00	191,603,600
システムソフト	60,900	78.00	4,750,200
アルゴグラフィックス	15,900	3,710.00	58,989,000
マーベラス	28,200	671.00	18,922,200
エイベックス	29,500	1,565.00	46,167,500
B I P R O G Y	63,800	3,405.00	217,239,000

都築電気	9,100	1,879.00	17,098,900
TBSホールディングス	88,700	2,624.50	232,793,150
日本テレビホールディングス	153,400	1,339.00	205,402,600
朝日放送グループホールディングス	16,300	665.00	10,839,500
テレビ朝日ホールディングス	42,100	1,697.00	71,443,700
スカパーJ SATホールディングス	153,800	573.00	88,127,400
テレビ東京ホールディングス	12,500	3,410.00	42,625,000
日本BS放送	4,900	926.00	4,537,400
ビジョン	22,800	1,704.00	38,851,200
スマートバリュー	3,400	385.00	1,309,000
USEN-NEXT HOLDINGS	19,400	3,380.00	65,572,000
ワイヤレスゲート	6,100	226.00	1,378,600
日本通信	160,100	244.00	39,064,400
クロップス	2,200	1,020.00	2,244,000
日本電信電話	55,489,800	166.90	9,261,247,620
KDDI	1,338,600	4,307.00	5,765,350,200
ソフトバンク	2,783,700	1,530.50	4,260,452,850
光通信	20,400	20,460.00	417,384,000
エムティーアイ	12,000	556.00	6,672,000
GMOインターネットグループ	64,000	2,712.50	173,600,000
ファイバーゲート	9,300	1,422.00	13,224,600
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	273.00	873,600
KADOKAWA	91,600	3,390.00	310,524,000
学研ホールディングス	28,900	870.00	25,143,000
ゼンリン	29,700	929.00	27,591,300
昭文社ホールディングス	5,900	300.00	1,770,000
インプレスホールディングス	12,000	225.00	2,700,000
アイネット	10,500	1,640.00	17,220,000
松竹	9,900	10,650.00	105,435,000
東宝	108,400	5,408.00	586,227,200
東映	4,800	17,860.00	85,728,000
NTTデータグループ	543,500	1,913.00	1,039,715,500
ピー・シー・エー	10,000	1,402.00	14,020,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,261.00	16,731,400
DTS	36,900	3,220.00	118,818,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	87,100	6,400.00	557,440,000
シーイーシー	24,300	1,739.00	42,257,700
カブコン	172,100	5,557.00	956,359,700
アイ・エス・ビー	8,900	1,561.00	13,892,900
ジャステック	10,700	1,351.00	14,455,700
SCSK	141,400	2,221.50	314,120,100
NSW	6,800	2,362.00	16,061,600

アイネス	12,200	1,463.00	17,848,600
T K C	27,600	3,735.00	103,086,000
富士ソフト	39,200	4,485.00	175,812,000
N S D	61,800	2,756.00	170,320,800
コナミグループ	74,200	7,349.00	545,295,800
福井コンピュータホールディングス	12,100	2,664.00	32,234,400
J B C Cホールディングス	12,600	2,432.00	30,643,200
ミロク情報サービス	15,800	1,583.00	25,011,400
ソフトバンクグループ	854,500	6,767.00	5,782,401,500
高千穂交易	5,100	3,150.00	16,065,000
オルパヘルスケアホールディングス	2,100	1,750.00	3,675,000
伊藤忠食品	4,100	5,130.00	21,033,000
エレマテック	16,400	1,809.00	29,667,600
あらた	14,000	4,820.00	67,480,000
トーメンデバイス	2,600	4,900.00	12,740,000
東京エレクトロン デバイス	6,700	10,080.00	67,536,000
円谷フィールズホールディングス	31,400	2,879.00	90,400,600
双日	182,100	3,187.00	580,352,700
アルフレッサ ホールディングス	183,400	2,138.50	392,200,900
横浜冷凍	49,800	1,175.00	58,515,000
ラサ商事	6,500	1,458.00	9,477,000
アルコニックス	24,100	1,380.00	33,258,000
神戸物産	141,400	3,584.00	506,777,600
ハイパー	2,800	446.00	1,248,800
あい ホールディングス	29,300	2,242.00	65,690,600
ディーブイエックス	3,900	875.00	3,412,500
ダイワボウホールディングス	74,700	2,690.50	200,980,350
マクニカホールディングス	43,200	5,710.00	246,672,000
ラクト・ジャパン	7,100	2,044.00	14,512,400
グリムス	7,600	2,916.00	22,161,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,700	919.00	24,537,300
八洲電機	14,800	1,341.00	19,846,800
メディアスホールディングス	11,700	806.00	9,430,200
レスターホールディングス	17,500	2,356.00	41,230,000
ジュテックホールディングス	3,300	1,181.00	3,897,300
大光	6,000	595.00	3,570,000
O C H Iホールディングス	3,300	1,309.00	4,319,700
T O K A Iホールディングス	90,300	894.00	80,728,200
黒谷	3,900	614.00	2,394,600
C o m i n i x	2,800	849.00	2,377,200
三洋貿易	20,600	1,353.00	27,871,800
ビューティガレージ	2,900	4,550.00	13,195,000

ウイン・パートナーズ	13,300	1,048.00	13,938,400
ミタチ産業	3,600	1,166.00	4,197,600
シップヘルスケアホールディングス	65,700	2,326.00	152,818,200
明治電機工業	6,800	1,464.00	9,955,200
デリカフーズホールディングス	5,600	590.00	3,304,000
スターティアホールディングス	2,800	1,311.00	3,670,800
コメダホールディングス	44,800	2,702.00	121,049,600
ピーバンドットコム	2,100	464.00	974,400
アセンテック	6,200	674.00	4,178,800
富士興産	3,200	1,616.00	5,171,200
協栄産業	1,300	2,005.00	2,606,500
フルサト・マルカホールディングス	18,200	2,481.00	45,154,200
ヤマエグループホールディングス	10,300	2,826.00	29,107,800
小野建	18,000	1,635.00	29,430,000
南陽	2,700	2,179.00	5,883,300
佐島電機	8,900	1,631.00	14,515,900
エコートレーディング	2,800	992.00	2,777,600
伯東	10,500	5,620.00	59,010,000
コンドーテック	14,100	1,216.00	17,145,600
中山福	7,600	345.00	2,622,000
ナガイレーベン	23,100	2,235.00	51,628,500
三菱食品	16,900	3,715.00	62,783,500
松田産業	13,900	2,250.00	31,275,000
第一興商	70,700	2,671.50	188,875,050
メディバルホールディングス	174,800	2,289.50	400,204,600
S P K	8,100	1,762.00	14,272,200
萩原電気ホールディングス	7,200	3,405.00	24,516,000
アズワン	26,000	5,454.00	141,804,000
スズデン	6,400	2,217.00	14,188,800
尾家産業	3,400	1,304.00	4,433,600
シモジマ	12,600	1,073.00	13,519,800
ドウシシャ	19,300	2,243.00	43,289,900
小津産業	3,200	1,573.00	5,033,600
高速	9,500	2,009.00	19,085,500
たけびし	7,000	1,711.00	11,977,000
リックス	2,900	3,105.00	9,004,500
丸文	16,300	1,246.00	20,309,800
ハピネット	15,500	2,155.00	33,402,500
橋本総業ホールディングス	7,200	1,187.00	8,546,400
日本ライフライン	53,600	981.00	52,581,600
タカショー	16,000	679.00	10,864,000
I D O M	55,300	958.00	52,977,400

進和	11,200	2,391.00	26,779,200
エスケイジャパン	3,500	546.00	1,911,000
ダイترون	7,200	2,940.00	21,168,000
シークス	26,100	1,516.00	39,567,600
田中商事	4,000	647.00	2,588,000
オーハシテクニカ	8,900	1,554.00	13,830,600
白銅	6,600	2,281.00	15,054,600
ダイコー通産	1,500	1,154.00	1,731,000
伊藤忠商事	1,126,000	5,524.00	6,220,024,000
丸紅	1,426,000	2,395.00	3,415,270,000
高島	2,200	3,470.00	7,634,000
長瀬産業	83,800	2,384.00	199,779,200
蝶理	9,800	3,020.00	29,596,000
豊田通商	160,100	7,246.00	1,160,084,600
三共生興	26,300	577.00	15,175,100
兼松	70,900	2,004.00	142,083,600
ツカモトコーポレーション	2,000	1,351.00	2,702,000
三井物産	1,296,900	5,157.00	6,688,113,300
日本紙パルプ商事	9,700	4,640.00	45,008,000
カメイ	19,400	1,470.00	28,518,000
東都水産	800	6,520.00	5,216,000
OUGホールディングス	2,100	2,445.00	5,134,500
スターゼン	13,900	2,288.00	31,803,200
山善	49,300	1,098.00	54,131,400
椿本興業	2,900	4,185.00	12,136,500
住友商事	1,131,700	2,954.00	3,343,041,800
内田洋行	7,400	5,760.00	42,624,000
三菱商事	1,114,100	6,862.00	7,644,954,200
第一実業	6,500	5,310.00	34,515,000
キャノンマーケティングジャパン	42,300	3,568.00	150,926,400
西華産業	7,200	2,017.00	14,522,400
佐藤商事	12,700	1,438.00	18,262,600
菱洋エレクトロ	15,600	3,630.00	56,628,000
東京産業	16,700	881.00	14,712,700
ユアサ商事	15,700	4,475.00	70,257,500
神鋼商事	4,600	5,780.00	26,588,000
トルク	7,700	263.00	2,025,100
阪和興業	32,800	4,500.00	147,600,000
正栄食品工業	12,200	4,220.00	51,484,000
カナデン	12,200	1,286.00	15,689,200
R Y O D E N	14,800	2,227.00	32,959,600
岩谷産業	41,600	7,419.00	308,630,400

ナイス	3,900	1,477.00	5,760,300
ニチモウ	1,800	3,965.00	7,137,000
極東貿易	10,900	1,745.00	19,020,500
アステナホールディングス	31,700	449.00	14,233,300
三愛オブリ	48,300	1,506.00	72,739,800
稲畑産業	36,900	3,130.00	115,497,000
G S I クレオス	10,600	1,969.00	20,871,400
明和産業	24,300	670.00	16,281,000
クワザワホールディングス	4,600	542.00	2,493,200
ワキタ	33,600	1,241.00	41,697,600
東邦ホールディングス	45,500	2,640.50	120,142,750
サンゲツ	45,900	2,464.00	113,097,600
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,356.00	31,594,800
シナネンホールディングス	5,900	3,795.00	22,390,500
伊藤忠エネクス	45,300	1,274.00	57,712,200
サンリオ	51,800	6,032.00	312,457,600
サンワテクノス	9,300	2,332.00	21,687,600
リョーサン	19,400	4,290.00	83,226,000
新光商事	24,600	1,156.00	28,437,600
トーホー	7,800	2,788.00	21,746,400
三信電気	7,400	2,128.00	15,747,200
東陽テクニカ	18,600	1,384.00	25,742,400
モスフードサービス	26,900	3,220.00	86,618,000
加賀電子	14,800	6,360.00	94,128,000
ソーダニッカ	10,400	826.00	8,590,400
立花エレテック	13,300	2,789.00	37,093,700
フォーバル	7,200	1,069.00	7,696,800
P A L T A C	28,700	4,793.00	137,559,100
三谷産業	32,000	317.00	10,144,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	4,600	4,535.00	20,861,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,057.00	2,468,400
コア商事ホールディングス	10,300	648.00	6,674,400
K P P グループホールディングス	42,600	634.00	27,008,400
ヤマタネ	8,100	1,710.00	13,851,000
丸紅建材リース	1,300	2,482.00	3,226,600
泉州電業	9,200	3,650.00	33,580,000
トラスコ中山	38,400	2,231.00	85,670,400
オートバックスセブン	63,600	1,545.50	98,293,800
モリト	13,100	1,077.00	14,108,700
加藤産業	22,600	3,810.00	86,106,000
北恵	3,200	778.00	2,489,600
イエローハット	32,300	1,825.00	58,947,500

J Kホールディングス	14,100	987.00	13,916,700	
日伝	10,800	2,425.00	26,190,000	
北沢産業	7,600	366.00	2,781,600	
杉本商事	8,100	2,106.00	17,058,600	
因幡電機産業	47,400	3,130.00	148,362,000	
東テク	6,100	5,300.00	32,330,000	
ミスミグループ本社	275,800	2,801.50	772,653,700	
アルテック	8,000	257.00	2,056,000	
タキヒヨー	3,500	1,090.00	3,815,000	
蔵王産業	2,400	2,356.00	5,654,400	
スズケン	53,500	3,856.00	206,296,000	
ジェコス	11,000	876.00	9,636,000	
グローセル	17,200	415.00	7,138,000	
ローソン	45,400	6,294.00	285,747,600	
サンエー	14,100	4,700.00	66,270,000	
カワチ薬品	14,500	2,185.00	31,682,500	
エービーシー・マート	26,700	7,746.00	206,818,200	
ハードオフコーポレーション	6,000	1,527.00	9,162,000	
アスクル	38,000	2,174.00	82,612,000	
ゲオホールディングス	18,100	1,934.00	35,005,400	
アダストリア	22,200	2,919.00	64,801,800	
くら寿司	21,600	3,070.00	66,312,000	
キャンドウ	6,700	2,523.00	16,904,100	
I Kホールディングス	5,800	373.00	2,163,400	
パルグループホールディングス	18,100	3,850.00	69,685,000	
エディオン	72,700	1,449.00	105,342,300	
サーラコーポレーション	39,000	735.00	28,665,000	
ワッツ	7,600	713.00	5,418,800	
ハローズ	8,400	3,670.00	30,828,000	
あみやき亭	4,600	3,340.00	15,364,000	
大黒天物産	5,700	6,010.00	34,257,000	
ハニーズホールディングス	14,700	1,768.00	25,989,600	
ファーマライズホールディングス	3,900	615.00	2,398,500	
アルペン	15,300	1,976.00	30,232,800	
ハブ	5,300	826.00	4,377,800	
クオールホールディングス	25,400	1,749.00	44,424,600	
ジズホールディングス	11,000	3,345.00	36,795,000	
ビックカメラ	97,700	1,085.00	106,004,500	
D C Mホールディングス	106,600	1,200.00	127,920,000	
Monotaro	259,300	1,827.50	473,870,750	
東京一番フーズ	4,200	504.00	2,116,800	
きちりホールディングス	3,300	837.00	2,762,100	



アークランドサービスホールディングス	15,100	2,908.00	43,910,800
J.フロント リテイリング	227,500	1,369.50	311,561,250
ドトール・日レスホールディングス	32,600	2,055.00	66,993,000
マツキヨココカラ&カンパニー	110,900	7,995.00	886,645,500
ブロンコピリー	9,900	2,733.00	27,056,700
Z O Z O	120,900	2,853.00	344,927,700
トレジャー・ファクトリー	9,100	1,838.00	16,725,800
物語コーポレーション	30,700	3,400.00	104,380,000
三越伊勢丹ホールディングス	308,000	1,461.00	449,988,000
H a m e e	6,800	965.00	6,562,000
マーケットエンタープライズ	1,800	1,557.00	2,802,600
ウエルシアホールディングス	95,000	3,102.00	294,690,000
クリエイティブSDホールディングス	30,400	3,490.00	106,096,000
丸善CHIホールディングス	18,200	355.00	6,461,000
ミサワ	3,400	615.00	2,091,000
ティーライフ	2,200	1,575.00	3,465,000
チムニー	4,400	1,355.00	5,962,000
シュッピン	14,000	1,109.00	15,526,000
オイシックス・ラ・大地	24,800	2,382.00	59,073,600
ネクステージ	41,800	3,760.00	157,168,000
ジョイフル本田	53,500	1,647.00	88,114,500
鳥貴族ホールディングス	7,000	2,622.00	18,354,000
ホットランド	14,300	1,628.00	23,280,400
すかいらーくホールディングス	250,100	1,751.00	437,925,100
SFPホールディングス	10,000	2,182.00	21,820,000
綿半ホールディングス	14,500	1,346.00	19,517,000
ヨシックスホールディングス	3,000	2,511.00	7,533,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	60,000	1,116.00	66,960,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	799.00	7,111,100
B E E N O S	8,000	1,989.00	15,912,000
あさひ	15,700	1,255.00	19,703,500
日本調剤	12,800	1,211.00	15,500,800
コスモス薬品	18,100	14,915.00	269,961,500
トーエル	7,000	740.00	5,180,000
セブン&アイ・ホールディングス	629,800	6,005.00	3,781,949,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	137,500	980.00	134,750,000
ツルハホールディングス	38,400	10,760.00	413,184,000
サンマルクホールディングス	15,000	1,871.00	28,065,000
フェリシモ	3,700	1,009.00	3,733,300
トリドールホールディングス	45,600	3,185.00	145,236,000
T O K Y O B A S E	20,200	346.00	6,989,200

ウイルプラスホールディングス	2,700	1,191.00	3,215,700
JMホールディングス	14,000	1,988.00	27,832,000
サツドラホールディングス	7,100	777.00	5,516,700
アレンザホールディングス	14,200	996.00	14,143,200
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,675.00	8,710,000
パロックジャパンリミテッド	12,400	896.00	11,110,400
クスリのアオキホールディングス	16,400	8,023.00	131,577,200
力の源ホールディングス	8,200	2,016.00	16,531,200
FOOD & LIFE COMPANIES	97,600	2,657.00	259,323,200
メディカルシステムネットワーク	17,200	364.00	6,260,800
はるやまホールディングス	7,000	508.00	3,556,000
ノジマ	60,000	1,372.00	82,320,000
カップ・クリエイト	28,700	1,515.00	43,480,500
ライトオン	10,700	608.00	6,505,600
良品計画	199,900	1,672.50	334,332,750
パリミキホールディングス	19,300	327.00	6,311,100
アドヴァングループ	17,900	993.00	17,774,700
アルビス	6,200	2,400.00	14,880,000
コナカ	15,500	403.00	6,246,500
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,610.00	3,381,000
G-7ホールディングス	23,200	1,248.00	28,953,600
イオン北海道	27,200	881.00	23,963,200
コジマ	31,100	602.00	18,722,200
ヒマラヤ	5,000	958.00	4,790,000
コーナン商事	24,800	3,500.00	86,800,000
エコス	7,000	1,879.00	13,153,000
ワタミ	22,100	893.00	19,735,300
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	369,000	2,582.00	952,758,000
西松屋チェーン	40,800	1,635.00	66,708,000
ゼンショーホールディングス	100,100	6,457.00	646,345,700
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,008.00	11,995,200
ハークスレイ	5,800	651.00	3,775,800
サイゼリヤ	27,200	3,565.00	96,968,000
VTホールディングス	70,300	532.00	37,399,600
魚力	5,900	2,187.00	12,903,300
フジ・コーポレーション	10,600	1,654.00	17,532,400
ユナイテッドアローズ	19,700	2,470.00	48,659,000
ハイデイ日高	27,300	2,457.00	67,076,100
YU-WA Creation Holdings	11,100	189.00	2,097,900
コロワイド	84,200	2,031.00	171,010,200

ピーシーデポコーポレーション	22,000	478.00	10,516,000	
壱番屋	14,500	5,370.00	77,865,000	
P L A N T	4,000	725.00	2,900,000	
スギホールディングス	36,900	6,289.00	232,064,100	
薬王堂ホールディングス	10,400	2,536.00	26,374,400	
スクロール	27,700	936.00	25,927,200	
ヨンドシーホールディングス	16,000	1,905.00	30,480,000	
木曽路	27,900	2,422.00	67,573,800	
S R S ホールディングス	30,700	957.00	29,379,900	
千趣会	34,900	393.00	13,715,700	
リテールパートナーズ	27,400	1,559.00	42,716,600	
ケーヨー	29,700	830.00	24,651,000	
上新電機	16,500	1,982.00	32,703,000	
日本瓦斯	97,100	1,961.50	190,461,650	
ロイヤルホールディングス	35,400	2,596.00	91,898,400	
いなげや	17,900	1,481.00	26,509,900	
チヨダ	18,000	898.00	16,164,000	
ライフコーポレーション	16,000	3,305.00	52,880,000	
リンガーハット	23,600	2,488.00	58,716,800	
M r M a x H D	26,400	624.00	16,473,600	
A O K I ホールディングス	34,100	914.00	31,167,400	
オークワ	29,400	835.00	24,549,000	
コメリ	28,300	2,869.00	81,192,700	
青山商事	39,500	1,293.00	51,073,500	
しまむら	21,500	13,280.00	285,520,000	
はせがわ	8,100	376.00	3,045,600	
高島屋	137,900	1,974.50	272,283,550	
松屋	31,100	1,177.00	36,604,700	
エイチ・ツー・オー リテイリング	89,100	1,495.00	133,204,500	
近鉄百貨店	8,000	2,468.00	19,744,000	
丸井グループ	134,800	2,452.00	330,529,600	
アクシアル リテイリング	12,600	3,610.00	45,486,000	
イオン	619,500	2,964.50	1,836,507,750	
イズミ	27,800	3,354.00	93,241,200	
平和堂	30,600	2,347.00	71,818,200	
フジ	28,100	1,765.00	49,596,500	
ヤオコー	20,700	7,259.00	150,261,300	
ゼビオホールディングス	25,200	1,085.00	27,342,000	
ケーズホールディングス	129,600	1,255.00	162,648,000	
O l y m p i c グループ	6,200	554.00	3,434,800	
日産東京販売ホールディングス	19,400	380.00	7,372,000	
シルバーライフ	3,800	1,368.00	5,198,400	

Genky DrugStores	8,100	4,100.00	33,210,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,800	1,030.00	2,884,000
ブックオフグループホールディングス	9,700	1,320.00	12,804,000
ギフトホールディングス	4,000	4,635.00	18,540,000
アインホールディングス	25,300	5,030.00	127,259,000
元気寿司	5,300	3,360.00	17,808,000
ヤマダホールディングス	750,500	424.70	318,737,350
アークランズ	27,100	1,572.00	42,601,200
ニトリホールディングス	73,900	16,200.00	1,197,180,000
グルメ杵屋	15,300	1,026.00	15,697,800
愛眼	10,500	186.00	1,953,000
ケーユーホールディングス	11,100	1,200.00	13,320,000
吉野家ホールディングス	71,700	2,583.50	185,236,950
松屋フーズホールディングス	8,700	4,115.00	35,800,500
サガミホールディングス	29,800	1,262.00	37,607,600
関西フードマーケット	16,900	1,434.00	24,234,600
王将フードサービス	12,100	6,540.00	79,134,000
ミニストップ	13,400	1,450.00	19,430,000
アークス	33,700	2,507.00	84,485,900
パローホールディングス	35,100	2,021.00	70,937,100
ベルク	9,200	6,380.00	58,696,000
大庄	8,100	1,154.00	9,347,400
ファーストリテイリング	82,200	34,650.00	2,848,230,000
サンドラッグ	69,500	4,204.00	292,178,000
サックスパー ホールディングス	17,900	971.00	17,380,900
ヤマザワ	3,000	1,271.00	3,813,000
やまや	3,100	2,702.00	8,376,200
ベルーナ	44,700	697.00	31,155,900
いよぎんホールディングス	202,400	827.80	167,546,720
しずおかフィナンシャルグループ	377,900	1,054.50	398,495,550
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	143,200	876.20	125,471,840
楽天銀行	59,200	1,890.00	111,888,000
島根銀行	4,600	488.00	2,244,800
じもとホールディングス	11,700	396.00	4,633,200
めぶきフィナンシャルグループ	844,100	346.30	292,311,830
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,800	3,315.00	72,267,000
九州フィナンシャルグループ	299,300	645.80	193,287,940
ゆうちょ銀行	467,300	1,131.00	528,516,300
富山第一銀行	54,000	763.00	41,202,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	912,700	587.60	536,302,520
西日本フィナンシャルホールディングス	105,600	1,403.00	148,156,800
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,628.00	24,745,600

第四北越フィナンシャルグループ	26,700	3,205.00	85,573,500
ひろぎんホールディングス	221,900	849.50	188,504,050
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,182.00	34,039,200
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,170.00	69,740,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	4,350.00	77,865,000
プロクレアホールディングス	20,800	2,070.00	43,056,000
あいちフィナンシャルグループ	23,800	2,229.00	53,050,200
あおぞら銀行	107,000	2,709.00	289,863,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,653,100	1,058.00	11,270,979,800
りそなホールディングス	2,149,900	727.00	1,562,977,300
三井住友トラスト・ホールディングス	309,100	5,326.00	1,646,266,600
三井住友フィナンシャルグループ	1,243,000	6,128.00	7,617,104,000
千葉銀行	474,100	918.60	435,508,260
群馬銀行	330,100	548.50	181,059,850
武蔵野銀行	21,800	2,340.00	51,012,000
千葉興業銀行	30,900	656.00	20,270,400
筑波銀行	74,600	210.00	15,666,000
七十七銀行	54,500	2,719.00	148,185,500
秋田銀行	11,400	1,699.00	19,368,600
山形銀行	18,900	1,065.00	20,128,500
岩手銀行	11,600	2,129.00	24,696,400
東邦銀行	134,500	233.00	31,338,500
東北銀行	6,400	1,036.00	6,630,400
ふくおかフィナンシャルグループ	135,800	3,131.00	425,189,800
スルガ銀行	149,900	575.00	86,192,500
八十二銀行	359,300	656.80	235,988,240
山梨中央銀行	17,500	1,312.00	22,960,000
大垣共立銀行	32,400	1,867.00	60,490,800
福井銀行	15,200	1,460.00	22,192,000
清水銀行	6,800	1,468.00	9,982,400
富山銀行	2,000	1,692.00	3,384,000
滋賀銀行	28,300	2,815.00	79,664,500
南都銀行	25,600	2,460.00	62,976,000
百五銀行	160,000	442.00	70,720,000
京都銀行	53,900	7,379.00	397,728,100
紀陽銀行	60,900	1,467.00	89,340,300
ほくほくフィナンシャルグループ	108,100	1,210.50	130,855,050
山陰合同銀行	106,500	855.00	91,057,500
鳥取銀行	4,200	1,175.00	4,935,000
百十四銀行	15,500	1,929.00	29,899,500
四国銀行	27,000	884.00	23,868,000
阿波銀行	23,900	2,014.00	48,134,600

大分銀行	10,200	2,253.00	22,980,600
宮崎銀行	11,100	2,427.00	26,939,700
佐賀銀行	10,000	1,720.00	17,200,000
琉球銀行	39,000	976.00	38,064,000
セブン銀行	609,300	289.60	176,453,280
みずほフィナンシャルグループ	2,460,100	2,224.50	5,472,492,450
高知銀行	4,500	755.00	3,397,500
山口フィナンシャルグループ	187,800	1,034.00	194,185,200
名古屋銀行	11,200	3,490.00	39,088,000
北洋銀行	257,700	290.00	74,733,000
大光銀行	3,900	1,088.00	4,243,200
愛媛銀行	22,900	827.00	18,938,300
トマト銀行	4,400	1,048.00	4,611,200
京葉銀行	77,900	556.00	43,312,400
栃木銀行	77,900	263.00	20,487,700
北日本銀行	6,000	2,060.00	12,360,000
東和銀行	31,200	547.00	17,066,400
福島銀行	13,900	217.00	3,016,300
大東銀行	5,200	652.00	3,390,400
トモニホールディングス	137,500	376.00	51,700,000
フィデアホールディングス	17,600	1,413.00	24,868,800
池田泉州ホールディングス	217,800	246.00	53,578,800
F P G	57,700	1,283.00	74,029,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,100	1,170.00	16,497,000
マーキュリアホールディングス	8,000	792.00	6,336,000
S B I ホールディングス	246,300	2,821.00	694,812,300
ジャフコ グループ	56,900	1,799.50	102,391,550
大和証券グループ本社	1,216,600	717.50	872,910,500
野村ホールディングス	3,133,100	541.40	1,696,260,340
岡三証券グループ	149,700	482.00	72,155,400
丸三証券	57,000	438.00	24,966,000
東洋証券	57,000	300.00	17,100,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,600	392.00	72,755,200
光世証券	3,300	567.00	1,871,100
水戸証券	46,200	340.00	15,708,000
いちよし証券	31,600	609.00	19,244,400
松井証券	100,700	797.00	80,257,900
マネックスグループ	183,600	540.00	99,144,000
極東証券	21,500	649.00	13,953,500
岩井コスモホールディングス	19,500	1,472.00	28,704,000
アイザワ証券グループ	24,800	803.00	19,914,400
マネーパートナーズグループ	14,500	267.00	3,871,500

スパークス・グループ	19,100	1,488.00	28,420,800
かんぽ生命保険	198,000	2,236.50	442,827,000
S O M P Oホールディングス	291,900	6,571.00	1,918,074,900
アニコム ホールディングス	57,800	637.00	36,818,600
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	346,200	5,220.00	1,807,164,000
第一生命ホールディングス	831,000	2,867.50	2,382,892,500
東京海上ホールディングス	1,681,400	3,279.00	5,513,310,600
T & Dホールディングス	456,500	2,221.50	1,014,114,750
アドバンスクリエイト	9,800	1,224.00	11,995,200
全国保証	44,600	4,946.00	220,591,600
あんしん保証	7,800	307.00	2,394,600
イントラスト	5,500	937.00	5,153,500
日本モーゲージサービス	8,000	570.00	4,560,000
C a s a	5,500	933.00	5,131,500
アルヒ	21,400	984.00	21,057,600
プレミアグループ	28,900	1,721.00	49,736,900
ネットプロテクションズホールディングス	57,500	333.00	19,147,500
クレディセゾン	108,000	2,242.50	242,190,000
芙蓉総合リース	15,700	11,020.00	173,014,000
みずほリース	25,400	4,650.00	118,110,000
東京センチュリー	31,900	5,122.00	163,391,800
日本証券金融	62,900	1,090.00	68,561,000
アイフル	282,900	335.00	94,771,500
リコーリース	16,200	4,245.00	68,769,000
イオンフィナンシャルサービス	98,000	1,278.00	125,244,000
アコム	304,700	350.90	106,919,230
ジャックス	18,200	5,070.00	92,274,000
オリエントコーポレーション	44,800	1,146.00	51,340,800
オリックス	1,116,700	2,538.50	2,834,742,950
三菱H C キャピタル	663,700	865.50	574,432,350
九州リースサービス	6,600	881.00	5,814,600
日本取引所グループ	478,100	2,339.50	1,118,514,950
イー・ギャランティ	27,800	1,900.00	52,820,000
アサックス	6,600	645.00	4,257,000
N E C キャピタルソリューション	8,500	3,125.00	26,562,500
大東建託	62,400	14,225.00	887,640,000
いちご	198,300	287.00	56,912,100
日本駐車場開発	183,100	225.00	41,197,500
スター・マイカ・ホールディングス	16,500	618.00	10,197,000
S R E ホールディングス	8,500	3,585.00	30,472,500
A Dワークスグループ	33,300	202.00	6,726,600
ヒューリック	397,400	1,212.50	481,847,500

三栄建築設計	8,700	1,444.00	12,562,800
野村不動産ホールディングス	106,600	3,478.00	370,754,800
三重交通グループホールディングス	37,700	552.00	20,810,400
サムティ	27,400	2,254.00	61,759,600
ディア・ライフ	29,800	829.00	24,704,200
地主	13,400	1,863.00	24,964,200
プレサンスコーポレーション	27,200	2,004.00	54,508,800
ハウスコム	2,900	924.00	2,679,600
JPMC	9,200	1,093.00	10,055,600
サンセイランディック	4,600	968.00	4,452,800
フージャースホールディングス	26,200	994.00	26,042,800
オープンハウスグループ	62,400	4,967.00	309,940,800
東急不動産ホールディングス	512,300	820.50	420,342,150
飯田グループホールディングス	149,300	2,430.00	362,799,000
イーランド	2,500	1,528.00	3,820,000
ムゲンエステート	9,800	705.00	6,909,000
And Doホールディングス	10,100	1,093.00	11,039,300
シーアールイー	10,000	1,369.00	13,690,000
ケイアイスター不動産	8,300	4,775.00	39,632,500
グッドコムアセット	16,600	822.00	13,645,200
ジェイ・エス・ビー	4,300	4,965.00	21,349,500
ロードスターキャピタル	10,100	1,611.00	16,271,100
テンポイノベーション	4,600	1,167.00	5,368,200
フェイスネットワーク	4,100	1,515.00	6,211,500
パーク24	133,000	1,827.50	243,057,500
パラカ	6,400	1,938.00	12,403,200
三井不動産	726,100	2,789.00	2,025,092,900
三菱地所	1,026,800	1,711.00	1,756,854,800
平和不動産	27,800	3,785.00	105,223,000
東京建物	162,500	1,875.00	304,687,500
京阪神ビルディング	29,200	1,148.00	33,521,600
住友不動産	307,700	3,570.00	1,098,489,000
テオーシー	31,900	617.00	19,682,300
東京楽天地	3,000	4,145.00	12,435,000
レオパレス21	191,500	299.00	57,258,500
スターツコーポレーション	24,700	2,845.00	70,271,500
フジ住宅	24,800	678.00	16,814,400
空港施設	21,800	556.00	12,120,800
明和地所	7,000	1,051.00	7,357,000
ゴールドクレスト	16,600	1,850.00	30,710,000
エスリード	8,300	2,633.00	21,853,900
日神グループホールディングス	28,700	502.00	14,407,400



日本エスコン	38,200	805.00	30,751,000
MIRARTHホールディングス	86,000	456.00	39,216,000
AVANTIA	8,200	883.00	7,240,600
イオンモール	88,600	1,861.00	164,884,600
毎日コムネット	5,800	744.00	4,315,200
ファースト住建	6,000	1,105.00	6,630,000
カチタス	46,000	2,575.00	118,450,000
トーセイ	28,700	1,803.00	51,746,100
穴吹興産	2,900	2,181.00	6,324,900
サンフロンティア不動産	28,800	1,412.00	40,665,600
FJネクストホールディングス	18,600	1,022.00	19,009,200
インテリックス	3,200	521.00	1,667,200
ランドビジネス	4,800	263.00	1,262,400
サンネクスタグループ	4,600	975.00	4,485,000
グランディハウス	12,300	581.00	7,146,300
日本空港ビルデング	60,300	6,362.00	383,628,600
明豊ファシリティワークス	7,300	765.00	5,584,500
LIFULL	61,800	293.00	18,107,400
MIXI	40,500	2,629.00	106,474,500
ジェイエシーリクルートメント	16,200	2,592.00	41,990,400
日本M&Aセンターホールディングス	305,000	1,049.00	319,945,000
メンバーズ	5,400	1,655.00	8,937,000
中広	2,700	412.00	1,112,400
UTグループ	26,200	2,854.00	74,774,800
アイティメディア	7,000	1,308.00	9,156,000
E・Jホールディングス	10,600	1,574.00	16,684,400
オープンアップグループ	53,400	2,013.00	107,494,200
コシダカホールディングス	53,400	1,152.00	61,516,800
アルトナー	3,500	1,862.00	6,517,000
パソナグループ	21,700	1,665.00	36,130,500
CDS	3,600	1,764.00	6,350,400
リンクアンドモチベーション	51,100	420.00	21,462,000
エス・エム・エス	67,700	2,787.50	188,713,750
サニーサイドアップグループ	4,500	716.00	3,222,000
パーソルホールディングス	195,900	2,598.50	509,046,150
リニカル	8,200	784.00	6,428,800
クックパッド	50,500	156.00	7,878,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,300	593.00	4,328,900
学情	8,200	1,880.00	15,416,000
スタジオアリス	9,000	2,168.00	19,512,000
シミックホールディングス	8,700	1,895.00	16,486,500
エプロ	3,400	729.00	2,478,600

N J S	4,000	2,672.00	10,688,000
総合警備保障	329,900	798.90	263,557,110
カカクコム	130,500	2,042.00	266,481,000
アイロムグループ	6,500	1,934.00	12,571,000
セントケア・ホールディング	11,700	766.00	8,962,200
サイネックス	2,800	652.00	1,825,600
ルネサンス	12,800	897.00	11,481,600
ディップ	31,200	3,535.00	110,292,000
デジタルホールディングス	14,200	1,055.00	14,981,000
新日本科学	19,000	2,051.00	38,969,000
キャリアデザインセンター	3,100	1,623.00	5,031,300
ベネフィット・ワン	82,500	1,397.00	115,252,500
エムスリー	350,900	3,028.00	1,062,525,200
ツカダ・グローバルホールディング	8,900	452.00	4,022,800
アウトソーシング	106,000	1,356.50	143,789,000
ウェルネット	11,100	576.00	6,393,600
ワールドホールディングス	8,100	2,617.00	21,197,700
ディー・エヌ・エー	71,200	1,826.50	130,046,800
博報堂D Yホールディングス	226,700	1,442.50	327,014,750
ぐるなび	33,600	356.00	11,961,600
タカミヤ	24,700	537.00	13,263,900
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	727.00	6,397,600
ファンコミュニケーションズ	35,600	404.00	14,382,400
ライク	6,800	1,679.00	11,417,200
ビジネス・ブレークスルー	5,900	444.00	2,619,600
エスプール	51,500	620.00	31,930,000
W D Bホールディングス	9,200	2,046.00	18,823,200
ティア	8,900	452.00	4,022,800
C D G	1,700	1,380.00	2,346,000
アドウェイズ	24,900	655.00	16,309,500
バリューコマース	13,600	1,326.00	18,033,600
インフォマート	185,300	334.00	61,890,200
J Pホールディングス	52,100	320.00	16,672,000
エコナックホールディングス	27,300	95.00	2,593,500
C Lホールディングス	5,300	810.00	4,293,000
プレステージ・インターナショナル	75,300	593.00	44,652,900
アミューズ	9,800	1,785.00	17,493,000
ドリームインキュベータ	5,500	2,735.00	15,042,500
クイック	13,700	2,234.00	30,605,800
T A C	8,300	201.00	1,668,300
電通グループ	174,600	4,616.00	805,953,600
イオンファンタジー	7,800	3,115.00	24,297,000

シーティーエス	20,100	743.00	14,934,300
ネクシィーズグループ	4,800	634.00	3,043,200
H.U.グループホールディングス	52,100	2,678.50	139,549,850
アルプス技研	15,600	2,779.00	43,352,400
日本空調サービス	19,500	746.00	14,547,000
オリエンタルランド	939,700	5,528.00	5,194,661,600
ダスキン	39,600	3,203.00	126,838,800
明光ネットワークジャパン	22,100	647.00	14,298,700
ファルコホールディングス	8,200	1,862.00	15,268,400
ラウンドワン	149,000	580.00	86,420,000
リゾートトラスト	70,200	2,175.00	152,685,000
ビー・エム・エル	22,000	2,771.00	60,962,000
リソー教育	81,900	272.00	22,276,800
早稲田アカデミー	10,100	1,322.00	13,352,200
ユー・エス・エス	182,700	2,375.50	434,003,850
東京個別指導学院	21,700	503.00	10,915,100
サイバーエージェント	392,600	1,042.00	409,089,200
楽天グループ	1,066,800	538.30	574,258,440
クリーク・アンド・リバー社	10,600	1,965.00	20,829,000
SBIグローバルアセットマネジメント	29,600	514.00	15,214,400
テー・オー・ダブリュー	35,800	308.00	11,026,400
山田コンサルティンググループ	9,200	1,572.00	14,462,400
セントラルスポーツ	6,800	2,354.00	16,007,200
フルキャストホールディングス	17,100	2,282.00	39,022,200
エン・ジャパン	32,200	2,419.00	77,891,800
リソルホールディングス	1,300	4,750.00	6,175,000
テクノプロ・ホールディングス	105,100	3,051.00	320,660,100
アトラグループ	3,100	179.00	554,900
インターワークス	4,500	334.00	1,503,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	1,697.00	15,951,800
Keeper 技研	11,000	5,570.00	61,270,000
ファーストロジック	1,900	990.00	1,881,000
三機サービス	2,300	1,149.00	2,642,700
Gunosy	14,600	608.00	8,876,800
デザインワン・ジャパン	5,300	182.00	964,600
イー・ガーディアン	6,900	2,094.00	14,448,600
リブセンス	7,500	288.00	2,160,000
ジャパンマテリアル	54,500	2,280.00	124,260,000
ベクトル	28,100	1,306.00	36,698,600
ウチヤマホールディングス	6,800	344.00	2,339,200
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,288.00	19,320,000
キャリアリンク	6,600	2,886.00	19,047,600

I B J	11,300	648.00	7,322,400	
アサンテ	9,000	1,692.00	15,228,000	
バリューHR	15,800	1,286.00	20,318,800	
M & Aキャピタルパートナーズ	14,500	3,120.00	45,240,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,032.00	6,811,200	
E R Iホールディングス	3,800	1,341.00	5,095,800	
アビスト	2,300	3,275.00	7,532,500	
シグマクシス・ホールディングス	27,200	1,301.00	35,387,200	
ウィルグループ	15,100	1,092.00	16,489,200	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	16,600	144.00	2,390,400	
メドピア	15,900	978.00	15,550,200	
レアジョブ	3,000	993.00	2,979,000	
リクルートホールディングス	1,314,500	4,487.00	5,898,161,500	
エラン	23,900	846.00	20,219,400	
土木管理総合試験所	6,800	336.00	2,284,800	
日本郵政	2,136,600	1,039.00	2,219,927,400	
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,358.00	32,592,000	
鎌倉新書	20,600	709.00	14,605,400	
S M N	4,000	448.00	1,792,000	
グローバルキッズCOMPANY	3,000	686.00	2,058,000	
エアトリ	13,000	2,677.00	34,801,000	
アトラエ	10,900	742.00	8,087,800	
ストライク	7,600	3,345.00	25,422,000	
ソラスト	49,400	659.00	32,554,600	
セラク	5,600	1,559.00	8,730,400	
インソース	38,800	1,146.00	44,464,800	
ベイカレント・コンサルティング	140,600	5,193.00	730,135,800	
Orchestra Holdings	4,100	1,173.00	4,809,300	
アイモバイル	8,100	1,305.00	10,570,500	
キャリアインデックス	5,800	312.00	1,809,600	
MS - Japan	4,800	1,139.00	5,467,200	
船場	2,800	752.00	2,105,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,500	1,849.00	117,411,500	
フルテック	2,200	1,113.00	2,448,600	
GameWith	5,100	356.00	1,815,600	
MS & Consulting	2,100	585.00	1,228,500	
ウェルビー	13,700	461.00	6,315,700	
エル・ティー・エス	2,400	3,730.00	8,952,000	
ミダックホールディングス	11,000	1,735.00	19,085,000	
日総工産	13,700	875.00	11,987,500	
キュービーネットホールディングス	8,600	1,513.00	13,011,800	
R P Aホールディングス	24,800	405.00	10,044,000	

スプリックス	4,400	793.00	3,489,200
マネジメントソリューションズ	9,900	3,965.00	39,253,500
プロレド・パートナーズ	5,000	500.00	2,500,000
テノ・ホールディングス	2,200	680.00	1,496,000
フロンティア・マネジメント	6,200	1,363.00	8,450,600
ピアラ	2,900	488.00	1,415,200
コプロ・ホールディングス	2,400	2,032.00	4,876,800
ギークス	2,300	737.00	1,695,100
アンビスホールディングス	19,100	2,884.00	55,084,400
カーブスホールディングス	48,900	722.00	35,305,800
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,178.00	12,486,800
Fast Fitness Japan	6,300	1,307.00	8,234,100
ダイレクトマーケティングミックス	21,600	874.00	18,878,400
ポピンズ	2,900	1,425.00	4,132,500
LITALICO	14,000	2,228.00	31,192,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,800	590.00	4,012,000
リログループ	99,000	1,909.00	188,991,000
東祥	12,600	1,275.00	16,065,000
ID&Eホールディングス	10,800	3,140.00	33,912,000
ビーウィズ	4,600	2,260.00	10,396,000
TREホールディングス	37,600	1,245.00	46,812,000
人・夢・技術グループ	6,900	1,673.00	11,543,700
大栄環境	45,300	2,374.00	107,542,200
日本管財ホールディングス	18,700	2,587.00	48,376,900
エイチ・アイ・エス	46,600	1,990.00	92,734,000
ラックランド	7,500	3,085.00	23,137,500
共立メンテナンス	30,500	5,434.00	165,737,000
イチネンホールディングス	19,000	1,337.00	25,403,000
建設技術研究所	9,200	3,355.00	30,866,000
スペース	13,200	1,045.00	13,794,000
燦ホールディングス	7,700	2,145.00	16,516,500
スバル興業	900	9,930.00	8,937,000
東京テアトル	5,100	1,123.00	5,727,300
タナベコンサルティンググループ	5,700	1,009.00	5,751,300
ナガワ	4,800	6,810.00	32,688,000
東京都競馬	14,900	3,810.00	56,769,000
カナモト	32,700	2,337.00	76,419,900
ニシオホールディングス	16,600	3,440.00	57,104,000
トランス・コスモス	22,200	3,370.00	74,814,000
乃村工藝社	77,800	949.00	73,832,200
藤田観光	7,900	3,360.00	26,544,000
KNT-CTホールディングス	10,600	1,446.00	15,327,600

トーカイ	15,900	1,879.00	29,876,100	
セコム	180,900	9,402.00	1,700,821,800	
セントラル警備保障	9,700	2,898.00	28,110,600	
丹青社	34,800	784.00	27,283,200	
メイテック	69,400	2,408.50	167,149,900	
応用地質	16,700	2,252.00	37,608,400	
船井総研ホールディングス	37,100	2,456.00	91,117,600	
進学会ホールディングス	5,600	292.00	1,635,200	
オオバ	9,000	760.00	6,840,000	
いであ	3,200	1,703.00	5,449,600	
学究社	7,200	2,063.00	14,853,600	
ベネッセホールディングス	66,400	1,826.00	121,246,400	
イオンディライト	19,700	3,025.00	59,592,500	
ナック	8,200	960.00	7,872,000	
ダイセキ	36,300	4,245.00	154,093,500	
ステップ	6,600	1,757.00	11,596,200	
合計	255,618,500		553,511,905,010	

## (2) 株式以外の有価証券

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

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,833,997
株式	4,468,445,690
派生商品評価勘定	249,282
未収配当金	9,895,850
差入委託証拠金	819,500
流動資産合計	4,494,244,319
資産合計	4,494,244,319
負債の部	
流動負債	
前受金	250,250
未払利息	12
流動負債合計	250,262

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債合計	250,262
純資産の部	
元本等	
元本	3,229,512,028
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,264,482,029
元本等合計	4,493,994,057
純資産合計	4,493,994,057
負債純資産合計	4,494,244,319

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,229,512,028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 1.3915円 (1万口当たり純資産額) (13,915円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	3,029,447,803円
期中追加設定元本額	200,064,225円
期中一部解約元本額	- 円
期末元本額	3,229,512,028円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	689,179,869円
分散投資コア戦略ファンドS	2,540,332,159円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	506,298,126	
合計	506,298,126	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

(2023年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	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	24,373,250	-	24,623,500	250,250
合計		24,373,250	-	24,623,500	250,250



## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大成建設	3,600	5,047.00	18,169,200	
大林組	36,900	1,230.00	45,387,000	
清水建設	25,600	897.60	22,978,560	
鹿島建設	10,200	2,156.00	21,991,200	
大和ハウス工業	14,000	3,690.00	51,660,000	
積水ハウス	22,600	2,861.50	64,669,900	
日清製粉グループ本社	3,900	1,718.50	6,702,150	
ヤクルト本社	5,000	8,805.00	44,025,000	
明治ホールディングス	17,800	3,264.00	58,099,200	
アサヒグループホールディングス	1,700	5,452.00	9,268,400	
キリンホールディングス	28,600	2,075.00	59,345,000	
サントリー食品インターナショナル	7,600	5,068.00	38,516,800	
味の素	4,600	5,615.00	25,829,000	
日清食品ホールディングス	4,600	11,905.00	54,763,000	
日本たばこ産業	21,600	3,051.00	65,901,600	
東レ	12,800	796.90	10,200,320	
王子ホールディングス	15,200	525.90	7,993,680	
旭化成	12,000	973.90	11,686,800	
信越化学工業	6,000	4,591.00	27,546,000	
三菱ケミカルグループ	7,800	849.40	6,625,320	
積水化学工業	4,100	2,018.00	8,273,800	
花王	9,900	5,371.00	53,172,900	
日本ペイントホールディングス	1,800	1,160.00	2,088,000	
富士フイルムホールディングス	6,700	8,271.00	55,415,700	
小林製薬	300	7,591.00	2,277,300	
日東電工	400	10,070.00	4,028,000	
ユニ・チャーム	8,200	5,334.00	43,738,800	
協和キリン	17,300	2,601.50	45,005,950	
武田薬品工業	14,700	4,408.00	64,797,600	
アステラス製薬	29,000	2,038.00	59,102,000	
塩野義製薬	5,000	5,788.00	28,940,000	
中外製薬	15,500	3,828.00	59,334,000	

エーザイ	2,600	9,247.00	24,042,200
小野薬品工業	20,900	2,517.00	52,605,300
第一三共	4,900	4,005.00	19,624,500
大塚ホールディングス	13,400	5,181.00	69,425,400
出光興産	5,400	2,881.50	15,560,100
E N E O Sホールディングス	74,800	495.00	37,026,000
ブリヂストン	11,600	5,730.00	66,468,000
小松製作所	2,300	3,714.00	8,542,200
ダイキン工業	800	28,745.00	22,996,000
ホンザキ	2,700	5,056.00	13,651,200
三菱重工業	600	6,529.00	3,917,400
日立製作所	2,000	8,842.00	17,684,000
東芝	10,200	4,504.00	45,940,800
三菱電機	23,900	1,997.50	47,740,250
日本電気	3,600	6,848.00	24,652,800
富士通	900	18,010.00	16,209,000
パナソニック ホールディングス	4,600	1,688.50	7,767,100
ソニーグループ	3,000	12,830.00	38,490,000
ヒロセ電機	200	18,295.00	3,659,000
キーエンス	600	65,390.00	39,234,000
ファナック	3,100	4,747.00	14,715,700
京セラ	8,700	7,485.00	65,119,500
村田製作所	6,400	7,954.00	50,905,600
キャノン	19,200	3,735.00	71,712,000
トヨタ自動車	33,500	2,260.00	75,710,000
本田技研工業	13,000	4,217.00	54,821,000
シマノ	200	23,675.00	4,735,000
テルモ	8,400	4,296.00	36,086,400
島津製作所	1,400	4,375.00	6,125,000
オリンパス	7,600	2,221.50	16,883,400
H O Y A	800	16,025.00	12,820,000
バンダイナムコホールディングス	9,300	3,110.00	28,923,000
大日本印刷	6,400	3,965.00	25,376,000
任天堂	11,000	6,305.00	69,355,000
中部電力	40,600	1,703.50	69,162,100
関西電力	38,200	1,762.00	67,308,400
東京瓦斯	13,500	3,112.00	42,012,000
大阪瓦斯	23,000	2,132.00	49,036,000
東武鉄道	7,200	3,649.00	26,272,800
東急	18,100	1,692.00	30,625,200
小田急電鉄	5,800	1,877.50	10,889,500
京王電鉄	2,100	4,283.00	8,994,300

京成電鉄	1,500	5,818.00	8,727,000
東日本旅客鉄道	7,500	7,836.00	58,770,000
西日本旅客鉄道	3,600	5,826.00	20,973,600
東海旅客鉄道	3,900	17,595.00	68,620,500
近鉄グループホールディングス	5,200	4,713.00	24,507,600
阪急阪神ホールディングス	4,800	4,584.00	22,003,200
ヤマトホールディングス	13,100	2,598.50	34,040,350
S Gホールディングス	9,200	2,070.50	19,048,600
NIPPON EXPRESSホールディングス	300	8,069.00	2,420,700
ANAホールディングス	2,400	3,396.00	8,150,400
T I S	1,200	3,569.00	4,282,800
コーエーテクモホールディングス	1,600	2,339.50	3,743,200
ネクソン	2,200	2,596.00	5,711,200
野村総合研究所	4,000	3,841.00	15,364,000
オービック	2,600	22,515.00	58,539,000
Zホールディングス	7,500	369.20	2,769,000
トレンドマイクロ	4,000	6,781.00	27,124,000
日本オラクル	2,600	9,963.00	25,903,800
伊藤忠テクノソリューションズ	6,900	3,498.00	24,136,200
大塚商会	4,600	5,501.00	25,304,600
日本電信電話	398,400	166.90	66,492,960
K D D I	14,700	4,307.00	63,312,900
ソフトバンク	43,400	1,530.50	66,423,700
東宝	7,900	5,408.00	42,723,200
N T Tデータグループ	8,200	1,913.00	15,686,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,800	6,400.00	11,520,000
カプコン	1,500	5,557.00	8,335,500
S C S K	9,300	2,221.50	20,659,950
伊藤忠商事	13,600	5,524.00	75,126,400
三井物産	4,900	5,157.00	25,269,300
住友商事	10,600	2,954.00	31,312,400
三菱商事	8,800	6,862.00	60,385,600
日本マクドナルドホールディングス	11,600	5,500.00	63,800,000
Z O Z O	1,800	2,853.00	5,135,400
ウエルシアホールディングス	800	3,102.00	2,481,600
セブン&アイ・ホールディングス	5,800	6,005.00	34,829,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	5,200	2,582.00	13,426,400
イオン	1,700	2,964.50	5,039,650
ニトリホールディングス	2,400	16,200.00	38,880,000
ファーストリテイリング	1,200	34,650.00	41,580,000
しずおかフィナンシャルグループ	15,900	1,054.50	16,766,550

ゆうちょ銀行	61,300	1,131.00	69,330,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	70,900	1,058.00	75,012,200
りそなホールディングス	14,900	727.00	10,832,300
三井住友トラスト・ホールディングス	5,400	5,326.00	28,760,400
三井住友フィナンシャルグループ	11,700	6,128.00	71,697,600
千葉銀行	3,500	918.60	3,215,100
みずほフィナンシャルグループ	31,600	2,224.50	70,294,200
かんぽ生命保険	1,000	2,236.50	2,236,500
SOMP Oホールディングス	4,200	6,571.00	27,598,200
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	9,800	5,220.00	51,156,000
東京海上ホールディングス	21,400	3,279.00	70,170,600
三菱HCキャピタル	25,900	865.50	22,416,450
日本取引所グループ	3,600	2,339.50	8,422,200
大東建託	1,200	14,225.00	17,070,000
三井不動産	5,200	2,789.00	14,502,800
三菱地所	29,400	1,711.00	50,303,400
オリエンタルランド	9,300	5,528.00	51,410,400
ユー・エス・エス	13,700	2,375.50	32,544,350
日本郵政	63,500	1,039.00	65,976,500
セコム	7,000	9,402.00	65,814,000
合 計	1,894,200		4,468,445,690

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 7月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,204,385,516
国債証券	547,776,054,330
地方債証券	32,926,408,693
特殊債証券	36,827,375,579
社債証券	29,305,397,000
未収入金	951,744,200
未収利息	965,170,110
前払費用	39,946,305
流動資産合計	649,996,481,733
資産合計	649,996,481,733

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払金	1,611,763,400
未払解約金	218,947,208
未払利息	1,004
流動負債合計	1,830,711,612
負債合計	1,830,711,612
純資産の部	
元本等	
元本	475,920,984,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	172,244,785,655
元本等合計	648,165,770,121
純資産合計	648,165,770,121
負債純資産合計	649,996,481,733

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	475,920,984,466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 99,930,000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 1.3619円 (1万口当たり純資産額) (13,619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 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	454,636,713,292円
期中追加設定元本額	48,774,667,694円
期中一部解約元本額	27,490,396,520円
期末元本額	475,920,984,466円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	5,430,510,178円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,561,005円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,058,136,695円
世界経済インデックスファンド	5,661,160,397円
DCマイセレクション25	28,184,189,888円
DCマイセレクション50	33,477,697,638円
DCマイセレクション75	10,685,170,020円
DC日本債券インデックス・オープン	422,821,055円
DC日本債券インデックス・オープンS	91,119,024,100円
DC日本債券インデックス・オープンP	64,500,555,141円
DCマイセレクションS25	15,403,555,085円
DCマイセレクションS50	17,832,540,256円
DCマイセレクションS75	4,292,430,534円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	590,353,540円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,557,125,386円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	992,247,960円
DC世界経済インデックスファンド	4,412,569,243円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,105,261円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	19,178,750円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,961,710円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	61,590,262円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	109,821,388円

区分	2023年 7月10日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	28,069,651円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	24,022,632円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,351,016,401円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	744,293,826円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,191,468,031円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	64,171,905円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	53,067,223円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	930,211,469円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,040,888,919円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,359,813,160円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	106,262,941円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,640,983,636円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,023,439,746円
分散投資コア戦略ファンドA	19,225,644,223円
分散投資コア戦略ファンドS	25,755,853,956円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	270,444,856円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,764,867,021円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,238,277円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,138,680円
SMT インデックスバランス・オープン	73,480,633円
SMT 世界経済インデックス・オープン	44,451,919円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	95,536,102円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	150,714,444円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,984,021円
グローバル経済コア	231,309,577円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	39,323,391円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	26,127,249円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	107,954,766円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	62,525,005円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	17,696,665円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	12,129,229円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	384,645,266円
10資産分散投資ファンド	301,645,795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）	88,316,640,316円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	40,443,314円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,198,918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）	431,644,787円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,220,880,870
地方債証券	61,048,069
特殊債券	42,700,163
社債券	18,754,000
合計	2,343,383,102

(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439回利付国債(2年)	470,000,000	470,596,900	
	第440回利付国債(2年)	1,170,000,000	1,171,602,900	
	第441回利付国債(2年)	440,000,000	440,589,600	
	第442回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,403,288,000	
	第443回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,304,356,000	
	第444回利付国債(2年)	2,925,000,000	2,928,656,250	
	第445回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,161,357,200	
	第446回利付国債(2年)	3,060,000,000	3,063,243,600	
	第448回利付国債(2年)	50,000,000	50,049,500	
	第449回利付国債(2年)	1,150,000,000	1,150,977,500	
	第141回利付国債(5年)	8,820,000,000	8,841,079,800	
	第142回利付国債(5年)	3,910,000,000	3,920,166,000	
	第143回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,491,737,600	
	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	5,064,695,500	
	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,136,281,600	
	第146回利付国債(5年)	4,860,000,000	4,876,621,200	
	第147回利付国債(5年)	4,540,000,000	4,544,267,600	
	第148回利付国債(5年)	6,210,000,000	6,214,533,300	
	第149回利付国債(5年)	5,370,000,000	5,372,523,900	
	第150回利付国債(5年)	6,660,000,000	6,660,000,000	
	第151回利付国債(5年)	4,510,000,000	4,507,474,400	
	第152回利付国債(5年)	210,000,000	210,619,500	
	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	5,801,982,200	
	第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	5,188,650,600	
	第155回利付国債(5年)	2,020,000,000	2,039,210,200	
	第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,667,739,000	
	第157回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,465,445,800	
	第158回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,645,729,500	
	第1回利付国債(40年)	500,000,000	625,600,000	
	第2回利付国債(40年)	1,130,000,000	1,361,243,200	
	第3回利付国債(40年)	650,000,000	783,776,500	
	第4回利付国債(40年)	950,000,000	1,147,448,000	
	第5回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,340,624,000	
	第6回利付国債(40年)	1,260,000,000	1,442,019,600	
第7回利付国債(40年)	1,340,000,000	1,467,233,000		
第8回利付国債(40年)	1,490,000,000	1,514,927,700		
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,697,938,000		
第10回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,790,100,000		
第11回利付国債(40年)	1,525,000,000	1,288,762,250		
第12回利付国債(40年)	1,290,000,000	975,381,900		



第13回利付国債(40年)	2,330,000,000	1,745,519,500	
第14回利付国債(40年)	2,130,000,000	1,701,273,600	
第15回利付国債(40年)	2,970,000,000	2,609,620,200	
第16回利付国債(40年)	650,000,000	623,077,000	
第335回利付国債(10年)	3,630,000,000	3,656,027,100	
第336回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,290,726,400	
第337回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,815,372,000	
第338回利付国債(10年)	4,560,000,000	4,595,066,400	
第339回利付国債(10年)	3,970,000,000	4,004,697,800	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,473,281,100	
第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	5,061,716,200	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,776,660,000	
第343回利付国債(10年)	2,670,000,000	2,679,425,100	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,920,709,000	
第345回利付国債(10年)	4,280,000,000	4,293,995,600	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,766,962,500	
第347回利付国債(10年)	3,550,000,000	3,558,378,000	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,267,114,200	
第349回利付国債(10年)	5,120,000,000	5,123,379,200	
第350回利付国債(10年)	6,670,000,000	6,665,331,000	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,825,475,050	
第352回利付国債(10年)	4,330,000,000	4,315,494,500	
第353回利付国債(10年)	4,385,000,000	4,366,056,800	
第354回利付国債(10年)	4,720,000,000	4,693,426,400	
第355回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,629,896,400	
第356回利付国債(10年)	4,630,000,000	4,594,626,800	
第357回利付国債(10年)	3,390,000,000	3,358,812,000	
第358回利付国債(10年)	4,000,000,000	3,957,880,000	
第359回利付国債(10年)	4,145,000,000	4,095,550,150	
第360回利付国債(10年)	5,070,000,000	4,998,563,700	
第361回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,583,762,400	
第362回利付国債(10年)	4,610,000,000	4,525,360,400	
第363回利付国債(10年)	5,550,000,000	5,436,447,000	
第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,937,587,000	
第365回利付国債(10年)	6,367,000,000	6,213,491,630	
第366回利付国債(10年)	5,370,000,000	5,277,582,300	
第367回利付国債(10年)	4,900,000,000	4,807,047,000	
第368回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,778,593,600	
第369回利付国債(10年)	4,660,000,000	4,689,591,000	
第370回利付国債(10年)	4,910,000,000	4,932,782,400	
第371回利付国債(10年)	120,000,000	119,258,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	127,420,700	

第2回利付国債（30年）	160,000,000	182,499,200	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	136,538,400	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	130,693,200	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	57,139,000	
第6回利付国債（30年）	350,000,000	407,956,500	
第7回利付国債（30年）	380,000,000	442,327,600	
第8回利付国債（30年）	850,000,000	955,714,500	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	261,127,200	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	169,577,600	
第11回利付国債（30年）	260,000,000	290,651,400	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	220,020,000	
第13回利付国債（30年）	400,000,000	459,552,000	
第14回利付国債（30年）	750,000,000	893,700,000	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	409,275,000	
第16回利付国債（30年）	200,000,000	241,252,000	
第17回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,353,604,400	
第18回利付国債（30年）	315,000,000	374,519,250	
第19回利付国債（30年）	530,000,000	630,758,300	
第20回利付国債（30年）	480,000,000	583,296,000	
第21回利付国債（30年）	500,000,000	597,040,000	
第22回利付国債（30年）	540,000,000	659,043,000	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	525,279,400	
第24回利付国債（30年）	780,000,000	954,197,400	
第25回利付国債（30年）	600,000,000	719,724,000	
第26回利付国債（30年）	1,550,000,000	1,880,367,000	
第27回利付国債（30年）	1,870,000,000	2,298,660,100	
第28回利付国債（30年）	2,020,000,000	2,489,407,600	
第29回利付国債（30年）	1,670,000,000	2,038,886,300	
第30回利付国債（30年）	2,070,000,000	2,499,359,400	
第31回利付国債（30年）	1,220,000,000	1,455,484,400	
第32回利付国債（30年）	1,460,000,000	1,765,563,400	
第33回利付国債（30年）	2,120,000,000	2,465,390,400	
第34回利付国債（30年）	1,865,000,000	2,226,492,950	
第35回利付国債（30年）	2,480,000,000	2,883,942,400	
第36回利付国債（30年）	2,420,000,000	2,816,589,600	
第37回利付国債（30年）	2,295,000,000	2,627,614,350	
第38回利付国債（30年）	1,510,000,000	1,700,335,500	
第39回利付国債（30年）	1,470,000,000	1,680,180,600	
第40回利付国債（30年）	1,330,000,000	1,496,196,800	
第41回利付国債（30年）	1,270,000,000	1,405,382,000	
第42回利付国債（30年）	1,400,000,000	1,549,408,000	
第43回利付国債（30年）	1,340,000,000	1,483,152,200	

第44回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,494,342,000
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,539,936,000
第46回利付国債(30年)	1,750,000,000	1,870,942,500
第47回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,805,100,600
第48回利付国債(30年)	1,930,000,000	2,022,447,000
第49回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,812,002,000
第50回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,493,806,300
第51回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,379,754,000
第52回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,407,635,400
第53回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,374,906,000
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,582,864,400
第55回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,459,492,800
第56回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,446,569,000
第57回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,369,770,000
第58回利付国債(30年)	2,260,000,000	2,058,408,000
第59回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,215,162,600
第60回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,351,726,400
第61回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,195,970,400
第62回利付国債(30年)	1,165,000,000	970,549,850
第63回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,196,062,000
第64回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,344,767,500
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,129,479,500
第66回利付国債(30年)	1,465,000,000	1,172,366,250
第67回利付国債(30年)	1,695,000,000	1,426,918,800
第68回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,334,200,800
第69回利付国債(30年)	1,420,000,000	1,222,918,200
第70回利付国債(30年)	1,960,000,000	1,686,207,600
第71回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,203,160,000
第72回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,433,678,300
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,603,693,300
第74回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,873,772,200
第75回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,407,039,000
第76回利付国債(30年)	1,960,000,000	2,003,590,400
第77回利付国債(30年)	1,870,000,000	2,002,227,700
第78回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,247,462,200
第72回利付国債(20年)	630,000,000	646,575,300
第73回利付国債(20年)	360,000,000	370,821,600
第74回利付国債(20年)	200,000,000	206,302,000
第75回利付国債(20年)	130,000,000	134,739,800
第76回利付国債(20年)	270,000,000	278,928,900
第77回利付国債(20年)	290,000,000	300,083,300
第78回利付国債(20年)	170,000,000	176,444,700
第79回利付国債(20年)	270,000,000	280,759,500

第80回利付国債(20年)	220,000,000	229,196,000	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	407,518,800	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	628,266,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	305,178,600	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	493,453,000	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	306,631,500	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	541,992,300	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,939,873,200	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	448,686,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	372,876,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	674,490,600	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	483,214,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	943,474,400	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	439,934,100	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	656,787,000	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	903,828,500	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,718,917,200	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	980,577,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	477,554,000	
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,644,692,000	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	526,689,600	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	791,219,000	
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,311,216,000	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	442,516,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	175,435,200	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,297,929,200	
第106回利付国債(20年)	680,000,000	751,461,200	
第107回利付国債(20年)	700,000,000	772,660,000	
第108回利付国債(20年)	840,000,000	918,128,400	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	570,055,200	
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,218,272,000	
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,083,926,500	
第112回利付国債(20年)	790,000,000	878,148,200	
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,252,764,600	
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,606,640,900	
第115回利付国債(20年)	700,000,000	787,556,000	
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,873,608,800	
第117回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,660,708,000	
第118回利付国債(20年)	660,000,000	738,309,000	
第119回利付国債(20年)	530,000,000	585,655,300	
第120回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,386,039,900	
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,637,359,500	

第122回利付国債(20年)	900,000,000	996,120,000
第123回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,057,783,000
第124回利付国債(20年)	760,000,000	853,761,200
第125回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,403,024,100
第126回利付国債(20年)	730,000,000	821,739,100
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,140,533,400
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,086,603,700
第129回利付国債(20年)	740,000,000	823,235,200
第130回利付国債(20年)	1,685,000,000	1,878,876,100
第131回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,461,372,000
第132回利付国債(20年)	660,000,000	731,570,400
第133回利付国債(20年)	990,000,000	1,105,463,700
第134回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,655,394,800
第135回利付国債(20年)	630,000,000	699,369,300
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,156,785,000
第137回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,334,100,000
第138回利付国債(20年)	780,000,000	853,702,200
第139回利付国債(20年)	830,000,000	915,589,600
第140回利付国債(20年)	2,670,000,000	2,973,846,000
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,785,216,000
第142回利付国債(20年)	1,265,000,000	1,422,922,600
第143回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,014,339,600
第144回利付国債(20年)	710,000,000	779,217,900
第145回利付国債(20年)	2,335,000,000	2,610,273,150
第146回利付国債(20年)	2,760,000,000	3,087,253,200
第147回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,616,366,800
第148回利付国債(20年)	2,130,000,000	2,340,209,700
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,140,423,000
第150回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,055,425,400
第151回利付国債(20年)	2,395,000,000	2,551,609,050
第152回利付国債(20年)	2,780,000,000	2,960,588,800
第153回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,602,976,200
第154回利付国債(20年)	2,635,000,000	2,801,900,900
第155回利付国債(20年)	3,000,000,000	3,117,270,000
第156回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,645,716,600
第157回利付国債(20年)	3,060,000,000	2,869,912,800
第158回利付国債(20年)	2,750,000,000	2,673,852,500
第159回利付国債(20年)	2,590,000,000	2,544,105,200
第160回利付国債(20年)	2,080,000,000	2,064,504,000
第161回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,326,116,800
第162回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,198,635,000
第163回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,216,638,800
第164回利付国債(20年)	1,970,000,000	1,883,635,200

	第165回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,935,787,700	
	第166回利付国債（20年）	1,850,000,000	1,811,427,500	
	第167回利付国債（20年）	2,290,000,000	2,170,210,100	
	第168回利付国債（20年）	1,510,000,000	1,404,254,700	
	第169回利付国債（20年）	2,000,000,000	1,823,780,000	
	第170回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,279,406,300	
	第171回利付国債（20年）	1,830,000,000	1,656,113,400	
	第172回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,090,304,000	
	第173回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,147,265,500	
	第174回利付国債（20年）	2,640,000,000	2,402,294,400	
	第175回利付国債（20年）	2,050,000,000	1,890,735,500	
	第176回利付国債（20年）	2,660,000,000	2,445,364,600	
	第177回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,098,165,000	
	第178回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,085,242,400	
	第179回利付国債（20年）	2,495,000,000	2,275,914,050	
	第180回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,256,423,000	
	第181回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,261,420,000	
	第182回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,415,288,000	
	第183回利付国債（20年）	2,450,000,000	2,588,449,500	
	第184回利付国債（20年）	1,540,000,000	1,543,742,200	
	国債証券合計	541,332,000,000	547,776,054,330	
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	99,883,000	
	第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	84,155,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	103,248,000	
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	119,569,000	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	116,899,000	
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	113,025,000	
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	110,688,000	
	第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	218,106,000	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,482,000	
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	110,375,000	
	第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	84,124,000	
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	219,568,000	
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	218,932,000	
	第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,608,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,682,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,220,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,039,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	298,239,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	195,854,000	
	第830回東京都公募公債	300,000,000	291,459,000	

平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,303,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,930,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,289,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	198,486,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	198,272,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	201,880,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	99,319,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	244,984,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	110,155,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	220,820,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	111,168,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,495,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	106,349,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,156,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,794,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,255,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,165,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,039,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	195,792,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	221,000,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	220,140,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	109,565,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,642,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	151,933,180	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,914,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,934,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,912,640	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	199,272,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,466,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,194,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,521,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	155,230,400	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	176,214,220	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	193,478,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	111,002,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	109,829,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,907,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	93,164,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	96,009,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	136,667,160	

第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	108,995,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,828,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,205,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,209,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,126,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	446,016,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,620,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	94,586,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	294,741,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,564,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	105,131,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	88,804,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	109,520,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,171,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,853,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,078,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,156,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,082,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	303,406,300	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	111,250,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,726,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,326,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,878,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	200,320,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	286,182,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,636,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	87,642,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	195,634,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,828,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	167,524,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	110,424,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	221,458,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,375,854	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,024,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	381,135,300	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	97,892,000	



第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	100,408,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	108,809,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	110,014,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	92,954,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	222,636,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	188,174,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	220,820,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	186,830,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,930,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,886,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,358,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,058,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,465,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	97,271,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	144,643,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,939,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	109,267,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,719,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,323,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,557,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	115,952,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,562,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,710,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,918,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	87,642,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	95,182,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	294,024,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	97,125,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	92,937,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン bond・10年)	100,000,000	100,183,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	99,959,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	220,028,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	110,858,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	109,520,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,585,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,865,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,887,000	

平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,150,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	293,229,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,725,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	129,048,400	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,917,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	292,440,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	292,323,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	100,085,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	219,312,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	99,917,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,990,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,617,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,660,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,268,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,164,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,744,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,588,792	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,871,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,962,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,002,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,944,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,758,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,632,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,308,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,720,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,125,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,343,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,078,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,851,167	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,033,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,842,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,982,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,428,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	194,560,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,143,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,231,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	97,909,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	99,306,230	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,915,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,027,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,979,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	222,166,000	

第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	83,487,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	281,028,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	96,683,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	194,350,000	
第1回名古屋市公募公債（12年）	100,000,000	101,841,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	118,970,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	121,299,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	109,374,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	109,682,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,256,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	293,937,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,250,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	128,550,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	220,340,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	111,693,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	109,732,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	83,254,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	83,664,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	104,049,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	331,533,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,915,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,107,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,239,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,689,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,889,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	212,334,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	293,955,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	97,172,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	104,804,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,548,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,243,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	198,794,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	109,648,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,089,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	97,415,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,561,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,935,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,918,000	

	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	110,690,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	107,733,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,302,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,583,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,093,450	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,877,600	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	538,829,500	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,514,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	195,486,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	290,391,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	97,233,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	99,346,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,931,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,830,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,903,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	109,000,000	
	地方債証券合計	32,480,430,000	32,926,408,693	
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	99,935,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,951,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,069,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	70,652,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,495,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,754,000	
	第21回道路債券	100,000,000	119,198,000	
	第28回道路債券	200,000,000	240,564,000	
	第33回道路債券	200,000,000	243,000,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,664,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,187,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,202,000	
	第38回道路債券	100,000,000	102,655,000	
	第42回道路債券	200,000,000	207,156,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,487,000	
	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	122,887,000	

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	221,452,000	
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	222,972,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,860,000	
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	117,620,000	
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	111,899,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,477,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,578,000	
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	110,352,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,686,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,384,000	
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	108,674,000	
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	109,422,000	
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	109,755,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	571,830,000	
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	111,063,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,623,000	
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	215,862,000	
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	107,340,000	
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	213,904,000	
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	100,695,000	
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	260,667,960	
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	301,341,000	
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	104,436,000	
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	210,026,000	
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	100,614,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	112,934,080	
	200,000,000	201,304,000	

第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
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	100,212,000	
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	83,062,000	
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	106,644,760	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,361,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,002,050	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,862,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,024,000	
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	100,071,000	
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	200,058,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,979,000	
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	119,942,400	
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	199,140,000	
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	286,599,000	
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	213,313,060	
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	98,150,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,799,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,982,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	348,528,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,400,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	360,012,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	240,178,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	118,327,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	221,102,000	
第10回公営企業債券（20年）	200,000,000	205,238,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,438,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	600,000,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	163,664,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,211,000	
	200,000,000	220,188,000	

第19回地方公共団体金融機構債券（20年）			
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,421,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	543,485,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,899,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,629,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,643,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	422,544,740	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	151,171,500	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,740,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,892,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,772,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,209,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,882,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,860,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,742,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,935,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,125,500	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,982,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,039,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,999,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,968,100	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,189,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,572,560	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,707,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,790,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,494,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,086,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	713,790,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,014,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,722,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,896,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,738,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,542,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,917,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,822,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,989,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,872,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,644,000	

第7回阪神高速道路債券	100,000,000	103,484,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,109,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,318,000	
第19回水資源債券(サステナビリティボンド)	200,000,000	199,798,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,727,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,017,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,851,320	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,039,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,338,500	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,416,560	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,993,400	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,890,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	203,816,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	139,434,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	76,820,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	162,492,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,076,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,917,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	105,774,000	105,174,261	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,529,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	72,564,000	72,419,597	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	107,558,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,077,000	10,115,494	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	125,907,000	124,839,308	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	144,516,000	142,974,014	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	51,475,000	51,023,564	
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,425,000	10,522,265	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	180,597,000	179,376,164	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	124,260,000	123,200,062	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,541,000	10,661,061	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,832,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,034,000	14,620,480	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,829,000	14,393,638	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,601,000	16,369,661	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,913,000	18,802,380	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,054,000	20,061,384	



第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,566,000	20,561,518	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,336,000	42,320,127	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,316,000	19,126,116	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,680,000	19,459,516	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,250,000	19,021,792	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,319,000	18,036,006	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,289,000	10,412,262	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,608,000	37,982,996	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,226,000	19,954,088	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,785,000	26,726,926	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,523,000	25,414,656	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,689,000	25,605,208	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,294,000	55,126,247	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,754,000	67,501,083	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,200,000	35,056,368	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,010,000	36,172,332	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,741,000	36,965,486	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,990,000	31,990,357	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,005,000	30,752,424	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,348,000	36,594,723	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	167,053,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,625,000	94,926,731	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,148,000	128,201,611	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,474,000	37,241,048	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,882,000	38,688,507	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,643,000	39,338,960	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,115,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,971,000	124,060,363	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,650,000	42,192,283	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,428,000	88,883,404	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,531,000	49,903,473	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,188,000	53,375,753	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	315,261,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,240,000	52,687,696	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,966,000	164,887,369	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,198,000	111,308,795	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,515,000	54,030,349	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,791,000	58,309,385	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,078,000	62,584,341	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,727,000	68,294,110	

第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,273,000	67,668,637	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,550,000	68,197,252	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,196,000	69,116,385	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,466,000	69,247,642	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,486,000	71,039,179	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,715,000	71,325,416	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,515,000	70,924,020	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,464,000	70,872,690	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,228,000	71,628,700	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,102,000	145,483,294	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,253,000	71,611,400	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,762,000	146,676,902	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,853,000	73,125,392	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,474,000	145,811,887	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,455,000	73,701,425	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,288,000	148,342,217	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,296,000	149,291,908	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,555,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,483,000	75,855,082	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,785,000	75,342,977	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,090,000	74,973,108	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,566,000	154,364,148	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,977,000	77,261,780	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,018,000	76,455,446	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,420,000	154,874,280	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,896,000	78,448,178	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	246,843,000	235,157,452	

第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,234,000	158,284,690	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,593,000	81,626,323	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,362,000	82,108,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,338,000	169,336,180	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,763,000	85,571,970	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,568,000	171,099,197	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,816,000	172,902,074	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,323,000	86,115,411	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,580,000	173,813,686	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,962,000	173,927,874	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,952,000	87,794,146	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,441,000	88,711,930	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,931,000	264,744,757	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,591,000	88,928,100	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,895,000	91,303,498	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,397,000	92,902,368	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,352,000	93,974,996	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	193,280,000	188,024,716	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,631,000	97,204,352	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,714,000	199,160,523	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,157,000	100,423,234	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,220,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,778,000	101,115,025	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,167,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	84,033,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	297,429,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,726,000	
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	199,704,000	
	い第847号商工債	100,000,000	99,742,000	
	い第850号商工債	200,000,000	199,302,000	
	い第876号商工債	300,000,000	300,018,000	
	第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,794,000	
	第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,732,000	
	第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,613,000	
	第385回信金中金債（5年）	400,000,000	397,812,000	
	第16号商工債（10年）	100,000,000	100,607,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,825,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	109,618,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,806,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,378,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	488,940,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,354,000	
	第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,910,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,632,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,666,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,128,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,842,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	599,124,000	
	第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,027,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,102,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,612,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,108,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,704,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	189,574,000	
	特殊債券合計	36,371,663,000	36,827,375,579	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,884,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,148,000	
	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	99,649,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,068,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,638,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,536,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,572,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,424,000	

第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空 円貨社債(2023)	100,000,000	99,772,000	
第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,246,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,895,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,271,000	
第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,854,000	
第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,415,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,497,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	96,275,000	
第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,116,000	
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	100,011,000	
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	100,125,000	
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	100,087,000	
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	100,715,000	
第16回キリンホールディングス株式会社無 担保社債	300,000,000	299,934,000	
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	198,828,000	
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	299,877,000	
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	99,255,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,004,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,143,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,006,000	
第10回J・フロントリテイリング株式会 社無担保社債	100,000,000	99,065,000	
第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	98,542,000	
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	100,165,000	
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	100,650,000	
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	199,706,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,767,000	
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	99,488,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,675,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,856,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,778,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,995,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	97,044,000	

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	99,096,000	
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	198,492,000	
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	199,688,000	
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	99,300,000	
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	85,604,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,123,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,976,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	196,886,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	288,291,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	100,059,000	
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	99,942,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,114,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,216,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,952,000	
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	98,195,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,896,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,899,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	97,904,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,842,000	
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	300,048,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,835,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,637,000	
第14回株式会社L I X I L 無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,952,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,120,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,625,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,521,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,602,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,536,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,845,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	97,483,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,590,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,706,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,678,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	200,142,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,611,000	

第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,575,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,593,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,552,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,664,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	194,376,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,916,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,479,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	88,791,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,865,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	110,044,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	196,224,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,525,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,317,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	97,284,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	99,460,000	
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	97,093,000	
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	99,632,000	
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	111,330,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,395,000	
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	100,205,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,500,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,175,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,706,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	196,014,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,364,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,739,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,962,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,108,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,861,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,998,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,484,000	
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	99,638,000	
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	99,577,000	

第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,868,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,356,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,148,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,873,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,882,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,344,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,791,000	
第36回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,888,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,416,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,826,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,245,000	
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	99,072,000	
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	100,307,000	
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	98,730,000	
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	299,754,000	
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	199,352,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	198,954,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,988,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,040,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	88,663,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,030,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,729,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,424,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,965,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	97,166,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,990,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,416,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,639,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	89,261,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,459,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,235,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,020,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,846,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	219,770,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,272,000	



第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	90,202,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	84,645,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,401,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,591,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,969,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	76,441,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,724,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,203,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	79,984,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,303,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,020,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,759,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,981,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,515,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,682,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	84,372,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,072,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	65,662,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	77,815,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,981,000	
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	163,806,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,996,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,967,000	
第20回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,897,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,669,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	178,700,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,624,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,520,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,606,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	94,129,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	86,134,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,011,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,156,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,691,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,402,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,019,000	

第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,420,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,738,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,134,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,019,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,605,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	196,482,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,191,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	299,268,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,136,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,862,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	196,536,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,544,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,907,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	195,434,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,877,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,078,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,518,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,619,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,984,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,081,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,233,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,628,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,779,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,625,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,152,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,160,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,252,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,802,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,970,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	92,143,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,904,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,122,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,352,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,742,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,809,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,883,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,748,000	
	100,000,000	97,115,000	

第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	275,967,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,130,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	96,275,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	80,469,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,366,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,584,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	87,235,000	
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	199,396,000	
社債券合計	29,900,000,000	29,305,397,000	
合計		646,835,235,602	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	97,142,687
コール・ローン	603,290,690
国債証券	65,704,611,633
派生商品評価勘定	670,972,172
未収利息	416,399,205
前払金	9,018,466
前払費用	48,857,792
差入委託証拠金	38,650,560
流動資産合計	67,588,943,205
資産合計	67,588,943,205
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,065,746
未払解約金	20,638
未払利息	502
流動負債合計	9,086,886
負債合計	9,086,886
純資産の部	
元本等	
元本	81,289,584,930
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,709,728,611
元本等合計	67,579,856,319
純資産合計	67,579,856,319

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	67,588,943,205

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	81,289,584,930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 13,709,728,611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 0.8313円 (1万口当たり純資産額) (8,313円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託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。</p>

	2023年 7月10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 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動	区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2022年 7月12日
期首元本額		73,444,156,090円
期中追加設定元本額		12,627,146,605円
期中一部解約元本額		4,781,717,765円
期末元本額		81,289,584,930円
期末元本額の内訳		
分散投資コア戦略ファンドA		20,705,134,236円
分散投資コア戦略ファンドS		27,771,514,520円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030		929,519,507円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040		426,047,342円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050		83,181,446円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060		12,766,236円
10資産分散投資ファンド		482,612,047円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)		6,691,330,419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 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,248,465,794
合計		2,248,465,794

(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 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	541,176,094	-		532,157,628	9,018,466
合計		541,176,094	-		532,157,628	9,018,466

## (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 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	67,686,727,924	-		67,015,803,032	670,924,892
	アメリカドル	33,008,632,015	-		32,591,698,785	416,933,230
	カナダドル	1,387,037,753	-		1,366,649,723	20,388,030
	メキシコペソ	672,805,053	-		664,136,949	8,668,104
	ユーロ	22,641,839,183	-		22,480,145,128	161,694,055
	イギリスポンド	3,306,796,264	-		3,299,496,939	7,299,325
	スウェーデンク ローナ	132,438,254	-		130,445,894	1,992,360
	ノルウェークロー ネ	107,117,972	-		106,945,129	172,843
	デンマーククロ ネ	213,173,394	-		211,559,838	1,613,556
	ポーランドズロ チ	346,084,348	-		342,407,687	3,676,661
	オーストラリア ドル	1,019,261,004	-		1,010,367,661	8,893,343
	ニュージーラン ドル	143,888,855	-		143,691,915	196,940
	シンガポール ドル	306,652,555	-		304,037,431	2,615,124
	マレーシアリン ギット	351,547,709	-		347,189,924	4,357,785

	イスラエルシェケル	199,719,234	-	197,808,811	1,910,423
	オフショア人民元	3,849,734,331	-	3,819,221,218	30,513,113
	合計	67,686,727,924	-	67,015,803,032	670,924,892

## (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	914,941.41	
		T 0.25% 06/30/25	1,940,000.00	1,770,742.58	
		T 0.25% 07/31/25	600,000.00	545,648.43	
		T 0.25% 08/31/25	400,000.00	362,710.93	
		T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,130,981.45	
		T 0.25% 10/31/25	1,240,000.00	1,117,719.53	
		T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,388,521.48	
		T 0.375% 04/30/25	1,550,000.00	1,426,121.08	
		T 0.375% 07/15/24	1,000,000.00	950,476.54	
		T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	849,394.53	
		T 0.375% 08/15/24	1,200,000.00	1,136,250.00	
		T 0.375% 09/15/24	1,000,000.00	943,417.97	
		T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	861,182.81	
		T 0.375% 11/30/25	800,000.00	720,953.12	
		T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,529,169.92	
		T 0.5% 02/28/26	650,000.00	582,448.24	
		T 0.5% 03/31/25	1,270,000.00	1,174,874.02	
		T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,636,263.67	
		T 0.5% 05/31/27	1,350,000.00	1,159,391.59	
		T 0.5% 06/30/27	1,920,000.00	1,644,262.50	
		T 0.5% 08/31/27	1,150,000.00	979,184.56	
		T 0.5% 10/31/27	1,200,000.00	1,016,062.50	
		T 0.625% 03/31/27	260,000.00	225,656.64	
		T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,277,332.02	
T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	887,265.62			
T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,583,017.19			

T 0.625% 10/15/24	2,250,000.00	2,121,723.63	
T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,418,325.78	
T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,160,727.14	
T 0.75% 01/31/28	1,270,000.00	1,079,872.07	
T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	1,982,707.03	
T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	1,930,128.91	
T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,073,976.56	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,820,456.04	
T 0.75% 11/15/24	3,000,000.00	2,824,042.98	
T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	897,402.34	
T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,093,007.41	
T 1.125% 01/15/25	820,000.00	771,472.65	
T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,579,164.82	
T 1.125% 02/28/25	1,300,000.00	1,218,699.22	
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	709,734.37	
T 1.125% 02/29/28	740,000.00	639,044.92	
T 1.125% 05/15/40	870,000.00	545,347.26	
T 1.125% 08/15/40	330,000.00	205,296.09	
T 1.125% 08/31/28	1,400,000.00	1,193,527.34	
T 1.125% 10/31/26	2,290,000.00	2,049,505.27	
T 1.25% 03/31/28	1,370,000.00	1,188,073.63	
T 1.25% 04/30/28	1,400,000.00	1,211,355.47	
T 1.25% 05/15/50	1,800,000.00	973,019.53	
T 1.25% 05/31/28	560,000.00	483,623.43	
T 1.25% 06/30/28	1,150,000.00	991,021.48	
T 1.25% 08/15/31	750,000.00	604,130.85	
T 1.25% 08/31/24	380,000.00	362,744.13	
T 1.25% 09/30/28	40,000.00	34,257.81	
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,434,156.25	
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,163,601.55	
T 1.375% 01/31/25	300,000.00	282,996.09	
T 1.375% 08/15/50	1,550,000.00	865,820.31	
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	398,638.27	
T 1.375% 10/31/28	1,100,000.00	946,386.71	
T 1.375% 11/15/31	3,160,000.00	2,557,378.14	
T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	900,676.56	
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	540,328.12	
T 1.5% 02/15/25	1,630,000.00	1,539,012.89	
T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,493,714.06	
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,711,534.36	
T 1.5% 09/30/24	260,000.00	248,228.90	
T 1.5% 10/31/24	260,000.00	247,543.35	



T 1.5% 11/30/24	2,200,000.00	2,089,656.25
T 1.5% 11/30/28	3,160,000.00	2,733,338.28
T 1.625% 02/15/26	1,200,000.00	1,109,156.25
T 1.625% 05/15/26	2,020,000.00	1,857,295.30
T 1.625% 05/15/31	2,010,000.00	1,677,918.17
T 1.625% 08/15/29	1,300,000.00	1,118,710.94
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	300,847.85
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	236,605.07
T 1.625% 11/15/50	1,320,000.00	788,854.69
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	363,289.06
T 1.75% 01/31/29	750,000.00	655,151.37
T 1.75% 03/15/25	1,100,000.00	1,040,617.18
T 1.75% 07/31/24	260,000.00	250,232.35
T 1.75% 08/15/41	1,740,000.00	1,185,171.08
T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	908,085.93
T 1.75% 12/31/24	450,000.00	427,965.82
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	819,720.70
T 1.875% 02/15/32	2,260,000.00	1,899,282.80
T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,069,937.50
T 1.875% 02/15/51	1,320,000.00	841,835.16
T 1.875% 06/30/26	100,000.00	92,451.17
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	212,067.18
T 1.875% 08/31/24	660,000.00	634,528.12
T 1.875% 11/15/51	690,000.00	438,513.86
T 1% 07/31/28	120,000.00	101,854.68
T 1% 12/15/24	2,000,000.00	1,884,062.50
T 2.125% 05/15/25	280,000.00	265,742.96
T 2.125% 05/31/26	420,000.00	391,289.06
T 2.125% 07/31/24	160,000.00	154,601.66
T 2.125% 09/30/24	650,000.00	625,244.13
T 2.125% 11/30/24	400,000.00	383,203.12
T 2.25% 02/15/27	1,120,000.00	1,035,256.25
T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	905,353.51
T 2.25% 03/31/26	220,000.00	206,378.90
T 2.25% 05/15/41	1,270,000.00	948,059.96
T 2.25% 08/15/27	1,440,000.00	1,321,650.00
T 2.25% 08/15/46	780,000.00	550,311.32
T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	707,493.16
T 2.25% 10/31/24	2,800,000.00	2,691,937.50
T 2.25% 11/15/24	2,910,000.00	2,795,759.77
T 2.25% 11/15/25	1,840,000.00	1,735,421.87
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	584,824.99
T 2.25% 12/31/24	1,860,000.00	1,781,385.94

T 2.375% 02/15/42	1,520,000.00	1,147,778.12	
T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,199,441.80	
T 2.375% 04/30/26	310,000.00	291,369.72	
T 2.375% 05/15/27	1,740,000.00	1,609,635.92	
T 2.375% 05/15/29	1,490,000.00	1,341,698.43	
T 2.375% 05/15/51	1,750,000.00	1,255,043.94	
T 2.375% 11/15/49	1,060,000.00	763,055.07	
T 2.5% 01/31/25	330,000.00	316,735.54	
T 2.5% 02/15/45	450,000.00	336,893.54	
T 2.5% 02/15/46	470,000.00	349,645.11	
T 2.5% 02/28/26	1,500,000.00	1,417,851.57	
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	319,602.53	
T 2.625% 01/31/26	290,000.00	275,318.75	
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,052,968.75	
T 2.625% 03/31/25	330,000.00	316,625.97	
T 2.625% 04/15/25	2,600,000.00	2,492,800.77	
T 2.625% 05/31/27	4,500,000.00	4,199,501.97	
T 2.625% 12/31/25	250,000.00	237,548.82	
T 2.75% 02/15/28	2,000,000.00	1,862,656.23	
T 2.75% 02/28/25	550,000.00	529,750.97	
T 2.75% 05/31/29	1,800,000.00	1,654,734.38	
T 2.75% 06/30/25	190,000.00	182,121.68	
T 2.75% 08/15/32	800,000.00	719,250.00	
T 2.75% 08/15/42	360,000.00	288,021.09	
T 2.75% 08/15/47	790,000.00	613,438.08	
T 2.75% 08/31/25	230,000.00	220,054.29	
T 2.75% 11/15/42	990,000.00	790,511.12	
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	660,227.53	
T 2.875% 04/30/25	880,000.00	846,845.31	
T 2.875% 05/15/28	1,930,000.00	1,803,645.31	
T 2.875% 05/15/32	3,580,000.00	3,257,240.62	
T 2.875% 05/15/43	830,000.00	673,288.86	
T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	822,088.86	
T 2.875% 05/15/52	1,790,000.00	1,431,056.06	
T 2.875% 05/31/25	1,460,000.00	1,404,194.91	
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	480,195.31	
T 2.875% 08/15/28	1,730,000.00	1,613,360.14	
T 2.875% 08/15/45	550,000.00	439,344.72	
T 2.875% 11/15/46	550,000.00	438,227.53	
T 2.875% 11/30/25	540,000.00	516,543.75	
T 2% 02/15/25	1,480,000.00	1,408,457.03	
T 2% 02/15/50	1,170,000.00	772,679.88	

T 2% 06/30/24	260,000.00	251,592.32
T 2% 08/15/25	650,000.00	612,790.04
T 2% 08/15/51	2,100,000.00	1,378,740.23
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,518,676.76
T 2% 11/15/41	1,650,000.00	1,171,661.13
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	153,706.64
T 3.125% 02/15/43	630,000.00	532,977.53
T 3.125% 05/15/48	760,000.00	633,516.40
T 3.125% 08/15/25	3,400,000.00	3,279,539.05
T 3.125% 08/15/44	770,000.00	645,311.13
T 3.125% 08/31/27	2,500,000.00	2,373,242.20
T 3.125% 08/31/29	1,920,000.00	1,799,400.00
T 3.125% 11/15/28	3,630,000.00	3,420,636.91
T 3.125% 11/15/41	330,000.00	282,465.81
T 3.25% 05/15/42	530,000.00	459,236.72
T 3.25% 06/30/27	1,300,000.00	1,241,652.34
T 3.375% 05/15/33	620,000.00	585,706.25
T 3.375% 05/15/44	410,000.00	358,117.38
T 3.375% 08/15/42	1,000,000.00	881,210.94
T 3.375% 11/15/48	910,000.00	794,632.62
T 3.5% 01/31/30	900,000.00	860,800.77
T 3.5% 02/15/33	3,800,000.00	3,628,406.25
T 3.5% 02/15/39	100,000.00	93,291.01
T 3.625% 02/15/44	590,000.00	535,828.31
T 3.625% 02/15/53	650,000.00	602,164.05
T 3.625% 08/15/43	570,000.00	518,488.47
T 3.75% 04/15/26	590,000.00	575,388.28
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	244,283.20
T 3.75% 11/15/43	570,000.00	527,717.57
T 3.875% 02/15/43	300,000.00	284,156.25
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	376,296.67
T 3.875% 09/30/29	1,400,000.00	1,367,734.36
T 3.875% 11/30/29	1,500,000.00	1,466,015.62
T 3.875% 12/31/27	1,500,000.00	1,466,542.96
T 3.875% 12/31/29	1,000,000.00	977,421.88
T 3% 02/15/47	180,000.00	146,534.76
T 3% 02/15/48	710,000.00	578,275.58
T 3% 02/15/49	1,210,000.00	988,655.07
T 3% 05/15/42	370,000.00	308,899.41
T 3% 05/15/45	480,000.00	392,409.37
T 3% 05/15/47	630,000.00	512,650.19
T 3% 07/15/25	2,000,000.00	1,925,585.94
T 3% 07/31/24	2,200,000.00	2,145,539.30

T 3% 08/15/48	1,250,000.00	1,018,774.41	
T 3% 08/15/52	1,500,000.00	1,229,912.11	
T 3% 09/30/25	1,340,000.00	1,287,865.62	
T 3% 10/31/25	270,000.00	259,205.27	
T 3% 11/15/44	680,000.00	557,135.15	
T 3% 11/15/45	320,000.00	260,981.25	
T 4.125% 10/31/27	2,600,000.00	2,566,128.91	
T 4.125% 11/15/32	1,900,000.00	1,904,750.00	
T 4.25% 05/15/39	150,000.00	152,701.17	
T 4.25% 10/15/25	3,300,000.00	3,256,558.60	
T 4.25% 11/15/40	200,000.00	202,261.71	
T 4.375% 02/15/38	210,000.00	217,879.10	
T 4.375% 05/15/40	300,000.00	308,455.07	
T 4.375% 05/15/41	800,000.00	819,234.37	
T 4.375% 11/15/39	350,000.00	360,718.75	
T 4.5% 02/15/36	110,000.00	115,987.69	
T 4.5% 05/15/38	110,000.00	115,437.69	
T 4.5% 08/15/39	350,000.00	366,433.59	
T 4.625% 02/15/40	160,000.00	169,746.87	
T 4.75% 02/15/41	150,000.00	161,176.75	
T 4% 02/28/30	1,950,000.00	1,920,597.65	
T 4% 11/15/42	980,000.00	945,470.30	
T 4% 11/15/52	1,650,000.00	1,636,722.64	
T 5.0% 05/15/37	250,000.00	276,489.25	
T 5.25% 11/15/28	150,000.00	156,064.45	
T 5.375% 02/15/31	60,000.00	64,696.87	
T 6.0% 02/15/26	420,000.00	432,649.21	
T 6.25% 05/15/30	470,000.00	525,518.75	
アメリカドル 小計	254,420,000.00	224,666,358.26 (32,023,942,706)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	600,000.00	537,706.03	
CAN 0.5% 09/01/25	860,000.00	787,926.05	
CAN 0.5% 12/01/30	600,000.00	477,840.60	
CAN 0.75% 10/01/24	470,000.00	446,462.59	
CAN 1.25% 03/01/25	50,000.00	47,226.84	
CAN 1.25% 03/01/27	30,000.00	27,077.57	
CAN 1.25% 06/01/30	840,000.00	716,166.46	
CAN 1.5% 04/01/25	490,000.00	463,190.80	
CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	157,313.83	
CAN 1.5% 06/01/31	940,000.00	802,329.58	
CAN 1.5% 09/01/24	490,000.00	470,922.34	
CAN 1.5% 12/01/31	830,000.00	703,047.64	

	CAN 1.75% 12/01/53	760,000.00	531,151.08
	CAN 1% 06/01/27	340,000.00	303,788.46
	CAN 1% 09/01/26	530,000.00	479,660.39
	CAN 2.25% 06/01/25	160,000.00	153,044.62
	CAN 2.25% 06/01/29	270,000.00	249,446.04
	CAN 2.5% 12/01/32	370,000.00	338,082.40
	CAN 2.75% 06/01/33	280,000.00	261,177.01
	CAN 2.75% 08/01/24	390,000.00	380,538.42
	CAN 2.75% 09/01/27	350,000.00	332,575.69
	CAN 2.75% 12/01/48	250,000.00	223,233.98
	CAN 2.75% 12/01/64	180,000.00	156,158.29
	CAN 2% 06/01/28	290,000.00	266,723.38
	CAN 2% 06/01/32	490,000.00	430,320.10
	CAN 2% 12/01/51	860,000.00	647,147.86
	CAN 3.25% 09/01/28	30,000.00	29,092.42
	CAN 3.5% 03/01/28	190,000.00	186,201.00
	CAN 3.5% 12/01/45	180,000.00	181,841.04
	CAN 3% 04/01/26	150,000.00	144,478.32
	CAN 3% 11/01/24	590,000.00	574,936.91
	CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	202,807.12
	CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	243,188.22
	CAN 5.75% 06/01/33	260,000.00	306,311.08
	CAN 5% 06/01/37	180,000.00	208,321.53
	カナダドル 小計	13,880,000.00	12,467,435.69 (1,337,755,849)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,632,330.00
	MBONO 10% 12/05/24	6,060,000.00	6,018,207.02
	MBONO 5.5% 03/04/27	6,920,000.00	6,086,901.20
	MBONO 5.75% 03/05/26	10,230,000.00	9,286,903.05
	MBONO 5% 03/06/25	2,390,000.00	2,207,141.10
	MBONO 7.5% 05/26/33	2,630,000.00	2,391,906.10
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,760,000.00	7,313,256.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,970,000.00	10,269,565.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	5,800,000.00	5,118,674.00
	MBONO 7.75% 11/23/34	2,100,000.00	1,929,921.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	3,750,000.00	3,674,887.50
	MBONO 8.5% 11/18/38	5,880,000.00	5,647,210.80
	MBONO 8% 07/31/53	2,750,000.00	2,457,097.50
	MBONO 8% 09/05/24	8,790,000.00	8,512,631.11
	MBONO 8% 11/07/47	6,310,000.00	5,682,091.90
	メキシコペソ 小計	83,840,000.00	78,228,724.58 (650,659,593)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	350,000.00	285,635.24

BGB 0.35% 06/22/32	620,000.00	483,159.49
BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	121,462.60
BGB 0.5% 10/22/24	270,000.00	260,010.00
BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	58,182.75
BGB 0.8% 06/22/25	450,000.00	429,191.91
BGB 0.8% 06/22/27	410,000.00	375,143.44
BGB 0.8% 06/22/28	390,000.00	350,205.18
BGB 0.9% 06/22/29	390,000.00	345,103.59
BGB 0% 10/22/27	280,000.00	245,741.29
BGB 0% 10/22/31	160,000.00	123,542.24
BGB 1.25% 04/22/33	80,000.00	67,162.00
BGB 1.4% 06/22/53	210,000.00	127,504.86
BGB 1.45% 06/22/37	220,000.00	172,678.00
BGB 1.6% 06/22/47	260,000.00	178,668.10
BGB 1.7% 06/22/50	280,000.00	190,719.20
BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	171,842.37
BGB 1% 06/22/26	260,000.00	244,381.80
BGB 1% 06/22/31	450,000.00	382,917.15
BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	128,277.00
BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	120,218.24
BGB 2.75% 04/22/39	120,000.00	109,254.36
BGB 3.3% 06/22/54	140,000.00	131,561.60
BGB 3.45% 06/22/43	70,000.00	68,701.08
BGB 3.75% 06/22/45	190,000.00	195,871.76
BGB 3% 06/22/33	180,000.00	175,581.25
BGB 3% 06/22/34	210,000.00	203,848.25
BGB 4.25% 03/28/41	370,000.00	405,621.49
BGB 4.5% 03/28/26	350,000.00	361,609.85
BGB 4% 03/28/32	270,000.00	286,009.65
BGB 5.5% 03/28/28	440,000.00	486,592.04
BGB 5% 03/28/35	400,000.00	461,908.40
BKO 0.4% 09/13/24	700,000.00	676,109.76
BKO 2.5% 03/13/25	470,000.00	463,971.31
BKO 2.8% 06/12/25	90,000.00	89,255.05
BTPS 0.25% 03/15/28	330,000.00	279,661.47
BTPS 0.35% 02/01/25	270,000.00	256,033.98
BTPS 0.45% 02/15/29	380,000.00	314,182.10
BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	506,143.55
BTPS 0.5% 07/15/28	510,000.00	432,296.40
BTPS 0.6% 08/01/31	620,000.00	473,058.76
BTPS 0.85% 01/15/27	490,000.00	443,148.65
BTPS 0.9% 04/01/31	140,000.00	110,933.20
BTPS 0.95% 03/01/37	340,000.00	221,691.56

BTPS 0.95% 06/01/32	450,000.00	344,133.45	
BTPS 0.95% 08/01/30	590,000.00	479,659.97	
BTPS 0.95% 09/15/27	20,000.00	17,811.33	
BTPS 0.95% 12/01/31	590,000.00	459,012.25	
BTPS 0% 04/01/26	600,000.00	541,422.00	
BTPS 0% 08/01/26	510,000.00	454,506.90	
BTPS 0% 08/15/24	560,000.00	537,424.72	
BTPS 1.1% 04/01/27	430,000.00	389,968.29	
BTPS 1.2% 08/15/25	340,000.00	322,285.66	
BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	441,742.08	
BTPS 1.35% 04/01/30	480,000.00	405,712.32	
BTPS 1.45% 03/01/36	290,000.00	208,435.76	
BTPS 1.45% 05/15/25	350,000.00	335,689.90	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,000,000.00	969,570.00	
BTPS 1.5% 04/30/45	270,000.00	159,932.93	
BTPS 1.5% 06/01/25	500,000.00	479,244.50	
BTPS 1.6% 06/01/26	390,000.00	366,814.50	
BTPS 1.65% 03/01/32	510,000.00	419,433.18	
BTPS 1.65% 12/01/30	730,000.00	618,921.01	
BTPS 1.7% 09/01/51	330,000.00	188,312.85	
BTPS 1.75% 07/01/24	350,000.00	343,057.75	
BTPS 1.8% 03/01/41	250,000.00	169,323.97	
BTPS 1.85% 07/01/25	340,000.00	327,641.34	
BTPS 2.05% 08/01/27	470,000.00	439,144.50	
BTPS 2.1% 07/15/26	580,000.00	552,280.64	
BTPS 2.15% 03/01/72	120,000.00	67,463.44	
BTPS 2.15% 09/01/52	210,000.00	131,267.01	
BTPS 2.2% 06/01/27	350,000.00	329,986.65	
BTPS 2.25% 09/01/36	440,000.00	347,013.92	
BTPS 2.45% 09/01/33	560,000.00	477,192.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	400,000.00	273,967.82	
BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	272,244.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	710,000.00	698,004.55	
BTPS 2.5% 12/01/32	690,000.00	600,631.20	
BTPS 2.65% 12/01/27	740,000.00	704,524.11	
BTPS 2.7% 03/01/47	310,000.00	231,077.10	
BTPS 2.8% 03/01/67	220,000.00	150,105.95	
BTPS 2.8% 06/15/29	670,000.00	628,939.72	
BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	417,186.44	
BTPS 2.95% 09/01/38	320,000.00	267,440.00	
BTPS 2% 02/01/28	580,000.00	535,862.00	
BTPS 2% 12/01/25	380,000.00	364,752.12	

BTPS 3.1% 03/01/40	280,000.00	234,227.84
BTPS 3.25% 03/01/38	150,000.00	130,135.61
BTPS 3.25% 09/01/46	510,000.00	419,999.28
BTPS 3.35% 03/01/35	410,000.00	371,108.22
BTPS 3.4% 04/01/28	400,000.00	391,950.00
BTPS 3.45% 03/01/48	420,000.00	354,717.72
BTPS 3.5% 01/15/26	380,000.00	377,207.00
BTPS 3.5% 03/01/30	770,000.00	749,091.42
BTPS 3.7% 06/15/30	110,000.00	107,666.35
BTPS 3.75% 09/01/24	200,000.00	199,861.40
BTPS 3.8% 04/15/26	550,000.00	549,666.70
BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	313,912.90
BTPS 3.85% 12/15/29	320,000.00	317,168.00
BTPS 3% 08/01/29	620,000.00	588,957.84
BTPS 4.4% 05/01/33	140,000.00	141,718.64
BTPS 4.45% 09/01/43	240,000.00	235,786.56
BTPS 4.5% 03/01/26	610,000.00	620,627.42
BTPS 4.5% 10/01/53	130,000.00	127,579.40
BTPS 4.75% 09/01/28	390,000.00	405,681.90
BTPS 4.75% 09/01/44	410,000.00	419,986.37
BTPS 4% 02/01/37	730,000.00	700,354.70
BTPS 4% 10/30/31	150,000.00	148,851.00
BTPS 5.0% 08/01/39	590,000.00	622,727.30
BTPS 5.25% 11/01/29	510,000.00	547,902.18
BTPS 5.75% 02/01/33	590,000.00	658,853.00
BTPS 5% 03/01/25	580,000.00	590,689.34
BTPS 5% 08/01/34	730,000.00	770,551.56
BTPS 5% 09/01/40	560,000.00	592,340.00
BTPS 6.5% 11/01/27	500,000.00	553,299.00
BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	542,449.92
DBR 0.25% 02/15/27	540,000.00	492,718.14
DBR 0.25% 02/15/29	470,000.00	411,864.29
DBR 0.25% 08/15/28	530,000.00	469,133.74
DBR 0.5% 02/15/25	60,000.00	57,457.56
DBR 0.5% 02/15/26	680,000.00	637,422.48
DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	633,446.56
DBR 0.5% 08/15/27	540,000.00	493,009.55
DBR 0% 02/15/30	650,000.00	548,162.55
DBR 0% 02/15/31	830,000.00	683,525.75
DBR 0% 02/15/32	850,000.00	682,571.25
DBR 0% 05/15/35	550,000.00	402,506.72
DBR 0% 05/15/36	420,000.00	298,608.35
DBR 0% 08/15/26	590,000.00	539,780.97



DBR 0% 08/15/29	380,000.00	324,282.24	
DBR 0% 08/15/30	550,000.00	458,472.30	
DBR 0% 08/15/31	780,000.00	634,556.52	
DBR 0% 08/15/50	1,110,000.00	559,477.74	
DBR 0% 08/15/52	560,000.00	268,352.56	
DBR 0% 11/15/27	600,000.00	533,113.80	
DBR 0% 11/15/28	560,000.00	486,297.84	
DBR 1.25% 08/15/48	840,000.00	634,478.04	
DBR 1.7% 08/15/32	750,000.00	695,655.75	
DBR 1.8% 08/15/53	420,000.00	347,845.68	
DBR 1% 05/15/38	410,000.00	324,548.57	
DBR 1% 08/15/24	700,000.00	682,496.50	
DBR 1% 08/15/25	390,000.00	373,032.66	
DBR 2.1% 11/15/29	540,000.00	522,423.54	
DBR 2.3% 02/15/33	800,000.00	777,805.60	
DBR 2.5% 07/04/44	710,000.00	689,136.65	
DBR 2.5% 08/15/46	650,000.00	634,548.20	
DBR 3.25% 07/04/42	450,000.00	484,643.56	
DBR 4.0% 01/04/37	660,000.00	754,770.84	
DBR 4.25% 07/04/39	400,000.00	477,344.00	
DBR 4.75% 07/04/28	570,000.00	623,746.15	
DBR 4.75% 07/04/34	530,000.00	634,820.22	
DBR 4.75% 07/04/40	500,000.00	635,552.50	
DBR 5.5% 01/04/31	560,000.00	668,001.60	
DBR 5.625% 01/04/28	600,000.00	672,262.67	
DBR 6.25% 01/04/30	490,000.00	594,262.20	
DBR 6.5% 07/04/27	240,000.00	272,734.32	
FRTR 0.25% 11/25/26	590,000.00	535,899.95	
FRTR 0.5% 05/25/25	1,380,000.00	1,308,717.48	
FRTR 0.5% 05/25/26	830,000.00	769,511.26	
FRTR 0.5% 05/25/29	1,100,000.00	951,450.50	
FRTR 0.5% 05/25/40	620,000.00	392,071.26	
FRTR 0.5% 05/25/72	210,000.00	76,896.54	
FRTR 0.5% 06/25/44	470,000.00	268,103.51	
FRTR 0.75% 02/25/28	940,000.00	846,517.00	
FRTR 0.75% 05/25/28	1,290,000.00	1,155,947.07	
FRTR 0.75% 05/25/52	800,000.00	412,665.60	
FRTR 0.75% 05/25/53	730,000.00	367,014.43	
FRTR 0.75% 11/25/28	1,100,000.00	976,146.22	
FRTR 0% 02/25/25	1,050,000.00	993,903.75	
FRTR 0% 02/25/26	1,180,000.00	1,085,340.40	
FRTR 0% 02/25/27	1,250,000.00	1,118,052.50	

FRTR 0% 03/25/25	880,000.00	831,136.24
FRTR 0% 05/25/32	770,000.00	587,251.28
FRTR 0% 11/25/29	1,060,000.00	876,173.88
FRTR 0% 11/25/30	1,240,000.00	993,611.05
FRTR 0% 11/25/31	1,070,000.00	830,260.08
FRTR 1.25% 05/25/34	940,000.00	771,061.32
FRTR 1.25% 05/25/36	1,000,000.00	786,176.00
FRTR 1.25% 05/25/38	300,000.00	225,990.00
FRTR 1.5% 05/25/31	1,340,000.00	1,198,296.34
FRTR 1.5% 05/25/50	810,000.00	537,444.72
FRTR 1.75% 05/25/66	390,000.00	251,818.71
FRTR 1.75% 06/25/39	470,000.00	379,559.78
FRTR 1.75% 11/25/24	780,000.00	762,485.88
FRTR 1% 05/25/27	1,200,000.00	1,108,554.60
FRTR 1% 11/25/25	550,000.00	521,888.40
FRTR 2.5% 05/25/30	1,300,000.00	1,258,327.36
FRTR 2.5% 05/25/43	200,000.00	172,462.00
FRTR 2.5% 09/24/26	370,000.00	361,941.03
FRTR 2.75% 02/25/29	370,000.00	363,531.95
FRTR 2.75% 10/25/27	1,110,000.00	1,095,203.70
FRTR 2% 05/25/48	700,000.00	531,274.10
FRTR 2% 11/25/32	1,000,000.00	908,802.50
FRTR 3.25% 05/25/45	640,000.00	620,300.80
FRTR 3.5% 04/25/26	1,520,000.00	1,531,303.63
FRTR 3% 05/25/33	100,000.00	98,515.60
FRTR 3% 05/25/54	60,000.00	54,272.82
FRTR 4.5% 04/25/41	860,000.00	983,994.97
FRTR 4.75% 04/25/35	680,000.00	775,993.22
FRTR 4% 04/25/55	480,000.00	526,454.82
FRTR 4% 04/25/60	410,000.00	455,346.00
FRTR 4% 10/25/38	770,000.00	827,277.99
FRTR 5.5% 04/25/29	1,040,000.00	1,171,695.20
FRTR 5.75% 10/25/32	1,090,000.00	1,316,404.99
IRISH 0.2% 05/15/27	60,000.00	53,736.27
IRISH 0.2% 10/18/30	280,000.00	228,654.61
IRISH 0.35% 10/18/32	90,000.00	70,647.71
IRISH 0.4% 05/15/35	130,000.00	94,832.40
IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	62,743.70
IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	153,976.58
IRISH 0% 10/18/31	100,000.00	78,129.80
IRISH 1.1% 05/15/29	230,000.00	206,414.88
IRISH 1.3% 05/15/33	130,000.00	110,201.00
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	213,547.20

IRISH 1.5% 05/15/50	190,000.00	127,777.47
IRISH 1.7% 05/15/37	140,000.00	114,854.18
IRISH 1% 05/15/26	270,000.00	254,463.82
IRISH 2.4% 05/15/30	190,000.00	183,020.35
IRISH 2% 02/18/45	260,000.00	204,479.60
IRISH 3% 10/18/43	50,000.00	47,552.55
IRISH 5.4% 03/13/25	270,000.00	279,340.46
NETHER 0.25% 07/15/25	410,000.00	386,321.80
NETHER 0.25% 07/15/29	220,000.00	187,960.08
NETHER 0.5% 01/15/40	300,000.00	203,805.89
NETHER 0.5% 07/15/26	390,000.00	361,265.70
NETHER 0.5% 07/15/32	350,000.00	283,504.96
NETHER 0.75% 07/15/27	350,000.00	320,669.65
NETHER 0.75% 07/15/28	370,000.00	332,423.31
NETHER 0% 01/15/26	290,000.00	268,088.47
NETHER 0% 01/15/27	420,000.00	377,963.88
NETHER 0% 01/15/29	370,000.00	315,164.33
NETHER 0% 01/15/38	250,000.00	161,935.00
NETHER 0% 01/15/52	330,000.00	150,465.35
NETHER 0% 07/15/30	300,000.00	245,370.00
NETHER 0% 07/15/31	400,000.00	318,115.21
NETHER 2.5% 01/15/30	140,000.00	136,158.96
NETHER 2.5% 01/15/33	230,000.00	221,766.00
NETHER 2.5% 07/15/33	140,000.00	134,842.68
NETHER 2.75% 01/15/47	480,000.00	468,579.84
NETHER 2% 01/15/54	200,000.00	164,565.20
NETHER 2% 07/15/24	340,000.00	335,103.66
NETHER 3.75% 01/15/42	390,000.00	431,753.79
NETHER 4% 01/15/37	410,000.00	453,700.05
NETHER 5.5% 01/15/28	350,000.00	386,534.40
OBL 0% 04/10/26	760,000.00	700,107.44
OBL 0% 04/11/25	760,000.00	718,746.44
OBL 0% 04/16/27	160,000.00	144,000.96
OBL 0% 10/09/26	1,170,000.00	1,065,238.41
OBL 0% 10/10/25	1,060,000.00	988,722.02
OBL 0% 10/18/24	520,000.00	498,294.72
OBL 1.3% 10/15/27	990,000.00	931,388.23
OBL 2.2% 04/13/28	200,000.00	195,097.40
RAGB 0.25% 10/20/36	40,000.00	27,109.40
RAGB 0.5% 02/20/29	540,000.00	467,777.70
RAGB 0.5% 04/20/27	330,000.00	299,268.75
RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	29,785.77

RAGB 0.75% 02/20/28	270,000.00	242,701.38
RAGB 0.75% 03/20/51	200,000.00	110,339.20
RAGB 0.75% 10/20/26	280,000.00	259,400.68
RAGB 0.85% 06/30/20	110,000.00	43,051.58
RAGB 0.9% 02/20/32	270,000.00	223,757.64
RAGB 0% 02/20/30	310,000.00	252,339.38
RAGB 0% 02/20/31	400,000.00	314,815.20
RAGB 0% 04/20/25	230,000.00	216,890.00
RAGB 0% 07/15/24	300,000.00	290,037.00
RAGB 0% 10/20/40	120,000.00	68,736.72
RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	334,671.75
RAGB 1.5% 02/20/47	190,000.00	134,681.50
RAGB 1.5% 11/02/86	40,000.00	22,676.28
RAGB 1.65% 10/21/24	230,000.00	225,184.72
RAGB 1.85% 05/23/49	100,000.00	75,565.40
RAGB 2.1% 09/20/17	170,000.00	118,235.00
RAGB 2.4% 05/23/34	180,000.00	166,041.18
RAGB 2.9% 02/20/33	170,000.00	165,014.41
RAGB 3.15% 06/20/44	200,000.00	196,183.80
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	100,361.61
RAGB 4.15% 03/15/37	440,000.00	477,531.12
RAGB 4.85% 03/15/26	200,000.00	208,431.90
RAGB 6.25% 07/15/27	240,000.00	267,976.32
RFGB 0.125% 04/15/36	110,000.00	73,980.50
RFGB 0.125% 04/15/52	110,000.00	48,448.07
RFGB 0.125% 09/15/31	180,000.00	141,185.86
RFGB 0.25% 09/15/40	90,000.00	54,307.08
RFGB 0.5% 04/15/26	170,000.00	158,249.43
RFGB 0.5% 04/15/43	150,000.00	89,685.00
RFGB 0.5% 09/15/27	130,000.00	116,827.36
RFGB 0.5% 09/15/28	140,000.00	122,856.21
RFGB 0.5% 09/15/29	110,000.00	94,257.24
RFGB 0.75% 04/15/31	130,000.00	109,059.10
RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	66,527.51
RFGB 0% 09/15/24	80,000.00	76,811.24
RFGB 0% 09/15/26	110,000.00	99,561.78
RFGB 0% 09/15/30	130,000.00	104,333.19
RFGB 1.125% 04/15/34	190,000.00	154,036.04
RFGB 1.375% 04/15/27	90,000.00	84,368.79
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	70,518.88
RFGB 1.5% 09/15/32	60,000.00	52,072.00
RFGB 2.625% 07/04/42	140,000.00	127,520.54
RFGB 2.75% 04/15/38	40,000.00	37,220.27

RFGB 2.75% 07/04/28	150,000.00	147,831.48
RFGB 4% 07/04/25	180,000.00	182,118.99
SPGB 0.1% 04/30/31	490,000.00	378,403.97
SPGB 0.25% 07/30/24	340,000.00	327,853.50
SPGB 0.5% 04/30/30	550,000.00	453,803.35
SPGB 0.5% 10/31/31	600,000.00	471,912.70
SPGB 0.6% 10/31/29	460,000.00	387,902.82
SPGB 0.7% 04/30/32	530,000.00	418,199.68
SPGB 0.8% 07/30/27	780,000.00	704,138.76
SPGB 0.8% 07/30/29	580,000.00	497,659.89
SPGB 0.85% 07/30/37	310,000.00	210,485.04
SPGB 0% 01/31/25	530,000.00	501,968.30
SPGB 0% 01/31/26	540,000.00	495,080.10
SPGB 0% 01/31/27	840,000.00	744,712.08
SPGB 0% 01/31/28	580,000.00	497,497.32
SPGB 0% 05/31/25	510,000.00	477,474.75
SPGB 1.2% 10/31/40	430,000.00	284,520.54
SPGB 1.25% 10/31/30	660,000.00	567,380.88
SPGB 1.3% 10/31/26	590,000.00	551,727.29
SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	456,494.50
SPGB 1.4% 07/30/28	420,000.00	381,621.08
SPGB 1.45% 04/30/29	620,000.00	557,489.12
SPGB 1.45% 10/31/27	550,000.00	507,312.85
SPGB 1.45% 10/31/71	110,000.00	50,496.80
SPGB 1.5% 04/30/27	460,000.00	429,151.94
SPGB 1.6% 04/30/25	600,000.00	580,339.08
SPGB 1.85% 07/30/35	580,000.00	475,020.00
SPGB 1.9% 10/31/52	310,000.00	196,350.90
SPGB 1.95% 04/30/26	590,000.00	566,787.04
SPGB 1.95% 07/30/30	460,000.00	417,719.10
SPGB 1% 07/30/42	170,000.00	103,540.20
SPGB 1% 10/31/50	450,000.00	229,720.50
SPGB 2.15% 10/31/25	500,000.00	486,243.00
SPGB 2.35% 07/30/33	420,000.00	375,487.35
SPGB 2.55% 10/31/32	530,000.00	487,489.76
SPGB 2.7% 10/31/48	410,000.00	326,038.15
SPGB 2.75% 10/31/24	530,000.00	524,544.71
SPGB 2.8% 05/31/26	210,000.00	206,112.06
SPGB 2.9% 10/31/46	410,000.00	343,555.40
SPGB 3.15% 04/30/33	540,000.00	519,262.98
SPGB 3.45% 07/30/43	220,000.00	202,989.60
SPGB 3.45% 07/30/66	340,000.00	296,940.36

	SPGB 3.55% 10/31/33	190,000.00	187,921.40
	SPGB 3.9% 07/30/39	180,000.00	179,078.28
	SPGB 4.2% 01/31/37	480,000.00	499,613.76
	SPGB 4.65% 07/30/25	510,000.00	521,696.85
	SPGB 4.7% 07/30/41	490,000.00	539,005.88
	SPGB 4.9% 07/30/40	490,000.00	549,703.80
	SPGB 5.15% 10/31/28	1,010,000.00	1,093,762.33
	SPGB 5.15% 10/31/44	360,000.00	419,713.20
	SPGB 5.75% 07/30/32	370,000.00	433,258.90
	SPGB 5.9% 07/30/26	140,000.00	149,758.75
	ユーロ 小計	155,600,000.00	140,544,228.72 (21,967,062,948)
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	230,000.00	202,319.50
	UKT 0.125% 01/31/28	400,000.00	321,860.00
	UKT 0.25% 01/31/25	590,000.00	545,371.45
	UKT 0.25% 07/31/31	630,000.00	446,821.20
	UKT 0.375% 10/22/26	640,000.00	546,592.00
	UKT 0.375% 10/22/30	490,000.00	361,571.00
	UKT 0.5% 01/31/29	400,000.00	315,280.00
	UKT 0.5% 10/22/61	450,000.00	132,201.00
	UKT 0.625% 06/07/25	180,000.00	164,723.25
	UKT 0.625% 07/31/35	540,000.00	339,845.76
	UKT 0.625% 10/22/50	300,000.00	115,002.00
	UKT 0.875% 01/31/46	270,000.00	126,387.00
	UKT 0.875% 07/31/33	400,000.00	280,233.35
	UKT 0.875% 10/22/29	310,000.00	246,162.07
	UKT 1.125% 01/31/39	400,000.00	241,032.00
	UKT 1.125% 10/22/73	240,000.00	87,139.20
	UKT 1.25% 07/22/27	170,000.00	146,664.10
	UKT 1.25% 07/31/51	580,000.00	272,774.00
	UKT 1.25% 10/22/41	530,000.00	305,162.37
	UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	359,102.08
	UKT 1.5% 07/22/47	440,000.00	237,459.20
	UKT 1.5% 07/31/53	320,000.00	158,524.03
	UKT 1.625% 10/22/28	240,000.00	204,414.72
	UKT 1.625% 10/22/54	250,000.00	127,567.50
	UKT 1.625% 10/22/71	220,000.00	102,095.84
	UKT 1.75% 01/22/49	240,000.00	135,395.52
	UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	230,947.20
	UKT 1.75% 09/07/37	330,000.00	228,473.58
UKT 1% 01/31/32	880,000.00	656,788.00	
UKT 2.5% 07/22/65	350,000.00	223,079.50	
UKT 2.75% 09/07/24	390,000.00	378,120.44	

UKT 2% 09/07/25	550,000.00	511,570.40	
UKT 3.25% 01/22/44	500,000.00	400,250.00	
UKT 3.25% 01/31/33	410,000.00	366,128.18	
UKT 3.5% 01/22/45	480,000.00	396,988.80	
UKT 3.5% 07/22/68	380,000.00	312,736.20	
UKT 3.5% 10/22/25	280,000.00	266,679.31	
UKT 3.75% 01/29/38	220,000.00	195,890.20	
UKT 3.75% 07/22/52	330,000.00	281,886.00	
UKT 3.75% 10/22/53	210,000.00	178,502.10	
UKT 4.125% 01/29/27	600,000.00	575,867.62	
UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	373,410.18	
UKT 4.25% 06/07/32	490,000.00	478,644.74	
UKT 4.25% 09/07/39	340,000.00	319,780.20	
UKT 4.25% 12/07/27	540,000.00	522,960.51	
UKT 4.25% 12/07/40	260,000.00	243,438.00	
UKT 4.25% 12/07/46	390,000.00	360,814.35	
UKT 4.25% 12/07/49	320,000.00	296,657.34	
UKT 4.25% 12/07/55	420,000.00	394,561.44	
UKT 4.5% 09/07/34	350,000.00	345,068.36	
UKT 4.5% 12/07/42	440,000.00	424,355.71	
UKT 4.75% 12/07/30	340,000.00	342,100.79	
UKT 4.75% 12/07/38	420,000.00	419,202.00	
UKT 4% 01/22/60	300,000.00	273,483.00	
UKT 4% 10/22/63	120,000.00	109,374.00	
UKT 5% 03/07/25	370,000.00	367,843.04	
UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	473,080.50	
イギリスポンド 小計	22,150,000.00	17,470,381.83 (3,193,935,206)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,560,000.00	1,281,293.52
	SGB 0.75% 05/12/28	1,300,000.00	1,179,113.94
	SGB 0.75% 11/12/29	1,450,000.00	1,286,984.78
	SGB 1.75% 11/11/33	600,000.00	556,341.60
	SGB 1% 11/12/26	1,890,000.00	1,765,655.59
	SGB 2.25% 06/01/32	880,000.00	850,320.73
	SGB 2.5% 05/12/25	1,850,000.00	1,818,292.33
	SGB 3.5% 03/30/39	1,010,000.00	1,115,141.00
スウェーデンクローナ 小計	10,540,000.00	9,853,143.49 (129,765,899)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	880,000.00	726,107.36
	NGB 1.375% 08/19/30	1,230,000.00	1,047,449.30
	NGB 1.5% 02/19/26	980,000.00	918,989.12
	NGB 1.75% 02/17/27	820,000.00	760,074.40

	NGB 1.75% 03/13/25	1,470,000.00	1,414,043.85
	NGB 1.75% 09/06/29	960,000.00	851,802.24
	NGB 2.125% 05/18/32	910,000.00	800,041.97
	NGB 2% 04/26/28	850,000.00	780,895.00
	NGB 3% 08/15/33	620,000.00	584,444.24
ノルウェークローネ 小計		8,720,000.00	7,883,847.48 (105,722,394)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,340,000.00	670,712.21
	DGB 0.5% 11/15/27	1,540,000.00	1,387,813.65
	DGB 0.5% 11/15/29	1,470,000.00	1,271,294.22
	DGB 0% 11/15/24	820,000.00	783,560.21
	DGB 0% 11/15/31	1,270,000.00	1,005,938.47
	DGB 1.75% 11/15/25	1,880,000.00	1,817,640.40
	DGB 4.5% 11/15/39	2,430,000.00	2,920,390.27
デンマーククローネ 小計		10,750,000.00	9,857,349.43 (206,807,191)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	740,000.00	623,154.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	480,000.00	440,568.00
	POLGB 0% 07/25/24	630,000.00	594,300.25
	POLGB 1.25% 10/25/30	850,000.00	631,962.25
	POLGB 1.75% 04/25/32	810,000.00	590,895.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	820,000.00	783,674.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	980,000.00	894,875.24
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,080,000.00	960,822.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,010,000.00	889,799.90
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,610,000.00	1,370,528.60
	POLGB 3.25% 07/25/25	960,000.00	917,366.40
	POLGB 3.75% 05/25/27	480,000.00	450,009.60
	POLGB 6% 10/25/33	120,000.00	122,160.00
	POLGB 7.5% 07/25/28	320,000.00	345,136.00
ポーランドズロチ 小計		10,890,000.00	9,615,251.24 (337,413,588)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	650,000.00	614,205.39
	ACGB 0.25% 11/21/25	410,000.00	372,998.05
	ACGB 0.5% 09/21/26	580,000.00	515,918.06
	ACGB 1.25% 05/21/32	630,000.00	491,559.03
	ACGB 1.5% 06/21/31	590,000.00	481,990.20
	ACGB 1.75% 06/21/51	450,000.00	256,025.45
	ACGB 1.75% 11/21/32	780,000.00	630,562.95
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	572,393.15
	ACGB 1% 12/21/30	250,000.00	198,891.92
	ACGB 2.25% 05/21/28	420,000.00	384,572.19
	ACGB 2.5% 05/21/30	480,000.00	431,279.47



	ACGB 2.75% 05/21/41	250,000.00	197,796.28	
	ACGB 2.75% 06/21/35	240,000.00	205,481.55	
	ACGB 2.75% 11/21/27	220,000.00	207,490.31	
	ACGB 2.75% 11/21/28	150,000.00	139,737.35	
	ACGB 2.75% 11/21/29	440,000.00	404,580.54	
	ACGB 3.25% 04/21/25	530,000.00	519,629.38	
	ACGB 3.25% 04/21/29	560,000.00	532,960.72	
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	199,397.51	
	ACGB 3.5% 12/21/34	400,000.00	371,894.24	
	ACGB 3.75% 04/21/37	340,000.00	318,354.53	
	ACGB 3.75% 05/21/34	370,000.00	353,561.18	
	ACGB 3% 03/21/47	320,000.00	251,096.97	
	ACGB 3% 11/21/33	410,000.00	367,166.98	
	ACGB 4.25% 04/21/26	470,000.00	469,974.17	
	ACGB 4.5% 04/21/33	420,000.00	428,263.71	
	ACGB 4.75% 04/21/27	500,000.00	509,382.50	
	オーストラリアドル 小計	11,830,000.00	10,427,163.78 (993,291,621)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	70,000.00	56,109.66	
	NZGB 0.5% 05/15/26	110,000.00	96,619.82	
	NZGB 1.5% 05/15/31	210,000.00	164,844.55	
	NZGB 1.75% 05/15/41	100,000.00	61,499.10	
	NZGB 2.75% 04/15/25	210,000.00	200,065.01	
	NZGB 2.75% 04/15/37	130,000.00	101,323.30	
	NZGB 2.75% 05/15/51	120,000.00	80,075.76	
	NZGB 2% 05/15/32	120,000.00	95,788.41	
	NZGB 3.5% 04/14/33	110,000.00	98,639.46	
	NZGB 3% 04/20/29	190,000.00	172,275.05	
	NZGB 4.25% 05/15/34	120,000.00	113,728.53	
	NZGB 4.5% 04/15/27	190,000.00	186,647.54	
	NZGB 4.5% 05/15/30	150,000.00	146,968.45	
	ニュージーランドドル 小計	1,830,000.00	1,574,584.64 (139,177,536)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	160,000.00	149,392.00	
	SIGB 1.25% 11/01/26	70,000.00	65,429.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	210,000.00	187,173.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	280,000.00	239,064.00	
	SIGB 2.125% 06/01/26	140,000.00	135,030.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	180,000.00	163,440.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	220,000.00	215,066.50	
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	64,648.50	
	SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	68,232.50	
		SIGB 2.625% 08/01/32	190,000.00	183,934.10

	SIGB 2.75% 03/01/46	100,000.00	100,440.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	140,000.00	139,896.40
	SIGB 2.875% 07/01/29	190,000.00	186,580.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	130,000.00	127,400.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	180,000.00	182,970.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	322,080.00
	SIGB 3% 08/01/72	60,000.00	67,278.00
	SIGB 3% 09/01/24	230,000.00	228,190.55
	シンガポールドル 小計	2,940,000.00	2,826,244.55 (299,073,198)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	300,000.00	273,701.04
	MGS 3.502% 05/31/27	470,000.00	467,364.84
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	590,568.05
	MGS 3.757% 05/22/40	910,000.00	862,624.02
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	489,857.29
	MGS 3.844% 04/15/33	290,000.00	286,839.26
	MGS 3.882% 03/14/25	360,000.00	362,642.83
	MGS 3.885% 08/15/29	650,000.00	650,415.35
	MGS 3.892% 03/15/27	430,000.00	432,913.33
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	423,549.79
	MGS 3.9% 11/30/26	370,000.00	374,279.93
	MGS 3.906% 07/15/26	410,000.00	414,311.15
	MGS 3.955% 09/15/25	170,000.00	171,603.76
	MGS 4.059% 09/30/24	410,000.00	412,708.46
	MGS 4.065% 06/15/50	210,000.00	203,498.79
	MGS 4.232% 06/30/31	940,000.00	958,297.19
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	609,331.74
	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	276,306.25
	MGS 4.498% 04/15/30	480,000.00	499,360.70
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	402,506.94
MGS 4.696% 10/15/42	150,000.00	161,091.07	
MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	256,691.42	
MGS 4.762% 04/07/37	260,000.00	277,876.89	
MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	338,846.58	
MGS 4.921% 07/06/48	810,000.00	887,304.45	
MGS 4.935% 09/30/43	130,000.00	142,410.71	
	マレーシアリンギット 小計	11,060,000.00	11,226,901.83 (343,482,570)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	430,000.00	408,409.00
	ILGOV 0.5% 02/27/26	290,000.00	264,912.62
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	616,062.08
	ILGOV 1.3% 04/30/32	160,000.00	129,915.39

	ILGOV 1.5% 05/31/37	410,000.00	303,095.04
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	483,349.03
	ILGOV 1% 03/31/30	550,000.00	458,718.09
	ILGOV 2.25% 09/28/28	360,000.00	334,099.72
	ILGOV 2.8% 11/29/52	140,000.00	106,948.78
	ILGOV 2% 03/31/27	360,000.00	335,669.68
	ILGOV 3.75% 03/31/47	600,000.00	564,673.98
	ILGOV 5.5% 01/31/42	480,000.00	570,691.39
	ILGOV 6.25% 10/30/26	440,000.00	469,149.68
	イスラエルシェケル 小計	5,390,000.00	5,045,694.48 (194,631,105)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	7,480,000.00	7,459,814.17
	CGB 1.99% 09/15/24	5,000,000.00	4,999,456.10
	CGB 2.18% 08/25/25	3,500,000.00	3,499,488.23
	CGB 2.24% 05/25/25	3,000,000.00	3,005,834.10
	CGB 2.26% 02/24/25	10,120,000.00	10,142,885.36
	CGB 2.28% 11/25/25	4,010,000.00	4,016,100.80
	CGB 2.29% 12/25/24	4,300,000.00	4,313,496.84
	CGB 2.37% 01/20/27	6,900,000.00	6,903,988.20
	CGB 2.44% 10/15/27	3,500,000.00	3,505,169.85
	CGB 2.46% 02/15/26	5,110,000.00	5,138,100.39
	CGB 2.47% 09/02/24	3,260,000.00	3,278,035.95
	CGB 2.48% 04/15/27	4,660,000.00	4,676,458.18
	CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,526,251.55
	CGB 2.6% 09/01/32	3,360,000.00	3,326,659.69
	CGB 2.62% 09/25/29	4,450,000.00	4,454,820.68
	CGB 2.64% 01/15/28	5,210,000.00	5,257,917.41
	CGB 2.68% 05/21/30	4,820,000.00	4,832,855.42
	CGB 2.69% 08/12/26	4,950,000.00	5,011,059.73
	CGB 2.69% 08/15/32	4,550,000.00	4,538,065.93
	CGB 2.75% 02/17/32	5,250,000.00	5,261,703.30
	CGB 2.75% 06/15/29	4,900,000.00	4,949,320.95
	CGB 2.76% 05/15/32	2,940,000.00	2,948,915.25
	CGB 2.79% 12/15/29	5,400,000.00	5,454,635.04
	CGB 2.8% 03/24/29	3,100,000.00	3,144,157.95
	CGB 2.8% 03/25/30	2,420,000.00	2,446,090.26
	CGB 2.8% 11/15/32	3,250,000.00	3,272,975.87
	CGB 2.85% 06/04/27	3,850,000.00	3,918,175.80
	CGB 2.89% 11/18/31	2,750,000.00	2,786,334.37
	CGB 2.91% 10/14/28	4,460,000.00	4,555,398.95
	CGB 2.94% 10/17/24	2,000,000.00	2,025,541.60
	CGB 3.01% 05/13/28	4,920,000.00	5,057,848.56
	CGB 3.02% 05/27/31	6,800,000.00	6,976,091.43

	CGB 3.02% 10/22/25	4,500,000.00	4,586,484.15	
	CGB 3.03% 03/11/26	6,730,000.00	6,877,166.25	
	CGB 3.12% 10/25/52	500,000.00	506,778.55	
	CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,335,719.84	
	CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,119,066.34	
	CGB 3.19% 04/15/53	250,000.00	258,745.87	
	CGB 3.25% 11/22/28	3,500,000.00	3,648,733.90	
	CGB 3.27% 11/19/30	1,380,000.00	1,446,296.30	
	CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,215,827.73	
	CGB 3.32% 04/15/52	2,730,000.00	2,852,734.52	
	CGB 3.39% 03/16/50	4,370,000.00	4,616,790.06	
	CGB 3.53% 10/18/51	2,800,000.00	3,035,959.92	
	CGB 3.72% 04/12/51	3,980,000.00	4,454,574.80	
	CGB 3.81% 09/14/50	2,200,000.00	2,497,239.36	
	CGB 3.86% 07/22/49	1,470,000.00	1,675,819.40	
	CGB 4.08% 10/22/48	2,640,000.00	3,113,826.40	
	オフショア人民元 小計	188,290,000.00	191,925,411.30	(3,781,890,229)
	合計		65,704,611,633	(65,704,611,633)

## 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 224銘柄	100.0%	48.7%
カナダドル	国債証券 35銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 351銘柄	100.0%	33.4%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 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%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券 26銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 48銘柄	100.0%	5.8%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,850,440,975
コール・ローン	428,139,473
株式	544,622,314,245
投資信託受益証券	177,859,122
投資証券	11,330,312,536
派生商品評価勘定	303,189,540
未収入金	40,874,987,516
未収配当金	503,620,866
前払金	53,413,722
差入委託証拠金	4,426,215,377
流動資産合計	606,570,493,372
資産合計	606,570,493,372
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	119,373,999
未払解約金	27,413,965,206
未払利息	356
流動負債合計	27,533,339,561
負債合計	27,533,339,561
純資産の部	
元本等	
元本	115,556,915,905
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	463,480,237,906
元本等合計	579,037,153,811
純資産合計	579,037,153,811
負債純資産合計	606,570,493,372

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<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</p>

2023年 7月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,556,915,905口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 5.0108円 (1万口当たり純資産額) (50,108円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ること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。</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 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	126,863,910,081円
期中追加設定元本額	15,403,827,859円
期中一部解約元本額	26,710,822,035円
期末元本額	115,556,915,905円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,580,589,534円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,398,300円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,835,689,546円
世界経済インデックスファンド	12,051,078,905円
外国株式インデックス・オープン	893,066,868円
D Cマイセレクション2 5	653,919,976円
D Cマイセレクション5 0	3,545,706,054円
D Cマイセレクション7 5	4,371,947,394円
D C外国株式インデックス・オープン	12,452,522,200円
D CマイセレクションS 2 5	419,188,258円
D CマイセレクションS 5 0	1,885,192,614円
D CマイセレクションS 7 5	1,851,067,622円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 2 5	29,395,337円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 3 5	152,920,311円
D Cターゲット・イヤール ファンド2 0 4 5	116,936,220円
D C世界経済インデックスファンド	9,420,206,928円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,009,758,842円
マイセレクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,912,583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）	23,440,358円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,866,275円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	36,392,965円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	7,918,160円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	23,236,774円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	194,321,088円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	139,436,465円

区分	2023年 7月10日現在
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,069,317,796円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	72,308,836円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	19,573,314円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	123,606,543円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	41,094,953円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	846,331,991円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	930,096,761円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,125,506,589円
コア投資戦略ファンド(安定型)	110,398,678円
コア投資戦略ファンド(成長型)	275,426,462円
分散投資コア戦略ファンドA	1,605,994,046円
分散投資コア戦略ファンドS	7,989,687,127円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,432,760,892円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,017,775,692円
コア投資戦略ファンド(切替型)	129,730,185円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	523,199,973円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,419,787円
SMT インデックスバランス・オープン	128,402,173円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	125,596,947円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	6,280,734,070円
SMT 世界経済インデックス・オープン	242,046,382円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	970,758,714円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	164,796,239円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,131,452円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	871,889,346円
グローバル経済コア	537,748,511円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,411,138円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,330,186円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	111,777,690円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	25,088,180円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	145,512,080円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	133,747,924円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	54,107,652円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	56,218,813円
10資産分散投資ファンド	53,452,126円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	84,351,896円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	23,546,995円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	446,293,883円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,419,108,764円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	107,329,331円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	67,905,113円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	83,030,523円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	75,921,911円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	214,968,295円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	209,372,552円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	208,311,048円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	209,262,076円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	207,193,300円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	85,708,275円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	134,994,647円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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



合計	14,687,156,663
----	----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	22,728,573,882	-	22,675,160,160	53,413,722
	合計	22,728,573,882	-	22,675,160,160	53,413,722

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年 7月10日現在)

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

(注)時価の算定方法

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

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	34.91	816,614.72	
	BAKER HUGHES CO	77,332	33.11	2,560,462.52	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	152.19	2,754,486.81	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	82.15	696,796.30	
	CHEVRON CORP	133,788	154.22	20,632,785.36	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	103.23	9,298,958.40	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	25.24	1,376,741.04	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	48.85	2,455,005.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	132.40	1,756,550.80	
	EOG RESOURCES INC	43,691	116.20	5,076,894.20	
	EQT CORPORATION	27,026	39.71	1,073,202.46	
	EXXON MOBIL	301,729	103.16	31,126,363.64	
	HALLIBURTON CO	70,302	35.58	2,501,345.16	
	HESS CORP	19,804	134.41	2,661,855.64	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	45.76	614,511.04	
	KINDER MORGAN INC	144,061	16.92	2,437,512.12	
	MARATHON OIL CORP	50,360	23.52	1,184,467.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	32,827	118.02	3,874,242.54	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,406	58.61	3,130,125.66	
	ONEOK INC	31,321	62.17	1,947,226.57	
	OVINTIV INC	14,661	37.93	556,091.73	
	PHILLIPS 66	34,260	99.44	3,406,814.40	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	206.40	3,585,993.60	
	SCHLUMBERGER	105,564	53.35	5,631,839.40	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	77.30	1,337,135.40	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,348.80	718,910.40	
	VALERO ENERGY CORP	26,571	114.88	3,052,476.48	
	WILLIAMS COS	90,577	32.73	2,964,585.21	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	286.84	4,735,154.72	
	ALBEMARLE CORP	8,403	237.52	1,995,880.56	
	ALCOA CORP	15,500	34.09	528,395.00	
	AMCOR PLC	110,292	9.94	1,096,302.48	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	171.65	1,139,412.70	
	BALL CORP	21,539	57.46	1,237,630.94	
	CELANESE CORP-SERIES A	8,582	116.94	1,003,579.08	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	71.85	944,755.65	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	16.29	700,470.00	
	CORTEVA INC	51,304	57.30	2,939,719.20	
	CROWN HOLDINGS INC	9,940	86.76	862,394.40	

DOW INC	51,372	53.10	2,727,853.20
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	70.41	2,402,318.79
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	84.96	750,366.72
ECOLAB INC	18,665	183.40	3,423,161.00
FMC CORP	8,264	104.25	861,522.00
FREEMONT-MCMORAN INC	105,762	38.64	4,086,643.68
INT'L PAPER CO	25,191	31.80	801,073.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	78.59	1,517,337.13
LINDE PLC	36,447	364.51	13,285,295.97
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	90.50	1,786,922.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	440.17	1,923,983.07
MOSAIC CO/THE	27,732	36.75	1,019,151.00
NEWMONT CORPORATION	61,808	42.24	2,610,769.92
NUCOR CORP	18,727	161.95	3,032,837.65
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,893	132.50	780,822.50
PPG INDUSTRIES INC	17,495	146.77	2,567,741.15
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	275.74	1,137,703.24
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	89.16	932,256.96
SEALED AIR CORP	11,690	40.94	478,588.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	255.42	4,661,415.00
STEEL DYNAMICS INC	11,618	105.16	1,221,748.88
VULCAN MATERIALS CO	10,153	217.38	2,207,059.14
WESTLAKE CORP	2,222	120.55	267,862.10
WESTROCK CO	21,356	29.00	619,324.00
3 M COMPANY	40,676	97.29	3,957,368.04
AECOM	10,456	85.81	897,229.36
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	62.74	750,872.32
ALLEGION PLC	5,598	116.79	653,790.42
AMETEK INC	17,753	157.08	2,788,641.24
AXON ENTERPRISE INC	5,367	188.10	1,009,532.70
BOEING CO	42,311	212.10	8,974,163.10
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	133.10	1,465,431.00
CARLISLE COS INC	3,456	257.22	888,952.32
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	49.33	3,061,567.79
CATERPILLAR	38,381	245.18	9,410,253.58
CUMMINS INC	10,414	245.80	2,559,761.20
DEERE&CO	20,925	405.28	8,480,484.00
DOVER CORP	10,657	146.10	1,556,987.70
EATON CORP	29,584	198.46	5,871,240.64
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	88.94	3,777,548.62
FASTENAL CO	44,011	57.87	2,546,916.57
FERGUSON PLC	14,498	154.79	2,244,145.42

FORTIVE CORP	25,894	72.35	1,873,430.90
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	69.08	712,214.80
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	136.08	709,112.88
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	214.15	3,641,406.60
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	108.27	8,774,417.34
GRACO INC	13,378	83.57	1,117,999.46
GRAINGER (WW) INC	3,363	776.18	2,610,293.34
HEICO CORP	3,640	174.02	633,432.80
HEICO CORP-CLASS A	4,690	138.20	648,158.00
HONEYWELL INTL INC	49,482	203.26	10,057,711.32
HOWMET AEROSPACE INC	26,751	49.40	1,321,499.40
HUBBELL INC	3,709	327.80	1,215,810.20
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	224.25	556,588.50
IDEX CORP	5,916	209.98	1,242,241.68
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	243.81	5,524,246.98
INGERSOLL-RAND INC	31,562	64.26	2,028,174.12
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	49.19	624,713.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	66.90	3,362,795.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	194.66	2,857,998.12
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	320.08	808,522.08
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	458.71	7,771,464.82
MASCO CORP	15,277	55.21	843,443.17
NORDSON CORP	4,121	242.29	998,477.09
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	452.45	4,859,313.00
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	86.86	2,668,078.62
OWENS CORNING	6,460	127.13	821,259.80
PACCAR INC	38,842	82.31	3,197,085.02
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	384.17	3,663,060.95
PENTAIR PLC	10,813	62.84	679,488.92
QUANTA SERVICES INC	10,250	193.60	1,984,400.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	108,761	97.42	10,595,496.62
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	325.38	2,754,667.08
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	44.41	614,101.48
SMITH (A.O.) CORP	9,016	70.64	636,890.24
SNAP-ON INC	4,000	280.73	1,122,920.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	90.18	1,136,087.64
TEXTRON	13,437	67.53	907,400.61
TORO CO	8,812	101.16	891,421.92
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	189.19	3,221,527.32
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	883.08	3,606,498.72
UNITED RENTALS INC	5,364	433.57	2,325,669.48
WABTEC CORP	13,304	109.64	1,458,650.56

WATSCO INC	2,656	370.38	983,729.28
XYLEM INC	16,864	109.57	1,847,788.48
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	218.74	6,736,973.26
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	112.04	1,035,249.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	163.30	1,353,757.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	65.60	699,820.80
CINTAS CORP	6,804	480.24	3,267,552.96
CLARIVATE PLC	27,357	9.30	254,420.10
COPART INC	31,883	88.11	2,809,211.13
COSTAR GROUP INC	29,397	86.78	2,551,071.66
EQUIFAX INC	9,160	225.61	2,066,587.60
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	121.23	1,050,700.41
LEIDOS HOLDINGS	8,529	88.04	750,893.16
PAYCHEX INC	24,118	113.44	2,735,945.92
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	324.51	1,374,299.85
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	187.13	640,545.99
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	150.33	2,473,680.15
ROBERT HALF INTL INC	7,185	77.53	557,053.05
ROLLINS INC	17,468	43.16	753,918.88
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	59.49	916,264.98
TRANSUNION	15,741	76.48	1,203,871.68
VERISK ANALYTICS INC	10,738	224.97	2,415,727.86
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	138.80	2,744,770.00
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	170.01	5,140,422.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	95.26	797,040.42
CSX CORP	152,261	33.30	5,070,291.30
DELTA AIR LINES INC	9,648	47.88	461,946.24
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	118.90	1,460,092.00
FEDEX CORP	17,749	251.25	4,459,436.25
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.32	375,196.52
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	179.61	1,032,398.28
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	54.74	745,723.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	226.72	3,836,102.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	369.94	2,721,278.64
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	37.59	508,705.47
U-HAUL HOLDING CO	6,606	50.47	333,404.82
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	42.91	5,780,963.93
UNION PACIFIC CORP	45,361	202.82	9,200,118.02
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	179.76	9,664,616.64
APTIV PLC	19,053	107.55	2,049,150.15
BORGWARNER INC	19,781	44.95	889,155.95
FORD MOTOR COMPANY	290,797	14.98	4,356,139.06

GENERAL MOTORS CO	103,664	39.61	4,106,131.04
LEAR CORP	3,648	148.63	542,202.24
LUCID GROUP INC	61,234	7.45	456,193.30
PHINIA INC	3,956	33.25	131,537.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	24.70	1,267,999.20
TESLA INC	212,019	274.43	58,184,374.17
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	527.18	1,108,659.54
DR HORTON INC	22,973	115.39	2,650,854.47
GARMIN LTD	10,561	105.03	1,109,221.83
HASBRO INC	10,572	64.56	682,528.32
LENNAR CORP-CL A	18,864	120.21	2,267,641.44
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	363.74	3,135,075.06
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	103.18	429,538.34
NIKE B	91,582	104.46	9,566,655.72
NVR INC	247	6,062.78	1,497,506.66
PULTE GROUP INC	16,747	75.03	1,256,527.41
VF CORP	25,718	18.66	479,897.88
WHIRLPOOL CORP	3,785	148.28	561,239.80
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	130.32	4,004,603.28
ARAMARK	16,686	42.38	707,152.68
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	2,636.91	7,380,711.09
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	49.16	863,249.60
CARNIVAL CORPORATION	71,810	19.04	1,367,262.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	2,077.46	4,252,560.62
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	163.45	1,504,884.15
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	341.68	973,104.64
DOORDASH INC - A	19,212	77.95	1,497,575.40
EXPEDIA GROUP INC	11,638	111.88	1,302,059.44
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	148.32	2,844,036.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	115.61	437,815.07
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	55.72	1,424,203.20
MARRIOTT INTL A	19,516	185.66	3,623,340.56
MCDONALD'S CORP	54,264	292.10	15,850,514.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	43.09	980,469.86
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	102.01	1,746,003.16
STARBUCKS CORP	85,428	96.05	8,205,359.40
VAIL RESORTS INC	3,014	243.90	735,114.60
WYNN RESORTS LTD	6,702	101.32	679,046.64
YUM BRANDS INC	19,972	133.45	2,665,263.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	55,381	82.43	4,565,055.83
ALPHABET INC-CL A	442,712	119.48	52,895,229.76
ALPHABET INC-CL C	399,244	120.14	47,965,174.16

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	371.94	2,674,992.48
COMCAST CORP-CL A	312,679	41.43	12,954,290.97
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	129.20	2,549,503.60
FOX CORP - CLASS A	21,544	34.08	734,219.52
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.92	330,212.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	37.94	1,081,707.34
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	81.61	746,976.33
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	74.11	1,139,737.69
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	33.49	454,928.16
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	91.76	1,065,608.88
MATCH GROUP INC	22,730	42.21	959,433.30
META PLATFORMS INC-CLASS A	164,626	290.53	47,828,791.78
NETFLIX INC	33,103	438.10	14,502,424.30
NEWS CORP-CLASS A	33,479	19.71	659,871.09
OMNICOM GROUP	14,048	92.99	1,306,323.52
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	16.29	529,555.32
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	27.45	1,256,304.15
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	41.15	1,172,898.45
ROKU INC	9,122	62.83	573,135.26
SEA LTD-ADR	28,338	54.98	1,558,023.24
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.45	269,082.60
SNAP INC - A	63,578	11.68	742,591.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	143.19	1,842,425.73
THE WALT DISNEY CO	135,788	88.64	12,036,248.32
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	75.80	2,545,591.40
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	12.54	2,224,759.02
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	25.52	559,781.20
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	69.38	320,258.08
AMAZON.COM	686,233	129.78	89,059,318.74
AUTOZONE INC	1,368	2,469.51	3,378,289.68
BATH & BODY WORKS INC	13,528	37.66	509,464.48
BEST BUY COMPANY INC	15,285	79.30	1,212,100.50
BURLINGTON STORES INC	5,108	154.12	787,244.96
CARMAX INC	10,695	81.39	870,466.05
CHEWY INC - CLASS A	6,878	36.70	252,422.60
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	130.66	646,767.00
EBAY	41,952	44.26	1,856,795.52
ETSY INC	10,294	82.76	851,931.44
GENUINE PARTS CO	9,903	165.42	1,638,154.26
HOME DEPOT	75,273	302.81	22,793,417.13
LKQ CORP	19,286	57.19	1,102,966.34
LOWES COMPANIES	44,328	221.94	9,838,156.32

MERCADOLIBRE INC	3,353	1,153.82	3,868,758.46
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	934.47	4,277,069.19
POOL CORP	2,664	365.72	974,278.08
ROSS STORES INC	25,425	107.46	2,732,170.50
TJX COMPANIES INC	85,671	82.70	7,084,991.70
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	216.86	1,701,483.56
ULTA BEAUTY INC	3,920	471.63	1,848,789.60
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	21.89	547,250.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	525.05	17,308,273.25
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	169.33	2,757,877.71
DOLLAR TREE INC	16,318	143.54	2,342,285.72
KROGER CO	50,664	47.17	2,389,820.88
SYSCO CORP	36,197	74.33	2,690,523.01
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	130.05	4,450,311.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	29.10	1,500,599.70
WALMART INC	110,203	153.49	16,915,058.47
ALTRIA GROUP INC	132,765	45.98	6,104,534.70
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	78.01	3,168,610.18
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	66.19	1,588,957.14
BUNGE LIMITED	11,604	100.99	1,171,887.96
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.54	722,674.26
COCA-COLA CO	305,497	59.76	18,256,500.72
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	64.49	992,759.06
CONAGRA BRANDS INC	33,324	33.22	1,107,023.28
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	253.49	3,036,556.71
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	62.86	832,392.12
GENERAL MILLS INC	43,531	75.17	3,272,225.27
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	242.98	2,658,687.16
HORMEL FOODS CORP	23,338	39.35	918,350.30
JM SMUCKER CO	7,850	147.71	1,159,523.50
KELLOGG CO	18,819	67.19	1,264,448.61
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	31.76	2,076,182.96
KRAFT HEINZ CO/THE	56,982	35.46	2,020,581.72
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	112.62	1,337,475.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	84.67	1,531,849.64
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	65.92	966,980.48
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	72.00	7,295,328.00
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	55.87	3,259,902.76
PEPSICO INC	102,377	183.08	18,743,181.16
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	97.70	11,271,844.40
TYSON FOODS INC	23,306	51.76	1,206,318.56
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	98.97	1,914,673.62



CLOROX COMPANY	9,570	157.99	1,511,964.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	75.59	4,441,743.99
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	192.46	3,266,623.58
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	135.36	3,335,676.48
PROCTER & GAMBLE CO	175,356	148.80	26,092,972.80
ABBOTT LABORATORIES	129,183	106.35	13,738,612.05
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	329.54	1,731,073.62
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,469	190.86	2,379,833.34
BAXTER INTERNATIONAL	34,687	45.30	1,571,321.10
BECTON DICKINSON & CO	21,103	256.92	5,421,782.76
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	52.29	5,586,559.02
CARDINAL HEALTH	19,151	93.97	1,799,619.47
CENTENE CORP	40,934	66.50	2,722,111.00
CVS HEALTH CORP	95,131	69.17	6,580,211.27
DAVITA INC	4,627	103.89	480,699.03
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	38.83	690,164.42
DEXCOM INC	28,772	126.71	3,645,700.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	90.26	4,066,393.52
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	429.40	7,573,327.80
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	79.62	2,382,310.02
HCA HEALTHCARE INC	15,457	291.49	4,505,560.93
HENRY SCHEIN INC	8,755	78.66	688,668.30
HOLOGIC INC	18,875	77.51	1,463,001.25
HUMANA INC	9,297	430.14	3,999,011.58
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	498.01	3,071,725.68
INSULET CORP	5,246	278.67	1,461,902.82
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	331.29	8,625,135.15
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	208.28	1,363,817.44
MASIMO CORP	2,669	158.61	423,330.09
MCKESSON CORP	10,179	414.80	4,222,249.20
MEDTRONIC PLC	98,891	85.89	8,493,747.99
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	295.23	1,341,820.35
NOVOCURE LTD	7,933	41.08	325,887.64
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	139.00	1,206,381.00
RESMED INC	10,920	215.80	2,356,536.00
STERIS PLC	6,933	217.85	1,510,354.05
STRYKER CORP	25,363	294.27	7,463,570.01
TELEFLEX INC	3,934	235.92	928,109.28
THE CIGNA GROUP	22,079	277.12	6,118,532.48
THE COOPER COS INC	3,504	378.38	1,325,843.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,339	461.58	32,005,495.62
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	150.96	705,285.12

VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	194.62	2,190,448.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	140.86	2,148,678.44
ABBVIE INC	131,130	135.50	17,768,115.00
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	117.00	2,549,547.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	192.68	1,858,013.24
AMGEN	39,709	218.65	8,682,372.85
AVANTOR INC	49,647	20.73	1,029,182.31
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	386.12	715,480.36
BIO-TECHNE CORP	12,980	80.80	1,048,784.00
BIOGEN INC	10,740	275.07	2,954,251.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	85.07	1,257,589.81
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	62.65	9,794,701.00
CATALENT INC	13,739	44.68	613,858.52
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	206.89	869,765.56
DANAHER CORP	51,486	233.08	12,000,356.88
ELI LILLY & CO	60,041	452.08	27,143,335.28
EXACT SCIENCES CORP	12,208	90.57	1,105,678.56
GILEAD SCIENCES INC	92,825	74.42	6,908,036.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	102.70	1,603,968.60
ILLUMINA INC	11,423	183.32	2,094,064.36
INCYTE CORP	15,212	62.07	944,208.84
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	216.81	2,999,783.16
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	122.00	606,462.00
JOHNSON & JOHNSON	193,140	159.25	30,757,545.00
MERCK & CO	188,628	109.00	20,560,452.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,269.09	2,064,809.43
MODERNA INC	24,153	118.87	2,871,067.11
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	94.02	633,882.84
PFIZER	419,551	35.53	14,906,647.03
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	692.45	5,534,060.40
REPLIGEN CORP	4,353	141.54	616,123.62
REVVITY INC	8,524	116.32	991,511.68
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	30.01	902,790.83
SEAGEN INC	9,758	191.51	1,868,754.58
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.96	733,442.36
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	513.73	14,728,639.10
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	211.82	766,364.76
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	338.18	6,475,132.46
VIATRIS INC	89,720	9.86	884,639.20
WATERS CORP	4,749	264.15	1,254,448.35
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	371.60	2,143,017.20
ZOETIS INC	34,383	167.14	5,746,774.62

BANK OF AMERICA CORP	535,131	28.53	15,267,287.43
CITIGROUP	144,682	45.74	6,617,754.68
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	26.93	1,064,327.46
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	26.65	1,450,293.00
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,284.88	984,218.08
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.83	524,163.64
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.89	1,242,679.68
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	144.34	31,451,252.98
KEY CORP	71,223	9.59	683,028.57
M & T BANK CORP	11,807	128.56	1,517,907.92
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	125.61	3,725,341.38
REGIONS FINL CORP	70,810	18.33	1,297,947.30
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	31.88	3,078,779.12
US BANCORP	113,859	33.54	3,818,830.86
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	38.86	554,648.78
WELLS FARGO & CO	279,720	42.77	11,963,624.40
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.63	573,317.27
AMERICAN EXPRESS	47,011	169.80	7,982,467.80
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	332.62	2,599,757.92
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	76.01	2,186,579.67
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	94.88	1,212,566.40
BANK NEW YORK CO	61,254	44.38	2,718,452.52
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	96,495	340.90	32,895,145.50
BLACKROCK INC	11,143	684.10	7,622,926.30
BLACKSTONE INC	52,505	91.91	4,825,734.55
BLOCK INC	39,463	67.27	2,654,676.01
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,372	108.04	2,957,270.88
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	31.73	497,177.37
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	135.84	970,440.96
CME GROUP INC	26,740	181.95	4,865,343.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,895	78.72	857,654.40
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	116.94	2,220,339.78
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	27.23	761,977.09
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	387.57	1,220,070.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	59.27	2,537,348.70
FISERV INC	46,319	125.20	5,799,138.80
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	253.49	1,283,673.36
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.15	681,730.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	42.34	182,739.44
GLOBAL PAYMENTS INC	18,535	105.85	1,961,929.75
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	315.17	7,819,998.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	112.29	4,671,713.16

INVESCO LTD	26,420	16.92	447,026.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	163.01	849,771.13
KKR & CO INC	44,805	54.87	2,458,450.35
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	224.82	1,193,119.74
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	248.10	795,656.70
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	388.68	24,590,617.56
MOODY'S CORP	12,261	339.57	4,163,467.77
MORGAN STANLEY	93,231	83.36	7,771,736.16
MSCI INC	5,952	471.75	2,807,856.00
NASDAQ INC	24,183	48.97	1,184,241.51
NORTHERN TRUST CORP	15,902	74.32	1,181,836.64
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	66.79	5,295,511.94
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	110.23	1,742,295.38
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	104.33	1,615,654.38
S&P GLOBAL INC	24,377	393.25	9,586,255.25
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	56.79	6,343,045.47
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	59.19	565,264.50
STATE STREET CORP	26,059	73.88	1,925,238.92
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	33.61	981,277.56
TOAST INC-CLASS A	20,341	22.49	457,469.09
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	65.60	594,401.60
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	236.45	28,559,376.80
AFLAC	43,196	70.04	3,025,447.84
ALLSTATE CORP	18,556	108.27	2,009,058.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	119.43	754,678.17
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	58.20	3,173,878.80
AON PLC	15,249	335.41	5,114,667.09
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	74.79	1,982,682.90
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	214.05	3,406,177.65
ASSURANT INC	4,726	125.86	594,814.36
BROWN & BROWN INC	16,344	67.80	1,108,123.20
CHUBB LTD	30,784	191.53	5,896,059.52
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	98.17	1,090,668.70
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	205.44	444,983.04
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	351.28	1,155,008.64
FNF GROUP	20,461	35.76	731,685.36
GLOBE LIFE INC	5,948	111.66	664,153.68
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	72.73	1,798,685.63
LOEWS CORP	12,757	60.45	771,160.65
MARKEL GROUP INC	1,007	1,377.90	1,387,545.30
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	183.99	6,770,648.01
METLIFE INC	48,925	57.61	2,818,569.25

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	76.62	1,420,228.32
PROGRESSIVE CORP	43,513	131.26	5,711,516.38
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	89.85	2,382,911.85
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	171.65	2,943,282.55
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	230.84	1,714,910.36
WR BERKLEY CORP	17,572	59.86	1,051,859.92
WEYERHAEUSER CO	52,615	33.45	1,759,971.75
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	305.76	14,353,291.68
ADOBE INC	34,096	485.27	16,545,765.92
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	89.77	1,030,918.68
ANSYS INC	6,794	320.17	2,175,234.98
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	169.14	404,921.16
ATLASSIAN CORP-CL A	10,436	169.45	1,768,380.20
AUTODESK INC	15,965	201.57	3,218,065.05
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	51.47	762,425.11
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	115.60	860,410.80
BLACK KNIGHT INC	11,543	60.26	695,581.18
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	226.89	4,607,682.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	125.03	773,435.58
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	62.36	1,264,847.88
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	65.34	2,372,299.38
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	144.05	2,387,052.55
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	155.64	482,484.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	98.02	1,736,522.32
DOCUSIGN INC	14,969	49.70	743,959.30
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	26.97	622,143.96
DYNATRACE INC	14,790	51.14	756,360.60
EPAM SYSTEMS INC	4,768	229.20	1,092,825.60
FAIR ISAAC CORP	1,816	793.79	1,441,522.64
FORTINET INC	48,642	74.68	3,632,584.56
GARTNER INC	5,655	347.74	1,966,469.70
GEN DIGITAL INC	43,555	18.08	787,474.40
GODADDY INC - CLASS A	11,388	75.52	860,021.76
HUBSPOT INC	3,646	512.86	1,869,887.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	132.08	8,905,626.08
INTUIT INC	20,854	448.19	9,346,554.26
MICROSOFT CORP	525,636	337.22	177,254,971.92
MONDAY.COM LTD	231	161.86	37,389.66
MONGODB INC	5,325	388.62	2,069,401.50
OKTA INC	11,505	68.53	788,437.65
ORACLE CORP	120,407	114.61	13,799,846.27
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	15.34	2,005,566.94

PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	247.59	5,569,041.87
PTC INC	8,226	137.25	1,129,018.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	476.41	3,762,686.18
SALESFORCE INC	74,331	209.59	15,579,034.29
SERVICENOW INC	15,145	552.98	8,374,882.10
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	170.61	3,297,208.86
SPLUNK INC	11,101	104.41	1,159,055.41
SYNOPSIS INC	11,321	431.29	4,882,634.09
TWILIO INC - A	12,842	62.45	801,982.90
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	406.48	1,357,236.72
UIPATH INC - CLASS A	28,419	16.49	468,629.31
UNITY SOFTWARE INC	16,437	40.46	665,041.02
VERISIGN INC	6,723	222.45	1,495,531.35
VMWARE INC-CLASS A	17,149	141.40	2,424,868.60
WIX.COM LTD	5,010	76.14	381,461.40
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	218.73	3,316,821.72
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	65.67	1,086,641.49
ZSCALER INC	7,204	143.18	1,031,468.72
AMPHENOL CORPORATION	44,247	83.62	3,699,934.14
APPLE INC	1,176,051	190.68	224,249,404.68
ARISTA NETWORKS INC	19,289	158.00	3,047,662.00
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	143.78	623,717.64
CDW CORP/DE	9,584	183.33	1,757,034.72
CISCO SYSTEMS	304,444	50.99	15,523,599.56
COGNEX CORP	14,352	54.23	778,308.96
CORNING	58,221	34.70	2,020,268.70
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	53.53	970,177.72
F5 INC	4,851	143.42	695,730.42
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.87	1,643,677.84
HP INC	68,329	31.13	2,127,081.77
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	31.08	786,976.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	163.77	2,266,249.26
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	291.87	3,561,397.74
NETAPP INC	15,191	76.25	1,158,313.75
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	60.28	768,931.68
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	139.82	3,187,196.90
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	409.97	1,361,100.40
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	52.07	922,576.26
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	37.67	971,509.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	295.22	1,228,705.64
AT&T INC	529,966	15.61	8,272,769.26
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	17.80	276,184.80

LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.74	353,605.06
T-MOBILE US INC	44,785	138.97	6,223,771.45
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	35.90	11,207,226.10
AES CORP	54,375	21.09	1,146,768.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	52.63	1,093,546.14
AMEREN CORPORATION	20,898	82.26	1,719,069.48
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	84.29	3,128,676.22
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	141.06	2,040,856.08
ATMOS ENERGY CORP	11,302	117.31	1,325,837.62
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	29.48	1,399,297.68
CMS ENERGY CORP	23,697	59.30	1,405,232.10
CONSOLIDATED EDISON INC	24,527	92.03	2,257,219.81
CONSTELLATION ENERGY	25,114	91.33	2,293,661.62
DOMINION ENERGY INC	60,549	52.24	3,163,079.76
DTE ENERGY COMPANY	15,851	109.99	1,743,451.49
DUKE ENERGY CORP	57,283	89.77	5,142,294.91
EDISON INTL	25,571	68.86	1,760,819.06
ENERGY CORP	16,181	97.46	1,577,000.26
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	39.15	798,620.85
EVERGY INC	18,475	58.69	1,084,297.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	70.83	1,944,283.50
EXELON CORP	73,907	40.96	3,027,230.72
FIRSTENERGY CORP	39,425	38.77	1,528,507.25
NEXTERA ENERGY INC	150,399	72.05	10,836,247.95
NISOURCE INC	32,351	27.52	890,299.52
NRG ENERGY INC	19,068	38.12	726,872.16
PG&E CORP	129,525	17.40	2,253,735.00
PPL CORPORATION	58,459	26.21	1,532,210.39
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	62.54	2,231,614.82
SEMPRA ENERGY	22,943	144.13	3,306,774.59
SOUTHERN CO	81,133	70.68	5,734,480.44
UGI CORP	18,019	25.95	467,593.05
VISTRA CORP	22,676	26.70	605,449.20
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	88.98	2,086,314.06
XCEL ENERGY INC	39,963	62.93	2,514,871.59
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	113.17	13,538,300.76
ANALOG DEVICES	37,601	185.31	6,967,841.31
APPLIED MATERIALS	62,818	139.57	8,767,508.26
BROADCOM INC	30,991	846.75	26,241,629.25
ENPHASE ENERGY INC	9,617	166.17	1,598,056.89
ENTEGRIS INC	10,321	105.84	1,092,374.64
FIRST SOLAR INC	7,921	189.14	1,498,177.94

	INTEL CORP	310,036	31.85	9,874,646.60	
	KLA CORP	10,294	455.83	4,692,314.02	
	LAM RESEARCH CORP	10,237	617.87	6,325,135.19	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	91.65	1,006,133.70	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	59.15	3,767,500.10	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	86.62	3,526,993.16	
	MICRON TECHNOLOGY	81,347	60.65	4,933,695.55	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	513.90	1,814,580.90	
	NVIDIA CORP	183,596	425.03	78,033,807.88	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	204.06	3,940,398.60	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	93.30	2,986,626.30	
	QORVO INC	6,249	100.23	626,337.27	
	QUALCOMM	82,879	115.94	9,608,991.26	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	108.34	1,217,958.28	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	258.94	1,076,154.64	
	TERADYNE INC	12,318	106.34	1,309,896.12	
	TEXAS INSTRUMENTS	67,444	173.70	11,715,022.80	
	WOLFSPEED INC	10,256	63.64	652,691.84	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	81.87	1,882,600.65	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.81	376,047.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,809	47.82	421,246.38	
	アメリカドル 小計	25,330,053		2,832,878,505.22 (403,798,502,134)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	18.38	687,412.00	
	CAMECO CORP	31,793	39.34	1,250,736.62	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	74.17	6,104,710.19	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.02	2,561,964.86	
	ENBRIDGE	150,513	48.38	7,281,818.94	
	IMPERIAL OIL	16,488	65.42	1,078,644.96	
	KEYERA CORP	18,607	30.66	570,490.62	
	PARKLAND CORP	4,564	33.00	150,612.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	40.50	1,544,305.50	
	SUNCOR ENERGY	98,973	38.82	3,842,131.86	
	TC ENERGY CORP	75,669	52.00	3,934,788.00	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	64.01	1,600,826.09	
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	64.26	2,319,786.00	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	21.71	2,903,213.17	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,275	64.39	532,827.25	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	31.84	1,380,582.40	
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	184.25	2,523,303.75	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	12.33	639,273.51	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.10	661,551.10	



LUNDIN MINING CORP	31,977	10.74	343,432.98
NUTRIEN LTD	37,152	80.86	3,004,110.72
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	19.12	428,593.92
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	54.65	1,933,844.90
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	112.27	393,506.35
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	55.21	1,761,530.26
CAE INC	25,999	28.86	750,331.14
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	108.65	566,392.45
WSP GLOBAL INC	9,951	170.79	1,699,531.29
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	51.05	713,219.55
RB GLOBAL INC	14,445	78.26	1,130,465.70
THOMSON REUTERS CORP	11,033	172.36	1,901,647.88
AIR CANADA	13,805	24.81	342,502.05
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	153.52	6,484,224.24
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	104.03	7,203,869.44
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	148.96	869,479.52
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	77.25	1,564,621.50
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	108.08	331,805.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	42.50	417,350.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	100.20	2,311,914.60
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.10	503,120.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	181.87	820,779.31
DOLLARAMA INC	22,000	87.10	1,916,200.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	65.26	3,708,138.46
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	36.86	255,439.80
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	118.66	1,532,256.58
METRO INC	18,840	73.09	1,377,015.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	153.02	799,682.52
SAPUTO INC	20,898	28.15	588,278.70
BANK MONTREAL	52,757	119.15	6,285,996.55
BANK NOVA SCOTIA	88,533	63.95	5,661,685.35
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	55.84	3,760,488.96
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	98.21	2,367,941.31
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	125.52	12,930,568.32
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	80.88	10,951,637.28
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.37	1,228,772.37
BROOKFIELD CORP	104,769	43.29	4,535,450.01
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.97	650,602.63
IGM FINANCIAL INC	7,685	40.14	308,475.90
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	38.75	166,663.75
ONEX CORP	6,603	73.35	484,330.05
TMX GROUP LTD	23,425	29.23	684,712.75

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	962.57	1,688,347.78
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.71	920,833.48
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	91.01	634,976.77
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	199.30	2,641,721.50
	MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.60	3,218,122.80
	POWER CORP OF CANADA	43,577	36.46	1,588,817.42
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	67.63	2,949,614.82
	CGI INC - CL A	16,084	138.05	2,220,396.20
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,659.64	3,962,863.60
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	103.28	721,307.52
	OPEN TEXT CORP	20,463	52.57	1,075,739.91
	SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	81.90	7,288,035.30
	BCE INC	6,203	59.54	369,326.62
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	60.20	1,678,436.20
	TELUS CORP	32,908	25.76	847,710.08
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.47	542,534.46
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	23.82	581,088.90
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	41.45	468,177.75
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.82	349,157.68
	EMERA INC	17,459	53.76	938,595.84
	FORTIS INC	35,547	55.98	1,989,921.06
	HYDRO ONE LTD	20,587	37.11	763,983.57
	NORTHLAND POWER INC	17,854	26.67	476,166.18
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	203.15	546,473.50
	カナダドル 小計	3,016,123		175,701,938.05 (18,852,817,952)
ユーロ	ENI	174,687	13.05	2,280,014.72
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.80	428,349.60
	NESTE OIL OYJ	32,766	35.65	1,168,107.90
	OMV AG	12,549	40.03	502,336.47
	REPSOL SA	89,536	12.74	1,141,136.32
	TENARIS SA	40,648	13.63	554,235.48
	TOTALENERGIES SE	175,847	51.10	8,985,781.70
	AIR LIQUIDE	38,920	154.78	6,024,037.60
	AKZO NOBEL	12,357	72.16	891,681.12
	ARCELORMITTAL	32,320	24.02	776,488.00
	ARKEMA	4,369	88.20	385,345.80
	BASF SE	64,204	45.25	2,905,231.00
	COVESTRO AG	14,454	47.87	691,912.98
	CRH PLC	55,581	49.01	2,724,024.81
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	99.21	1,359,871.47
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.73	284,416.19

HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	68.08	732,881.20
OCI NV	7,248	22.29	161,557.92
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	31.08	606,184.32
SOLVAY SA	5,356	102.30	547,918.80
STORA ENSO OYJ R	42,169	10.85	457,744.49
SYMRISE AG	10,018	93.50	936,683.00
UMICORE	17,605	25.71	452,624.55
UPM KYMMENE OYJ	42,324	27.70	1,172,374.80
VOESTALPINE AG	7,152	31.62	226,146.24
WACKER CHEMIE AG	1,770	126.45	223,816.50
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	29.42	459,599.24
ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	15,622	1.46	22,878.41
AIRBUS SE	44,063	131.10	5,776,659.30
ALSTOM	24,388	25.42	619,942.96
BOUYGUES ORD	16,606	29.37	487,718.22
BRENTAG SE	12,514	68.98	863,215.72
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	13.08	1,060,225.21
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	32.03	1,107,437.25
DASSAULT AVIATION SA	2,130	180.00	383,400.00
EIFFAGE	5,924	92.76	549,510.24
FERROVIAL SE	37,026	28.57	1,057,832.82
GEA GROUP AG	13,382	36.63	490,182.66
IMCD NV	4,641	129.10	599,153.10
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	57.04	707,181.92
KNORR-BREMSE AG	5,022	64.36	323,215.92
KONE OYJ-B	26,369	46.31	1,221,148.39
LEGRAND SA	19,340	87.80	1,698,052.00
METSO CORPORATION	51,970	10.96	569,851.05
MTU AERO ENGINES AG	3,962	223.10	883,922.20
PRYSMIAN SPA	21,155	36.84	779,350.20
RATIONAL AG	483	642.00	310,086.00
RHEINMETALL AG	2,795	242.20	676,949.00
SAFRAN SA	24,910	134.84	3,358,864.40
SAINT-GOBAIN	36,177	53.68	1,941,981.36
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	156.92	6,328,269.76
SIEMENS	56,492	142.62	8,056,889.04
SIEMENS ENERGY AG	36,841	14.91	549,299.31
THALES SA	8,524	131.90	1,124,315.60
VINCI S.A.	39,327	102.40	4,027,084.80
WARTSILA OYJ	41,917	9.91	415,732.80
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.41	586,958.93
RANDSTAD NV	6,064	48.81	295,983.84

TELEPERFORMANCE	4,734	145.00	686,430.00
WOLTERS KLUWER	18,738	109.60	2,053,684.80
ADP	2,382	128.00	304,896.00
AENA SME SA	5,508	145.05	798,935.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.01	408,857.83
DHL GROUP	74,810	43.96	3,288,647.60
GETLINK	21,115	15.73	332,244.52
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,611	107.14	2,636,822.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	99.75	497,852.25
CONTINENTAL AG	8,168	68.44	559,017.92
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	110.35	808,975.85
FERRARI NV	9,370	288.20	2,700,434.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,618	71.95	4,577,315.10
MICHELIN	47,236	26.36	1,245,140.96
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	52.60	617,787.00
RENAULT SA	11,597	37.77	438,076.67
STELLANTIS NV	162,367	16.20	2,631,644.33
VALEO SA	16,596	19.55	324,451.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	122.36	1,875,534.08
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	152.95	380,233.70
ADIDAS AG	11,414	166.62	1,901,800.68
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,862.20	4,385,481.00
KERING	5,534	477.60	2,643,038.40
LVMH	20,525	825.40	16,941,335.00
MONCLER SPA	14,605	61.60	899,668.00
PUMA SE	9,220	51.94	478,886.80
SEB SA	2,282	91.70	209,259.40
ACCOR	14,436	33.35	481,440.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	65.76	2,111,224.80
DELIVERY HERO SE	13,414	39.46	529,383.51
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	172.45	2,249,092.90
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	13.44	209,381.11
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	34.84	282,482.72
SODEXO	6,173	96.06	592,978.38
BOLLORE SE	83,646	5.62	470,090.52
PUBLICIS GROUPE	17,217	70.02	1,205,534.34
SCOUT24 SE	3,716	56.90	211,440.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	20.70	1,362,598.20
VIVENDI SE	61,243	8.45	517,870.80
D' IETEREN GROUP	2,217	156.30	346,517.10
INDITEX	81,082	34.08	2,763,274.56
PROSUS	59,578	64.20	3,824,907.60

ZALANDO SE	17,664	24.69	436,124.16
CARREFOUR	39,746	16.88	671,111.21
HELLOFRESH SE	13,805	24.50	338,222.50
JERONIMO MARTINS	14,298	25.48	364,313.04
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.39	349,343.78
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	31.21	2,212,789.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	50.63	3,211,055.86
DANONE (GROUPE)	47,639	55.26	2,632,531.14
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	12.43	421,086.40
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	78.90	750,496.80
HEINEKEN NV	20,157	94.66	1,908,061.62
JDE PEET'S BV	7,000	27.00	189,000.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	88.58	938,239.36
PERNOD-RICARD	15,339	196.40	3,012,579.60
REMY COINTREAU	1,032	141.35	145,873.20
BEIERSDORF AG	7,430	116.50	865,595.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	61.86	543,130.80
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	70.26	802,017.90
LOREAL	17,902	402.65	7,208,240.30
AMPLIFON SPA	11,650	30.29	352,878.50
BIOMERIEUX	3,044	90.90	276,699.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	97.72	335,179.60
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	91.50	189,405.00
ESSILORLUXOTTICA	21,384	170.98	3,656,236.32
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	42.88	728,316.80
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	24.64	830,096.96
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	19.64	1,411,217.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	49.58	1,069,291.86
ARGENX SE	4,177	348.20	1,454,431.40
BAYER	72,310	48.76	3,525,835.60
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	56.74	579,882.80
GRIFOLS SA	27,685	12.25	339,279.67
IPSEN	3,532	108.30	382,515.60
MERCK KGAA	9,080	146.50	1,330,220.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	36.21	113,301.09
QIAGEN N.V.	17,038	40.76	694,468.88
RECORDATI SPA	5,163	41.96	216,639.48
SANOFI	84,347	93.95	7,924,400.65
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	309.40	564,345.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	223.60	351,946.40
UCB (GROUPE)	9,389	78.34	735,534.26
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	14.72	407,661.62

AIB GROUP PLC	88,299	3.86	341,187.33
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	6.89	3,042,963.34
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.26	3,991,973.18
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	8.95	791,336.61
BNP PARIBAS	82,574	55.12	4,551,478.88
CAIXABANK	336,789	3.69	1,243,424.98
COMMERZBANK AG	81,889	10.30	843,456.70
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	10.59	1,053,406.17
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	31.79	806,703.04
FINECOBANK SPA	41,585	12.85	534,367.25
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.37	3,330,177.12
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.34	2,930,389.24
KBC GROEP NV	18,057	64.42	1,163,231.94
MEDIOBANCA	25,262	11.01	278,134.62
SOCIETE GENERALE	53,019	23.30	1,235,607.79
UNICREDIT SPA	139,080	21.28	2,959,622.40
ADYEN NV	1,609	1,462.00	2,352,358.00
AMUNDI SA	4,626	53.65	248,184.90
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	9.27	1,247,111.82
DEUTSCHE BOERSE	14,123	161.20	2,276,627.60
EDENRED	20,131	57.94	1,166,390.14
EURAZEO SA	3,357	61.05	204,944.85
EURONEXT NV	6,480	61.25	396,900.00
EXOR NV	7,825	79.44	621,618.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	69.80	594,347.00
NEXI SPA	48,458	7.59	367,893.13
SOFINA	1,238	187.30	231,877.40
WENDEL	2,023	91.15	184,396.45
WORLDLINE SA	20,332	34.18	694,947.76
AEGON	148,741	4.69	697,595.29
AGEAS	11,086	36.51	404,749.86
ALLIANZ SE-REG	29,979	204.00	6,115,716.00
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	18.44	1,313,948.02
AXA SA	136,364	25.35	3,456,827.40
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	187.25	834,198.75
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	327.90	3,414,750.60
NN GROUP NV	16,208	33.28	539,402.24
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.77	449,854.02
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	39.96	1,323,954.72
TALANX AG	5,053	51.65	260,987.45
BECHTLE AG	7,659	36.17	277,026.03
CAPGEMINI SA	12,235	169.45	2,073,220.75

	DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	39.06	1,849,608.18
	NEMETSCHKE SE	5,455	62.00	338,210.00
	SAP SE	77,618	121.44	9,425,929.92
	NOKIA OYJ	396,129	3.82	1,514,401.16
	CELLNEX TELECOM SA	41,890	36.25	1,518,512.50
	DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.50	4,697,940.00
	ELISA A	10,227	47.71	487,930.17
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.66	354,324.37
	KPN (KON.)	216,358	3.23	699,701.77
	ORANGE	128,563	10.33	1,328,312.91
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	216,633.46
	TELEFONICA	373,259	3.63	1,355,303.42
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.38	235,139.13
	ACCIONA SA	2,181	138.20	301,414.20
	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	28.02	152,344.74
	E.ON SE	166,881	11.30	1,886,589.70
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	17.20	374,134.40
	ELIA GROUP SA/NV	987	111.00	109,557.00
	ENAGAS	21,663	15.99	346,499.68
	ENDESA	25,972	19.43	504,635.96
	ENEL	596,378	6.09	3,636,116.66
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.35	1,189,199.31
	ENGIE	129,254	15.09	1,950,959.87
	FORTUM OYJ	32,550	12.17	396,133.50
	IBERDROLA SA	432,701	11.18	4,839,760.68
	IBERDROLA SA-RTS	432,701	0.29	129,031.43
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.00	260,260.00
	REDEIA CORP SA	30,678	14.87	456,335.25
	RWE STAMM	44,929	39.05	1,754,477.45
	SNAM SPA	147,559	4.60	679,361.63
	TERNA SPA	95,819	7.46	715,193.01
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.52	1,419,754.12
	VERBUND AG	6,430	71.20	457,816.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	372.35	1,265,990.00
	ASML HOLDING NV	29,993	640.40	19,207,517.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	35.74	3,469,767.15
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	43.80	2,202,526.80
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	53.50	282,212.50
	VONOVIA SE	52,580	17.78	935,135.30
	ユーロ 小計	14,094,279		344,000,020.06 (53,767,203,135)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.53	5,965,366.26

SHELL PLC-NEW	508,994	22.82	11,617,788.05
ANGLO AMERICAN PLC	93,327	22.01	2,054,127.27
ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.15	422,611.68
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	55.62	607,592.88
ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	18.30	322,153.20
GLENCORE PLC	793,369	4.36	3,461,865.63
JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	17.07	287,595.36
MONDI PLC	41,710	12.14	506,567.95
RIO TINTO PLC REG	83,678	49.15	4,112,773.70
ASHTED GROUP PLC	33,317	50.94	1,697,167.98
BAE SYSTEMS PLC	219,532	8.88	1,949,883.22
BUNZL PLC	22,799	28.75	655,471.25
DCC PLC	6,622	42.03	278,322.66
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.48	944,324.86
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.80	418,320.80
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	99.74	549,966.36
EXPERIAN PLC	67,859	28.60	1,940,767.40
INTERTEK GROUP PLC	13,890	39.98	555,322.20
RELX PLC	141,442	24.63	3,483,716.46
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	5.94	1,081,184.96
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.02	294,784.45
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	38.72	269,181.44
BURBERRY GROUP PLC	29,776	20.33	605,346.08
PERSIMMON PLC	25,686	9.74	250,335.75
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.00	265,292.46
COMPASS GROUP PLC	129,701	20.70	2,684,810.70
ENTAIN PLC	49,630	12.17	603,997.10
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	52.54	597,012.02
PEARSON	55,305	8.17	452,284.29
WHITBREAD PLC	17,434	33.09	576,891.06
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.97	432,887.98
INFORMA PLC	110,598	7.05	780,600.68
WPP PLC	85,821	8.14	698,754.58
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.41	291,623.25
KINGFISHER PLC	153,717	2.24	344,479.79
NEXT PLC	7,832	66.58	521,454.56
OCADO GROUP PLC	54,753	5.92	324,137.76
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.70	401,246.17
TESCO PLC	525,585	2.46	1,295,041.44
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.91	512,612.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.74	4,064,037.12
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.72	426,011.20



	DIAGEO	167,595	32.70	5,480,356.50
	IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.44	1,194,256.32
	HALEON PLC	346,790	3.08	1,070,887.52
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	57.42	3,036,656.70
	UNILEVER PLC	187,760	39.90	7,492,562.80
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.63	798,102.82
	ASTRAZENECA	115,201	101.10	11,646,821.10
	GSK PLC	304,379	13.16	4,005,627.64
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	18.47	122,271.40
	BARCLAYS	1,129,529	1.48	1,679,835.52
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	6.09	9,057,191.87
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.43	2,080,831.73
	NATWEST GROUP PLC	426,244	2.32	991,443.54
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.73	1,280,911.02
	3I GROUP PLC	74,757	18.62	1,392,349.12
	ABRDN PLC	153,430	2.14	328,493.63
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.79	257,817.72
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	80.90	2,414,784.10
	M&G PLC	131,539	1.84	242,623.68
	SCHRODERS PLC	39,932	4.20	167,714.40
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	10.68	437,379.79
	WISE PLC - A	49,048	6.28	308,413.82
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	20.29	329,813.95
	AVIVA PLC	193,334	3.81	738,149.21
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.20	902,815.87
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.26	268,469.26
	PRUDENTIAL	212,226	10.39	2,205,028.14
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.00	689,940.00
	HALMA PLC	31,069	21.53	668,915.57
	BT GROUP PLC	464,863	1.22	568,295.01
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.70	1,106,505.43
	CENTRICA PLC	453,631	1.21	552,749.37
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.99	2,598,809.28
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.94	418,183.92
	SSE PLC	81,692	17.34	1,416,539.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.31	471,203.28
	イギリスポンド 小計	20,310,344		128,028,462.42 (23,406,163,499)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.19	229,479.62
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	670.00	384,580.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,927.00	1,984,506.00
	HOLCIM LTD	41,204	56.40	2,323,905.60

SIG GROUP AG	26,203	24.64	645,641.92
SIKA AG-BR	10,856	244.80	2,657,548.80
ABB LTD	116,833	33.57	3,922,083.81
GEBERIT AG-REG	2,530	444.60	1,124,838.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	194.60	398,540.80
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	203.00	627,676.00
VAT GROUP AG	1,956	356.50	697,314.00
ADECCO GROUP AG-REG	8,571	29.88	256,101.48
SGS SA	10,147	81.64	828,401.08
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	261.70	989,487.70
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	143.80	5,571,962.40
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	264.60	657,001.80
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	50.10	197,293.80
DUFREY AG-REG	7,820	42.38	331,411.60
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,663.00	465,640.00
CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	8	106,000.00	848,000.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,670.00	874,940.00
NESTLE SA - REGISTERED	204,409	104.66	21,393,445.94
ALCON INC	38,399	71.72	2,753,976.28
SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	232.50	903,727.50
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	135.95	1,161,013.00
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	74.15	137,177.50
LONZA GROUP AG-REG	5,536	525.00	2,906,400.00
NOVARTIS	152,294	84.91	12,931,283.54
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	283.60	628,174.00
ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	265.20	13,849,274.40
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	95.60	237,757.20
JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	55.00	840,895.00
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	803.20	1,264,236.80
UBS GROUP AG	249,657	17.66	4,410,190.90
BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	129.70	308,556.30
HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	121.40	358,737.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	516.20	1,248,687.80
SWISS RE LTD	22,063	88.84	1,960,076.92
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	410.50	4,591,032.00
TEMENOS AG - REG	5,150	68.58	353,187.00
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	53.20	569,346.40
SWISSCOM	1,856	551.20	1,023,027.20
BKW AG	1,744	153.30	267,355.20
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	78.75	447,221.25
スイスフラン 小計	1,103,720		100,561,133.54 (16,114,921,649)

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	317.55	7,066,122.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	393.80	2,119,825.40	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	140.80	5,039,232.00	
	ALFA LAVAL AB	18,955	373.00	7,070,215.00	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	250.10	19,001,847.70	
	ATLAS COPCO A	207,097	149.40	30,940,291.80	
	ATLAS COPCO B	108,178	130.00	14,063,140.00	
	BEIJER REF AB	26,868	135.50	3,640,614.00	
	EPIROC AB-A	53,479	200.40	10,717,191.60	
	EPIROC AB-B	28,804	172.50	4,968,690.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	94.70	3,666,026.40	
	INDUTRADE AB	22,644	232.80	5,271,523.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	206.10	2,885,812.20	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	215.60	3,874,332.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	98.00	12,039,104.00	
	SAAB AB-B	6,388	574.40	3,669,267.20	
	SANDVIK AB	75,334	202.70	15,270,201.80	
	SKANSKA B	25,507	155.15	3,957,411.05	
	SKF AB-B	21,050	185.20	3,898,460.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	223.20	3,016,324.80	
	VOLVO B	114,238	217.90	24,892,460.20	
	SECURITAS B	28,375	87.36	2,478,840.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	45.32	2,258,703.48	
	EVOLUTION AB	13,186	1,301.60	17,162,897.60	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	24.08	1,279,779.76	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	179.16	7,408,445.16	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	279.70	13,837,877.80	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	179.40	3,192,602.40	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	203.40	2,915,739.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	115.70	27,378,785.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	120.60	13,266,120.60	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	90.82	10,965,243.52	
	SWEDBANK AB-A	58,652	183.60	10,768,507.20	
	EQT AB	31,471	201.80	6,350,847.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	290.90	3,437,856.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	289.80	3,236,486.40		
INVESTOR AB-A SHS	26,088	206.60	5,389,780.80		
INVESTOR AB-B SHS	128,538	208.00	26,735,904.00		
KINNEVIK AB - B	18,792	141.70	2,662,826.40		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	446.30	3,249,064.00		
ERICSSON (LM) B	214,689	58.07	12,466,990.23		
HEXAGON AB-B SHS	148,878	124.80	18,579,974.40		

	TELE2 AB-B SHS	46,762	89.90	4,203,903.80
	TELIA CO AB	123,760	24.30	3,007,368.00
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	42.28	2,397,276.00
	SAGAX AB-B	17,402	217.20	3,779,714.40
	スウェーデンクローナ 小計	2,691,864		395,479,627.10 (5,208,466,688)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	261.00	4,725,405.00
	EQUINOR ASA	73,436	304.90	22,390,636.40
	NORSK HYDRO	100,517	62.84	6,316,488.28
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	382.20	4,776,735.60
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	465.00	4,019,925.00
	ADEVINTA ASA	19,117	68.00	1,299,956.00
	MOWI ASA	31,968	168.10	5,373,820.80
	ORKLA	37,417	76.82	2,874,373.94
	SALMAR ASA	5,423	426.00	2,310,198.00
	DNB BANK ASA	71,795	199.10	14,294,384.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	167.00	3,101,858.00
	TELENOR ASA	51,193	107.85	5,521,165.05
	ノルウェークローネ 小計	448,688		77,004,946.57 (1,032,636,333)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	479.40	4,066,750.20
	NOVOZYMES A/S	17,111	320.90	5,490,919.90
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,643.50	1,240,842.50
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	72,778	176.90	12,874,428.20
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,340.00	2,702,460.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,485.00	3,820,410.00
	DSV A/S	14,203	1,409.50	20,019,128.50
	PANDORA A/S	7,957	622.40	4,952,436.80
	CARLSBERG AS-B	6,810	1,041.00	7,089,210.00
	COLOPLAST-B	9,208	809.60	7,454,796.80
	DEMANT A/S	8,512	271.40	2,310,156.80
	GENMAB A/S	4,628	2,571.00	11,898,588.00
	NOVO NORDISK A/S-B	123,050	1,074.00	132,155,700.00
	DANSKE BANK A/S	46,499	165.35	7,688,609.65
TRYG A/S	29,772	144.40	4,299,076.80	
	ORSTED A/S	12,910	616.80	7,962,888.00
	デンマーククローネ 小計	363,201		236,026,402.15 (4,951,833,917)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	29.42	606,905.18
	SANTOS	218,974	7.46	1,633,546.04
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	34.16	4,821,171.60
	BHP GROUP LTD	377,956	43.20	16,327,699.20
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.51	678,362.70

FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	21.67	2,654,683.35
IGO LTD	56,345	15.06	848,555.70
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,156	38.69	1,089,355.64
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	67.45	971,887.05
NEWCREST MINING LIMITED	60,966	26.19	1,596,699.54
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	12.23	901,130.86
ORICA LTD	38,288	14.67	561,684.96
PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.88	1,022,286.80
RIO TINTO LTD	28,272	111.75	3,159,396.00
SOUTH32 LTD	346,773	3.67	1,272,656.91
REECE LTD	16,814	17.60	295,926.40
BRAMBLES LTD	108,007	14.09	1,521,818.63
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	23.22	1,030,410.72
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.87	462,817.17
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.12	520,200.00
TRANSURBAN GROUP	224,973	14.00	3,149,622.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	36.80	1,700,528.00
IDP EDUCATION LTD	17,793	21.10	375,432.30
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.10	928,266.30
REA GROUP LTD	3,586	139.63	500,713.18
SEEK LTD	28,001	22.24	622,742.24
WESFARMERS LTD	84,329	47.09	3,971,052.61
COLES GROUP LTD	108,486	17.96	1,948,408.56
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.16	676,990.16
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	38.86	3,577,879.06
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	10.78	689,488.80
COCHLEAR LIMITED	4,783	221.56	1,059,721.48
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	55.08	666,853.56
SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	34.58	941,959.20
CSL LIMITED	35,855	266.90	9,569,699.50
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	23.28	5,159,057.52
COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	98.73	12,390,713.73
NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	25.66	5,986,426.68
WESTPAC BANKING	255,840	20.85	5,334,264.00
ASX LTD	14,549	60.99	887,343.51
MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	172.35	4,671,546.75
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	31.02	428,448.24
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.73	954,973.26
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.49	810,318.67
QBE INSURANCE GROUP	104,083	15.55	1,618,490.65
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.33	1,264,537.12
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	75.75	1,045,425.75

	XERO LTD	11,340	115.20	1,306,368.00	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.26	1,314,069.42	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.43	922,924.83	
	オーストラリアドル 小計	5,120,036		116,451,459.53 (11,093,166,034)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.38	691,023.18	
	EBOS GROUP LTD	14,283	37.55	536,326.65	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	24.50	979,510.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	5.02	487,979.14	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.58	425,153.54	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.60	619,046.40	
	ニュージーランドドル 小計	409,088		3,739,038.91 (330,493,649)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	46.00	8,072,816.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	81.35	8,704,450.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.78	1,083,760.00	
	MTR CORP	125,000	35.00	4,375,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.64	1,756,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	49.60	8,630,400.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	26.80	5,306,400.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	18.88	2,754,592.00	
	WH GROUP LTD	658,301	3.98	2,620,037.98	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	22.35	6,291,525.00	
	HANG SENG BANK	59,400	106.90	6,349,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	282.20	24,918,260.00	
	AIA GROUP LTD	865,600	76.55	66,261,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	39.95	1,498,125.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	59.20	6,038,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.44	5,825,991.08	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	39.85	4,463,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	42.05	5,129,931.80	
	ESR GROUP LTD	157,000	12.56	1,971,920.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	11.54	1,996,420.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	22.65	2,836,414.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	18.52	2,525,665.00	
	SINO LAND CO	315,400	9.30	2,933,220.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	95.10	9,985,500.00	
SWIRE PACIFIC A	10,000	59.85	598,500.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.70	1,798,940.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	38.35	4,717,050.00		
	香港ドル 小計	5,609,853		199,444,858.06 (3,631,890,865)	

シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	33.75	270,000.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.45	727,560.00	
	SEATRUM LTD	2,152,791	0.12	269,098.87	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.57	526,218.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.32	792,990.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.93	272,304.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.67	655,462.00	
	DBS GROUP	130,200	30.67	3,993,234.00	
	OCBC BANK	257,100	12.05	3,098,055.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	27.40	2,575,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.28	612,480.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.49	372,393.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.48	1,377,994.64	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.22	409,584.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.76	289,328.00	
UOL GROUP LIMITED	47,500	6.50	308,750.00		
シンガポールドル 小計		4,346,866		16,551,051.75 (1,751,432,296)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	21.00	1,247,967.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	761.80	1,634,822.80	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	30.75	3,023,032.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	28.02	3,152,586.24	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.23	1,813,885.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	122.80	1,535,368.40	
	NICE LTD	4,991	736.00	3,673,376.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	130.90	1,309,000.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	202.20	310,781.40	
イスラエルシェケル 小計		400,926		17,700,819.34 (682,786,094)	
合 計		83,245,041		544,622,314,245 (544,622,314,245)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	807,913.00	
		LENLEASE GROUP	64,786	503,387.22	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,311,300.22 (124,914,458)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,907,450.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,907,450.00 (52,944,664)	
投資信託受益証券合計			463,076	177,859,122 (177,859,122)	

投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,462,976.03	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	900,312.70	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	6,774,047.55	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	719,240.46	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,926,558.81	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	665,181.72	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	842,936.22	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,724,109.55	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,431,450.80	
		EQUINIX INC	6,951	5,368,326.81	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	928,812.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,722,387.90	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,214,066.25	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,286	1,375,442.32	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	867,655.25	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	568,480.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	930,195.75	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	990,688.85	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,563,577.92	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,351,741.70	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	953,150.30	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,408,398.15	
		PROLOGIS INC	68,641	8,373,515.59	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,401,155.23	
		REALTY INCOME CORP	49,099	2,924,827.43	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	767,049.41	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,822,511.95	
		SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,778,693.45	
		SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,110,235.63	
		UDR INC	23,815	1,015,709.75	
		VENTAS INC	31,565	1,511,963.50	
		VICI PROPERTIES INC	74,643	2,323,636.59	
		WELLTOWER INC	36,855	2,941,397.55	
		WP CAREY INC	16,024	1,084,023.60	
	アメリカドル 小計	894,017	68,744,457.52	(9,798,834,974)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	242,835.03		
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	295,394.30		
	カナダドル 小計	20,377	538,229.33	(57,752,007)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	217,434.84		
	GECINA SA	3,139	296,635.50		



	KLEPIERRE	17,225	385,667.75
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	517,627.05
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	341,446.16
	ユーロ 小計	48,695	1,758,811.30 (274,902,206)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	240,624.42
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	322,085.65
	SEGRO PLC	78,133	554,431.76
	イギリスポンド 小計	213,836	1,117,141.83 (204,235,869)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	736,724.70
	GOODMAN GROUP	116,335	2,282,492.70
	GPT GROUP	167,884	683,287.88
	MIRVAC GROUP	266,683	597,369.92
	SCENTRE GROUP	381,283	995,148.63
	STOCKLAND	207,412	819,277.40
	VICINITY CENTERS	305,149	550,793.94
	オーストラリアドル 小計	1,538,836	6,665,095.17 (634,916,965)
香港ドル	LINK REIT	166,900	7,001,455.00
	香港ドル 小計	166,900	7,001,455.00 (127,496,495)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	758,648.46
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	629,663.94
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	455,934.29
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	349,800.00
	シンガポールドル 小計	1,125,856	2,194,046.69 (232,174,020)
	投資証券合計	4,008,517	11,330,312,536 (11,330,312,536)
	合計		11,508,171,658 (11,508,171,658)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 606銘柄	97.6%			72.6%
	投資証券 34銘柄			2.4%	1.8%

カナダドル	株式	85銘柄	99.7%			3.4%
	投資証券	2銘柄			0.3%	0.0%
ユーロ	株式	223銘柄	99.5%			9.7%
	投資証券	5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式	79銘柄	99.1%			4.2%
	投資証券	3銘柄			0.9%	0.0%
スイスフラン	株式	44銘柄	100.0%			2.9%
スウェーデンクローナ	株式	46銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式	16銘柄	100.0%			0.9%
オーストラリアドル	株式	50銘柄	93.6%			2.0%
	投資信託受益証券	2銘柄		1.1%		0.0%
	投資証券	7銘柄			5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式	27銘柄	95.3%			0.7%
	投資信託受益証券	1銘柄		1.4%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	88.3%			0.3%
	投資証券	4銘柄			11.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	306,179,496
コール・ローン	5,368,851
株式	17,837,559,031
投資信託受益証券	32,271,033
投資証券	111,072,479
派生商品評価勘定	1,973,466
未収配当金	22,150,224
差入委託証拠金	88,618,810
流動資産合計	18,405,193,390
資産合計	18,405,193,390
負債の部	

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	359,884
前受金	1,613,582
未払利息	4
流動負債合計	1,973,470
負債合計	1,973,470
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	10,057,036,381
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,346,183,539
元本等合計	18,403,219,920
純資産合計	18,403,219,920
負債純資産合計	18,405,193,390

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売相場の中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相場の中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>

2023年 7月10日現在	
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

2023年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,057,036,381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 1.8299円 (1万口当たり純資産額) (18,299円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	11,229,018,204円
期中追加設定元本額	346,056,039円
期中一部解約元本額	1,518,037,862円
期末元本額	10,057,036,381円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,279,705,734円
分散投資コア戦略ファンドS	6,282,702,829円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	2,494,627,818円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	562,887,161	
投資信託受益証券	3,671,136	
投資証券	8,313,332	
合計	574,871,629	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

(2023年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引					
	買建	264,927,226	-		266,540,808	1,613,582
合計		264,927,226	-		266,540,808	1,613,582

## (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。

## 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	CHENIERE ENERGY INC	2,901	152.19	441,503.19	
	WILLIAMS COS	12,975	32.73	424,671.75	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	747	71.85	53,671.95	
	NEWMONT CORPORATION	33,776	42.24	1,426,698.24	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,400	49.19	118,056.00	

LOCKHEED MARTIN CORP	1,190	458.71	545,864.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,258	452.45	569,182.10
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,307	218.74	285,893.18
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	776	112.04	86,943.04
REPUBLIC SERVICES INC	10,642	150.33	1,599,811.86
ROLLINS INC	2,885	43.16	124,516.60
WASTE CONNECTIONS INC	11,248	138.80	1,561,222.40
WASTE MANAGEMENT INC	11,695	170.01	1,988,266.95
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,211	95.26	401,139.86
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,121	118.90	371,086.90
UNITED PARCEL SERVICE B	738	179.76	132,662.88
DOMINO'S PIZZA INC	1,300	341.68	444,184.00
MCDONALD'S CORP	5,979	292.10	1,746,465.90
YUM BRANDS INC	6,150	133.45	820,717.50
ACTIVISION BLIZZARD INC	9,750	82.43	803,692.50
ELECTRONIC ARTS INC	4,888	129.20	631,529.60
AUTOZONE INC	360	2,469.51	889,023.60
GENUINE PARTS CO	1,820	165.42	301,064.40
HOME DEPOT	720	302.81	218,023.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	668	934.47	624,225.96
TJX COMPANIES INC	890	82.70	73,603.00
ULTA BEAUTY INC	270	471.63	127,340.10
DOLLAR GENERAL CORP	502	169.33	85,003.66
KROGER CO	12,140	47.17	572,643.80
WALMART INC	7,713	153.49	1,183,868.37
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,937	45.54	452,530.98
CONAGRA BRANDS INC	1,970	33.22	65,443.40
GENERAL MILLS INC	19,847	75.17	1,491,898.99
HERSHEY FOODS CORPORATION	6,338	242.98	1,540,007.24
HORMEL FOODS CORP	13,773	39.35	541,967.55
JM SMUCKER CO	3,648	147.71	538,846.08
KELLOGG CO	13,028	67.19	875,351.32
KEURIG DR PEPPER INC	34,287	31.76	1,088,955.12
KRAFT HEINZ CO/THE	5,710	35.46	202,476.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,296	72.00	93,312.00
PEPSICO INC	10,084	183.08	1,846,178.72
CHURCH & DWIGHT CO INC	6,115	98.97	605,201.55
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,064	75.59	533,967.76
KIMBERLY-CLARK CORP	3,059	135.36	414,066.24
PROCTER & GAMBLE CO	8,008	148.80	1,191,590.40
ABBOTT LABORATORIES	1,958	106.35	208,233.30
AMERISOURCEBERGEN CORP	3,562	190.86	679,843.32

BECTON DICKINSON & CO	578	256.92	148,499.76
ELEVANCE HEALTH INC	136	429.40	58,398.40
HOLOGIC INC	1,694	77.51	131,301.94
HUMANA INC	758	430.14	326,046.12
MCKESSON CORP	2,871	414.80	1,190,890.80
MOLINA HEALTHCARE INC	209	295.23	61,703.07
QUEST DIAGNOSTICS	778	139.00	108,142.00
THE CIGNA GROUP	270	277.12	74,822.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,473	461.58	1,603,067.34
ABBVIE INC	6,319	135.50	856,224.50
AMGEN	1,877	218.65	410,406.05
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4,055	85.07	344,958.85
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	17,724	62.65	1,110,408.60
ELI LILLY & CO	3,194	452.08	1,443,943.52
GILEAD SCIENCES INC	19,275	74.42	1,434,445.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,571	102.70	264,041.70
INCYTE CORP	9,666	62.07	599,968.62
JOHNSON & JOHNSON	10,703	159.25	1,704,452.75
MERCK & CO	15,273	109.00	1,664,757.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,113	94.02	292,684.26
PFIZER	23,180	35.53	823,585.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	915	692.45	633,591.75
SEAGEN INC	3,408	191.51	652,666.08
UNITED THERAPEUTICS CORP	320	211.82	67,782.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,804	338.18	610,076.72
FIRST HORIZON CORP	16,373	11.83	193,692.59
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5,897	340.90	2,010,287.30
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,421	135.84	736,388.64
CME GROUP INC	719	181.95	130,822.05
FISERV INC	1,891	125.20	236,753.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,124	163.01	346,233.24
MASTERCARD INC-CLASS A	231	388.68	89,785.08
VISA INC-CLASS A SHARES	2,497	236.45	590,415.65
ALLSTATE CORP	671	108.27	72,649.17
AON PLC	2,171	335.41	728,175.11
ASSURANT INC	1,557	125.86	195,964.02
CHUBB LTD	1,773	191.53	339,582.69
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,272	205.44	261,319.68
MARSH & MCLENNAN COS	7,834	183.99	1,441,377.66
PROGRESSIVE CORP	6,559	131.26	860,934.34
WILLIS TOWERS WATSON PLC	361	230.84	83,333.24
ACCENTURE PLC-CL A	3,767	305.76	1,151,797.92

AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	6,574	89.77	590,147.98	
BLACK KNIGHT INC	8,021	60.26	483,345.46	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,512	125.03	314,075.36	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,034	65.34	328,921.56	
GEN DIGITAL INC	28,289	18.08	511,465.12	
GODADDY INC - CLASS A	3,670	75.52	277,158.40	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,803	132.08	1,691,020.24	
MICROSOFT CORP	3,143	337.22	1,059,882.46	
ORACLE CORP	13,479	114.61	1,544,828.19	
PTC INC	1,180	137.25	161,955.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,872	476.41	1,368,249.52	
VERISIGN INC	1,372	222.45	305,201.40	
VMWARE INC-CLASS A	7,950	141.40	1,124,130.00	
AMPHENOL CORPORATION	6,113	83.62	511,169.06	
APPLE INC	729	190.68	139,005.72	
ARROW ELECTRONICS INC	2,920	143.78	419,837.60	
CISCO SYSTEMS	39,290	50.99	2,003,397.10	
F5 INC	467	143.42	66,977.14	
JUNIPER NETWORKS INC	13,438	31.08	417,653.04	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	8,283	163.77	1,356,506.91	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,677	291.87	1,656,945.99	
AT&T INC	23,108	15.61	360,715.88	
T-MOBILE US INC	9,469	138.97	1,315,906.93	
VERIZON COMMUNICATIONS	44,680	35.90	1,604,012.00	
ALLIANT ENERGY CORPORATION	2,767	52.63	145,627.21	
AMEREN CORPORATION	5,734	82.26	471,678.84	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,520	84.29	465,280.80	
CENTERPOINT ENERGY INC	2,470	29.48	72,815.60	
CMS ENERGY CORP	4,754	59.30	281,912.20	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,888	92.03	1,554,202.64	
DOMINION ENERGY INC	6,980	52.24	364,635.20	
DUKE ENERGY CORP	11,864	89.77	1,065,031.28	
EVERGY INC	1,954	58.69	114,680.26	
EVERSOURCE ENERGY	1,132	70.83	80,179.56	
SOUTHERN CO	18,010	70.68	1,272,946.80	
WEC ENERGY GROUP INC	13,363	88.98	1,189,039.74	
XCEL ENERGY INC	20,170	62.93	1,269,298.10	
ANALOG DEVICES	640	185.31	118,598.40	
TEXAS INSTRUMENTS	8,187	173.70	1,422,081.90	
アメリカドル 小計	871,492		86,609,341.66 (12,345,295,560)	
カナダドル	AGNICO EAGLE MINES	16,585	64.26	1,065,752.10



	BARRICK GOLD CORP	77,826	21.71	1,689,602.46
	FRANCO-NEVADA CORP	9,769	184.25	1,799,938.25
	KINROSS GOLD CORP	14,868	6.10	90,694.80
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	21,554	55.21	1,189,996.34
	THOMSON REUTERS CORP	8,324	172.36	1,434,724.64
	INTACT FINANCIAL CORP	5,056	199.30	1,007,660.80
	CGI INC - CL A	5,272	138.05	727,799.60
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	654	2,659.64	1,739,404.56
	BCE INC	3,705	59.54	220,595.70
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	5,954	60.20	358,430.80
	TELUS CORP	21,380	25.76	550,748.80
	HYDRO ONE LTD	15,287	37.11	567,300.57
	カナダドル 小計	206,234		12,442,649.42 (1,335,096,282)
ユーロ	ENI	12,966	13.05	169,232.23
	OCI NV	4,530	22.29	100,973.70
	SYMRISE AG	2,593	93.50	242,445.50
	KONE OYJ-B	6,436	46.31	298,051.16
	WOLTERS KLUWER	6,340	109.60	694,864.00
	GETLINK	3,640	15.73	57,275.40
	FERRARI NV	584	288.20	168,308.80
	BOLLORE SE	47,670	5.62	267,905.40
	VIVENDI SE	36,790	8.45	311,096.24
	INDITEX	5,413	34.08	184,475.04
	KONINKLIJKE AHOLD NV	13,852	31.21	432,320.92
	QIAGEN N.V.	6,986	40.76	284,749.36
	SANOFI	4,365	93.95	410,091.75
	UCB (GROUPE)	2,734	78.34	214,181.56
	DEUTSCHE BOERSE	1,328	161.20	214,073.60
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,851	69.80	129,199.80
	SAMPO OYJ-A SHS	4,966	39.96	198,441.36
	SAP SE	3,244	121.44	393,951.36
	NOKIA OYJ	15,190	3.82	58,071.37
	CELLNEX TELECOM SA	4,605	36.25	166,931.25
	DEUTSCHE TELEKOM	81,796	19.50	1,595,022.00
	ELISA A	7,288	47.71	347,710.48
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	16,008	11.66	186,733.32
	KPN (KON.)	168,965	3.23	546,432.81
	ORANGE	93,953	10.33	970,722.39
	TELEFONICA	241,013	3.63	875,118.20
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	49,127	2.38	117,020.51
	ELIA GROUP SA/NV	1,349	111.00	149,739.00

	NATURGY ENERGY GROUP SA	6,000	26.00	156,000.00
	REDEIA CORP SA	20,085	14.87	298,764.37
	ユーロ 小計	871,667		10,239,902.88 (1,600,496,820)
イギリスポンド	ENDEAVOUR MINING PLC	8,260	18.30	151,158.00
	ASTRAZENECA	2,030	101.10	205,233.00
	イギリスポンド 小計	10,290		356,391.00 (65,155,402)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	313	670.00	209,710.00
	GIVAUDAN-REG	69	2,927.00	201,963.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	695	194.60	135,247.00
	SGS SA	4,475	81.64	365,339.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2,526	261.70	661,054.20
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,400	50.10	70,140.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	87	1,663.00	144,681.00
	NESTLE SA - REGISTERED	15,215	104.66	1,592,401.90
	NOVARTIS	19,379	84.91	1,645,470.89
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,338	283.60	379,456.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	5,286	265.20	1,401,847.20
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,491	95.60	142,539.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	875	410.50	359,187.50
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	3,718	53.20	197,797.60
	SWISSCOM	1,323	551.20	729,237.60
	BKW AG	1,073	153.30	164,490.90
	SWISS PRIME SITE-REG	3,935	78.75	309,881.25
	スイスフラン 小計	63,198		8,710,445.44 (1,395,848,881)
スウェーデンクローナ	TELIA CO AB	57,949	24.30	1,408,160.70
	スウェーデンクローナ 小計	57,949		1,408,160.70 (18,545,476)
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	32,630	107.85	3,519,145.50
	ノルウェークローネ 小計	32,630		3,519,145.50 (47,191,741)
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	3,284	1,074.00	3,527,016.00
	TRYG A/S	6,044	144.40	872,753.60
	デンマーククローネ 小計	9,328		4,399,769.60 (92,307,166)
オーストラリアドル	NEWCREST MINING LIMITED	5,323	26.19	139,409.37
	WESFARMERS LTD	21,457	47.09	1,010,410.13
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	11,453	23.28	266,625.84
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,954	31.02	339,793.08

	MEDIBANK PRIVATE LTD	134,425	3.49	469,143.25
	TELSTRA GROUP LTD	206,817	4.26	881,040.42
	オーストラリアドル 小計	390,429		3,106,422.09 (295,917,768)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	11,670	8.38	97,794.60
	SPARK NEW ZEALAND LTD	59,879	5.02	300,592.58
	ニュージーランドドル 小計	71,549		398,387.18 (35,213,442)
香港ドル	MTR CORP	79,000	35.00	2,765,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	14.64	936,960.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	20,000	49.60	992,000.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	188,500	22.35	4,212,975.00
	HANG SENG BANK	38,900	106.90	4,158,410.00
	HONG KONG & CHINA GAS	479,505	6.44	3,088,012.20
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	82,000	11.54	946,280.00
	SWIRE PROPERTIES LTD	23,400	18.70	437,580.00
	香港ドル 小計	975,305		17,537,217.20 (319,352,725)
シンガポールドル	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	27,100	3.57	96,747.00
	OCBC BANK	44,400	12.05	535,020.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	43,100	9.28	399,968.00
	VENTURE CORP LTD	14,000	14.49	202,860.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	381,800	2.48	946,864.00
	シンガポールドル 小計	510,400		2,181,459.00 (230,841,991)
イスラエルシェケル	ICL LTD	35,039	21.00	735,819.00
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,528	130.90	723,615.20
	イスラエルシェケル 小計	40,567		1,459,434.20 (56,295,777)
	合 計	4,111,038		17,837,559,031 (17,837,559,031)

## (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	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	192,000	1,772,160.00	
		香港ドル 小計	192,000	1,772,160.00 (32,271,033)	
		投資信託受益証券合計	192,000	32,271,033 (32,271,033)	
投資証券	アメリカドル	PUBLIC STORAGE	530	152,157.70	
		WP CAREY INC	6,370	430,930.50	
		アメリカドル 小計	6,900	583,088.20 (83,113,392)	

香港ドル	LINK REIT	36,600	1,535,370.00	
香港ドル 小計		36,600	1,535,370.00 (27,959,087)	
投資証券合計		43,500	111,072,479 (111,072,479)	
合計			143,343,512 (143,343,512)	

(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 128銘柄	99.3%			68.7%
	投資証券 2銘柄			0.7%	0.5%
カナダドル	株式 13銘柄	100.0%			7.4%
ユーロ	株式 30銘柄	100.0%			8.9%
イギリスポンド	株式 2銘柄	100.0%			0.4%
スイスフラン	株式 17銘柄	100.0%			7.8%
スウェーデンクローナ	株式 1銘柄	100.0%			0.1%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 2銘柄	100.0%			0.5%
オーストラリアドル	株式 6銘柄	100.0%			1.6%
ニュージーランドドル	株式 2銘柄	100.0%			0.2%
香港ドル	株式 8銘柄	84.1%			1.8%
	投資信託受益証券 1銘柄		8.5%		0.2%
	投資証券 1銘柄			7.4%	0.2%
シンガポールドル	株式 5銘柄	100.0%			1.3%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%			0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	254,375,590
コール・ローン	2,437,669,499
国債証券	274,776,412,628
派生商品評価勘定	308,865
未収入金	66,496,152
未収利息	1,808,808,559
前払金	35,680,301
前払費用	160,680,196
差入委託証拠金	108,381,251
流動資産合計	279,648,813,041
資産合計	279,648,813,041
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	51,408,021
未払解約金	74,639,265
未払利息	2,032
流動負債合計	126,049,318
負債合計	126,049,318
純資産の部	
元本等	
元本	86,522,070,708
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	193,000,693,015
元本等合計	279,522,763,723
純資産合計	279,522,763,723
負債純資産合計	279,648,813,041

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

	2023年 7月10日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,522,070,708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 3.2307円 (1万口当たり純資産額) (32,307円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2023年 7月10日現在
期首	2022年 7月12日
期首元本額	100,796,020,727円
期中追加設定元本額	16,501,308,920円
期中一部解約元本額	30,775,258,939円
期末元本額	86,522,070,708円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,192,836,808円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	543,535,352円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	368,681,116円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,471,265,738円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,228,336円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,723,036,292円
世界経済インデックスファンド	17,250,707,617円
D C マイセレクション 2 5	2,015,252,244円
D C マイセレクション 5 0	1,787,096,317円
D C マイセレクション 7 5	1,347,995,700円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,266,552,081円
D C マイセレクション S 2 5	1,062,784,130円
D C マイセレクション S 5 0	950,605,510円
D C マイセレクション S 7 5	504,409,124円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	21,671,276円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	100,104,761円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	52,962,775円
D C 世界経済インデックスファンド	13,460,514,427円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	383,151,045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）	18,980,826円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	29,649,867円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	56,123,523円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	58,090,610円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	56,828,132円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	976,582,774円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	399,317,860円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,632,197,119円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	55,340,786円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	34,945,004円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	383,240,680円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	146,279,937円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	190,907,530円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	668,874,845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）	2,502,271,245円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	652,471,026円
外国債券ファンド・シリーズ 1	737,083,096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）	658,720,422円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,305,773,671円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	240,100,889円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,093,328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）	1,287,571,781円
S M T インデックスバランス・オープン	179,676,609円
S M T 世界経済インデックス・オープン	348,057,541円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	448,482,628円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	707,990,793円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	7,112,290円
グローバル経済コア	769,998,800円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	20,493,840円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	2,191,564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	56,033,114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	66,894,213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	30,381,525円

区分	2023年 7月10日現在
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	34,840,288円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	225,727,350円
10資産分散投資ファンド	26,149,273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）	11,994,922,313円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	190,869,817円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	646,577,941円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	119,265,203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）	57,309,463円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,236,733,408
合計		2,236,733,408

(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 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	2,383,396,188	-	-	2,347,715,887	35,680,301
合計		2,383,396,188	-	-	2,347,715,887	35,680,301

## (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 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,580,931,506	-	-	2,565,512,651	15,418,855
	アメリカドル	1,321,680,498	-	-	1,310,561,160	11,119,338
	カナダドル	94,536,923	-	-	93,299,322	1,237,601
	ユーロ	875,551,574	-	-	873,349,178	2,202,396
	イギリスポンド	129,589,497	-	-	129,725,236	135,739
	オフショア人民元	159,573,014	-	-	158,577,755	995,259
合計		2,580,931,506	-	-	2,565,512,651	15,418,855

## (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	3,568,271.49	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,468,464.85	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,728,953.11	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,714,355.48	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,244,992.19	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,166,562.48	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,360,624.96	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,563,793.62	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,671,669.91	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,734,375.00	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,226,558.60	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,341,653.17	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,703,574.23	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,598,046.88	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,032,333.99	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,679,205.10	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,531,902.74	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,005,830.06	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,960,451.57	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,967,826.15	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,350,390.62	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,509,326.20	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,175,136.69	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,098,124.96	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,364,878.96	
		T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,790,380.46	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,123,242.20	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,133,562.46	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,227,490.24	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,407,382.82	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,528,476.61	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,579,921.88	

T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,625,090.03	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,223,035.58	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,179,218.72	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,344,570.32	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,873,396.45	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,397,578.10	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,298,743.72	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,968,417.99	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,908,593.76	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,071,889.45	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,234,968.77	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,317,169.71	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,353,915.60	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,922,031.28	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	3,000,143.57	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,181,679.68	
T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,447,031.24	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,434,837.08	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,136,230.44	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,274,433.62	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,381,906.99	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,773,281.24	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,183,984.37	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,028,437.49	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,180,954.74	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,887,812.50	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,202,132.78	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,403,281.28	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,460,073.43	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,827,929.65	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,115,175.76	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,358,625.00	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,487,353.52	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,176,062.52	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,087,158.58	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,975,319.55	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,808,691.44	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,548,054.68	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,123,558.61	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,341,304.31	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,241,210.96	
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,986,632.80	

T 1.75% 06/30/24	3,110,000.00	3,002,141.96
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,187,701.55
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,594,531.25
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,849,378.06
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,560,859.37
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,209,175.80
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,644,609.36
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,785,342.18
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,768,437.50
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	2,097,240.22
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,941,523.42
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,536,250.00
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,014,616.98
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,353,906.23
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,638,049.96
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,809,570.30
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,130,064.46
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,994,630.85
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,035,644.55
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,822,415.25
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,911,128.12
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,157,064.83
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,852,685.54
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,056,859.37
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,751,533.22
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,149,921.86
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	6,990,486.30
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,171,765.65
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,153,144.54
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,418,996.10
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,443,746.08
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,814,163.22
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,212,754.68
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,844,918.95
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,839,648.45
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,951,439.44
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,799,023.45
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,103,713.07
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,822,618.16
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,612,429.65
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,077,729.49
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,452,568.75
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,058,187.50

T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,956,176.78
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,239,734.38
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,530,136.70
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,100,199.18
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,239,992.21
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,271,943.38
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,407,062.50
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,960,509.73
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,144,840.83
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,601,628.88
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,806,946.46
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,369,051.75
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,849,296.88
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,056,625.00
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,784,696.87
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,189,421.87
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,230,776.37
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,852,718.74
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	6,075,992.21
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,673,989.43
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,243,732.78
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,655,706.23
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,837,259.75
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,991,943.35
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,051,044.95
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,816,127.94
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,322,145.34
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,252,500.98
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,153,862.31
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,963,720.71
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,402,605.49
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	896,622.06
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,691,992.18
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	4,943,095.12
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,542,042.19
T 3.125% 08/31/27	1,850,000.00	1,756,199.22
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,700,890.62
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,915,523.44
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,595,910.17
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,833,007.82
T 3.375% 05/15/33	5,000,000.00	4,723,437.50
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,629,105.66

T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,628,080.09
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,729,062.49
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	718,340.82
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,179,640.61
T 3.625% 02/15/53	7,100,000.00	6,577,484.37
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,819,257.82
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,730,656.26
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,777,460.93
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,360,605.48
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,799,656.25
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,399,051.75
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,458,414.04
T 3.875% 11/30/29	3,500,000.00	3,420,703.12
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,302,531.24
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	814,472.66
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	817,070.31
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,045,415.03
T 3% 05/15/45	700,000.00	572,263.67
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,612,074.80
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,643,271.49
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,648,813.47
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,263,695.33
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,036,593.75
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,800,097.65
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,294,085.94
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,059,615.24
T 4.125% 11/15/32	7,550,000.00	7,568,875.00
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	916,207.02
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,809,167.98
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	748,368.35
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,037,519.53
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,953,548.82
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	1,996,883.79
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	989,400.00
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,149,332.61
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	577,188.47
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,779,820.30
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,464,066.79
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	805,883.79
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,380,410.14
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,106,515.65
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,444,585.93
T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,737,234.33

	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	442,382.81
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,352,558.59
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,102,648.43
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,751,199.22
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,546,289.06
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,174,031.25
	アメリカドル 小計	1,068,440,000.00	939,555,041.09 (133,924,175,556)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,043,282.96
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,757,741.20
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,521,125.91
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	664,944.28
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,360,133.16
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,696,861.44
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,393,264.89
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,380,119.53
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	842,091.68
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,388,562.17
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,153,279.21
	CAN 1.5% 12/01/31	3,770,000.00	3,193,360.96
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	2,019,771.89
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	723,731.34
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,384,680.01
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,224,356.99
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	221,729.82
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,101,593.35
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	298,488.01
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	819,621.23
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,520,346.00
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	937,582.72
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	405,861.73
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	537,878.58
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	377,091.67
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,334,870.52
	CAN 2% 12/01/51	3,400,000.00	2,558,491.56
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,136,806.13
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,060,739.40
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	1,994,719.73
	CAN 3% 04/01/26	760,000.00	732,023.49
	CAN 3% 10/01/25	510,000.00	492,440.87
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,104,853.79
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	789,880.37

	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,647,047.54
	CAN 5.75% 06/01/33	1,380,000.00	1,625,804.98
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	729,125.37
	カナダドル 小計	57,690,000.00	52,174,304.48 (5,598,302,870)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,304,281.00
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,349,242.04
	MBONO 5.5% 03/04/27	20,300,000.00	17,856,083.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,151,057.21
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,142,605.20
	MBONO 7.5% 05/26/33	18,500,000.00	16,825,195.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,695,969.30
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	38,035,774.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,249,183.30
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,133,238.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	30,400,000.00	29,791,088.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,670,000.00	14,089,214.70
	MBONO 8% 07/31/53	8,850,000.00	7,907,386.50
	MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,460,740.09
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	22,152,054.00
		メキシコペソ 小計	351,000,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	848,744.72
	BGB 0.35% 06/22/32	1,570,000.00	1,223,484.51
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	309,729.63
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,367,460.00
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	170,669.40
	BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,812,143.62
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,546,322.96
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,436,739.20
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,442,356.03
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	684,565.04
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,289,472.13
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	730,386.75
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	637,524.30
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	627,920.00
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	742,159.80
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	749,254.00
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	531,893.05
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,372,297.80
	BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,080,677.29
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	627,132.00
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	503,413.88	

BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	364,181.20
BGB 3.3% 06/22/54	600,000.00	563,835.48
BGB 3.45% 06/22/43	360,000.00	353,319.84
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	958,740.72
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,092,505.56
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	922,170.69
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,028,107.45
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,177,814.94
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,144,038.60
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,256,017.64
BGB 5% 03/28/35	1,590,000.00	1,836,085.89
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,757,885.40
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,367,772.51
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,609,091.99
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	793,378.25
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,423,731.12
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	549,998.93
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,711,465.65
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,757,698.51
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,101,932.00
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,411,073.68
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,148,568.95
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,313,749.60
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	665,074.68
BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,185,348.55
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,812,952.09
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,326,944.41
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,664,891.90
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,021,308.80
BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,140,723.20
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,439,530.50
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	710,981.25
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,312,602.65
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,794,577.20
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,563,682.90
BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	503,120.80
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,205,962.20
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,910,052.90
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	740,430.25
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,309,958.49
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,015,794.00
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,570,818.38
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,153,505.98



BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	958,683.60
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	980,165.00
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	447,015.29
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,601,857.70
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,560,119.00
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,371,179.52
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	331,695.29
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	637,582.62
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,149,627.32
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,616,769.42
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,874,686.00
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	691,768.77
BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,139,060.00
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,900,159.75
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,654,964.00
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,675,624.93
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	827,405.10
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	566,308.81
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,450,048.76
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,346,374.42
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	986,185.00
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,088,014.00
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,090,794.28
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,187,869.76
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	832,867.95
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,869,408.56
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,013,759.04
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,537,110.12
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	903,311.50
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,295,916.56
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,148,510.05
BTPS 3.8% 04/15/26	750,000.00	749,545.50
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,318,434.18
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,834,689.00
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,061,352.44
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	471,795.40
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	404,910.40
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	835,077.40
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,116,237.76
BTPS 4.5% 10/01/53	450,000.00	441,621.00
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,735,752.30
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,536,535.50

BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,734,261.50
BTPS 4% 04/30/35	1,150,000.00	1,109,742.41
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,240,425.05
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,828,659.60
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,911,401.78
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,546,076.00
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,187,685.58
BTPS 5% 08/01/34	3,080,000.00	3,251,094.30
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,591,487.50
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,987,814.60
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,288,318.56
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,548,260.42
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,770,135.54
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,655,210.21
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,327,965.54
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,949,488.08
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,812,158.00
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,588,081.69
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	319,543.23
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,239,690.69
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	930,583.25
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,939,071.50
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,741,756.42
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,585,468.27
DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,149,975.05
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,517,454.27
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,958,927.10
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,235,516.85
DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,709,068.22
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,308,475.72
DBR 0% 08/15/52	1,800,000.00	862,561.80
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,150,225.66
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,728,094.11
DBR 1.25% 08/15/48	3,230,000.00	2,439,719.13
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,931,029.56
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,971,125.52
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,511,921.42
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,949,990.00
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,324,280.42
DBR 2.1% 11/15/29	3,160,000.00	3,057,145.16
DBR 2.3% 02/15/33	3,130,000.00	3,043,164.41
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,698,309.70
DBR 2.5% 08/15/46	2,890,000.00	2,821,298.92

DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,970,883.83
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,790,364.96
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,267,384.00
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,564,836.84
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,551,258.62
DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,249,855.85
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,697,866.00
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,644,233.20
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,515,975.00
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,136,418.84
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,250,867.40
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,404,562.14
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,172,049.00
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,416,572.25
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,701,083.37
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	362,512.26
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	844,240.84
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,232,585.00
FRTR 0.75% 05/25/28	4,790,000.00	4,292,237.57
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,516,546.08
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,588,720.02
FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,191,323.11
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,120,328.00
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,697,515.60
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,078,655.52
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,524,025.67
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,501,537.92
FRTR 0% 11/25/29	2,930,000.00	2,421,876.92
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,208,445.09
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,267,692.00
FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,551,803.74
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,498,483.20
FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	828,630.00
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,623,277.67
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,904,279.44
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	955,619.72
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,358,116.08
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,066,591.36
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,295,649.07
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,061,240.64
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,391,448.78
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	448,401.20

FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	880,397.10
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	491,259.40
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,285,611.10
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,170,634.18
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,635,527.25
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,985,197.60
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,765,175.11
FRTR 3% 05/25/33	1,600,000.00	1,576,249.60
FRTR 3% 05/25/54	1,040,000.00	940,728.88
FRTR 4.5% 04/25/41	3,210,000.00	3,672,818.44
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,784,446.26
FRTR 4% 04/25/55	2,020,000.00	2,215,497.41
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,976,868.00
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,954,564.25
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,669,649.60
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,335,682.49
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,011,651.60
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	600,055.01
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	636,966.45
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	368,938.07
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	444,982.80
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	225,877.32
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	697,423.34
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	664,103.30
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	951,303.36
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	364,511.00
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	418,196.60
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	538,010.40
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	475,824.46
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	942,458.60
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	760,979.35
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	770,730.80
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	446,993.97
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,200,129.38
NETHER 0.25% 07/15/25	1,450,000.00	1,366,260.07
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	811,645.80
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	937,507.11
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,315,377.70
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	826,214.49
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	824,579.10
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,527,350.38
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,100,087.17
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,655,841.76

NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,371,390.75
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	621,830.40
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	793,362.89
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,104,165.00
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,248,602.30
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	389,025.60
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,494,510.00
NETHER 2.5% 07/15/33	560,000.00	539,370.72
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,796,222.72
NETHER 2% 01/15/54	630,000.00	518,380.38
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,961,342.01
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,882,003.70
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,947,590.48
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,689,707.52
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,828,065.58
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,182,148.75
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,295,015.30
OBL 0% 10/09/26	2,820,000.00	2,567,497.76
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,731,026.63
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,309,404.46
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,339,826.51
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,341,168.80
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	487,969.20
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,221,419.55
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	988,493.75
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	119,143.09
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	791,026.72
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	408,255.04
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,926,976.48
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	90,016.94
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,019,340.36
RAGB 0% 02/20/30	1,100,000.00	895,397.80
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,314,353.46
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	971,290.00
RAGB 0% 07/15/24	580,000.00	560,738.20
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	619,905.05
RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	269,218.82
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,137,883.95
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	765,558.00
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	153,064.89
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	969,273.36
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	347,600.84

RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	452,075.00
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	673,389.23
RAGB 2.9% 02/20/33	550,000.00	533,870.15
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	217,534.90
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	686,643.30
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	468,354.18
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,703,917.86
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,115,110.66
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,317,550.24
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	295,922.00
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	202,601.02
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	290,215.38
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	181,023.60
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	577,144.98
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	292,971.00
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	485,282.88
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	640,607.41
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	454,148.52
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	478,182.23
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	418,172.92
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	403,259.07
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	271,532.16
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	513,640.32
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	299,964.92
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	328,100.85
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	359,646.27
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	494,684.07
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	473,647.72
RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	269,847.01
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	542,048.76
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	450,901.20
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	586,827.87
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,698,956.60
SPGB 0.25% 07/30/24	1,650,000.00	1,591,053.75
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,269,016.75
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,021,359.40
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,028,785.74
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,735,923.20
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,202,690.48
SPGB 0.8% 07/30/29	2,200,000.00	1,887,675.49
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	991,316.64
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,159,410.80
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,438,727.90

SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,579,895.42	
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,084,342.22	
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,864,848.50	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,396,135.70	
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,710,739.32	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,478,097.15	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,981,186.13	
SPGB 1.4% 07/30/28	1,980,000.00	1,799,070.80	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,418,783.44	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,210,000.00	2,038,475.27	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	302,980.90	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,399,408.50	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,402,486.12	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,785,420.00	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,280,000.00	810,739.20	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,209,508.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,834,331.70	
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	542,063.40	
SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	959,721.20	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,526,803.02	
SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,287,385.20	
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,821,188.16	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,359,817.65	
SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,336,104.45	
SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	981,486.00	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,642,362.40	
SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,634,716.81	
SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	673,556.40	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,205,228.52	
SPGB 3.55% 10/31/33	1,240,000.00	1,226,434.40	
SPGB 3.9% 07/30/39	670,000.00	666,569.19	
SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,029,680.90	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,905,135.40	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,068,022.56	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,940,790.98	
SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,400,409.62	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,490,000.00	1,737,146.30	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,348,974.20	
SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,203,593.12	
SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,185,538.72	
□ 小計	649,590,000.00	587,801,023.40	(91,873,299,957)

イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,108,359.00
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,215,021.50
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,736,100.86
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,922,040.40
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,203,449.00
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,586,485.00
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,718,276.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	511,177.20
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,281,180.88
	UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,069,884.80
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	410,173.80
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	758,322.00
	UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,141,950.93
	UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,437,268.87
	UKT 1.125% 01/31/39	1,950,000.00	1,175,031.00
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	381,234.00
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	819,593.50
	UKT 1.25% 07/31/51	2,620,000.00	1,232,186.00
	UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,128,525.03
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,436,408.32
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	917,456.00
	UKT 1.5% 07/31/53	970,000.00	480,525.97
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	911,348.96
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	683,761.80
	UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	547,604.96
	UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	338,488.80
	UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	818,812.80
	UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,308,530.53
	UKT 1% 01/31/32	3,510,000.00	2,619,688.50
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	905,065.40
	UKT 2.75% 09/07/24	1,440,000.00	1,396,137.02
	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,213,704.64
	UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,528,955.00
	UKT 3.25% 01/31/33	2,030,000.00	1,812,781.05
	UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,629,308.20
	UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,259,174.70
	UKT 3.5% 10/22/25	590,000.00	561,931.41
	UKT 3.75% 01/29/38	900,000.00	801,369.00
	UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,127,544.00
	UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,377,016.20
UKT 4.125% 01/29/27	2,420,000.00	2,322,666.13	
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,809,603.18	
UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,465,239.00	



	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,194,473.10
	UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,111,210.97
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,357,635.00
	UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,471,012.35
	UKT 4.25% 12/07/49	1,110,000.00	1,029,030.16
	UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,672,188.96
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,370,414.34
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,736,000.64
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,469,021.04
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,397,340.00
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,139,512.50
	UKT 4% 10/22/63	460,000.00	419,267.00
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,173,121.07
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,419,241.50
	イギリスポンド 小計	92,860,000.00	73,068,849.97 (13,358,447,151)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,671,398.74
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,832,078.99
	SGB 0.75% 11/12/29	5,260,000.00	4,668,648.28
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,503,537.22
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,454,990.29
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,324,167.31
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,597,513.36
	SGB 3.5% 03/30/39	4,200,000.00	4,637,220.00
	スウェーデンクローナ 小計	44,280,000.00	41,689,554.19 (549,051,428)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,036,448.96
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,428,240.96
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,835,372.96
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,920,871.60
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,021,710.59
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,770,999.50
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,954,001.12
	NGB 2% 04/26/28	2,630,000.00	2,416,181.00
	NGB 3% 08/15/33	3,140,000.00	2,959,927.28
	ノルウェークローネ 小計	36,840,000.00	33,343,753.97 (447,139,740)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,587,747.85
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,173,067.24
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,275,438.60
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,774,466.87
	DGB 0% 11/15/31	5,640,000.00	4,467,317.35

	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,342,404.80
	DGB 4.5% 11/15/39	10,510,000.00	12,630,988.41
デンマーククローネ 小計		44,780,000.00	41,251,431.12 (865,455,024)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,903,146.00
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,267,546.00
	POLGB 0% 07/25/24	1,310,000.00	1,235,767.19
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,085,462.75
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,790,000.00	2,035,305.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,755,901.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,474,376.20
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,234,734.00
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,850,079.00
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,107,560.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,851,027.70
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,306,299.20
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	605,250.00
	POLGB 6% 10/25/33	1,400,000.00	1,425,200.00
	POLGB 7.5% 07/25/28	730,000.00	787,341.50
ポーランドズロチ 小計		44,980,000.00	39,924,995.54 (1,401,027,980)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,645,807.86
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,910,477.83
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,076,311.81
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,903,815.92
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,960,638.12
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	972,896.71
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,471,313.57
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,150,341.84
	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,607,046.73
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,355,159.17
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,070,000.00	1,859,892.71
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,180,000.00	933,598.46
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,027,407.79
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,820,255.99
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,546,426.83
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,342,471.82
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,029,495.91
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,598,882.19
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	970,979.19
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,348,116.64
ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,086,150.77	
ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,423,800.43	

	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,137,783.15
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,647,773.76
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,600,000.00	1,599,912.08
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,742,927.09
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,363,534.80
	オーストラリアドル 小計	49,130,000.00	43,533,219.17 (4,146,974,458)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	590,000.00	472,924.31
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	588,502.58
	NZGB 1.5% 05/15/31	790,000.00	620,129.49
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	282,895.86
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	809,786.95
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	491,028.34
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	346,994.97
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	423,065.50
	NZGB 3.5% 04/14/33	600,000.00	538,033.47
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	589,362.02
	NZGB 4.25% 05/15/34	320,000.00	303,276.08
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	825,178.62
	NZGB 4.5% 05/15/30	370,000.00	362,522.18
		ニュージーランドドル 小計	7,820,000.00
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	550,883.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	757,107.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	499,128.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	657,426.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	279,227.20
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	607,635.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	590,200.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	879,817.50
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	434,068.50
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	701,820.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	230,000.00	222,657.08
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	642,816.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	629,533.80
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	638,300.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	414,708.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	617,400.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	660,000.00	670,890.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	744,810.00
	SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	246,686.00
	SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	892,919.57

	シンガポールドル 小計	12,140,000.00	11,678,032.65 (1,235,769,415)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,505,355.72
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,501,533.85
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	691,654.40
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,932,821.00
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,237,134.83
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,734,094.82
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,859,509.70
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,380,057.44
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,161,380.24
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,137,655.97
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,986,650.24
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,498,571.47
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,309.00
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,705,943.29
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,288,455.68
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,974,958.59
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,288,605.31
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,538,468.09
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,777,217.57
	MGS 4.392% 04/15/26	1,910,000.00	1,954,610.91
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,144,368.27
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	921,529.05
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,127,637.52
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,048,156.64
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,436,766.64	
MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,011,218.44	
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,840,335.16	
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,128,331.01	
	マレーシアリンギット 小計	46,810,000.00	47,419,330.85 (1,450,775,459)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,934,846.15
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,032,245.73
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,258,894.30
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,210,000.00	982,485.15
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,308,483.47
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,175,201.56
	ILGOV 1% 03/31/30	1,350,000.00	1,125,944.41
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,505,747.96
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	381,959.95
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,491,865.28
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,522,210.44

	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,235,207.95
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,428,774.06
	イスラエルシェケル 小計	22,910,000.00	21,383,866.41 (824,854,847)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,724,624.26
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,265,976.70
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,410,735.78
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,207,953.20
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,969,565.68
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,313,737.03
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,640,227.05
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,659,695.60
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,070,636.00
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,153,132.41
	CGB 2.6% 09/01/32	21,800,000.00	21,583,684.92
	CGB 2.62% 04/15/28	4,100,000.00	4,140,539.98
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,021,666.00
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,616,754.54
	CGB 2.68% 05/21/30	25,830,000.00	25,898,891.19
	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000.00	64,688,225.66
	CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,166,965.56
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,532,323.40
	CGB 2.75% 06/15/29	12,640,000.00	12,767,227.92
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,131,528.80
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,408,763.06
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,215,622.00
	CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,028,278.00
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,052,917.24
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,484,986.65
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,529,874.62
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,824,585.06
	CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,392,252.00
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,251,679.90
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,211,103.36
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,513,879.64
	CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,690,957.10
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,179,079.48
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,662,674.59	
CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,404,619.30	
CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	17,780,452.37	
CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,077,821.93	
CGB 3.72% 04/12/51	7,940,000.00	8,886,764.80	

	CGB 3.81% 09/14/50	13,300,000.00	15,096,947.03	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,657,358.13	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,686,086.08	
	オフショア人民元 小計	786,620,000.00	801,000,794.02	(15,783,720,646)
	合計		274,776,412,628	(274,776,412,628)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 208銘柄	100.0%	48.7%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 359銘柄	100.0%	33.4%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 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%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 41銘柄	100.0%	5.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,863,231,597
コール・ローン	79,833,828
株式	146,874,045,514

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	461,615,033
投資証券	123,704,439
派生商品評価勘定	60,761,090
未収入金	3,767,488,206
未収配当金	1,048,486,970
前払金	110,928,905
差入委託証拠金	1,158,899,011
流動資産合計	160,548,994,593
資産合計	160,548,994,593
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,827,927
未払金	245,954
未払解約金	5,115,734,934
未払利息	66
流動負債合計	5,231,808,881
負債合計	5,231,808,881
純資産の部	
元本等	
元本	41,095,182,350
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	114,222,003,362
元本等合計	155,317,185,712
純資産合計	155,317,185,712
負債純資産合計	160,548,994,593

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2023年 7月10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)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,095,182,350口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.7794円 (37,794円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。



2023年 7月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	31,174,998,147円
期中追加設定元本額	12,637,800,831円
期中一部解約元本額	2,717,616,628円
期末元本額	41,095,182,350円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,761,120,980円
世界経済インデックスファンド	9,123,466,028円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,941,865,854円
DC世界経済インデックスファンド	7,100,760,108円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	108,509,879円
コア投資戦略ファンド（安定型）	48,466,827円
コア投資戦略ファンド（成長型）	120,923,879円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,090,054,799円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	766,684,850円
コア投資戦略ファンド（切替型）	56,957,230円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	395,161,858円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,313,518円
SMT インデックスバランス・オープン	97,044,363円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	49,003,308円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,785,120,889円
SMT 世界経済インデックス・オープン	229,100,538円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	924,633,937円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	157,523,287円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,220,230円
グローバル経済コア	405,802,572円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	164,387,778円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	49,096,565円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,025,606円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	93,179,112円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	85,265,979円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	34,340,004円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	35,366,545円
10資産分散投資ファンド	13,160,558円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,364,213,517円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	101,301,341円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	78,316,770円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,647,255円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	41,313,883円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	7,509,060,277	
投資信託受益証券	46,345,401	
投資証券	700,177	
合計	7,556,105,855	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	7,933,499,160	-	7,822,570,255	110,928,905
合計		7,933,499,160	-	7,822,570,255	110,928,905

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		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	236,395,970	-	235,254,706	1,141,264
	アメリカドル	236,395,970	-	235,254,706	1,141,264
	売建	5,242,097,970	-	5,185,094,638	57,003,332
	アメリカドル	3,601,500,000	-	3,562,952,500	38,547,500
	ブラジルレアル	5,676,459	-	5,666,559	9,900
	香港ドル	1,546,692,000	-	1,529,421,600	17,270,400
	フィリピンペソ	88,229,511	-	87,053,979	1,175,532
合計		5,478,493,940	-	5,420,349,344	55,862,068

(注)時価の算定方法

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

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	1.35	189,444.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.48	126,636.40	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,749	70.67	1,112,981.83	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	24.89	1,588,753.59	
	NIO INC - ADR	201,974	9.99	2,017,720.26	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	39.16	1,181,026.44	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	6.18	489,876.24	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	55.59	3,694,066.68	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	29.55	362,962.65	
	IQIYI INC-ADR	59,454	5.16	306,782.64	
	JOYY INC	6,185	32.02	198,043.70	
	KANZHUN LTD	38,815	14.80	574,462.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	7.25	823,215.75	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	13.34	70,021.66	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	16.97	182,020.22	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	70.00	5,668,180.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	16.13	881,923.88	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,037	68.89	553,668.93	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.13	456,407.00	
	CREDICORP LTD	10,882	151.71	1,650,908.22	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.48	168,916.84	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	18.22	378,119.66	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.62	370,058.04	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	39.23	307,367.05		
KE HOLDINGS INC	92,870	14.31	1,328,969.70		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.61	94,355.40		
アメリカドル 小計		2,059,883		24,776,889.38 (3,531,697,812)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,214,261	11.54	25,552,571.94	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	83.26	40,705,147.92	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	232.92	8,152,200.00	

	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	37.78	6,745,694.56	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	10.30	3,229,050.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	123.34	12,580,680.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	488.16	16,389,972.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	319.58	19,168,408.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	170.72	7,287,183.20	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	590,690	16.97	10,024,009.30	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	68.79	56,908,591.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	175.67	14,382,981.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	190.37	59,612,461.80	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	279.04	7,243,878.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	88.62	16,111,116.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.56	7,010,208.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	51.95	7,413,265.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	147.48	60,806,004.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	41.10	11,166,870.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,969,540	18.56	92,234,662.40	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.18	3,577,398.00	
	メキシコペソ 小計	11,688,330		486,302,353.37 (4,044,771,193)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	18.96	3,073,416.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	594,100	33.13	19,682,533.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	29.50	21,477,180.00	
	PRIO SA	130,000	39.35	5,115,500.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	19.30	1,459,080.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.72	1,264,368.00	
	GERDAU SA-PREF	155,590	26.14	4,067,122.60	
	SUZANO SA	121,779	44.51	5,420,383.29	
	VALE SA	525,387	65.46	34,391,833.02	
	WEG SA	255,844	37.00	9,466,228.00	
	CCR SA	248,600	13.78	3,425,708.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	93,140	70.14	6,532,839.60	
	RUMO SA	244,300	22.72	5,550,496.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	20.42	4,419,847.74	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.18	971,490.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.31	3,167,630.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.63	1,542,138.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	28.49	5,392,587.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	14.00	2,125,200.00	
	AMBEV SA	756,200	14.85	11,229,570.00	
	JBS SA	110,000	17.75	1,952,500.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	16.73	1,678,152.84	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.37	4,567,322.98	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	31.64	3,027,948.00	
	HYPERA SA	54,500	45.74	2,492,830.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	14.50	4,727,333.50	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	16.28	13,482,802.96	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	49.96	7,818,740.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	29.14	22,737,388.34	
	ITAUSA SA	774,657	9.74	7,545,159.18	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	14.36	12,743,193.24	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	31.32	3,410,748.00	
	TOTVS SA	57,900	30.50	1,765,950.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	42.11	3,764,634.00	
	TIM SA	96,100	14.19	1,363,659.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	43.85	1,622,450.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	39.52	8,366,384.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.60	2,669,020.20	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	56.00	2,828,000.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	35.70	971,040.00	
	ENEVA SA	102,200	12.49	1,276,478.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	44.70	2,067,375.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	32.97	5,443,347.00	
	ブラジルリアル 小計	11,721,498		268,097,606.69 (7,841,157,941)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	5,995.00	542,085,885.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,580.20	214,851,893.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	63,621.00	1,352,009,871.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	55.55	136,718,993.40	
	FALABELLA SA	70,837	1,985.50	140,646,863.50	
	CENCOSUD SA	306,432	1,630.00	499,484,160.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,670.00	49,257,950.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	84.20	638,505,692.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	25,451.00	157,618,043.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	37.99	438,790,920.31	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	108.49	378,772,764.35	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	52.55	134,595,158.90	
	チリペソ 小計	28,285,639		4,683,338,195.06 (825,546,073)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	27,002	30,400.00	820,860,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	27,730.00	1,707,197,450.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	16,980.00	857,676,780.00	
	コロンビアペソ 小計	139,078		3,385,735,030.00 (115,832,766)	

ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	22.28	115,878.28	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	30.96	628,333.20	
	OPAP SA	20,586	15.59	320,935.74	
	JUMBO SA	19,341	25.78	498,610.98	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.51	398,402.34	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.54	662,233.05	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	5.95	438,158.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.74	386,291.18	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	10.28	574,569.76	
	TERNA ENERGY SA	13,651	19.19	261,962.69	
ユーロ 小計		926,142		4,285,375.22	(669,804,146)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	90.80	12,947,172.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	39.00	10,095,852.00	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	31.84	4,236,853.28	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	27.04	453,812.32	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	58.10	6,857,194.40	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	59.05	5,879,372.30	
	KOC HOLDING AS	89,884	109.30	9,824,321.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	46.56	13,909,706.88	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	682.60	4,901,750.60	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	215.20	18,639,548.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	841.00	13,767,170.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	259.00	8,185,177.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	181.20	14,718,513.60	
	AKBANK T.A.S.	586,183	20.26	11,876,067.58	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	46.70	9,871,072.40	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	13.91	5,347,880.33	
YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	12.96	4,809,805.92		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	39.96	5,717,916.36		
トルコリラ 小計		3,076,763		162,039,186.17	(886,759,446)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	665.50	8,853,146.50	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	79.90	4,850,729.00	
	CEZ AS	25,283	905.00	22,881,115.00	
チェココルナ 小計		99,296		36,584,990.50	(239,686,565)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	3,004.00	133,747,092.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,300.00	238,550,300.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	11,800.00	472,247,800.00	
ハンガリーフォリント 小計		113,285		844,545,192.00	(343,339,713)

ポーランドズロチ	ORLEN SA	102,979	64.80	6,673,039.20
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	112.15	2,263,859.90
	LPP SA	124	13,430.00	1,665,320.00
	CD PROJEKT SA	6,704	145.00	972,080.00
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	16.06	579,914.37
	ALLEGRO.EU SA	83,795	32.00	2,681,440.00
	PEPCO GROUP NV	22,887	35.84	820,270.08
	DINO POLSKA SA	9,471	456.20	4,320,670.20
	BANK PEKAO SA	27,684	106.10	2,937,272.40
	M BANK SA	1,423	418.20	595,098.60
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	36.65	4,775,385.05
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	381.00	2,797,683.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	38.51	3,332,231.79
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	7.12	710,775.60
ポーランドズロチ 小計		635,320		35,125,040.19 (1,232,590,347)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,220	0.00	-
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
ロシアルーブル 小計		760,525,356		76.00 (118)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	5.77	1,898,330.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	8.59	2,078,780.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.48	17,334,912.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	455,500	23.50	10,704,250.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	8.57	188,540.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.39	17,345,020.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	11.96	5,130,840.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.51	1,193,400.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	20.10	4,773,750.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	6.43	3,571,865.00

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.59	3,341,520.00
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.03	872,640.00
CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.20	3,402,000.00
DONGYUE GROUP	147,000	6.04	887,880.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	50.50	2,729,020.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	11.84	2,770,560.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.90	1,783,600.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	14.38	1,366,100.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.08	1,824,480.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.46	10,371,300.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.78	1,039,500.00
BOC AVIATION LTD	23,800	63.30	1,506,540.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.52	689,920.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	9.42	2,289,060.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	4.89	625,920.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	5.09	3,593,540.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.84	3,907,280.00
CITIC LTD	1,038,000	8.50	8,823,000.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	4.16	3,893,760.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.37	1,546,560.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.46	1,361,880.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	10.12	1,619,200.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	408,800	11.48	4,693,024.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	30.10	1,875,230.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.03	1,166,774.22
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.95	1,273,300.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.07	1,257,360.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.54	1,744,865.38
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.61	2,756,780.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	7.81	4,045,970.50
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.51	1,130,990.74
JD LOGISTICS INC	326,200	11.82	3,855,684.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.82	2,196,040.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	113.60	1,988,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.90	982,470.30
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.88	1,822,800.00
BYD CO LTD-H	158,000	254.60	40,226,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.62	962,920.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	31.05	1,813,320.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.64	9,138,720.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.19	4,537,562.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.76	1,705,717.44



LI AUTO INC-CLASS A	171,642	137.20	23,549,282.40
MINTH GROUP LTD	176,000	21.45	3,775,200.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	54.60	9,127,045.20
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	17.06	3,992,040.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	77.30	15,367,240.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.28	1,436,640.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	23.30	7,236,980.00
LI NING CO LTD	380,000	39.00	14,820,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	75.10	9,169,710.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.28	1,201,200.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	28.20	1,240,800.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	16.78	3,926,520.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	235,000	12.24	2,876,400.00
MEITUAN-CLASS B	787,350	119.10	93,773,385.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	30.80	7,530,600.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	16.30	2,718,840.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.30	1,050,700.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	262.40	23,001,196.80
BAIDU INC-CLASS A	351,450	137.40	48,289,230.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	115.20	3,064,320.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	32.15	1,658,940.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.99	2,523,320.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	30.50	5,221,600.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	52.50	19,551,000.00
NETEASE INC	313,630	147.60	46,291,788.00
TENCENT HOLDINGS LTD	968,500	326.60	316,312,100.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,575,888	84.30	217,147,358.40
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	10.26	1,067,040.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	103.70	933,300.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	13.60	3,427,200.00
JD.COM INC - CL A	360,461	134.70	48,554,096.70
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	17.38	1,122,748.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.38	2,615,800.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	29.35	2,700,200.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.67	3,661,280.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	49.45	9,566,102.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	18.32	983,784.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	134.40	2,042,880.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.46	2,515,440.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	458,000	28.00	12,824,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	47.70	11,734,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.48	856,080.00

HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.10	11,897,460.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	7.52	1,466,400.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	11.52	4,792,320.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	68.20	7,911,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.34	507,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	556,000	5.19	2,885,640.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	16.08	771,840.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	30.55	2,673,125.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	18.78	469,500.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	43.65	3,291,210.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	13.40	884,400.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	10.42	4,159,664.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.88	1,910,592.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	23.85	4,560,120.00
3SBIO INC	445,500	7.29	3,247,695.00
AKESO INC	61,000	35.95	2,192,950.00
BEIGENE LTD	110,905	115.70	12,831,708.50
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.86	2,929,420.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.50	9,023,040.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	6.23	2,111,970.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.37	1,637,820.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	16.50	2,178,000.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	43.15	220,065.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	12.56	1,532,320.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	30.25	6,140,750.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	23.40	782,730.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	20.30	1,481,900.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.42	6,740,820.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	63,688	62.05	3,951,840.40
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	567,000	37.80	21,432,600.00
ZAI LAB LTD	128,250	22.80	2,924,100.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	2.85	11,214,750.00
BANK OF CHINA LTD-H	12,394,200	2.76	34,207,992.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.45	6,103,063.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.56	5,572,112.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	14,601,620	4.37	63,809,079.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.18	817,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	32.55	20,243,593.65
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.86	1,928,784.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	3.61	31,509,939.15
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	4.33	4,654,750.00

CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.78	648,960.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.12	1,989,960.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	13.62	4,783,344.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	13.68	3,909,402.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.92	1,420,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.56	935,616.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	4.79	1,710,988.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.59	2,550,940.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,109,000	12.10	13,418,900.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	20.00	7,732,000.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	7.93	1,459,310.32
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	19.58	2,063,732.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.80	5,258,400.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	8.46	10,129,056.48
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	48.90	49,095,600.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	21.85	2,536,785.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	4.96	1,368,960.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	9.96	1,261,932.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	10.50	5,176,500.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	18.30	1,308,450.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	24.60	3,948,300.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	21.45	1,437,150.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.61	525,090.00
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	8.39	9,967,320.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	74.20	8,866,900.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	10.80	25,965,360.00
ZTE CORP-H	82,908	30.30	2,512,112.40
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.87	6,161,340.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.90	1,660,050.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.84	1,122,400.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.89	2,698,920.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	8.38	3,908,432.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	7.78	3,516,560.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.93	1,951,380.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,800	24.75	2,643,300.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	17.40	4,478,760.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	84.80	9,921,600.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.62	2,952,520.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.77	3,358,080.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.93	3,249,640.00
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	24.10	1,542,400.00

	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.64	5,164,360.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	25.95	2,335,500.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	19.56	841,080.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	8.23	7,373,973.01	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	18.24	1,668,120.96	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.12	701,008.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	16.60	9,703,364.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	7.97	1,793,250.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.70	17,153,218.70	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	37.50	4,462,500.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	10.10	3,186,550.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,852,654	1.50	2,778,981.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	9.47	3,229,270.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	7.48	542,300.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	3.61	649,800.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	17.12	5,880,720.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	8.55	2,741,130.00	
	香港ドル 小計	130,804,683		1,805,636,852.80 (32,880,647,089)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.11	872,839.48	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.86	1,932,424.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.02	2,506,728.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.79	3,628,904.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.38	698,610.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.05	689,509.30	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	6.84	733,802.04	
	MISC BHD	217,540	6.99	1,520,604.60	
	GENTING BHD	271,600	4.09	1,110,844.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.46	909,462.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.52	461,244.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.75	1,013,775.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	22.54	2,575,104.84	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	130.60	940,320.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.88	1,166,862.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.32	663,936.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.28	1,057,356.88	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.79	1,327,647.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.85	429,165.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.60	1,082,520.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	5.16	4,747,210.32	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	18.86	2,287,567.12	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.22	286,420.26	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	8.67	7,642,648.35	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,122,900	3.85	8,173,165.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.40	1,184,473.80	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.57	1,390,598.73	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.05	2,016,900.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.95	1,058,205.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	4.79	1,300,734.08	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	16.88	2,504,992.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.05	3,998,063.75	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.70	741,690.00	
	マレーシアリングット 小計	12,038,592		62,654,326.95 (1,916,884,071)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	8.95	15,333,140.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	150.50	30,220,400.00	
	PTT PCL-NVDR	1,377,500	33.75	46,490,625.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	44.25	12,992,021.25	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	33.25	6,862,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	38.50	18,716,159.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	35.00	7,094,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	322.00	41,988,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	71.25	46,661,625.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.30	6,781,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.50	6,071,250.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.60	3,727,380.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.00	11,970,354.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	38.75	7,060,250.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.80	11,593,863.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	20.70	16,402,680.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	34.50	6,127,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	62.75	60,014,100.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	33.25	7,910,507.50	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	64.25	2,974,775.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	19.40	10,794,160.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	27.75	8,133,525.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	26.75	50,506,675.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	220.00	18,194,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	129.50	10,774,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.20	8,422,080.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,200	108.50	8,810,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	46.00	4,669,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	37.00	3,322,600.00	

	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	46.50	3,547,950.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	98.75	48,980,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	214.00	43,613,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	72.75	8,864,587.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.45	13,000,736.10	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	34.00	10,914,000.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	128.00	9,113,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	54.00	11,874,600.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	52.00	3,546,400.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	45.50	18,331,950.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	35.25	12,550,762.50	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	65.50	24,785,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.40	7,324,800.00	
	タイパーツ 小計	20,515,990		707,067,955.85 (2,870,695,900)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	54.00	12,848,760.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	605.00	32,918,050.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	44.95	26,346,228.85	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	910.50	33,037,492.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	198.40	30,380,992.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	240.20	14,654,602.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	137.50	13,139,500.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	105.90	24,865,531.80	
	BDO UNIBANK INC	394,773	135.90	53,649,650.70	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	54.70	8,822,398.90	
	PLDT INC	10,460	1,300.00	13,598,000.00	
	ACEN CORP	821,840	5.20	4,273,568.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	328.00	17,443,040.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	24.00	30,741,600.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	31.90	49,551,865.00	
	フィリピンペソ 小計	5,735,050		366,271,279.75 (938,496,900)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,380.00	5,146,274,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,750.00	4,771,375,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,975.00	1,946,955,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	760.00	2,198,078,840.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,850.00	2,161,170,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,330.00	5,405,579,010.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,325.00	1,924,065,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,425.00	2,537,258,200.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,825.00	22,367,572,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	108.00	14,541,109,632.00	

	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,680.00	5,731,716,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	5,375.00	5,123,987,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,275.00	6,758,235,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,275.00	3,121,702,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,240.00	4,907,376,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,990.00	8,335,115,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,025.00	78,420,932,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,150.00	31,424,228,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	9,075.00	11,727,622,500.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,375.00	58,912,160,750.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,100.00	3,124,660,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	3,960.00	28,907,208,000.00	
	インドネシアルピア 小計	193,375,608		309,494,381,732.00 (2,940,196,626)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	57,800.00	299,404,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	63,400.00	404,935,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	166,000.00	1,531,184,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	41,000.00	749,316,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	32,950.00	368,677,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	444,500.00	535,178,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	121,700.00	230,986,600.00	
	LG CHEM LTD	8,087	656,000.00	5,305,072,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	367,000.00	321,859,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	151,200.00	350,179,200.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	398,500.00	1,896,063,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	400,000.00	4,714,000,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	92,600.00	216,498,800.00	
	SKC CO LTD	1,432	104,300.00	149,357,600.00	
	CJ CORP	1,230	60,600.00	74,538,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	59,600.00	256,756,800.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	17,400.00	1,426,852,200.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	280,000.00	2,304,960,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	35,100.00	231,414,300.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	131,500.00	766,119,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	136,000.00	287,640,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	120,400.00	754,787,600.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	34,650.00	338,461,200.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	87,000.00	250,821,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	54,000.00	724,464,000.00	
	LG CORP	16,658	82,800.00	1,379,282,400.00	
	LG ENERGY SOLUTION	5,668	562,000.00	3,185,416,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	13,780	45,050.00	620,789,000.00	

SAMSUNG C&T CORP	11,910	100,100.00	1,192,191,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	28,700.00	531,409,200.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	7,100.00	675,699,900.00
SK INC	6,394	140,200.00	896,438,800.00
SK SQUARE CO LTD	11,660	44,250.00	515,955,000.00
HMM CO LTD	35,545	18,500.00	657,582,500.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	195,600.00	546,310,800.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	25,050.00	671,891,100.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,855.00	144,368,280.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	7,066	36,650.00	258,968,900.00
HANON SYSTEMS	19,000	9,020.00	171,380,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	232,500.00	2,359,410,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	20,743	204,000.00	4,231,572,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	109,800.00	663,411,600.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	108,100.00	372,836,900.00
KIA CORP	39,244	87,900.00	3,449,547,600.00
COWAY CO LTD	9,036	42,700.00	385,837,200.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	112,400.00	339,110,800.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	123,000.00	2,122,242,000.00
KANGWON LAND INC	28,528	16,520.00	471,282,560.00
HYBE CO LTD	2,474	286,000.00	707,564,000.00
KAKAO CORP	52,020	49,850.00	2,593,197,000.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	29,400.00	88,817,400.00
KRAFTON INC	3,793	174,500.00	661,878,500.00
NAVER CORP	21,578	195,000.00	4,207,710,000.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	279,500.00	757,165,500.00
NETMARBLE CORP	2,465	44,900.00	110,678,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	50,100.00	230,710,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	73,500.00	320,680,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	166,800.00	272,217,600.00
EMART	3,594	75,200.00	270,268,800.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	264,000.00	485,496,000.00
KT&G CORP	13,993	81,300.00	1,137,630,900.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	122,400.00	384,580,800.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	94,700.00	356,261,400.00
LG H&H CO LTD	1,321	432,000.00	570,672,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	61,500.00	944,640,000.00
HLB INC	22,765	30,750.00	700,023,750.00
CELLTRION INC	17,544	148,600.00	2,607,038,400.00
CELLTRION PHARM INC	2,066	69,900.00	144,413,400.00
HANMI PHARM CO LTD	1,179	279,500.00	329,530,500.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	719,000.00	1,923,325,000.00



	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	75,400.00	241,053,800.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	73,500.00	154,350,000.00	
	YUHAN CORPORATION	13,195	56,700.00	748,156,500.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	51,249	37,700.00	1,932,087,300.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,100.00	286,133,000.00	
	KAKAObANK CORP	35,459	22,850.00	810,238,150.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	46,500.00	3,003,853,500.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	32,500.00	2,202,785,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	11,360.00	875,333,440.00	
	KAKAOPAY CORP	3,065	45,800.00	140,377,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	48,250.00	222,046,500.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	41,150.00	698,521,250.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,950.00	215,554,250.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,320.00	112,837,240.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	34,800.00	554,955,600.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	72,200.00	727,342,800.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	222,000.00	918,858,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	66,400.00	805,498,400.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	115,200.00	839,116,800.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,780	200,000.00	756,000,000.00	
	L&F CO LTD	4,327	238,000.00	1,029,826,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	14,910.00	571,067,910.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	299,000.00	806,104,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	54,700.00	118,480,200.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	140,400.00	1,296,313,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	743,174	69,900.00	51,947,862,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	125,351	58,300.00	7,307,963,300.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	697,000.00	6,149,631,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	10,190.00	225,453,750.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,490.00	862,237,600.00	
	SK HYNIX INC	83,801	111,800.00	9,368,951,800.00	
	韓国ウォン 小計	2,401,989		166,065,949,530.00 (18,184,221,473)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	111,240	79.90	8,888,076.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	43.95	19,961,035.20	
	CHINA STEEL	1,779,261	28.65	50,975,827.65	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	63.70	34,529,285.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	82.00	49,021,568.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	68.70	52,950,662.40	
	TAIWAN CEMENT	913,419	37.30	34,070,528.70	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	977.00	18,130,189.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	32.05	11,602,997.40	

VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,870.00	16,830,000.00
WALSIN LIHWA CORP	502,213	41.20	20,691,175.60
CHINA AIRLINES LTD	465,000	26.25	12,206,250.00
EVA AIRWAYS CORP	386,000	39.80	15,362,800.00
EVERGREEN MARINE	183,215	108.00	19,787,220.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	31.05	14,655,600.00
WAN HAI LINES LIMITED	74,635	56.70	4,231,804.50
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	50.60	10,980,200.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	38.75	6,861,113.75
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	495.00	19,768,815.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	194.50	13,702,136.00
GIANT MANUFACTURING	35,713	232.00	8,285,416.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	335.00	10,385,000.00
POU CHEN	273,780	30.95	8,473,491.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	53,000	769.00	40,757,000.00
MOMO.COM INC	6,000	670.00	4,020,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	283.00	25,057,952.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	73.20	56,832,114.00
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	353.00	8,825,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	18.30	10,861,782.00
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	24.60	64,974,430.20
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,929,455	25.55	49,297,575.25
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,605,202	27.20	43,661,494.40
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	21.40	32,492,925.40
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,671,622	37.30	62,351,500.60
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,756,318	17.15	30,120,853.70
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,920,011	18.25	35,040,200.75
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	14.05	10,959,000.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,442,787	27.65	39,893,060.55
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	43.35	29,910,849.75
CHAILEASE HOLDING CO LTD	216,375	201.00	43,491,375.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,412,633	22.65	31,996,137.45
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	42.25	64,687,158.25
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	11.90	30,657,089.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,110,906	60.00	66,654,360.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.62	16,652,684.92
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	351.00	24,570,000.00
ACER INC	617,803	31.30	19,337,233.90
ADVANTECH CO LTD	76,261	374.50	28,559,744.50
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	293.00	37,237,956.00
AUO CORP	1,268,072	18.40	23,332,524.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	172.50	20,475,750.00

	CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	15.35	21,337,728.00	
	COMPAL ELECTRONICS	805,760	29.20	23,528,192.00	
	DELTA ELECTRONICS INC	302,903	348.00	105,410,244.00	
	E INK HOLDINGS INC	144,000	212.50	30,600,000.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	105.50	204,485,164.00	
	INVENTEC CO LTD	280,511	44.60	12,510,790.60	
	LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,340.00	35,193,600.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	111.00	39,233,172.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	173.00	17,300,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	246.50	5,176,500.00	
	PEGATRON CORP	340,474	70.50	24,003,417.00	
	QUANTA COMPUTER INC	408,270	160.50	65,527,335.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	55.80	11,277,180.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	170.00	35,870,000.00	
	WISTRON CORP	344,000	106.00	36,464,000.00	
	WIWYNN CORP	16,000	1,505.00	24,080,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	56.10	14,624,821.20	
	YAGEO CORPORATION	42,588	491.50	20,932,002.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	105.00	14,481,810.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	114.50	66,904,067.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	69.70	15,055,200.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	93.50	22,926,200.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	109.00	56,060,335.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,095.00	25,140,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,600.00	20,800,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	491.00	20,622,000.00	
	MEDIATEK INC	241,804	682.00	164,910,328.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	69.10	17,896,900.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	435.50	41,827,597.50	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,010.00	8,080,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	30.15	17,366,400.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	383.00	23,724,552.00	
	SILERGY CORP	53,000	367.50	19,477,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,828,389	565.00	2,163,039,785.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	48.35	82,243,350.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	80.50	15,134,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	167.50	5,360,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	26.40	9,213,600.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	35.40	10,977,044.40	
	新台湾ドル 小計	53,685,906		4,963,853,759.92 (22,587,520,149)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	391.75	36,648,212.50	

COAL INDIA LTD	181,265	234.00	42,416,010.00
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	305.80	18,172,165.00
INDIAN OIL CORP LTD	597,036	99.25	59,255,823.00
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	163.50	88,250,433.00
PETRONET LNG LTD	83,779	229.80	19,252,414.20
RELIANCE INDUSTRIES LTD	471,182	2,635.45	1,241,776,601.90
ACC LTD	14,288	1,789.65	25,570,519.20
AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	417.85	30,725,764.05
ASIAN PAINTS LTD	56,921	3,344.05	190,346,670.05
BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	673.60	19,836,846.40
GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,744.85	81,734,008.55
HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	422.35	75,875,177.50
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	610.75	42,614,470.50
JSW STEEL LTD	99,332	788.75	78,348,115.00
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,760.60	48,124,398.20
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,612.40	76,177,584.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	23,896.95	33,145,069.65
SRF LTD	19,164	2,223.65	42,614,028.60
TATA STEEL LTD	1,137,948	111.60	126,994,996.80
ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	8,337.70	139,156,213.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	663.05	46,182,095.55
VEDANTA LTD	107,173	280.60	30,072,743.80
ABB LTD INDIA	5,256	4,397.10	23,111,157.60
ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	2,379.00	54,721,758.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	123.95	62,892,849.75
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	386.30	27,197,837.80
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,284.25	45,804,060.50
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	10,646	3,758.95	40,017,781.70
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,448.50	263,434,115.00
SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,686.90	40,648,072.50
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	630.30	14,492,487.90
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	718.75	75,168,312.50
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	671.75	17,771,146.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,630.05	69,567,452.55
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,829.10	46,571,840.40
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,382.00	21,035,442.00
BHARAT FORGE LTD	30,322	842.45	25,544,768.90
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,184.45	56,912,490.40
HERO MOTOCORP LTD	13,719	3,147.45	43,179,866.55
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,563.80	234,745,145.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,850.50	210,101,314.50
MRF LTD	432	101,187.70	43,713,086.40

SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	91.35	47,614,817.25
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	535.35	31,740,366.15
TATA MOTORS LTD	277,381	618.45	171,546,279.45
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,184.55	67,359,601.60
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,322.05	54,539,850.70
PAGE INDUSTRIES LTD	886	36,588.05	32,417,012.30
TITAN CO LTD	56,531	3,144.75	177,775,862.25
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	382.30	62,887,203.10
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	493.20	21,666,276.00
ZOMATO LTD	842,242	73.22	61,668,959.24
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,403.05	63,210,185.80
TRENT LTD	37,950	1,702.10	64,594,695.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,810.05	108,936,949.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	5,056.80	76,332,396.00
ITC LTD	480,447	468.35	225,017,352.45
MARICO LTD	81,711	516.05	42,166,961.55
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	22,882.20	117,751,801.20
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	833.25	77,691,396.75
UNITED SPIRITS LTD	32,483	914.90	29,718,696.70
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	820.90	65,965,882.20
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,765.50	45,903,000.00
DABUR INDIA LTD	79,726	572.25	45,623,203.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,062.60	67,364,589.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,696.35	349,182,717.70
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	5,152.90	75,036,529.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	609.65	73,274,443.15
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	743.70	26,338,135.50
CIPLA LTD	88,546	1,020.75	90,383,329.50
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,670.25	80,495,923.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,182.30	94,944,918.30
LUPIN LTD	26,552	901.10	23,926,007.20
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,035.50	150,309,038.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,902.00	23,242,440.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	761.05	22,933,480.70
AXIS BANK LTD	359,795	978.70	352,131,366.50
BANDHAN BANK LTD	74,811	230.45	17,240,194.95
BANK OF BARODA	248,313	208.90	51,872,585.70
ICICI BANK LTD	812,223	947.15	769,297,014.45
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,853.55	311,607,704.70
STATE BANK OF INDIA	268,868	593.75	159,640,375.00
YES BANK LTD	2,352,478	17.45	41,050,741.10
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	7,621.35	336,650,272.20

	BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,614.45	88,794,750.00
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	7,149.25	21,412,003.75
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,177.25	64,527,427.00
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	274,646	2,768.60	760,384,915.60
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,267.95	15,751,742.85
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	836.60	50,777,437.00
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,718.10	66,292,888.50
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	658.30	92,247,579.00
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,335.80	44,924,289.80
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	572.45	25,941,144.20
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,293.45	94,080,379.20
	HCL TECHNOLOGIES LTD	139,039	1,157.05	160,875,074.95
	INFOSYS LTD	513,793	1,331.15	683,935,551.95
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,116.55	80,324,718.45
	MPHASIS LTD	19,317	1,879.45	36,305,335.65
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,325.70	476,177,051.70
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,544.70	31,529,301.30
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,155.25	109,514,234.25
	WIPRO LTD	182,000	395.95	72,062,900.00
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	871.10	312,703,122.50
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	950.90	40,489,322.00
	ADANI POWER LTD	85,623	243.85	20,879,168.55
	GAIL INDIA LTD	504,548	110.50	55,752,554.00
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	495.10	13,231,052.40
	NTPC LTD	664,141	192.55	127,880,349.55
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	600,735	255.60	153,547,866.00
	TATA POWER CO LTD	199,512	227.85	45,458,809.20
	DLF LTD	87,983	502.85	44,242,251.55
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,579.70	20,100,102.80
	インドルピー 小計	17,718,213		12,629,115,226.79 (21,974,660,494)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.66	998,167.24
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.16	1,958,304.37
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.91	851,448.15
	INDUSTRIES QATAR	282,919	11.73	3,318,639.87
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.81	3,092,164.22
	DUKHAN BANK	319,751	3.97	1,269,411.47
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.53	2,896,617.93
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	9.92	2,129,883.62
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	17.90	4,646,213.50
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.17	11,986,853.34
	OORED00 QSC	72,800	11.70	851,760.00

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.30	1,669,657.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.57	535,116.71	
	カタールリアル 小計	4,842,933		36,204,238.02	(1,418,482,045)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	165.17	5,651,621.89	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	191.82	2,813,999.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	823.20	8,224,591.20	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	381.97	25,761,202.71	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	252.36	36,390,312.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	75.44	7,533,513.84	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	120.94	18,243,436.18	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	429.00	2,304,588.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	122.52	5,889,413.88	
	SASOL LTD	88,115	236.22	20,814,525.30	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	29.05	11,472,542.20	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	263.04	13,231,701.12	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	88.00	3,566,552.00	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	145.13	4,137,656.30	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,209.47	98,180,896.77	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	16.38	7,789,967.64	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	94.00	3,530,076.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	73.55	12,968,041.80	
	BID CORP LTD	58,066	413.90	24,033,517.40	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	253.37	8,974,872.14	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	219.99	18,748,427.76	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	178.96	10,054,330.72	
	ABSA GROUP LTD	140,135	169.90	23,808,936.50	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,536.36	22,430,856.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	224.23	14,151,379.53	
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	178.00	36,244,182.00	
	FIRSTRAND LTD	816,636	68.32	55,792,571.52	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	408.99	7,029,311.13	
	REMGRO LTD	74,679	150.44	11,234,708.76	
	DISCOVERY LIMITED	58,396	146.06	8,529,319.76	
OLD MUTUAL LTD	974,656	12.06	11,754,351.36		
OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	34.86	2,514,556.38		
SANLAM LTD	307,490	59.86	18,406,351.40		
MTN GROUP LTD	255,377	133.93	34,202,641.61		
VODACOM GROUP	79,334	114.54	9,086,916.36		
NEPI ROCKCASTLE N.V.	63,952	110.00	7,034,720.00		
	南アフリカランド 小計	5,273,289		612,536,588.56	(4,624,651,243)

アラブ首長国連邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.32	1,725,224.72	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.95	1,704,211.70	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.96	1,758,327.12	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.11	3,823,297.30	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.76	1,999,003.56	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.50	2,888,292.00	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	15.95	4,310,647.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.74	9,948,021.06	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	22.10	12,343,645.60	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.18	3,759,804.58	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.88	7,627,635.84	
アラブ首長国連邦ディルハム 小計		5,964,783		51,888,110.48	(2,016,890,854)
クウェートディナール	AGILITY	323,386	0.63	205,350.11	
	BOUBAYAN BANK K.S.C	162,047	0.65	106,140.78	
	GULF BANK	144,000	0.26	38,736.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.76	993,009.40	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,101,927	0.95	1,054,544.13	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.52	157,023.07	
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.88	125,231.47	
クウェートディナール 小計		3,462,996		2,680,034.96	(1,247,181,068)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.13	899,271.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	28.70	2,554,300.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	14.04	898,560.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.86	613,970.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.73	773,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	19.13	1,840,306.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	8.16	1,940,382.72	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	9.05	720,380.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	17.27	170,973.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	25.21	705,880.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	33.09	684,963.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	6.06	995,658.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	23.44	690,073.60	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	5.71	2,109,845.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	34.30	717,899.00	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	30.71	632,626.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	13.44	1,239,168.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	25.20	524,160.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	57.90	596,370.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	60.90	682,080.00	



GEM CO LTD-A	289,800	6.96	2,017,008.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	40.34	1,001,480.84
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.51	538,321.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.77	998,575.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.26	1,880,546.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	68.36	164,064.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	12.26	122,600.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.85	852,850.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.32	259,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.79	262,917.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	86.92	677,976.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	16.11	246,483.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	14.83	698,493.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	12.75	1,009,800.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	4.13	80,535.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	18.97	902,972.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.61	562,504.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	15.01	832,679.75
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	23.47	170,204.44
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	31.61	567,083.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.09	885,594.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	38.21	620,530.40
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	7.62	835,746.36
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.95	542,730.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	13.39	660,127.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	49.30	532,440.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	115.86	111,225.60
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	20.35	1,015,465.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	61.80	614,292.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	68.51	781,014.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	13.45	131,810.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.02	1,001,432.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	85.41	3,442,023.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	30.15	444,772.80
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	53.85	887,717.25
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	62.00	112,840.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	91.80	376,380.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	22.81	853,094.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	43.98	325,891.80
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	13.10	1,695,140.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	11.55	3,108,105.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	41.78	476,292.00

AVICOPTER PLC-A	15,500	39.31	609,305.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	24.86	208,824.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	11.69	748,160.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	30.95	1,708,904.25
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.37	1,429,347.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.28	1,905,228.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.64	3,171,936.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	222.25	8,841,105.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	6.63	1,231,854.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	19.02	821,664.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	56.89	2,245,618.97
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.25	142,500.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	96.53	231,672.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	10.64	213,981.04
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	163.60	616,772.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	26.69	154,802.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	51.85	326,655.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	32.66	859,611.20
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	49.49	367,908.66
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	64.66	740,744.96
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.62	641,982.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	15.07	724,867.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	4.05	1,340,145.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	16.50	597,300.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	23.50	1,973,530.00
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	154.40	917,136.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	47.95	601,005.30
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	53.83	628,465.25
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	17.75	717,100.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.80	946,560.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	193.10	531,411.20
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.54	693,026.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.56	2,219,352.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	67.21	1,908,293.53
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	9.92	248,595.20
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	115.60	1,156,000.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	16.09	654,863.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	157.70	645,939.20
TBEA CO LTD-A	22,519	21.89	492,940.91
WEICHAO POWER CO LTD-A	43,200	12.65	546,480.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.57	1,310,058.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	27.33	863,628.00

ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	57.42	474,289.20
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	28.17	205,641.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.14	734,228.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.71	537,471.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	42.36	465,960.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.77	227,143.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.49	2,180,079.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	5.03	201,200.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.01	1,836,835.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.56	1,213,380.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	45.09	2,394,279.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	46.50	247,333.50
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.25	233,100.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	15.03	837,171.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	9.55	208,572.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	88.81	959,148.00
BYD CO LTD -A	17,000	264.40	4,494,800.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	134.60	1,211,400.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.83	599,558.16
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	35.80	662,300.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.51	634,893.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	159.86	1,342,824.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	18.74	549,082.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	74.82	52,374.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.41	613,866.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	22.68	890,280.72
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	75.96	212,688.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	36.48	1,586,880.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	25.00	694,000.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	38.89	308,475.48
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	91.30	703,010.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.86	2,311,146.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.16	466,752.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	52.01	416,080.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	45.08	1,181,096.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.47	354,471.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.67	424,191.60
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	30.25	741,125.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.98	427,728.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.77	943,738.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	443.80	1,287,020.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2,800	15.98	44,744.00

MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	33.31	542,953.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	15.59	355,452.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	7.00	430,500.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	109.66	2,272,155.20
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.78	749,190.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	27.23	606,983.93
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	36.74	521,561.04
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	35.74	382,418.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	247.00	395,200.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	50.45	110,990.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	60.91	1,114,653.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	149.77	449,310.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.95	413,525.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	86.13	680,427.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	5,980	17.78	106,324.40
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	45.79	2,475,270.03
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.16	524,984.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	47.12	801,040.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	24.32	1,911,065.60
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	28.68	983,781.36
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	52.19	902,887.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	130.28	1,185,548.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	91.86	514,416.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	37.04	425,960.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	33.82	236,740.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,690.03	19,435,345.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	211.35	3,888,840.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	41.68	1,398,697.44
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.89	318,652.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	36.23	1,818,746.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	198.10	1,858,178.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	59.90	682,860.00
TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	9.98	1,473,048.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.43	703,288.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	163.66	6,791,890.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	40.02	404,202.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.73	83,369.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	20.89	620,433.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	17.81	1,634,049.69
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.39	502,240.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	73.99	209,983.62
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	45.61	443,329.20

JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	22.25	274,787.50
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	15,496	9.66	149,691.36
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	22.08	326,784.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.95	172,638.00
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	31.10	224,199.90
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,900	291.64	2,303,956.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	100.00	200,000.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	119.13	33,356.40
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	83,180	25.78	2,144,380.40
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	53.58	1,521,672.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	63.73	668,336.51
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	52.01	837,361.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	58.95	324,225.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	91.08	825,822.36
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	141.71	311,762.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	55.25	563,550.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	41.82	621,027.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	49.17	1,091,229.81
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	62.93	503,440.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	21.92	413,192.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	454.77	945,921.60
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	48.39	1,892,145.78
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	40.31	448,085.96
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	13.25	366,786.50
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	39.02	744,423.56
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.36	471,776.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	25.14	273,523.20
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	32.70	228,900.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	24.88	234,867.20
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	28.62	321,459.84
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	25.17	427,890.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	63.01	1,037,396.64
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	52.02	517,078.80
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	281.19	1,096,641.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.17	163,893.40
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	26.10	1,735,650.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	15.30	533,174.40
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	33.43	324,271.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.52	3,632,992.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.38	254,040.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	12.22	1,923,428.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.75	2,943,425.00

BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	11.69	1,317,463.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.29	1,674,804.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	7.98	1,177,050.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	24.74	1,442,342.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	5.77	262,535.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.19	773,131.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.06	2,556,018.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	32.31	6,009,660.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.77	1,031,472.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.63	1,055,103.40
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.37	641,178.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.76	2,754,136.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	15.52	3,189,360.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.20	1,337,280.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.88	690,520.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.22	3,157,306.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.89	476,525.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.58	840,052.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.37	422,522.10
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.88	117,012.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.18	382,006.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.91	398,660.60
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	20.13	2,839,940.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	24.27	584,907.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	14.02	1,646,326.54
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.40	59,040.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.71	343,742.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.83	898,698.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.45	1,107,329.55
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.93	2,010,143.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.38	1,039,674.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.68	1,015,694.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	165.25	892,350.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	14.21	447,615.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.28	717,615.60
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.95	403,731.20
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.61	955,192.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	7.48	2,300,848.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.69	420,660.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.99	436,563.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.89	2,168,972.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	27.47	2,752,494.00

PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	47.21	4,947,608.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	12.20	328,180.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	33.16	135,956.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	447.00	2,155,881.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	13.25	455,773.50
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	50.60	1,632,659.60
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.81	379,317.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	41.57	688,482.34
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	68.61	740,988.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	11.76	390,432.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	108.29	324,870.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	49.10	467,972.10
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	101.12	556,160.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	19.94	262,609.80
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	24.72	936,888.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.32	495,072.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	26.92	541,092.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	30.37	850,360.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.15	492,420.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	92.58	842,478.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	23.66	1,067,066.00
GOERTEK INC -A	26,900	18.52	498,188.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.61	330,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	63.83	446,810.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	46.02	907,146.24
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	12.11	203,448.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	33.31	1,547,249.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	107.30	185,414.40
NINESTAR CORP-A	18,543	35.06	650,117.58
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	15.00	364,500.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	75.68	360,236.80
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	141.86	912,869.10
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	25.61	729,885.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.41	442,270.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	30.61	561,387.40
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	48.55	203,910.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.78	417,863.80
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	134.67	632,949.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	33.80	532,350.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	20.84	631,452.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	146.99	1,278,813.00
ZTE CORP-A	76,400	42.99	3,284,436.00

CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.69	1,982,932.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.38	1,282,644.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.35	1,290,955.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.00	3,957,360.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.76	1,043,056.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.76	1,187,032.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.29	2,174,101.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	14.50	1,338,350.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	149.33	1,059,795.01
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	85.21	863,858.98
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	195.43	2,232,201.46
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	53.55	1,126,263.60
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	105.21	659,877.12
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	35.19	744,901.92
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	30.73	230,475.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	88.79	665,925.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	36.16	1,236,744.32
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	30.75	916,350.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	12.52	287,784.72
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	27.36	2,745,302.40
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	63.70	1,341,203.50
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	285.14	883,934.00
SG MICRO CORP-A	4,095	81.66	334,397.70
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	106.30	839,770.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	225.98	632,744.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	30.31	1,117,681.25
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.28	303,920.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	22.44	504,137.04
TONGWEI CO LTD-A	31,600	32.20	1,017,520.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	37.79	960,546.22
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	93.08	638,435.72
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	105.18	766,762.20
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	42.87	608,754.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	67.10	1,142,176.20
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	12.62	690,314.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	13.87	744,819.00
GEMDALE CORP-A	45,500	7.02	319,410.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	4.05	2,117,340.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	12.80	1,047,040.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	13.95	178,560.00
オフショア人民元 小計	25,674,347		363,503,218.73 (7,162,830,925)



サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	11.40	512,304.60
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	32.30	13,445,650.20
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	46.15	543,416.25
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	15.12	482,751.36
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	131.60	4,923,550.80
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	37.45	1,769,175.45
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	43.60	9,192,798.40
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	145.00	1,355,605.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	89.30	12,853,306.20
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	25.75	2,197,067.25
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.44	1,390,112.64
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	49.50	2,528,410.50
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	180.80	760,625.60
	JARIR MARKETING CO	125,000	16.32	2,040,000.00
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	171.80	1,104,845.80
	ALMARAI CO	30,130	65.20	1,964,476.00
	SAVOLA	36,289	41.00	1,487,849.00
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	157.60	1,076,880.80
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	290.00	3,397,930.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	239.60	1,907,695.20
	AL RAJHI BANK	291,473	72.50	21,131,792.50
	ALINMA BANK	161,322	35.00	5,646,270.00
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	26.65	2,292,726.15
	BANK AL-JAZIRA	97,894	18.30	1,791,460.20
	BANK ALBILAD	89,702	38.60	3,462,497.20
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	42.40	4,021,004.00
	RIYAD BANK	234,479	33.35	7,819,874.65
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	39.55	5,849,247.25
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	17.18	1,213,595.20
	THE SAUDI NATIONAL BANK	437,009	36.75	16,060,080.75
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	198.40	2,173,868.80
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	186.00	2,645,478.00
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	324.80	1,434,641.60
ELM CO	2,436	580.80	1,414,828.80	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	47.40	2,315,205.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.80	1,249,010.40	
SAUDI TELECOM CO	301,319	44.60	13,438,827.40	
ACWA POWER CO	16,922	176.80	2,991,809.60	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	23.02	3,731,749.18	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	15.94	1,609,796.54	
EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.37	432,772.19	
	3,932,292		167,660,987.06	

サウジアラビアリアル 小計			(6,379,500,557)
合 計	1,304,697,261		146,874,045,514 (146,874,045,514)

## (2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	メキシコペ ソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	13,645,977.60	
	メキシコペソ 小計		97,360	13,645,977.60 (113,499,054)	
	ブラジルレ アル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,451,663.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,368,738.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,895,058.00	
KLABIN SA-UNIT		100,000	2,187,000.00		
ブラジルリアル 小計		383,600	11,902,459.00 (348,115,979)		
投資信託受益証券合計			480,960	461,615,033 (461,615,033)	
投資証券	メキシコペ ソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,788,583.00	
	メキシコペソ 小計		391,700	9,788,583.00 (81,415,560)	
	南アフリカ ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	5,601,176.10	
	南アフリカランド 小計		478,733	5,601,176.10 (42,288,879)	
投資証券合計			870,433	123,704,439 (123,704,439)	
合計				585,319,472 (585,319,472)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 34銘柄	100.0%			2.4%
メキシコペソ	株式 21銘柄	95.4%			2.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.7%		0.1%
	投資証券 1銘柄			1.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 43銘柄	95.7%			5.3%

	投資信託受 4銘柄 益証券		4.3%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.6%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%			0.6%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%			0.8%
ロシアルーブル	株式 14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 196銘柄	100.0%			22.3%
マレーシアリンギット	株式 33銘柄	100.0%			1.3%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%			1.9%
フィリピンペソ	株式 15銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式 101銘柄	100.0%			12.3%
新台湾ドル	株式 90銘柄	100.0%			15.3%
インドルピー	株式 114銘柄	100.0%			14.9%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.0%			1.0%
南アフリカランド	株式 36銘柄	99.1%			3.1%
	投資証券 1銘柄			0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 11銘柄	100.0%			1.4%
クウェートディナール	株式 7銘柄	100.0%			0.8%
オフショア人民元	株式 354銘柄	100.0%			4.9%
サウジアラビアリアル	株式 41銘柄	100.0%			4.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 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 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,517,850,091
コール・ローン	698,200,683
国債証券	107,703,391,970
派生商品評価勘定	166,021

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
未収入金	53,718,961
未収利息	1,374,980,898
前払費用	165,663,293
流動資産合計	111,513,971,917
資産合計	111,513,971,917
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,294
未払金	190,847,513
未払解約金	36,893,221
未払利息	582
流動負債合計	227,898,610
負債合計	227,898,610
純資産の部	
元本等	
元本	53,714,392,724
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	57,571,680,583
元本等合計	111,286,073,307
純資産合計	111,286,073,307
負債純資産合計	111,513,971,917

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>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>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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	53,714,392,724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 2.0718円 (1万口当たり純資産額) (20,718円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	47,067,575,964円
期中追加設定元本額	12,603,000,206円
期中一部解約元本額	5,956,183,446円
期末元本額	53,714,392,724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	4,833,285,794円
世界経済インデックスファンド	17,864,171,040円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,742,531,769円
DC世界経済インデックスファンド	13,945,584,121円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	11,284,172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)	681,789,014円

区分	2023年 7月10日現在
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,460,037,021円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	248,860,877円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	106,873,237円
S M T インデックスバランス・オープン	186,304,106円
S M T 世界経済インデックス・オープン	448,707,241円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	578,204,349円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	913,115,871円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	12,189,898円
グローバル経済コア	798,436,454円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	91,758,256円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	76,690,737円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	29,332,187円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	29,284,103円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	91,072,004円
10資産分散投資ファンド	42,820,170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）	247,953,984円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	153,972,370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）	10,453,464円
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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
S M T A M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 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	4,038,441,127
合計	4,038,441,127

(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）

## 通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	9,811,679	-	9,654,385	157,294
	アメリカドル	9,811,679	-	9,654,385	157,294
	売建	9,811,679	-	9,645,658	166,021
	チリペソ	9,811,679	-	9,645,658	166,021
合計		19,623,358	-	19,300,043	8,727

## (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	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	34,605,396.00	
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,655,174.28	
		MBONO 5.5% 03/04/27	102,000,000.00	89,720,220.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	159,139,208.69	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	53,100,675.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	43,000,000.00	39,107,210.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	130,997,770.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	164,856,015.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	74,573,785.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	25,824,181.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	105,600,000.00	103,484,832.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	94,408,303.00	
		MBONO 8% 07/31/53	50,500,000.00	45,121,245.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,348,331.58	
		MBONO 8% 11/07/47	96,000,000.00	86,447,040.00	
		メキシコペソ 小計			1,402,350,000.00
ブラジルレアル	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	60,128,283.19	
		BLTN 0% 07/01/24	37,250,000.00	33,486,293.14	
		BLTN 0% 07/01/25	46,400,000.00	38,152,826.40	
		BLTN 0% 07/01/26	88,000,000.00	65,966,587.28	
		BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000.00	54,726,368.99	
		BNTNF 10% 01/01/27	50,400,000.00	50,078,059.71	
		BNTNF 10% 01/01/29	41,700,000.00	40,888,378.55	
		BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	13,478,726.87	
		BNTNF 10% 01/01/33	18,400,000.00	17,772,160.45	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,368,290.00	
ブラジルレアル 小計			429,200,000.00	376,045,974.58 (10,998,367,036)	
チリペソ	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	539,342,893.75	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,808,817,530.04	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	2,060,000,000.00	2,007,880,588.90	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	1,610,000,000.00	1,554,264,226.27	
		BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,184,181,465.05	
		BTPCL 5% 10/01/28	820,000,000.00	802,971,576.60	
		BTPCL 6% 01/01/43	1,900,000,000.00	2,095,644,041.20	

	BTPCL 6% 04/01/33	1,500,000,000.00	1,585,645,521.00	
	BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	561,035,791.47	
	チリペソ 小計	14,200,000,000.00	14,139,783,634.28	(2,492,462,080)
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	63,073,197,517.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	22,900,000,000.00	21,183,961,249.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	42,100,000,000.00	33,669,055,684.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	34,900,000,000.00	24,581,155,390.00	
	コロンビアペソ 小計	165,200,000,000.00	142,507,369,840.00	(4,875,462,136)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	4,210,893.52	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	8,350,000.00	7,455,460.40	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,678,333.83	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,700,000.00	9,581,814.32	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	8,003,350.44	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	5,150,000.00	5,228,792.88	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	9,550,000.00	9,587,637.79	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,250,000.00	11,506,915.01	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,400,000.00	9,750,328.22	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,550,000.00	2,706,443.06	
	ペルーソル 小計	72,900,000.00	71,709,969.47	(2,805,580,845)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,250,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,212,511.04	
	ウルグアイペソ 小計	42,000,000.00	39,462,511.04	(147,092,563)
ドミニカペ ソ	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	39,743,419.20	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	41,000,000.00	41,799,500.00	
	ドミニカペソ 小計	73,000,000.00	81,542,919.20	(208,684,638)
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,752,532.20	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	58,843,182.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	54,727,201.10	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	22,140,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	77,755,160.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	54,825,732.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,666,016.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	41,676,375.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	20,500,000.00	15,272,500.00	
	CZGB 1% 06/26/26	53,800,000.00	47,874,468.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	71,229,158.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	78,700,000.00	71,287,404.40	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	73,097,220.00	



	CZGB 2% 10/13/33	74,500,000.00	59,977,417.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	20,137,150.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,604,035.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	6,500,000.00	6,792,500.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	28,000,000.00	29,310,260.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	36,700,000.00	36,661,465.00	
	CZGB 5% 09/30/30	45,000,000.00	46,476,225.00	
	CZGB 6% 02/26/26	48,000,000.00	49,200,000.00	
	チェココルナ 小計	1,023,300,000.00	905,306,000.70 (5,931,112,263)	
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	500,610,000.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	413,821,400.00	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	694,970,500.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	478,820,000.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	164,044,800.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	578,000,000.00	521,153,700.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	580,500,000.00	478,310,637.60	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	302,914,950.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	619,353,000.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	213,195,150.00	
	HGB 3% 06/26/24	292,500,000.00	271,922,625.00	
	HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	473,611,500.00	
	HGB 3% 10/27/27	822,000,000.00	678,602,100.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	242,155,000.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	263,000,000.00	228,078,202.50	
	HGB 4.75% 11/24/32	570,000,000.00	471,648,443.70	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	609,351,204.00	
HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	728,202,762.30		
	ハンガリーフォロント 小計	10,041,500,000.00	8,090,765,975.10 (3,289,203,817)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,578,850.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	13,125,255.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	13,903,169.50	
	POLGB 1.75% 04/25/32	24,800,000.00	18,091,600.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,110,515.00	
	POLGB 2.5% 04/25/24	24,500,000.00	23,861,040.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	19,449,839.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	15,657,840.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,500,790.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	22,217,886.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,026,349.50	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	19,781,672.00	

	POLGB 6% 10/25/33	6,600,000.00	6,718,800.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	10,600,000.00	11,432,630.00	
ポーランドズロチ 小計		267,100,000.00	238,456,236.40 (8,367,787,019)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,549,914.65	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	7,300,000.00	7,126,975.32	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	5,964,654.41	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	4,000,000.00	3,756,017.88	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	9,896,341.72	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,138,736.00	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,677,347.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,135,465.67	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,310,248.69	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	5,300,000.00	4,117,464.00	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,163,733.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,389,558.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	6,033,312.00	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,512,752.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,077,096.00	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	10,100,000.00	9,810,433.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,519,190.00	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,744,104.00	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	5,400,000.00	5,871,690.00	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	5,500,000.00	6,017,550.00	
ROMGB 8.75% 10/30/28	4,500,000.00	4,889,438.10		
ルーマニアレイ 小計		140,500,000.00	131,702,021.44 (4,157,753,795)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000.00	31,293,152.24	
	MGS 3.478% 06/14/24	9,650,000.00	9,663,620.97	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,551,041.39	
	MGS 3.582% 07/15/32	13,500,000.00	13,151,175.39	
	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	19,018,293.20	
	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	25,926,117.70	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,033,659.63	
	MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,311,586.24	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,312,971.70	
	MGS 3.899% 11/16/27	15,500,000.00	15,631,004.45	
	MGS 3.9% 11/30/26	17,450,000.00	17,651,851.13	
	MGS 3.906% 07/15/26	15,600,000.00	15,764,034.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	28,970,752.93	
	MGS 4.059% 09/30/24	15,450,000.00	15,552,062.70	
	MGS 4.065% 06/15/50	16,750,000.00	16,231,451.65	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,161,178.39	

	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,361,835.64	
	MGS 4.504% 04/30/29	14,600,000.00	15,076,289.96	
	MGS 4.696% 10/15/42	8,800,000.00	9,450,676.40	
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,420,743.99	
	MGS 4.893% 06/08/38	10,800,000.00	11,804,977.80	
	MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,544,413.28	
マレーシアリングット 小計		362,050,000.00	361,882,890.78 (11,071,662,290)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,251,397.27	
	THAIGB 0.75% 09/17/24	70,000,000.00	68,892,789.70	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	138,993,954.53	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	182,328,985.60	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,826,129.98	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	58,205,274.62	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	126,100,000.00	120,132,973.22	
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	155,423,629.60	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	202,544,352.92	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,768,489.80	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	70,000,000.00	71,034,600.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	98,343,801.23	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	103,582,014.50	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	68,017,838.34	
	THAIGB 2% 12/17/31	113,000,000.00	109,448,555.77	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	156,228,889.18	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	71,000,000.00	75,758,079.20	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	46,000,000.00	48,882,636.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	167,719,839.72	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	52,000,000.00	55,085,378.40	
THAIGB 3.65% 06/20/31	142,500,000.00	154,536,704.25		
THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	198,761,940.00		
THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	109,599,568.14		
THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	136,152,217.45		
タイバーツ 小計		2,744,800,000.00	2,776,520,039.42 (11,272,671,360)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	28,552,540.80	
フィリピンペソ 小計		30,000,000.00	28,552,540.80 (73,160,175)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,006,364,050.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,285,250,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	61,855,920,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	59,000,000,000.00	58,575,200,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	16,055,680,000.00	

	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,737,700,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	62,531,960,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	16,111,189,500.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	26,500,000,000.00	27,017,280,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	63,031,250,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	50,530,000,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	20,464,000,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	16,000,000,000.00	17,198,400,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	38,800,000,000.00	40,980,560,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	13,500,000,000.00	14,507,437,500.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	41,000,000,000.00	44,557,980,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	21,601,050,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	43,700,000,000.00	47,584,930,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,910,640,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	61,000,000,000.00	64,419,355,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	40,043,640,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	55,000,000,000.00	57,321,000,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,668,140,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	46,200,000,000.00	50,990,940,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	38,970,680,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	15,166,622,500.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	35,600,000,000.00	36,267,500,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	50,945,400,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,929,080,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	42,886,950,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	27,269,220,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,713,041,760.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	32,700,780,000.00	
	インドネシアルピア 小計	1,098,200,000,000.00	1,160,835,140,310.00 (11,027,933,832)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	205,400,000.00	212,142,255.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	45,092,510.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	58,100,000.00	33,584,705.00	
	SAGB 7% 02/28/31	83,700,000.00	66,064,410.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000.00	136,876,775.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	129,700,000.00	97,009,115.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	80,421,600.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	128,689,025.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	121,253,000.00	
	SAGB 8% 01/31/30	190,600,000.00	166,460,510.00	
	SAGB 9% 01/31/40	130,300,000.00	98,063,780.00	
	南アフリカランド 小計	1,480,200,000.00	1,185,657,685.00 (8,951,715,521)	

オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,563,298.49	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,198,508.55	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,006,784.20	
	CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	21,031,019.10	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,087,985.60	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,419,071.72	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,024,232.20	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,732,306.19	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	17,976,002.84	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	5,005,416.50	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,000,000.00	10,091,972.00	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,372,811.83	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,123,353.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	9,973,771.30	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,717,164.84	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,009,713.95	
	CGB 2.76% 05/15/32	4,500,000.00	4,513,645.80	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,121,411.20	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,170,934.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	9,969,988.05	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,792,793.87	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,725,827.20	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,481,572.60	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,105,700.00	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,128,339.40	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,293,728.40	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,074,576.40	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,720,114.30	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,440,296.51	
	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,926,410.40	
	CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	4,662,362.66	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,549,536.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,579,634.47	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,362,803.27	
CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,146,907.68		
CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,653,873.00		
CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,737,702.62		
CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,056,897.60		
CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,079,939.30		
CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,840,743.76		
CGB 3.32% 04/15/52	3,200,000.00	3,343,864.64		
CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,541,588.32		

	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,513,539.15	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,729,295.20	
	オフショア人民元 小計	552,400,000.00	564,597,438.11 (11,125,392,517)	
	合計		107,703,391,970 (107,703,391,970)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルレアル	国債証券 10銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	2.3%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.5%
ペルーソル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.6%
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 21銘柄	100.0%	5.5%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.1%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.8%
ルーマニアレイ	国債証券 21銘柄	100.0%	3.9%
マレーシアリンギット	国債証券 22銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券 24銘柄	100.0%	10.5%
フィリピンペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券 33銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	8.3%
オフショア人民元	国債証券 44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

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 - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,964,354,157

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
投資証券	131,964,315,500
未収入金	19,592,918
未収配当金	1,064,544,337
前払金	15,630,100
差入委託証拠金	238,123,000
流動資産合計	136,266,560,012
資産合計	136,266,560,012
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,630,100
未払金	368,668,348
未払解約金	17,445,217
未払利息	2,471
流動負債合計	401,746,136
負債合計	401,746,136
純資産の部	
元本等	
元本	64,657,212,453
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,207,601,423
元本等合計	135,864,813,876
純資産合計	135,864,813,876
負債純資産合計	136,266,560,012

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	64,657,212,453口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1013円 (21,013円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	54,153,941,017円
期中追加設定元本額	15,858,231,600円
期中一部解約元本額	5,354,960,164円
期末元本額	64,657,212,453円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,922,458,640円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,180,330円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,948,186,166円
J リートインデックス・オープン（SMA専用）	34,387,033,594円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,403,182,278円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,164,268,574円
分散投資コア戦略ファンドA	1,060,652,310円
分散投資コア戦略ファンドS	1,827,718,193円



区分	2023年 7月10日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,021,696,978円
SMT インデックスバランス・オープン	24,382,353円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	247,976,186円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,608,403円
グローバル経済コア	271,838,832円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,600,825円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	637,380,154円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	143,632,814円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	419,567,927円
10資産分散投資ファンド	23,169,915円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	506,856,886円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,174,141円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	455,057,747円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	95,554,811円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	519,109,269円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	250,858,758円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	286,066,369円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		5,615,313,365
合計		5,615,313,365

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	3,865,460,100	-	3,849,830,000	15,630,100
合計		3,865,460,100	-	3,849,830,000	15,630,100

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,560	310,528,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	4,034	369,514,400	

S O S i L A 物流リート投資法人	6,264	815,572,800	
東海道リート投資法人	2,094	268,450,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	4,349	2,813,803,000	
森ヒルズリート投資法人	14,809	2,190,251,100	
産業ファンド投資法人	19,215	2,876,485,500	
アドバンス・レジデンス投資法人	12,592	4,186,840,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,236	2,137,210,400	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,607	2,669,228,000	
G L P 投資法人	42,460	5,867,972,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	6,022	2,086,623,000	
日本プロロジスリート投資法人	21,897	6,319,474,200	
星野リゾート・リート投資法人	2,203	1,370,266,000	
O n e リート投資法人	2,197	552,765,200	
イオンリート投資法人	14,458	2,232,315,200	
ヒューリックリート投資法人	11,783	1,889,993,200	
日本リート投資法人	4,091	1,413,440,500	
積水ハウス・リート投資法人	37,843	3,133,400,400	
トーセイ・リート投資法人	2,794	375,513,600	
ケネディクス商業リート投資法人	5,475	1,595,962,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,105	497,110,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,274	391,570,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	40,726	6,601,684,600	
いちごホテルリート投資法人	2,086	214,649,400	
ラサールロジポート投資法人	16,098	2,462,994,000	
スターアジア不動産投資法人	15,724	922,998,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,924	245,117,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,975	2,437,750,000	
大江戸温泉リート投資法人	2,033	129,095,500	
投資法人みらい	15,300	711,450,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,327	1,741,617,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,396	957,790,000	
ザイマックス・リート投資法人	2,043	236,375,100	
タカラレーベン不動産投資法人	5,937	571,139,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,489	730,585,900	
日本ビルファンド投資法人	14,692	8,609,512,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,914	7,154,356,000	
日本都市ファンド投資法人	63,542	6,112,740,400	
オリックス不動産投資法人	25,093	4,343,598,300	
日本プライムリアルティ投資法人	8,613	3,053,308,500	
N T T 都市開発リート投資法人	12,106	1,619,782,800	
東急リアル・エステート投資法人	8,444	1,595,916,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	9,268	1,066,746,800	

ユナイテッド・アーバン投資法人	28,171	4,098,880,500	
森トラストリート投資法人	23,440	1,680,648,000	
インヴィンシブル投資法人	55,430	3,059,736,000	
フロンティア不動産投資法人	4,673	2,184,627,500	
平和不動産リート投資法人	8,873	1,291,021,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,492	2,611,290,000	
福岡リート投資法人	6,513	1,066,178,100	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,328	2,539,152,000	
いちごオフィスリート投資法人	10,319	921,486,700	
大和証券オフィス投資法人	2,609	1,651,497,000	
阪急阪神リート投資法人	5,688	814,521,600	
スターツプロシード投資法人	2,183	490,301,800	
大和ハウスリート投資法人	18,983	5,216,528,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40,612	3,001,226,800	
大和証券リビング投資法人	17,451	1,984,178,700	
ジャパンエクセレント投資法人	11,553	1,469,541,600	
合計	768,410	131,964,315,500	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	297,236,645
コール・ローン	1,934,249,115
投資証券	90,340,824,295
派生商品評価勘定	1,161,757
未収入金	12,897,302
未収配当金	388,840,059
流動資産合計	92,975,209,173
資産合計	92,975,209,173
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	2,036,464,987
未払利息	1,612
流動負債合計	2,036,466,599
負債合計	2,036,466,599
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	35,682,145,567
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	55,256,597,007

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	90,938,742,574
純資産合計	90,938,742,574
負債純資産合計	92,975,209,173

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	35,682,145,567口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.5486円 (1万口当たり純資産額) (25,486円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	39,468,176,591円
期中追加設定元本額	7,193,145,137円
期中一部解約元本額	10,979,176,161円
期末元本額	35,682,145,567円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	57,018,047円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	100,877,861円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,577,901,981円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,188,754円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,175,977,780円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	13,807,710,095円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドA	1,144,609,846円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	510,318,247円
SMT インデックスバランス・オープン	113,388,333円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,243,558円
グローバル経済コア	230,347,318円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,807,762円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	345,064,516円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	76,629,281円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	151,565,868円
10資産分散投資ファンド	12,821,000円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,160,472,703円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	182,535,189円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,092,434円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	57,560,119円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	37,829,136円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	101,254,666円

区分	2023年 7月10日現在
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	98,602,587円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	98,102,805円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	98,563,944円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	97,589,221円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	72,650,022円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	63,576,431円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		2,208,610,013
合計		2,208,610,013

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	111,860,280	-	110,698,523	1,161,757
	アメリカドル	108,045,000	-	106,888,575	1,156,425
	オーストラリアドル	3,815,280	-	3,809,948	5,332
合計		111,860,280	-	110,698,523	1,161,757

(注)時価の算定方法

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

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	710,098.09	
		AGREE REALTY CORP	47,425	3,087,841.75	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,043	665,714.21	
		ALEXANDER'S INC	886	162,155.72	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	78,187	9,148,660.87	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	92,283.00	

AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,042	573,289.08	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	155,862	5,618,825.10	
AMERICOLD REALTY TRUST	133,901	4,233,949.62	
APARTMENT INCOME REIT CO	73,779	2,658,257.37	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	69,944	592,425.68	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	104,891	1,602,734.48	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	381,086.39	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	66,980.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	70,567	13,483,236.69	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	30,067.20	
BOSTON PROPERTIES	70,725	4,178,433.00	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	113,652.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	377,659.05	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	148,786	3,255,437.68	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	95,237	1,469,506.91	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	100,450.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	52,967	5,761,750.26	
CARETRUST REIT INC	52,232	1,018,524.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	257,685.34	
CENTERSPACE	7,349	458,871.56	
CHATHAM LODGING TRUST	25,562	245,139.58	
CITY OFFICE REIT INC	15,298	87,351.58	
CLIPPER REALTY INC	7,300	42,486.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	382,551.00	
CORPORATE OFFICE PPTYS	59,276	1,449,890.96	
COUSINS PROPERTIES INC	74,825	1,735,191.75	
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	145,824.00	
CUBESMART	111,419	4,933,633.32	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	112,866	917,600.58	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	85,824.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	144,817	16,480,174.60	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	284,992.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	82,382	1,119,571.38	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	49,311	719,447.49	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	21,994	3,815,959.00	
ELME COMMUNITIES	40,527	665,453.34	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	62,623	499,105.31	
EPR PROPERTIES	38,177	1,798,900.24	
EQUINIX INC	46,511	35,920,910.41	
EQUITY COMMONWEALTH	57,330	1,165,518.90	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	86,840	5,724,492.80	

EQUITY RESIDENTIAL PPTY	169,422	11,273,339.88
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	74,641	1,740,628.12
ESSEX PROPERTY TRUST	31,863	7,432,044.75
EXTRA SPACE STORAGE INC	67,080	9,935,889.60
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	281,524.32
FEDERAL REALTY INVS TRUST	36,331	3,487,049.38
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	66,879	3,551,943.69
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,562	1,078,521.08
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	71,717.88
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	130,342	6,249,898.90
GETTY REALTY CORP	22,990	749,244.10
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	256,711.00
GLADSTONE LAND CORP	15,061	244,741.25
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,431	245,279.68
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	522,744.60
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	190,423	3,560,910.10
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	271,357	5,576,386.35
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	121,029.30
HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,689	1,337,392.99
HOST HOTELS AND RESORTS INC	352,929	6,158,611.05
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	306,335.46
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	111,096	1,979,730.72
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	125,367.48
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,642	1,063,887.72
INVENTRUST PROPERTIES CORP	32,229	753,514.02
INVITATION HOMES INC	288,771	10,031,904.54
IRON MOUNTAIN INC	144,804	8,391,391.80
JBG SMITH PROPERTIES	46,081	723,010.89
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	118,231.50
KILROY REALTY CORPORATION	52,622	1,672,853.38
KIMCO REALTY CORP	307,605	6,121,339.50
KITE REALTY GROUP TRUST	108,393	2,407,408.53
LIFE STORAGE INC	42,213	5,576,759.43
LTC PROPERTIES INC	22,125	727,912.50
LXP INDUSTRIAL TRUST	144,466	1,404,209.52
MACERICH CO/THE	112,250	1,272,915.00
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	141,142.71
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	295,942	2,740,422.92
MID-AMERICA APARTMENT COMM	57,929	8,872,984.93
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,098	1,518,773.52
NATL HEALTH INVESTORS INC	23,139	1,209,012.75



NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	444,125.44
NETSTREIT CORP	27,610	479,585.70
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490	195,793.60
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	502,479.00
NNN REIT INC	90,208	3,814,896.32
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	181,210.20
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	116,063	3,593,310.48
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	176,709.45
ORION OFFICE REIT INC	34,844	240,423.60
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	395,239.52
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	109,726	1,460,453.06
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,648	891,481.04
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	57,873	1,915,596.30
PHYSICIANS REALTY TRUST	119,855	1,663,587.40
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	442,178.84
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,962	407,557.78
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	103,530.00
PRIME US REIT	295,000	64,900.00
PROLOGIS INC	459,352	56,036,350.48
PUBLIC STORAGE	78,668	22,584,796.12
REALTY INCOME CORP	334,695	19,937,781.15
REGENCY CENTERS CORP	77,230	4,734,971.30
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,925	904,156.75
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	99,666	5,143,762.26
RLJ LODGING TRUST	76,182	794,578.26
RPT REALTY	39,523	410,643.97
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,109	2,840,181.97
SABRA HEALTH CARE REIT INC	117,928	1,397,446.80
SAFEHOLD INC	21,624	535,410.24
SAUL CENTERS INC	6,846	247,140.60
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,293	781,313.75
SIMON PROPERTY GROUP	162,551	19,270,421.05
SITE CENTERS CORP	87,704	1,169,971.36
SL GREEN REALTY CORP	31,274	984,192.78
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,857	2,820,387.25
STAG INDUSTRIAL INC	88,787	3,185,677.56
STAR HOLDINGS	6,183	94,167.09
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	350,131.70
SUN COMMUNITIES INC	61,768	8,141,640.08
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,395	1,035,072.45
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	50,538	1,104,255.30

	TERRENO REALTY CORP	37,611	2,196,106.29
	UDR INC	153,571	6,549,803.15
	UMH PROPERTIES INC	25,129	406,838.51
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,281	298,849.98
	URBAN EDGE PROPERTIES	57,394	895,346.40
	URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	317,555.00
	VENTAS INC	198,700	9,517,730.00
	VERIS RESIDENTIAL INC	43,050	703,006.50
	VICI PROPERTIES INC	499,155	15,538,695.15
	VORNADO REALTY TRUST	80,077	1,481,424.50
	WELLTOWER INC	247,098	19,720,891.38
	WHITESTONE REIT	23,074	223,587.06
	WP CAREY INC	106,177	7,182,874.05
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,932	708,073.48
	アメリカドル 小計	12,893,011	496,572,599.60 (70,781,458,346)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	639,582.45
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	215,343.00
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	136,560.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,093	695,087.38
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	164,540.00
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	64,200.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	40,850	2,029,836.50
	CHOICE PROPERTIES REIT	82,975	1,093,610.50
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	369,420.30
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	413,731.60
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	66,102	940,631.46
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,339	69,460.39
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	67,876.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,125	703,470.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,352,294.20
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	627,686.15
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	29,406.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	422,712.90
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,096	504,524.64
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	165,279.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	116,513.00
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	134,365.85
		58,872	376,192.08

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES			
	PRIMARIS REIT	22,050	290,178.00	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	84,480.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,438	1,343,252.66	
	SLATE GROCERY REIT	8,419	110,709.85	
	SLATE OFFICE REI	17,000	34,000.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,154	839,125.98	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	60,888.00	
	カナダドル 小計	873,566	14,094,957.89 (1,512,388,981)	
ユーロ	AEDIFICA	23,987	1,444,017.40	
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	36,720.00	
	ALTAREA	1,959	200,993.40	
	CARE PROPERTY INVEST	17,887	221,441.06	
	CARMILA	26,392	371,599.36	
	COFINIMMO	14,398	1,001,380.90	
	COVIVIO(FP)	23,027	1,009,043.14	
	CROMWELL REIT EUR	170,400	265,824.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,490	449,960.40	
	GECINA SA	27,070	2,558,115.00	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	233,840.00	
	ICADE	17,300	613,458.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	81,264.95	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,184	814,172.96	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	166,738.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	196,560.00	
	KLEPIERRE	96,595	2,162,762.05	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	193,120.00	
	MERCIALYS	36,384	305,807.52	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	166,888	1,312,574.12	
	MONTEA NV	6,890	486,434.00	
	NSI NV	7,359	149,387.70	
	RETAIL ESTATES	5,335	311,030.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	54,250	2,685,917.50	
	VASTNED RETAIL	10,650	210,870.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,709	2,081,065.96	
	WERELDHAVE NV	22,376	329,822.24	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,191	326,109.25	
	ユーロ 小計	1,327,811	20,220,029.41 (3,160,390,596)	
イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	59,447.04	

AEW UK REIT PLC	68,000	64,804.00	
ASSURA PLC	1,556,822	691,851.69	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	247,852.00	
BIG YELLOW GROUP PLC	87,773	894,406.87	
BRITISH LAND CO PLC	468,934	1,420,870.02	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	115,067	91,823.46	
CLS HOLDINGS PLC	75,636	104,528.95	
CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	195,386.18	
DERWENT LONDON PLC	56,125	1,144,950.00	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	63,800.00	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	260,712.00	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	121,885	498,022.11	
HAMMERSON PLC	1,931,365	475,502.06	
HELICAL PLC	45,400	118,721.00	
HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	162,293	142,817.84	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
LAND SECURITIES GROUP PLC	371,925	2,128,154.85	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	499,236	819,246.27	
LXI REIT PLC	834,609	694,811.99	
NEWRIVER REIT PL	126,000	106,722.00	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	184,116.00	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	690,955	637,060.51	
PRS REIT PLC/THE	260,002	210,341.61	
REGIONAL REIT LTD	222,000	98,679.00	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	107,256	896,660.16	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	86,430.00	
SEGRO PLC	608,940	4,321,038.24	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	950,577	1,059,893.35	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	675,749	477,078.79	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	107,538.29	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	932,234	1,169,021.43	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	198,926.28	
UNITE GROUP PLC	197,900	1,676,213.00	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	243,975.73	
WAREHOUSE REIT PLC	237,876	186,732.66	
WORKSPACE GROUP PLC	65,316	302,674.34	
イギリスポンド 小計	14,834,274	22,232,476.51 (4,064,541,355)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	194,329	503,312.11
	ARENA REIT	192,648	685,826.88

	BWP TRUST	237,407	845,168.92	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	348,575	557,720.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	270,296	832,511.68	
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	283,461.31	
	CHARTER HALL GROUP	231,682	2,497,531.96	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	330,964	1,313,927.08	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	275,874	982,111.44	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	449,684.40	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	368,192.00	
	DEXUS	543,275	4,253,843.25	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	305,100.00	
	GDI PROPERTY GROUP	185,597	122,494.02	
	GOODMAN GROUP	851,459	16,705,625.58	
	GPT GROUP	953,138	3,879,271.66	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	380,339.40	
	HEALTHCO REIT	194,021	260,958.24	
	HMC CAPITAL LTD	122,191	592,626.35	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	736,165	842,908.92	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	316,334.48	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	635,544.36	
	MIRVAC GROUP	1,987,126	4,451,162.24	
	NATIONAL STORAGE REIT	603,590	1,370,149.30	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	131,541.60	
	REGION RE GROUP	588,421	1,318,063.04	
	RURAL FUNDS GROUP	181,331	343,622.24	
	SCENTRE GROUP	2,581,713	6,738,270.93	
	STOCKLAND	1,191,357	4,705,860.15	
	VICINITY CENTERS	1,891,583	3,414,307.31	
	WAYPOINT REIT LTD	336,956	845,759.56	
	オーストラリアドル 小計	16,779,653	60,933,230.41 (5,804,499,528)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	488,215.26	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	556,435	1,235,285.70	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	680,533.99	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	651,295	843,427.02	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	432,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	241,387	567,259.45	
	ニュージーランドドル 小計	2,910,148	4,246,721.42 (375,367,706)	
香港ドル	CHAMPION REIT	927,000	2,586,330.00	
	FORTUNE REIT	735,000	4,152,750.00	
	LINK REIT	1,268,300	53,205,185.00	
	PROSPERITY REIT	492,000	826,560.00	

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,660,560.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	2,051,456.20	
	香港ドル 小計	5,289,960	64,482,841.20 (1,174,232,538)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	335,500.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,640,718	4,380,717.06	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,092,277	1,157,813.62	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	640,004.89	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,559,744	4,761,123.84	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	461,564.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	195,398.00	
	EC WORLD REIT	180,000	54,000.00	
	ESR-LOGOS REIT	3,029,264	1,029,949.76	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	334,800.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	137,215.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	529,862	1,133,904.68	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,448,796	1,767,531.12	
	KEPPEL DC REIT	661,303	1,415,188.42	
	KEPPEL REIT	1,047,300	942,570.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	871,250	570,668.75	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,029,063	2,243,357.34	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,642,585	2,644,561.85	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,142,873	1,817,168.07	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,273,644	388,461.42	
PARAGON REIT	519,600	491,022.00		
PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	197,500	750,500.00		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	208,539.00		
STARHILL GLOBAL REIT	663,000	338,130.00		
SUNTEC REIT	1,134,100	1,428,966.00		
	シンガポールドル 小計	23,681,300	29,628,655.32 (3,135,304,305)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	90,650,400.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	66,792,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	81,340	316,005,900.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	50,075,850.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	4,501	490,609.00	
	JR REIT XXVII	76,683	312,866,640.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	142,933,460.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	263,464,800.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	177,383,500.00	

	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	49,406,445.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	224,464,600.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	46,579,280.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	199,283,320.00	
	韓国ウォン 小計	460,839	1,940,396,804.00 (212,473,450)	
イスラエル シェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	591,480.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,656,000.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	867,790.00	
	イスラエルシェケル 小計	578,500	3,115,270.00 (120,167,490)	
	合計	79,629,062	90,340,824,295 (90,340,824,295)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 144銘柄	100.0%	78.3%
カナダドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.5%
イギリスポンド	投資証券 38銘柄	100.0%	4.5%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.3%
シンガポールドル	投資証券 25銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 13銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
預金	2,687,630
コール・ローン	112,164,243
投資信託受益証券	30,403,512,556
派生商品評価勘定	386,764,962
流動資産合計	30,905,129,391
資産合計	30,905,129,391
負債の部	
流動負債	
未払金	506,028
未払解約金	9,764,061
未払利息	93
流動負債合計	10,270,182
負債合計	10,270,182
純資産の部	
元本等	
元本	24,854,962,097
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,039,897,112
元本等合計	30,894,859,209
純資産合計	30,894,859,209
負債純資産合計	30,905,129,391

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,854,962,097口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.2430円 (1万口当たり純資産額) (12,430円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項



	2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	25,625,430,409円
期中追加設定元本額	5,719,589,312円
期中一部解約元本額	6,490,057,624円
期末元本額	24,854,962,097円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,323,181,016円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,619,980,624円
分散投資コア戦略ファンドA	2,034,630,620円
分散投資コア戦略ファンドS	7,439,587,857円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,663,978,391円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	517,627,891円
グローバル経済コア	1,310,568,348円

区分	2023年 7月10日現在
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,464,735,644円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	912,842,328円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	207,870,061円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	591,073,671円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	679,703,398円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	89,182,248円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		2,568,371,330
合計		2,568,371,330

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	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	30,620,951,155	-	30,234,186,193	386,764,962
	アメリカドル	30,620,951,155	-	30,234,186,193	386,764,962
合計		30,620,951,155	-	30,234,186,193	386,764,962

## （注）時価の算定方法

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

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
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	5,850,195	213,298,109.70	
		アメリカドル 小計	5,850,195	213,298,109.70 (30,403,512,556)	
合計			5,850,195	30,403,512,556 (30,403,512,556)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### H F リターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 貸借対照表

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,225,231
コール・ローン	1,595,051,512
国債証券	2,801,237,600
投資信託受益証券	1,475,073,964
派生商品評価勘定	85,302,862
未収配当金	3,753,862
差入委託証拠金	1,452,515,494
流動資産合計	7,417,160,525
資産合計	7,417,160,525
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	153,175,518
前受金	21,114,258
未払利息	1,329
流動負債合計	174,291,105
負債合計	174,291,105
純資産の部	
元本等	
元本	8,130,578,453
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	887,709,033
元本等合計	7,242,869,420
純資産合計	7,242,869,420
負債純資産合計	7,417,160,525

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券 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。

2023年 7月10日現在	
	(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 株価指数先物取引及び債券先物取引 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。  (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。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買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	(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,130,578,453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 887,709,033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) 0.8908円 (8,908円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2023年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ること及び組入外貨建資産の為替リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従って株価指数先物取引、債券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。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2023年 7月10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 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	14,257,391,013円
期中追加設定元本額	195,758,952円
期中一部解約元本額	6,322,571,512円
期末元本額	8,130,578,453円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	3,927,125,252円
分散投資コア戦略ファンドS	4,203,453,201円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,842,400	
投資信託受益証券	33,982,334	
合計	35,824,734	

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「HFリターン・ターゲット・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 )

## 株式関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,680,105,696	-	2,630,162,991	49,942,705
	売建	1,284,625,606	-	1,267,104,604	17,521,002
合計		3,964,731,302	-	3,897,267,595	32,421,703

## (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。

## 債券関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	1,725,703,957	-	1,672,167,996	53,535,961
合計		1,725,703,957	-	1,672,167,996	53,535,961

## (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 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	77,033,915	-	79,891,581	2,857,666
	カナダドル	33,257,622	-	34,424,232	1,166,610
	ユーロ	28,552,781	-	29,840,732	1,287,951
	スウェーデンクローナ	15,223,512	-	15,626,617	403,105
	売建	2,980,317,664	-	3,072,162,244	91,844,580
	アメリカドル	2,658,371,928	-	2,736,366,230	77,994,302
	イギリスポンド	128,651,960	-	135,206,584	6,554,624
	スイスフラン	193,293,776	-	200,589,430	7,295,654
合計		3,057,351,579	-	3,152,053,825	88,986,914

## (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	円	第1115回国庫短期証券	2,800,000,000	2,801,237,600	
国債証券合計			2,800,000,000	2,801,237,600	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GSCI COMMODITY DYNAM	49,960	1,322,940.80	
		ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	84,460	7,144,471.40	
		SPDR GOLD SHARES ETF	10,530	1,881,079.20	
	アメリカドル 小計		144,950	10,348,491.40 (1,475,073,964)	
投資信託受益証券合計			144,950	1,475,073,964 (1,475,073,964)	
合計				4,276,311,564 (1,475,073,964)	

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券3銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

### 貸借対照表

2023年 7月10日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,855,978,968
国債証券	11,831,192,840
派生商品評価勘定	227,539,490

	2023年 7月10日現在
項目	金額（円）
未収入金	66,959,673
差入委託証拠金	2,369,173,621
流動資産合計	21,350,844,592
資産合計	21,350,844,592
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,036,605
前受金	198,472,959
未払金	113,295,876
未払解約金	1,001,489
未払利息	5,715
流動負債合計	360,812,644
負債合計	360,812,644
純資産の部	
元本等	
元本	18,037,415,789
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,952,616,159
元本等合計	20,990,031,948
純資産合計	20,990,031,948
負債純資産合計	21,350,844,592

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)によっております。</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 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		18,037,415,789口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1637円 (11,637円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

		2023年 7月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2023年 7月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	252,120,355円
期中追加設定元本額	17,817,943,970円
期中一部解約元本額	32,648,536円
期末元本額	18,037,415,789円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	475,146,861円

区分	2023年 7月10日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	617,507,446円
分散投資コア戦略ファンドA	2,121,663,480円
分散投資コア戦略ファンドS	6,009,060,337円
コア投資戦略ファンド（切替型）	288,321,085円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	117,442,367円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	8,031,435,641円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,875,338円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	28,048,620円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標コース）（適格機関投資家専用）	219,471,819円
FOFs用GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	442,795円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2023年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,821,060	
合計	3,821,060	

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引					
	買建	4,737,490,000	-	4,721,600,000	15,890,000	
	売建	9,880,882,080	-	9,666,519,121	214,362,959	
合計		14,618,372,080	-	14,388,119,121	198,472,959	

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2023年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	2,357,935,679	-	2,351,059,683	6,875,996	
	アメリカドル	1,138,891,090	-	1,132,242,465	6,648,625	
	カナダドル	594,329,958	-	590,763,292	3,566,666	
	スウェーデンクローナ	526,346,380	-	529,685,365	3,338,985	
	オーストラリアドル	98,368,251	-	98,368,561	310	

	売建	4,085,855,668	-	4,097,939,186	12,083,518
	ユーロ	811,721,586	-	810,159,358	1,562,228
	イギリスポンド	692,775,469	-	693,493,362	717,893
	スイスフラン	2,357,368,636	-	2,370,352,371	12,983,735
	ノルウェークローネ	121,506,529	-	121,451,111	55,418
	ニュージーランドドル	102,483,448	-	102,482,984	464
	合計	6,443,791,347	-	6,448,998,869	18,959,514

## (注)時価の算定方法

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

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。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第1108回国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,249,000	
	第1115回国庫短期証券	2,120,000,000	2,120,937,040	
	第1145回国庫短期証券	1,700,000,000	1,701,774,800	
	第1152回国庫短期証券	7,000,000,000	7,008,232,000	
	合計	11,820,000,000	11,831,192,840	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

## 【分散投資コア戦略ファンドA】

(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12期中間計算期間(2023年7月11日から2024年1月10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。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (2023年7月10日現在)	第12期中間計算期間 (2024年1月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,691,547,846	1,525,703,368
投資信託受益証券	11,490,926,176	10,995,358,702
親投資信託受益証券	74,727,756,164	76,841,997,344
流動資産合計	87,910,230,186	89,363,059,414
<b>資産合計</b>	<b>87,910,230,186</b>	<b>89,363,059,414</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	97,415,463	94,616,720
未払受託者報酬	23,099,293	24,161,181
未払委託者報酬	369,588,638	386,578,853
未払利息	1,410	1,022
その他未払費用	963,196	988,084
流動負債合計	491,068,000	506,345,860
<b>負債合計</b>	<b>491,068,000</b>	<b>506,345,860</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	81,087,575,188	81,731,478,733
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,331,586,998	7,125,234,821
(分配準備積立金)	5,946,356,278	5,707,403,156
元本等合計	87,419,162,186	88,856,713,554
<b>純資産合計</b>	<b>87,419,162,186</b>	<b>88,856,713,554</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>87,910,230,186</b>	<b>89,363,059,414</b>

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日	第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,656	8,637
有価証券売買等損益	1,793,584,086	1,159,460,655
営業収益合計	1,793,582,430	1,159,469,292
<b>営業費用</b>		
支払利息	421,835	294,741
受託者報酬	23,140,429	24,161,181
委託者報酬	370,246,802	386,578,853
その他費用	979,882	988,159
営業費用合計	394,788,948	412,022,934
営業利益又は営業損失（ ）	2,188,371,378	747,446,358
経常利益又は経常損失（ ）	2,188,371,378	747,446,358
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,188,371,378	747,446,358
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（ ）	23,579,981	13,515,525
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,883,126,429	6,331,586,998
剰余金増加額又は欠損金減少額	267,747,013	292,925,194
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	267,747,013	292,925,194
剰余金減少額又は欠損金増加額	179,501,536	260,239,254
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	179,501,536	260,239,254
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,806,580,509	7,125,234,821

## （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	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。  (2)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11期 (2023年 7月10日現在)	第12期中間計算期間 (2024年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	81,087,575,188口	81,731,478,733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 (1万口当たり純資産額) 1.0781円 (10,781円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0872円 (10,872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12期中間計算期間 (2024年 1月10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11期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日	第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	77,480,101,954円	81,087,575,188円
期中追加設定元本額	9,056,644,310円	3,981,346,466円
期中一部解約元本額	5,449,171,076円	3,337,442,921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。

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

(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12期中間計算期間(2023年7月11日から2024年1月10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。

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (2023年7月10日現在)	第12期中間計算期間 (2024年1月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,328,847,911	3,689,836,145
投資信託受益証券	27,393,031,393	26,945,492,258
親投資信託受益証券	163,999,236,670	171,422,261,635
未収入金	400,000,000	-
流動資産合計	195,121,115,974	202,057,590,038
資産合計	195,121,115,974	202,057,590,038
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	243,540,244	200,196,960
未払受託者報酬	50,333,942	54,195,056
未払委託者報酬	805,343,022	867,120,841
未払利息	2,775	2,471
その他未払費用	1,235,539	1,288,408
流動負債合計	1,100,455,522	1,122,803,736
負債合計	1,100,455,522	1,122,803,736
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	150,743,580,465	152,444,641,382
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	43,277,079,987	48,490,144,920
(分配準備積立金)	22,355,544,166	21,487,781,057
元本等合計	194,020,660,452	200,934,786,302
純資産合計	194,020,660,452	200,934,786,302
負債純資産合計	195,121,115,974	202,057,590,038



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日	第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	3,597	13,726
有価証券売買等損益	2,191,835,097	5,641,755,830
営業収益合計	2,191,831,500	5,641,769,556
<b>営業費用</b>		
支払利息	973,488	659,375
受託者報酬	49,868,751	54,195,056
委託者報酬	797,899,982	867,120,841
その他費用	1,247,160	1,288,598
営業費用合計	849,989,381	923,263,870
営業利益又は営業損失（ ）	3,041,820,881	4,718,505,686
経常利益又は経常損失（ ）	3,041,820,881	4,718,505,686
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,041,820,881	4,718,505,686
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（ ）	31,534,023	47,970,813
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	34,176,264,035	43,277,079,987
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,994,402,739	2,263,726,842
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,994,402,739	2,263,726,842
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,287,087,210	1,721,196,782
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,287,087,210	1,721,196,782
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	31,873,292,706	48,490,144,920

## （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	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。  (2)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11期 (2023年 7月10日現在)	第12期中間計算期間 (2024年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	150,743,580,465口	152,444,641,382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) 1.2871円 (12,871円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3181円 (13,181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12期中間計算期間 (2024年 1月10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11期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日	第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	143,734,318,300円	150,743,580,465円
期中追加設定元本額	20,898,235,211円	7,694,151,096円
期中一部解約元本額	13,888,973,046円	5,993,090,179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

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,180,500,784
株式	605,974,738,150
派生商品評価勘定	283,918,850
未収入金	27,012,250
未収配当金	845,885,359
差入委託証拠金	413,334,617
流動資産合計	613,725,390,010
資産合計	613,725,390,010
負債の部	
流動負債	
前受金	284,014,000
未払解約金	567,555,992
未払利息	4,140
流動負債合計	851,574,132
負債合計	851,574,132
純資産の部	
元本等	
元本	244,052,800,164
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	368,821,015,714
元本等合計	612,873,815,878
純資産合計	612,873,815,878
負債純資産合計	613,725,390,010

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10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）

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	244,052,800,164口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.5112円 (1万口当たり純資産額) (25,112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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	246,129,288,443円
期中追加設定元本額	12,300,773,961円
期中一部解約元本額	14,377,262,240円
期末元本額	244,052,800,164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）	307,732,523円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,372,075,405円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,521,140円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,941,751,493円
世界経済インデックスファンド	5,249,636,735円
日本株式インデックス・オープン	2,950,685,953円
DCマイセレクション25	5,355,262,304円
DCマイセレクション50	17,284,525,979円
DCマイセレクション75	18,743,694,219円
DC日本株式インデックス・オープン	6,000,350,525円
DCマイセレクションS25	3,184,777,989円
DCマイセレクションS50	9,614,853,344円
DCマイセレクションS75	8,391,556,909円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,228,674,473円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	91,280,837円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	623,708,921円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	489,438,747円
DC世界経済インデックスファンド	3,837,478,962円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	846,796,389円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,504,090円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,124,653円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,731,768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）	145,949,939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）	14,958,010円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	67,375,820円

区分	2024年 1月10日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,174,102円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	43,300,165円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	494,464,250円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	316,660,474円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,126,420,812円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	29,840,484円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,449,949円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	328,538,832円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	181,936,971円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	244,956,359円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	19,486,404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）	419,338,186円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,526,183,279円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,913,206,995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）	612,590,224円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	411,381,794円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,206,404,459円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	195,540,810円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,661,630円
SMT インデックスバランス・オープン	46,876,980円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,888,144,852円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,816,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,960,783円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	220,826,701円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	38,230,620円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,169,183円
グローバル経済コア	221,177,947円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,323,610円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,348,016,714円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,463,819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	54,691,818円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	53,045,008円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,116,884円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	27,494,174円
10資産分散投資ファンド	92,963,462円
グローバル10資産バランスファンド	7,464,529円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340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）	41,893,581,637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）	487,748,253円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,624,599円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	20,763,677円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	346,365,787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）	47,159,071,288円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,619,274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）	213,615,827円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,521,916,000	-	7,805,930,000	284,014,000

合計	7,521,916,000	-	7,805,930,000	284,014,000
----	---------------	---	---------------	-------------

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,315,939
株式	5,159,853,970
派生商品評価勘定	1,062,332
未収配当金	11,568,750
差入委託証拠金	1,617,774
流動資産合計	5,189,418,765
資産合計	5,189,418,765
負債の部	
流動負債	
前受金	1,063,300
未払利息	10
流動負債合計	1,063,310
負債合計	1,063,310
純資産の部	
元本等	
元本	3,331,130,739
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,857,224,716
元本等合計	5,188,355,455
純資産合計	5,188,355,455
負債純資産合計	5,189,418,765

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 1月10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

	2024年 1月10日現在
	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）

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,331,130,739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)
	1.5575円 (15,575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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	3,229,512,028円
期中追加設定元本額	101,618,711円
期中一部解約元本額	- 円
期末元本額	3,331,130,739円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	778,057,240円
分散投資コア戦略ファンドS	2,553,073,499円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

(2024年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	25,853,700	-	26,917,000	1,063,300
合計		25,853,700	-	26,917,000	1,063,300

(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。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,043,228,591
国債証券	551,100,801,670
地方債証券	33,200,281,486
特殊債券	36,932,361,464
社債券	29,540,555,000
未収入金	173,766,220
未収利息	1,020,523,233
前払費用	37,349,705
流動資産合計	653,048,867,369
資産合計	653,048,867,369
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	495,113,900
未払解約金	508,100,019
未払利息	698
流動負債合計	1,003,214,617
負債合計	1,003,214,617
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	484,135,744,291
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	167,909,908,461
元本等合計	652,045,652,752
純資産合計	652,045,652,752
負債純資産合計	653,048,867,369

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、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）



2024年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	484,135,744,291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 99,875,000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 1.3468円 (1万口当たり純資産額) (13,468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

2024年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	475,920,984,466円
期中追加設定元本額	22,826,718,863円
期中一部解約元本額	14,611,959,038円
期末元本額	484,135,744,291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
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,230,184,671円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,079,203円
SMT 国内債券インデックス・オープン	17,395,534,950円
世界経済インデックスファンド	6,395,329,771円
DCマイセレクション25	28,555,485,219円
DCマイセレクション50	34,693,857,870円
DCマイセレクション75	11,009,091,471円
DC日本債券インデックス・オープン	406,416,872円
DC日本債券インデックス・オープンS	89,434,702,625円
DC日本債券インデックス・オープンP	63,467,418,706円
DCマイセレクションS25	16,614,232,185円
DCマイセレクションS50	19,426,465,853円
DCマイセレクションS75	4,926,359,344円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	474,709,722円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,804,338,211円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,114,795,106円
DC世界経済インデックスファンド	4,613,712,748円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,110,023円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	19,928,786円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	7,880,588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)	54,602,274円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	99,348,956円

区分	2024年 1月10日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	28,004,800円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	21,865,148円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,082,404,896円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	720,676,728円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,073,933,139円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	64,578,191円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	49,386,040円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	890,072,388円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	989,581,466円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,318,127,829円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	92,837,307円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,756,787,622円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,683,314,125円
分散投資コア戦略ファンドA	18,370,222,201円
分散投資コア戦略ファンドS	25,852,152,181円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	298,007,182円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,829,088,118円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	92,024,305円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,826,763円
SMT インデックスバランス・オープン	66,879,951円
SMT 世界経済インデックス・オープン	48,166,701円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	107,748,859円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	172,688,446円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,945,210円
グローバル経済コア	243,925,315円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	42,350,110円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	34,082,812円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	136,273,601円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	77,288,194円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,139,861円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	16,299,922円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	760,137,921円
10資産分散投資ファンド	324,082,693円
グローバル10資産バランスファンド	93,423,459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）	94,427,618,021円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	37,784,815円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,807,583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）	468,294,210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（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,136,433,429
コール・ローン	536,962,937
国債証券	71,042,360,780
派生商品評価勘定	3,613,878
未収入金	756,446,389
未収利息	500,826,619
前払費用	47,724,407
差入委託証拠金	41,248,171
流動資産合計	75,065,616,610
資産合計	75,065,616,610

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,279,509,440
前受金	589,974
未払金	2,761,714,804
未払解約金	897,109
未払利息	359
流動負債合計	4,042,711,686
負債合計	4,042,711,686
純資産の部	
元本等	
元本	84,699,033,397
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,676,128,473
元本等合計	71,022,904,924
純資産合計	71,022,904,924
負債純資産合計	75,065,616,610

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10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。 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）

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	84,699,033,397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 13,676,128,473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 0.8385円 (1万口当たり純資産額) (8,385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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	81,289,584,930円
期中追加設定元本額	6,902,374,906円
期中一部解約元本額	3,492,926,439円
期末元本額	84,699,033,397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	1,232,999,502円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	561,560,470円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	124,846,624円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	30,851,498円
10資産分散投資ファンド	517,831,059円
グローバル10資産バランスファンド	21,521,366円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	8,295,048,291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

(2024年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	債券先物取引 買建				
		393,509,268	-	394,099,242	589,974
合計		393,509,268	-	394,099,242	589,974

## (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

(2024年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)		
			(円)			
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建	70,962,797,148	-	72,239,282,684	1,276,485,536	
	アメリカドル	33,286,134,941	-	34,100,067,144	813,932,203	
	カナダドル	1,453,695,142	-	1,472,376,665	18,681,523	
	メキシコペソ	614,055,235	-	628,968,071	14,912,836	
	ユーロ	23,282,823,932	-	23,550,797,254	267,973,322	
	イギリスポンド	3,800,892,680	-	3,882,294,065	81,401,385	
	スウェーデンク ローナ	150,991,884	-	150,645,042	346,842	
	ノルウェークロー ネ	128,121,056	-	129,348,401	1,227,345	
	デンマーククロー ネ	198,744,750	-	200,966,800	2,222,050	
	ポーランドズロチ	375,854,172	-	379,851,724	3,997,552	
	オーストラリアド ル	1,008,692,488	-	1,011,232,034	2,539,546	
	ニュージーランド ドル	176,680,350	-	177,862,212	1,181,862	
	シンガポールドル	301,069,484	-	305,388,350	4,318,866	
	マレーシアリン ギット	360,408,430	-	364,040,476	3,632,046	
	イスラエルシェケ ル	228,120,053	-	226,758,568	1,361,485	
	オフショア人民元	5,596,512,551	-	5,658,685,878	62,173,327	
	合計		70,962,797,148	-	72,239,282,684	1,276,485,536

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,223,756,734
コール・ローン	523,514,250
株式	616,595,059,312
投資信託受益証券	124,095,710
投資証券	12,692,305,404
派生商品評価勘定	202,838,534
未収入金	2
未収配当金	574,381,163
差入委託証拠金	5,097,282,778
流動資産合計	642,033,233,887
資産合計	642,033,233,887
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,947,432
前受金	176,186,253
未払解約金	365,345,324
未払利息	350
流動負債合計	567,479,359
負債合計	567,479,359
純資産の部	
元本等	
元本	116,102,138,625
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	525,363,615,903
元本等合計	641,465,754,528
純資産合計	641,465,754,528
負債純資産合計	642,033,233,887

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10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（金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券</p>

2024年 1月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,102,138,625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 5.5250円 (1万口当たり純資産額) (55,250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

2024年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。

	2024年 1月10日現在
--	---------------

## （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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	115,556,915,905円
期中追加設定元本額	6,690,164,658円
期中一部解約元本額	6,144,941,938円
期末元本額	116,102,138,625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）	1,543,547,194円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,755,896円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,327,670,454円
世界経済インデックスファンド	13,098,834,342円
外国株式インデックス・オープン	883,796,976円
D Cマイセクション25	638,212,510円
D Cマイセクション50	3,471,618,382円
D Cマイセクション75	4,314,538,701円
D C外国株式インデックス・オープン	12,800,838,733円
D CマイセクションS25	404,444,608円
D CマイセクションS50	1,915,489,329円
D CマイセクションS75	1,917,828,282円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	20,670,015円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	141,199,056円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	110,807,860円
D C世界経済インデックスファンド	9,516,896,554円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	981,392,899円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,991,576円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,927,777円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	21,870,247円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	6,815,478円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	31,698,226円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	7,179,167円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	19,214,922円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	154,636,052円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	129,367,643円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	977,202,607円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	65,665,256円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	16,436,629円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	112,073,636円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	36,645,152円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	784,470,399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）	826,196,566円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,179,852,342円
コア投資戦略ファンド（安定型）	127,534,818円
コア投資戦略ファンド（成長型）	300,506,762円
分散投資コア戦略ファンドA	1,570,591,910円
分散投資コア戦略ファンドS	7,247,527,069円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,504,255,012円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,025,254,442円
コア投資戦略ファンド（切替型）	136,289,740円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	467,233,637円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,402,772円
S M T インデックスバランス・オープン	116,183,508円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	76,270,162円
外国株式S M T Bセクション（SMA専用）	5,162,545,562円



区分	2024年 1月10日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	255,290,082円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,047,113,165円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	184,884,574円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,496,331円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,401,125,753円
グローバル経済コア	545,109,309円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,057,776円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,919,511円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	124,430,320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	148,551,061円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	143,235,739円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	63,153,289円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	74,696,983円
10資産分散投資ファンド	51,501,891円
グローバル10資産バランスファンド	3,362,626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）	54,746,482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）	202,281,089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）	624,553,312円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,440,791,018円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	98,456,911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）	84,028,319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）	82,557,494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

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,691,600,462	-	11,867,786,715	176,186,253
合計		11,691,600,462	-	11,867,786,715	176,186,253

## （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

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	138,172,800	-	138,880,704	707,904

	アメリカドル	138,172,800	-	138,880,704	707,904
	売建	94,016,000	-	94,019,055	3,055
	アメリカドル	94,016,000	-	94,019,055	3,055
	合計	232,188,800	-	232,899,759	704,849

## (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。

## 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

2024年 1月10日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	487,444,340
コール・ローン	5,832,473
株式	17,115,544,661
投資信託受益証券	27,344,823
投資証券	60,470,140
派生商品評価勘定	9,994,892
未収配当金	16,396,557
差入委託証拠金	117,740,351
流動資産合計	17,840,768,237
資産合計	17,840,768,237
負債の部	
流動負債	
前受金	9,994,892
未払利息	3
流動負債合計	9,994,895
負債合計	9,994,895
純資産の部	
元本等	
元本	9,026,265,721
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,804,507,621
元本等合計	17,830,773,342
純資産合計	17,830,773,342
負債純資産合計	17,840,768,237

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 1月10日現在	
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  (2)新株予約権証券

2024年 1月10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（金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,026,265,721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) 1.9754円 (19,754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

2024年 1月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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>

	2024年 1月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	10,057,036,381円
期中追加設定元本額	48,725,456円
期中一部解約元本額	1,079,496,116円
期末元本額	9,026,265,721円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,247,748,012円
分散投資コア戦略ファンドS	5,678,114,753円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	2,100,402,956円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	397,666,820	-	407,661,712	9,994,892
合計		397,666,820	-	407,661,712	9,994,892

## (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。

- 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。
- 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。
- 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。

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
預金	1,928,084,822
コール・ローン	2,177,478,014
国債証券	298,031,191,517
派生商品評価勘定	23,217,902
未収入金	183,732
未収利息	2,194,849,297
前払金	9,709,976
前払費用	199,673,307
差入委託証拠金	240,348,180
流動資産合計	304,804,736,747
資産合計	304,804,736,747
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,692,933
未払金	1,451,240,666
未払解約金	132,284,419
未払利息	1,458
流動負債合計	1,599,219,476
負債合計	1,599,219,476
純資産の部	
元本等	
元本	89,212,965,941
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	213,992,551,330
元本等合計	303,205,517,271
純資産合計	303,205,517,271
負債純資産合計	304,804,736,747

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10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。 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>

	2024年 1月10日現在
	(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)

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	89,212,965,941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 3.3987円 (1万口当たり純資産額) (33,987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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引 のリスクの大きさを示すものではありません。

## (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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年 7月11日
期首元本額		86,522,070,708円
期中追加設定元本額		6,617,520,265円
期中一部解約元本額		3,926,625,032円
期末元本額		89,212,965,941円
期末元本額の内訳		
外国債券オープン（毎月決算型）		1,135,980,167円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）		511,634,254円
財産四分法ファンド（毎月決算型）		338,394,891円
SBI資産設計オープン（資産成長型）		2,413,313,731円
SBI資産設計オープン（分配型）		8,791,077円
SMT グローバル債券インデックス・オープン		8,657,738,338円
世界経済インデックスファンド		19,297,072,124円
DCマイセレクション25		1,960,628,530円
DCマイセレクション50		1,765,979,085円
DCマイセレクション75		1,372,638,967円
DC外国債券インデックス・オープン		2,250,893,389円
DCマイセレクションS25		1,061,425,783円
DCマイセレクションS50		971,158,780円
DCマイセレクションS75		547,219,754円
DCターゲット・イヤー ファンド2025		16,145,034円
DCターゲット・イヤー ファンド2035		100,392,609円

区分	2024年 1月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	54,146,340円
DC世界経済インデックスファンド	14,016,977,635円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	666,167,727円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,028,294円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	940,568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）	15,953,582円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,552,120円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	49,320,829円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,345,956円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	49,382,939円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	819,478,023円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	376,289,717円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,532,206,222円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	53,180,661円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	31,056,146円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	356,154,717円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	131,348,565円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	176,683,249円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	640,045,294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）	1,500,904,192円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	628,988,584円
外国債券ファンド・シリーズ1	780,773,819円
分散投資コア戦略ファンドA	518,368,608円
分散投資コア戦略ファンドS	1,368,649,263円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	719,749,703円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,446,013,758円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	226,484,144円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,493,736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）	1,341,615,655円
SMT インデックスバランス・オープン	165,331,326円
SMT 世界経済インデックス・オープン	374,470,320円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	500,751,898円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	802,176,612円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,761,949円
グローバル経済コア	807,950,551円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,245,069円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,569,587円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	55,504,820円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	75,925,709円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	37,904,308円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	49,101,200円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	450,280,127円
10資産分散投資ファンド	26,154,155円
グローバル10資産バランスファンド	5,350,579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）	12,251,075,268円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	179,614,536円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	49,614,561円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	123,718,945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）	129,757,862円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2024年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,875,270,416	-	1,865,560,440	9,709,976
合計		1,875,270,416	-	1,865,560,440	9,709,976

(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。

- 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。
- 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。
- 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

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,027,272,353	-	2,044,507,298	17,234,945
	アメリカドル	992,384,214	-	1,003,205,454	10,821,240
	カナダドル	83,616,131	-	84,238,596	622,465
	ユーロ	652,441,964	-	656,061,465	3,619,501
	イギリスポンド	118,136,814	-	119,466,165	1,329,351
	オフショア人民元	180,693,230	-	181,535,618	842,388
合計		2,027,272,353	-	2,044,507,298	17,234,945

### (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

	2024年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,381,752,166
コール・ローン	173,768,052
株式	159,759,287,222
投資信託受益証券	516,968,842
投資証券	179,833,761
派生商品評価勘定	35,160,857
未収配当金	254,651,845
差入委託証拠金	1,247,389,141
流動資産合計	166,548,811,886
資産合計	166,548,811,886
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,842,120
前受金	3,950,037
未払金	2,555
未払解約金	96,055,545
未払利息	116
流動負債合計	130,850,373
負債合計	130,850,373



	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	42,594,762,792
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	123,823,198,721
元本等合計	166,417,961,513
純資産合計	166,417,961,513
負債純資産合計	166,548,811,886

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<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）

		2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		42,594,762,792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)	3.9070円 (39,070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

		2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

## （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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	41,095,182,350円
期中追加設定元本額	3,314,747,436円
期中一部解約元本額	1,815,166,994円
期末元本額	42,594,762,792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	7,600,699,446円
世界経済インデックスファンド	10,231,694,652円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,123,855,601円
DC 世界経済インデックスファンド	7,404,783,709円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	90,968,223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
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,196,610,841円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	792,515,366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）	372,294,889円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,559,147円
SMT インデックスバランス・オープン	88,957,302円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,400,016,682円
SMT 世界経済インデックス・オープン	247,612,603円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,048,139,680円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	179,024,201円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,775,939円

区分	2024年 1月10日現在
グローバル経済コア	426,516,958円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	263,984,347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
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	99,907,570円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	96,388,058円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	42,514,515円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	50,325,511円
10資産分散投資ファンド	13,165,097円
グローバル10資産バランスファンド	4,623,924円
DC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）	1,476,881,648円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	95,144,680円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	81,304,532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）	12,382,492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）	23,117,247円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,934,483,500	-	5,938,433,537	3,950,037
合計		5,934,483,500	-	5,938,433,537	3,950,037

## （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

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	71,965,000	-	72,333,700	368,700
	アメリカドル	71,965,000	-	72,333,700	368,700
合計		71,965,000	-	72,333,700	368,700

## （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

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,593,130,718
コール・ローン	1,481,572,635
国債証券	122,690,858,474
派生商品評価勘定	60,840
未収入金	1,678,183,668
未収利息	1,588,014,498
前払費用	111,802,495
流動資産合計	129,143,623,328
資産合計	129,143,623,328
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,847,304
未払金	2,682,284,980
未払解約金	37,916,343
未払利息	992
流動負債合計	2,722,049,619
負債合計	2,722,049,619
純資産の部	
元本等	
元本	57,873,516,333
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,548,057,376
元本等合計	126,421,573,709
純資産合計	126,421,573,709
負債純資産合計	129,143,623,328

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10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>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。</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>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）

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,873,516,333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 2.1844円 (1万口当たり純資産額) (21,844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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	53,714,392,724円
期中追加設定元本額	5,323,540,906円
期中一部解約元本額	1,164,417,297円
期末元本額	57,873,516,333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	5,160,915,755円
世界経済インデックスファンド	19,889,706,879円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,870,644,747円
DC世界経済インデックスファンド	14,496,365,094円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	8,844,362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）	742,195,143円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,593,035,399円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	235,294,462円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,220,080円
SMT インデックスバランス・オープン	171,998,176円
SMT 世界経済インデックス・オープン	481,298,990円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	642,630,801円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,029,178,589円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,202,323円
グローバル経済コア	836,098,283円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	97,111,711円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	83,894,556円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	35,071,533円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	39,691,937円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	174,648,315円
10資産分散投資ファンド	42,829,933円
グローバル10資産バランスファンド	8,354,133円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	234,020,558円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	159,463,292円

区分	2024年 1月10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）	22,528,561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）

## 通貨関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	556,797,074	-	555,709,770	1,087,304
	チェココルナ	45,010,000	-	45,017,000	7,000
	ポーランドズロチ	102,155,760	-	101,832,360	323,400
	ルーマニアレイ	104,975,244	-	104,926,800	48,444
	マレーシアリンギット	102,821,070	-	102,569,610	251,460
	オフショア人民元	201,835,000	-	201,364,000	471,000
	売建	288,272,000	-	288,971,160	699,160
	メキシコペソ	254,856,000	-	255,609,000	753,000
	ハンガリーフォリント	33,416,000	-	33,362,160	53,840
合計	845,069,074	-	844,680,930	1,786,464	

## (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

	2024年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,878,006,991
投資証券	114,351,579,700
派生商品評価勘定	21,202,600
未収入金	250,762,348
未収配当金	1,127,809,461
差入委託証拠金	212,949,582
流動資産合計	118,842,310,682
資産合計	118,842,310,682
負債の部	
流動負債	

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
前受金	21,267,280
未払金	272,542,827
未払解約金	337,604,022
未払利息	1,927
流動負債合計	631,416,056
負債合計	631,416,056
純資産の部	
元本等	
元本	56,169,850,329
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,041,044,297
元本等合計	118,210,894,626
純資産合計	118,210,894,626
負債純資産合計	118,842,310,682

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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）

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,169,850,329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 2.1045円 (1万口当たり純資産額) (21,045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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

2024年 1月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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る場合、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>

## （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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	64,657,212,453円
期中追加設定元本額	6,172,788,822円
期中一部解約元本額	14,660,150,946円
期末元本額	56,169,850,329円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,875,326,865円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,591,283円
SMT J-REITインデックス・オープン	17,242,939,542円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	27,123,167,347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	1,879,598,173円
コア投資戦略ファンド（切替型）	737,523,051円
SMT インデックスバランス・オープン	22,253,081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	12,226,216円
グローバル経済コア	286,306,470円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,168,332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）	559,507,264円
10資産分散投資ファンド	23,176,847円
グローバル10資産バランスファンド	8,537,615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）	345,199,684円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,591,104円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	627,179,319円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	70,914,324円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	508,588,864円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	280,360,146円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 投資証券関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,819,649,720	-	3,840,917,000	21,267,280
	合計	3,819,649,720	-	3,840,917,000	21,267,280

(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ではありません。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	407,776,807
コール・ローン	241,890,715
投資証券	109,834,664,714
派生商品評価勘定	174,172
未収入金	4,729,675,532
未収配当金	456,617,412
流動資産合計	115,670,799,352
資産合計	115,670,799,352
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	196,421
未払解約金	199,118,514
未払利息	162
流動負債合計	199,315,097
負債合計	199,315,097
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	41,523,811,942
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,947,672,313
元本等合計	115,471,484,255
純資産合計	115,471,484,255
負債純資産合計	115,670,799,352

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10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。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</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該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>

2024年 1月10日現在	
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)

2024年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,523,811,942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) 2.7808円 (27,808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

2024年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	35,682,145,567円
期中追加設定元本額	8,175,585,509円
期中一部解約元本額	2,333,919,134円
期末元本額	41,523,811,942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	53,226,984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）	1,541,388,294円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,560,446円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,435,414,052円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,962,383,097円
コア投資戦略ファンド（安定型）	456,960,323円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,244,870,344円
分散投資コア戦略ファンドA	1,006,149,778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）	563,037,443円

区分	2024年 1月10日現在
SMT インデックスバランス・オープン	104,096,247円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,092,574円
グローバル経済コア	242,001,203円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,308,483円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	416,896,905円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	106,064,560円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	179,153,327円
10資産分散投資ファンド	12,821,285円
グローバル10資産バランスファンド	6,843,850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）	1,320,062,810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）	215,320,761円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	77,018,615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）	51,202,353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

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	38,932,210	-	39,100,042	167,832
	アメリカドル	21,589,500	-	21,700,110	110,610
	ユーロ	17,342,710	-	17,399,932	57,222
	売建	4,825,762,070	-	4,825,952,151	190,081
	アメリカドル	3,760,640,000	-	3,760,762,200	122,200
	カナダドル	70,240,300	-	70,238,610	1,690
	ユーロ	185,035,500	-	185,050,008	14,508
	イギリスポンド	248,258,250	-	248,271,345	13,095
	オーストラリアドル	300,011,800	-	300,007,150	4,650
	香港ドル	87,704,220	-	87,712,278	8,058
	シンガポールドル	173,872,000	-	173,910,560	38,560
合計		4,864,694,280	-	4,865,052,193	22,249

（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。

#### ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	670,533,762
コール・ローン	114,796,183
投資信託受益証券	28,638,946,619
流動資産合計	29,424,276,564
資産合計	29,424,276,564
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	273,757,496
未払金	669,086,862
未払解約金	39,750,705
未払利息	76
流動負債合計	982,595,139
負債合計	982,595,139
純資産の部	
元本等	
元本	22,496,456,140
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,945,225,285
元本等合計	28,441,681,425
純資産合計	28,441,681,425
負債純資産合計	29,424,276,564

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,496,456,140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 1.2643円 (1万口当たり純資産額) (12,643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

	2024年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	24,854,962,097円
期中追加設定元本額	1,795,501,812円
期中一部解約元本額	4,154,007,769円
期末元本額	22,496,456,140円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,624,197,759円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,655,968,565円
分散投資コア戦略ファンドA	2,114,521,968円
分散投資コア戦略ファンドS	7,673,402,803円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,204,574,837円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	316,330,899円
グローバル経済コア	1,415,391,547円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,280,298,526円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	719,469,911円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	183,841,968円
グローバル10資産バランスファンド	14,368,671円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	571,213,355円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	652,713,959円
ファンドライプ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	70,161,372円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	28,238,167,393	-	28,511,924,889	273,757,496
	アメリカドル	28,238,167,393	-	28,511,924,889	273,757,496

合計	28,238,167,393	-	28,511,924,889	273,757,496
----	----------------	---	----------------	-------------

## (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。

## HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	10,514,725
コール・ローン	1,722,010,725
国債証券	2,801,307,600
投資信託受益証券	1,035,766,831
派生商品評価勘定	83,624,981
未収入金	197,307,013
差入委託証拠金	1,533,642,802
流動資産合計	7,384,174,677
資産合計	7,384,174,677
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	63,977,362
前受金	19,663,411
未払金	7,021,888
未払利息	1,153
流動負債合計	90,663,814
負債合計	90,663,814
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	8,178,964,186
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	885,453,323
元本等合計	7,293,510,863
純資産合計	7,293,510,863
負債純資産合計	7,384,174,677

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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> <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>

2024年 1月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引及び債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</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)

2024年 1月10日現在		
1. 計算期間の末日における受益権の総数		8,178,964,186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	885,453,323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)	0.8917円 (8,917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

2024年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。

## (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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	8,130,578,453円
期中追加設定元本額	655,539,893円
期中一部解約元本額	607,154,160円
期末元本額	8,178,964,186円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	3,497,633,373円
分散投資コア戦略ファンドS	4,681,330,813円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,423,960,047	-	3,503,242,049	79,282,002
	売建	1,518,400,118	-	1,539,020,269	20,620,151
合計		4,942,360,165	-	5,042,262,318	58,661,851

## (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。

## 債券関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	1,580,173,091	-	1,619,171,531	38,998,440
合計		1,580,173,091	-	1,619,171,531	38,998,440

## (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

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	315,507,393	-	315,486,704	20,689



	カナダドル	62,168,061	-	62,166,674	1,387
	ユーロ	224,663,448	-	224,654,749	8,699
	スウェーデンク ローナ	28,675,884	-	28,665,281	10,603
	売建	3,143,261,280	-	3,143,256,383	4,897
	アメリカドル	2,850,192,962	-	2,850,173,235	19,727
	イギリスポンド	88,564,498	-	88,568,224	3,726
	スイスフラン	204,503,820	-	204,514,924	11,104
	合計	3,458,768,673	-	3,458,743,087	15,792

## (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。

## GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

## 貸借対照表

	2024年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,644,944,064
国債証券	11,705,444,200
派生商品評価勘定	244,997,037
未収入金	135,256,481
差入委託証拠金	2,376,865,996
流動資産合計	20,107,507,778
資産合計	20,107,507,778
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	181,967,662
前受金	97,238,554
未払金	78,195,419
未払解約金	60,366
未払利息	3,781
流動負債合計	357,465,782
負債合計	357,465,782
純資産の部	
元本等	
元本	17,993,868,192
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,756,173,804
元本等合計	19,750,041,996
純資産合計	19,750,041,996
負債純資産合計	20,107,507,778

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2024年 1月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段（外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場）によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,993,868,192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 1.0976円 (1万口当たり純資産額) (10,976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

2024年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （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	2024年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 7月11日
期首元本額	18,037,415,789円
期中追加設定元本額	1,842,057,040円
期中一部解約元本額	1,885,604,637円
期末元本額	17,993,868,192円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	344,838,529円
コア投資戦略ファンド（成長型）	470,003,414円
分散投資コア戦略ファンドA	3,027,614,598円
分散投資コア戦略ファンドS	6,382,953,534円
コア投資戦略ファンド（切替型）	226,527,080円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	135,075,942円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,822,564,896円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	82,859,039円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,385,380円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標コース）（適格機関投資家専用）	201,058,139円
FOFs用GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	279,987,641円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	5,536,990,000	-	5,587,140,000	50,150,000
	売建	16,196,516,292	-	16,149,427,738	47,088,554
合計		21,733,506,292	-	21,736,567,738	97,238,554

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

（2024年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	8,228,941,935	-	8,289,672,243	60,730,308
	アメリカドル	2,634,199,232	-	2,672,371,644	38,172,412
	カナダドル	1,035,662,293	-	1,051,146,477	15,484,184
	スウェーデンクローナ	2,990,667,131	-	2,996,526,149	5,859,018
	オーストラリアドル	1,568,413,279	-	1,569,627,973	1,214,694

	売建	7,370,171,599	-	7,465,098,546	94,926,947
	ユーロ	1,525,157,251	-	1,539,452,177	14,294,926
	イギリスポンド	1,552,054,829	-	1,567,396,080	15,341,251
	スイスフラン	3,710,278,320	-	3,771,021,470	60,743,150
	ノルウェークローネ	235,516,232	-	237,200,411	1,684,179
	ニュージーランドドル	347,164,967	-	350,028,408	2,863,441
	合計	15,599,113,534	-	15,754,770,789	34,196,639

## (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】

## 【分散投資コア戦略ファンドA】

## 【純資産額計算書】

(2024年 1月31日現在)

資産総額	89,542,833,815円
負債総額	179,881,287円
純資産総額( - )	89,362,952,528円
発行済口数	81,744,766,370口
1口当たり純資産額( / )	1.0932円
(1万口当たり純資産額)	(10,932円)

## 【分散投資コア戦略ファンドS】

## 【純資産額計算書】

(2024年 1月31日現在)

資産総額	204,349,689,587円
負債総額	378,184,225円
純資産総額( - )	203,971,505,362円
発行済口数	152,536,776,124口
1口当たり純資産額( / )	1.3372円
(1万口当たり純資産額)	(13,372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

(2024年 1月31日現在)

資産総額	639,904,925,624円
負債総額	3,595,693,728円
純資産総額( - )	636,309,231,896円
発行済口数	242,788,974,268口
1口当たり純資産額( / )	2.6208円
(1万口当たり純資産額)	(26,208円)

## 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年 1月31日現在)

資産総額	4,994,312,135円
負債総額	1,835,704円
純資産総額( - )	4,992,476,431円
発行済口数	3,113,781,020口

1口当たり純資産額（ / ）	1.6033円
（1万口当たり純資産額）	（16,033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

（2024年 1月31日現在）

資産総額	659,337,383,701円
負債総額	4,245,346,222円
純資産総額（ - ）	655,092,037,479円
発行済口数	491,668,203,510口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3324円
（1万口当たり純資産額）	（13,324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

（2024年 1月31日現在）

資産総額	73,654,918,966円
負債総額	2,672,852,182円
純資産総額（ - ）	70,982,066,784円
発行済口数	85,005,338,472口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8350円
（1万口当たり純資産額）	（8,350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

（2024年 1月31日現在）

資産総額	668,779,394,058円
負債総額	685,512,268円
純資産総額（ - ）	668,093,881,790円
発行済口数	115,237,422,864口
1口当たり純資産額（ / ）	5.7975円
（1万口当たり純資産額）	（57,975円）

## 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 1月31日現在）

資産総額	18,189,863,830円
負債総額	11,523,471円
純資産総額（ - ）	18,178,340,359円
発行済口数	8,894,876,832口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0437円

（1万口当たり純資産額）	（20,437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

（2024年 1月31日現在）

資産総額	311,661,076,217円
負債総額	107,569,287円
純資産総額（ - ）	311,553,506,930円
発行済口数	90,290,831,588口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4506円
（1万口当たり純資産額）	（34,506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

（2024年 1月31日現在）

資産総額	170,283,903,931円
負債総額	187,244,823円
純資産総額（ - ）	170,096,659,108円
発行済口数	43,160,073,013口
1口当たり純資産額（ / ）	3.9411円
（1万口当たり純資産額）	（39,411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

（2024年 1月31日現在）

資産総額	129,540,217,745円
負債総額	40,976,181円
純資産総額（ - ）	129,499,241,564円
発行済口数	58,476,373,283口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2146円
（1万口当たり純資産額）	（22,146円）

## J-REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 1月31日現在）

資産総額	118,212,156,730円
負債総額	116,707,130円
純資産総額（ - ）	118,095,449,600円
発行済口数	56,428,774,488口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0928円
（1万口当たり純資産額）	（20,928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

(2024年 1月31日現在)

資産総額	109,407,935,957円
負債総額	32,856,527円
純資産総額（ - ）	109,375,079,430円
発行済口数	39,525,007,160口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7672円
（1万口当たり純資産額）	（27,672円）

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

(2024年 1月31日現在)

資産総額	29,766,356,164円
負債総額	1,135,502,444円
純資産総額（ - ）	28,630,853,720円
発行済口数	22,642,062,204口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2645円
（1万口当たり純資産額）	（12,645円）

## HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

(2024年 1月31日現在)

資産総額	7,495,081,647円
負債総額	184,079,958円
純資産総額（ - ）	7,311,001,689円
発行済口数	8,178,964,186口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8939円
（1万口当たり純資産額）	（8,939円）

## GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

## 純資産額計算書

(2024年 1月31日現在)

資産総額	20,212,814,871円
負債総額	287,081,084円
純資産総額（ - ）	19,925,733,787円
発行済口数	18,005,767,372口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1066円
（1万口当たり純資産額）	（11,066円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】



## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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

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

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

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

## 償還金

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

## 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2024年 1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ DO（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2024年 4月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2024年 1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	540	14,616,414
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	63	219,430
単体型公社債投資信託	51	176,359
合計	654	15,012,203

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。  
また、第38期事業年度の間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の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
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

株主資本				
------	--	--	--	--

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

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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

##### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリ毎に管理しております。

##### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

##### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それら的一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用してしております。

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

## (1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年3月31日）

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

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

## (2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

## 投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

## デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2. その他有価証券

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

（デリバティブ取引関係）

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	0
合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## （2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### （1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
退職給付債務の期末残高	820	911

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

## (5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報



- (1) 営業収益  
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
- (2) 有形固定資産  
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載してあります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬  
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。  
投信販売代行手数料等  
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。  
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬  
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等  
該当事項はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

前事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

### 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

#### 資産の部

##### 流動資産

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

##### 固定資産

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

##### 投資その他の資産

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

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

## 負債の部

## 流動負債

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

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		2,000
-----	--	-------

## 資本剰余金

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

資本剰余金合計		17,239
---------	--	--------

## 利益剰余金

利益準備金		500
-------	--	-----

## その他利益剰余金

別途積立金		2,100
-------	--	-------

繰越利益剰余金		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

## 評価・換算差額等

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

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

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

## 中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

## 営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

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

## 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額 等 合計	
当期首残高	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

## 注記事項

（重要な会計方針）

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

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

(2) デリバティブ

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

## （表示方法の変更）

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

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

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

## （リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （金融商品関係）

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

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

(\*1)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額1,041百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は16,243百万円であります。

(\*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は上記に含めておりません。

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

## (2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

## 投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

## デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

## (有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

## (デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (1)通貨関連

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

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## (2)株式関連

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

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)通貨関連

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

(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4月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

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。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

分散投資コア戦略ファンドSの募集・販売等の取扱いを行います。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

### 3【資本関係】

#### (1)受託会社

該当事項はありません。

#### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

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

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

**独立監査人の監査報告書**

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2023年9月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2022年7月12日から2023年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドAの2023年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2023年9月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2022年7月12日から2023年7月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドSの2023年7月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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3月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田信之

## 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」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2023年7月11日から2024年1月10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、分散投資コア戦略ファンドAの2024年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年7月11日から2024年1月10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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年3月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 山田信之

## 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」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2023年7月11日から2024年1月10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、分散投資コア戦略ファンドSの2024年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年7月11日から2024年1月10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。