

【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5月21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】	グローバル経済コア
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル経済コア

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

（６）【申込単位】

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

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

（７）【申込期間】

2024年 5月22日から2024年11月20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。

ただし、2024年11月5日受付分からは午後3時半までとします。なお、販売会社により受付時限が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

< 申込みコース >

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

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお

問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。

以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

(3) 北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とす

る旨の記載があるものをいう。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

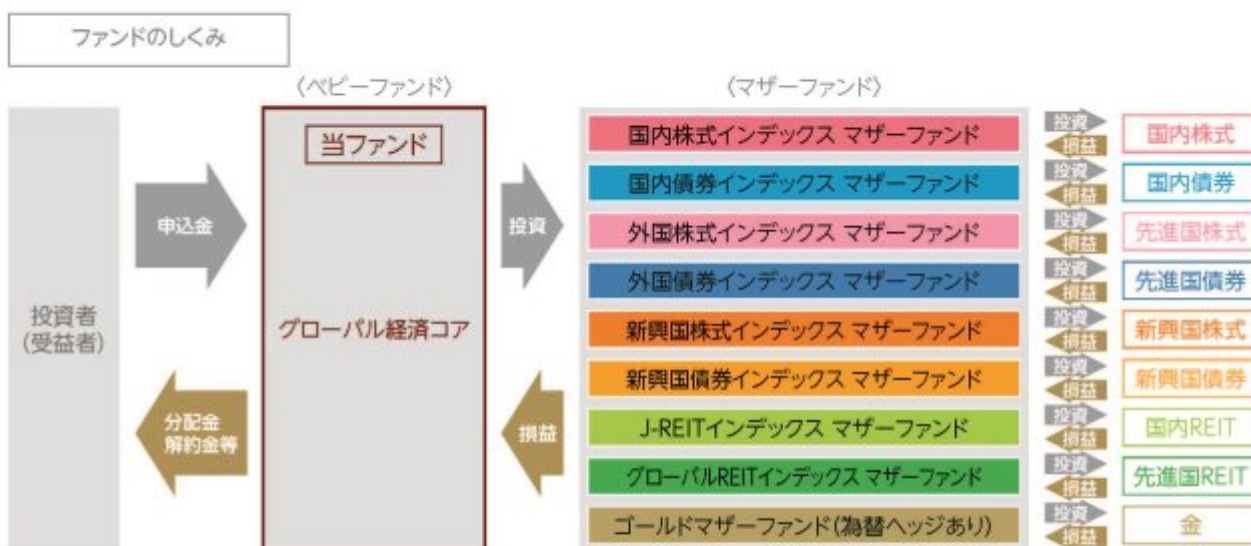
<ファンドの特色>

1. 世界の幅広い資産に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

- 日本を含む世界[※]の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。
※REITは新興国を含みません。
※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こともあります。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)[※]への連動を目指す運用を行います。

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

- 「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
※「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」は、金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券に投資を行うとともに、組入外貨建資産については対円で為替ヘッジを行います。株式などの主要資産が下落する局面では、金(為替ヘッジあり)にも投資することでリスクの低減を図ります。



? ファミリーファンド方式とは

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

? DR(預託証券)とは

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

2. 世界経済全体の発展を享受します。

- 株式及び債券を投資対象とする各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。

基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

資産	基本資産配分比率 (変動幅) ^{*1, *2}	投資するマザーファンド	各マザーファンド受益証券の 基本組入比率 ^{*2}
株式	37.5% (35.0%~40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ^{*3}
		外国株式インデックス マザーファンド	
		新興国株式インデックス マザーファンド	
債券	37.5% (35.0%~40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
		外国債券インデックス マザーファンド	
		新興国債券インデックス マザーファンド	
REIT	10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5.0%
		グローバルREITインデックス マザーファンド	5.0%
金	15.0% (10.0%~20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0%~20.0%）の通り。 ^{*4}

※1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

※2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

※4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンド受益証券へ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更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。

分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

（2）【ファンドの沿革】

2017年11月30日

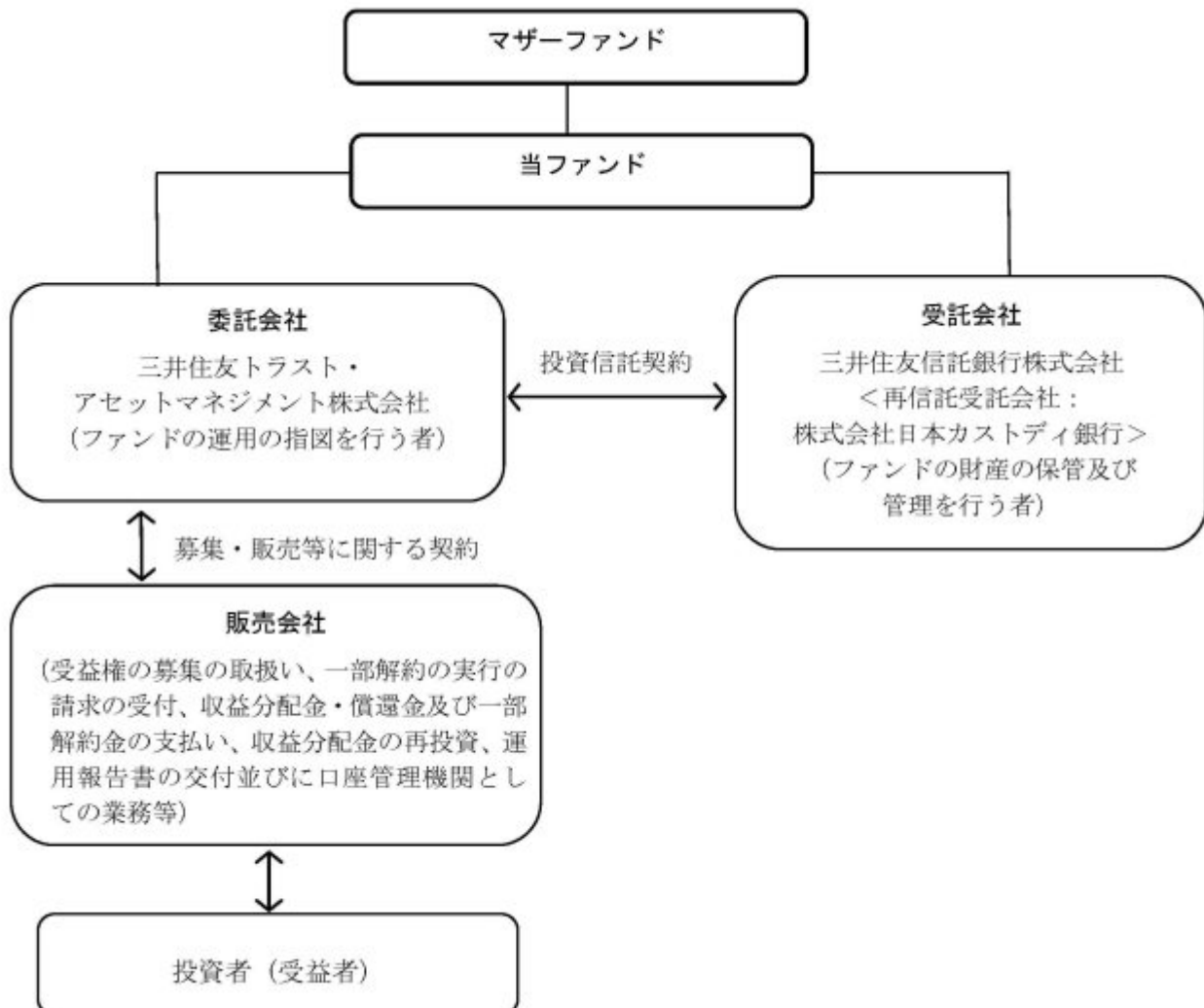
当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2023年11月22日

信託期間の延長（終了日を2027年8月20日から無期限へ変更）

(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 3月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

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

投資態度

イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券、及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券（以下「金」という場合があります。）に実質的に分散投資します。

REITは新興国を含みません。

ロ．基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、以下の通りとします。

基本資産配分比率 （変動幅） ^{1 2}	投資対象マザーファンド	各マザーファンド受益証券 の基本組入比率 ²
< 株式 > 37.5% (35.0 ~ 40.0%)	国内株式インデックス マザーファンド	地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率を参考に株式及び債券の地域別構成比（日本、先進国、新興国の比率）を定め、当該構成比及び資産配分比率に基づき各マザーファンド受益証券の基本組入比率を決定します。 ³
	外国株式インデックス マザーファンド	
	新興国株式インデックス マザーファンド	
< 債券 > 37.5% (35.0 ~ 40.0%)	国内債券インデックス マザーファンド	
	外国債券インデックス マザーファンド	
	新興国債券インデックス マザーファンド	
< REIT > 10.0%	J-REITインデックス マザーファンド	5%
	グローバルREITインデックス マザーファンド	5%
< 金 > 15.0% (10.0 ~ 20.0%)	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	基本資産配分比率で決定した比率（10.0 ~ 20.0%）の通り。 ⁴

1 基本資産配分比率の変動幅の範囲内で、市場動向等に応じて資産配分比率を決定します。

- 2 資産配分比率及びマザーファンド受益証券の基本組入比率には、一定の変動許容幅を設けます。
- 3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。
- 4 基準価額の下落抑制を目的として委託会社が必要と判断した場合には、「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の組入比率を引き下げ、その引き下げた部分をコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券及び短期金融商品で運用することがあります。

ハ。「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

ニ．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ます。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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。

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

金融商品の指図範囲

- イ．委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ロ．上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、T O P I X (東証株価指数)(配当込み)¹と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、T O P I X (東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、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が有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合²と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法

人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

※2「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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)³に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

※3 「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。

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）⁴と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

※4 「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。

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）⁵に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

※5 「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。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）⁶ に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示

する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

※6「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨債権市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）⁷の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証

券に係る取引を含みます。)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

※7「東証REIT指数」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している(上場予定を含みます。以下同じ。)不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)⁸の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

※8 「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

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 3月29日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

(2)投資態度

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）⁹（「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。

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、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

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。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

3. 運用制限

株式（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。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

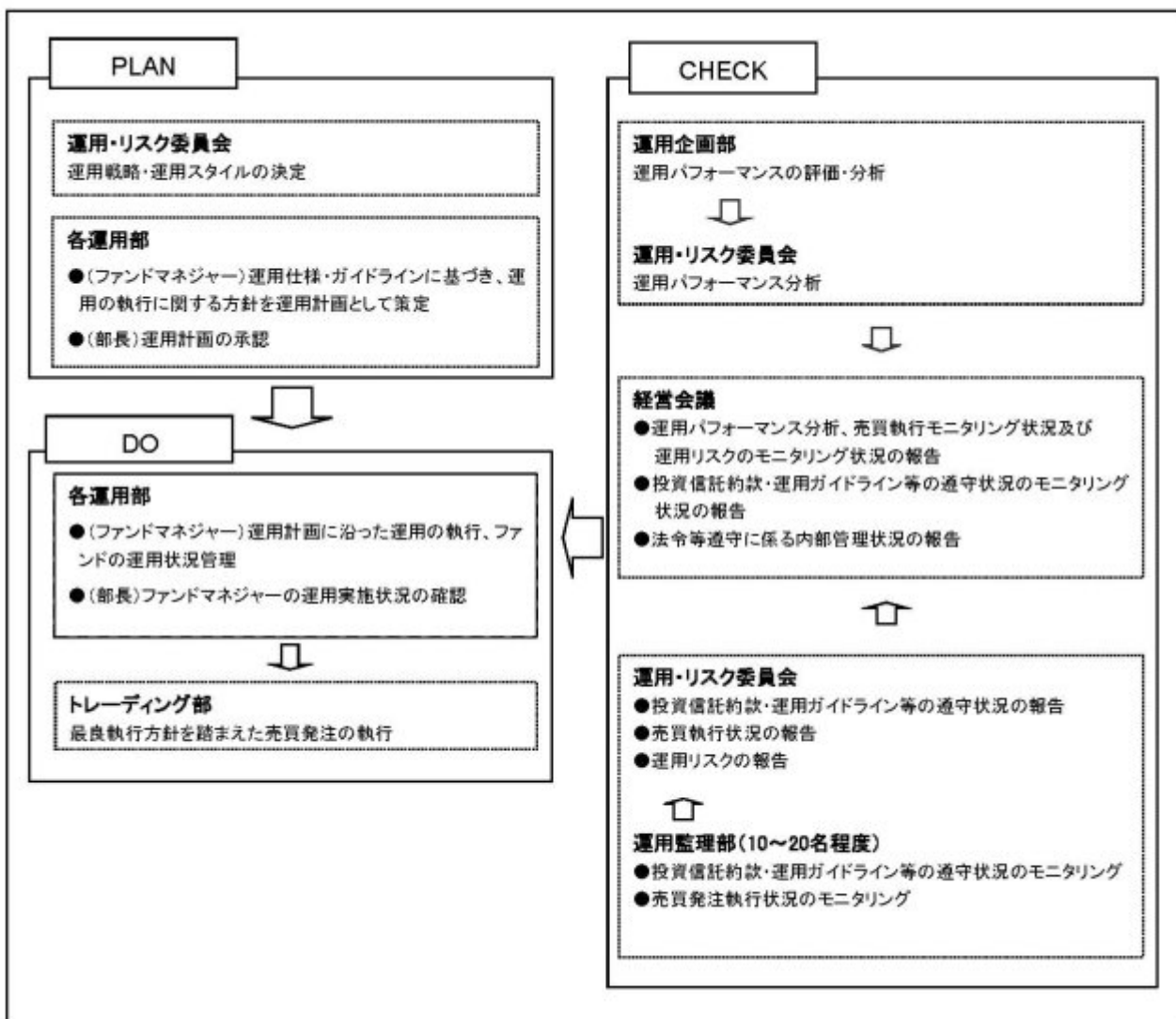
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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。

- 9 金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）とはLBMA金価格（円ヘッジベース）です（2024年3月29日現在）。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。

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券

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

へ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとしします。（以下同じ。）
- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

カ．資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開

始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

(二) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

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

金利変動リスク

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

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。

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。

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、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ます。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、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>

ファンドは中長期的な成長を目指して、市場環境等の変化や見通しに応じた運用を行うため、委託会社の判断で投資対象とする資産の投資割合を変更します。この投資割合の変更が、ファンドの収益の増加に寄与する場合がありますが、収益の減少や損失の発生の要因となる場合があります。

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年4月～2024年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPXが算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く把握するとともに、投資対象としての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、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数の知的財産及び同指数に係る権利又は商標は、株式会社JPXが所有し、同指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI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、配当利益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ＆コンサルティング株式会社公表する、国内で発行された公募定期付留債の市場全体の傾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世界債権インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界債権インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としてあり、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権の一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEIグローバル・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・ハイブリッド・インデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 2 ）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（ 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 0.605%（税抜0.55%）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 0.275% （税抜 0.25%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.275% （税抜 0.25%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及び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5月22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。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年 3月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率 ¹⁾	その他費用の比率 ²⁾
1.00%	0.94%	0.06%

※対象期間は2022年8月23日～2023年8月21日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年3月29日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	17,458,271,601	99.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		155,969,233	0.89
合計(純資産総額)		17,614,240,834	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	636,021,211	5.2368	3,330,763,774	6.3305	4,026,332,276	22.86
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	1,060,195,676	3.3237	3,523,835,132	3.5389	3,751,926,477	21.30
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	590,422,958	3.8740	2,287,315,951	4.3103	2,544,900,075	14.45
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	1,053,759,632	2.1322	2,246,882,444	2.2662	2,388,030,078	13.56
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	1,306,579,686	1.2253	1,601,002,835	1.3665	1,785,441,140	10.14
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	301,849,826	2.5905	781,954,124	2.9276	883,695,550	5.02
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	401,936,607	2.0906	840,296,895	2.1077	847,161,786	4.81
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	254,427,415	2.3582	600,011,479	2.8717	730,639,207	4.15
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	374,612,398	1.3370	500,876,169	1.3351	500,145,012	2.84

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.11

合計	99.11
----	-------

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末	(2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
第3期計算期間末	(2020年 8月20日)	11,044,987,442	11,044,987,442	10,880	10,880
第4期計算期間末	(2021年 8月20日)	10,716,800,292	10,716,800,292	12,281	12,281
第5期計算期間末	(2022年 8月22日)	11,407,002,963	11,407,002,963	12,927	12,927
第6期計算期間末	(2023年 8月21日)	12,110,129,607	12,110,129,607	13,500	13,500
	2023年 3月末日	11,200,934,042		12,658	
	4月末日	11,342,369,783		12,807	
	5月末日	11,625,123,951		13,102	
	6月末日	12,188,341,610		13,661	
	7月末日	12,271,428,755		13,750	
	8月末日	12,500,633,624		13,864	
	9月末日	12,389,610,125		13,525	
	10月末日	12,340,665,567		13,409	
	11月末日	12,899,765,737		14,036	
	12月末日	13,099,474,099		14,129	
	2024年 1月末日	14,358,584,348		14,403	
	2月末日	15,761,847,220		14,746	
	3月末日	17,614,240,834		15,214	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	0
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	0
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	0
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	8.6
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	12.9
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	5.3
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	4.4
第7期中間計算期間	2023年 8月22日～2024年 2月21日	8.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	3,287,324,947	5,855,394,358	10,151,427,698
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	1,307,931,638	2,732,701,316	8,726,658,020
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,388,526,736	1,290,690,879	8,824,493,877
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	1,225,075,777	1,078,889,688	8,970,679,966
第7期中間計算期間	2023年 8月22日～2024年 2月21日	1,995,010,848	506,736,971	10,458,953,843

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	662,742,852,480	98.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,125,463,403	1.80
合計(純資産総額)		674,868,315,883	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	11,689,400,000	1.73

(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	9,297,500	1,949.30	18,123,616,750	3,792.00	35,256,120,000	5.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,155,900	937.25	9,518,617,275	1,557.00	15,812,736,300	2.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,197,800	13,269.36	15,894,039,408	12,985.00	15,553,433,000	2.30
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	358,400	19,788.63	7,092,244,992	39,570.00	14,181,888,000	2.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,440,000	2,005.56	6,899,126,400	3,487.00	11,995,280,000	1.78
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,400	68,425.93	11,591,352,542	69,540.00	11,780,076,000	1.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	821,900	8,178.23	6,721,687,237	13,905.00	11,428,519,500	1.69
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,185,700	5,692.47	6,749,561,679	8,909.00	10,563,401,300	1.57
日本	株式	信越化学工業	化学	1,521,000	4,422.30	6,726,318,300	6,584.00	10,014,264,000	1.48
日本	株式	三井物産	卸売業	1,343,300	4,709.00	6,325,599,700	7,106.00	9,545,489,800	1.41
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	50,514,600	163.02	8,234,890,092	179.80	9,082,525,080	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	1,069,000	5,934.04	6,343,488,760	8,196.00	8,761,524,000	1.30
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,288,700	4,457.15	5,743,929,205	6,707.00	8,643,310,900	1.28
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,204,300	5,002.25	6,024,209,675	6,466.00	7,787,003,800	1.15
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,648,400	3,122.76	5,147,557,584	4,703.00	7,752,425,200	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,016,500	1,347.78	5,413,358,370	1,891.00	7,595,201,500	1.13
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	837,700	5,568.12	4,664,414,124	8,962.00	7,507,467,400	1.11
日本	株式	第一三共	医薬品	1,479,400	4,532.60	6,705,528,440	4,777.00	7,067,093,800	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,251,000	2,087.53	4,699,030,030	3,046.00	6,856,546,000	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,503,000	4,530.99	6,810,077,970	4,184.00	6,288,552,000	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	333,300	17,139.04	5,712,442,032	18,740.00	6,246,042,000	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,312,300	4,361.40	5,723,465,220	4,482.00	5,881,728,600	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,733,500	1,517.14	4,147,102,190	1,951.00	5,333,058,500	0.79
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,903,400	1,826.03	3,475,665,502	2,512.00	4,781,340,800	0.71
日本	株式	ディスコ	機械	82,300	20,724.82	1,705,652,686	57,190.00	4,706,737,000	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	921,200	5,369.65	4,946,521,580	4,849.00	4,466,898,800	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,540,600	2,752.52	4,240,532,312	2,824.00	4,350,654,400	0.64
日本	株式	S M C	機械	51,200	74,502.90	3,814,548,480	84,830.00	4,343,296,000	0.64
日本	株式	三菱重工業	機械	2,991,000	618.68	1,850,492,817	1,448.50	4,332,463,500	0.64
日本	株式	ダイキン工業	機械	204,200	26,672.84	5,446,593,928	20,600.00	4,206,520,000	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	0.33
		建設業	2.05

食料品	3.03
繊維製品	0.35
パルプ・紙	0.17
化学	5.61
医薬品	4.19
石油・石炭製品	0.51
ゴム製品	0.68
ガラス・土石製品	0.68
鉄鋼	0.92
非鉄金属	0.70
金属製品	0.51
機械	5.52
電気機器	17.09
輸送用機器	9.33
精密機器	2.17
その他製品	2.24
電気・ガス業	1.36
陸運業	2.45
海運業	0.69
空運業	0.40
倉庫・運輸関連業	0.13
情報・通信業	7.12
卸売業	7.28
小売業	4.15
銀行業	7.27
証券、商品先物取引業	0.91
保険業	2.67
その他金融業	1.17
不動産業	2.10
サービス業	4.35
小計	98.20
合計	98.20

(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	422円		11,570,873,400	11,689,400,000	1.73

(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	567,540,936,640	84.69
地方債証券	日本	33,311,138,853	4.97
特殊債券	日本	37,216,286,674	5.55
	国際機関	299,343,000	0.04
	小計	37,515,629,674	5.60
社債券	日本	29,236,699,000	4.36
	フランス	1,495,907,000	0.22
	韓国	99,638,000	0.01
	小計	30,832,244,000	4.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		900,453,012	0.13
合計(純資産総額)		670,100,402,179	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144回利付国債(5年)	6,580,000,000	100.26	6,597,521,300	100.04	6,583,158,400	0.100	2025/6/20	0.98
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	99.31	6,524,864,100	0.100	2028/3/20	0.97
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,160,000,000	100.39	6,184,604,300	98.77	6,084,232,000	0.500	2033/3/20	0.91
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	6,030,000,000	99.96	6,027,768,800	99.32	5,989,478,400	0.005	2027/6/20	0.89
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	99.61	5,946,896,100	0.005	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.44	5,926,373,000	99.79	5,887,610,000	0.100	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,860,000,000	100.78	5,905,957,400	100.41	5,884,260,400	0.400	2025/6/20	0.88
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,800,000,000	98.94	5,739,098,400	98.86	5,734,112,000	0.600	2033/12/20	0.86
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	99.70	5,733,037,500	0.100	2027/3/20	0.86
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	99.55	5,654,837,600	0.005	2026/9/20	0.84
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,760,000,000	98.38	5,667,065,000	97.21	5,599,699,200	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	5,630,000,000	98.42	5,541,226,200	97.71	5,501,410,800	0.100	2030/12/20	0.82
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,600,000,000	97.90	5,482,736,000	96.94	5,428,864,000	0.100	2031/9/20	0.81
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	5,320,000,000	100.66	5,355,261,900	101.02	5,374,370,400	0.800	2033/9/20	0.80

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	96.73	5,368,848,000	0.200	2032/9/20	0.80
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,430,000,000	98.63	5,355,718,700	97.92	5,317,164,600	0.100	2030/9/20	0.79
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	99.49	5,283,396,900	0.005	2026/12/20	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	99.44	5,131,465,200	0.100	2027/12/20	0.77
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	5,280,000,000	98.28	5,189,362,200	96.98	5,120,544,000	0.200	2032/6/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,160,000,000	100.68	5,195,152,400	99.00	5,108,761,200	0.500	2032/12/20	0.76
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	99.55	5,067,196,800	0.100	2027/9/20	0.76
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	100.26	5,033,353,200	0.300	2025/12/20	0.75
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	99.67	5,023,670,400	0.005	2026/3/20	0.75
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	100.01	5,020,702,800	0.100	2025/9/20	0.75
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	5,100,000,000	97.58	4,976,668,800	97.65	4,980,405,000	0.400	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,120,000,000	98.19	5,027,328,000	97.21	4,977,254,400	0.100	2031/6/20	0.74
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	96.66	4,907,783,590	0.100	2031/12/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	100.35	4,897,140,600	99.75	4,868,092,800	0.100	2026/12/20	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	99.22	4,797,673,800	0.100	2028/6/20	0.72
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	99.92	4,796,256,000	0.100	2025/12/20	0.72

(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	84.69
地方債証券	4.97
特殊債券	5.60
社債券	4.60
合計	99.87

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	508,343,751,082	69.66
	イギリス	26,720,308,792	3.66

	カナダ	23,684,530,877	3.25
	フランス	21,684,348,542	2.97
	スイス	20,981,676,086	2.88
	ドイツ	17,086,928,201	2.34
	オランダ	14,511,179,571	1.99
	アイルランド	13,342,313,073	1.83
	オーストラリア	12,965,647,949	1.78
	デンマーク	7,192,370,987	0.99
	スウェーデン	6,058,383,988	0.83
	スペイン	5,081,170,725	0.70
	イタリア	3,963,393,293	0.54
	香港	2,672,923,387	0.37
	シンガポール	2,046,872,772	0.28
	フィンランド	1,886,487,809	0.26
	ジャージー	1,744,686,586	0.24
	ベルギー	1,477,264,543	0.20
	イスラエル	1,454,570,974	0.20
	ノルウェー	1,165,841,810	0.16
	キュラソー	915,247,781	0.13
	バミューダ	909,248,358	0.12
	ケイマン	832,220,852	0.11
	ニュージーランド	505,459,045	0.07
	ルクセンブルク	397,537,725	0.05
	リベリア	387,884,453	0.05
	オーストリア	362,394,830	0.05
	ポルトガル	303,618,317	0.04
	パナマ	177,660,769	0.02
	マン島	75,675,242	0.01
	小計	698,931,598,419	95.77
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	69,073,238	0.01
	香港	55,620,873	0.01
	小計	124,694,111	0.02
投資証券	アメリカ	11,481,070,226	1.57
	オーストラリア	952,958,463	0.13
	フランス	281,767,135	0.04
	シンガポール	241,306,194	0.03
	イギリス	205,878,971	0.03
	香港	108,617,017	0.01
	カナダ	57,391,729	0.01
	ベルギー	55,779,833	0.01
	小計	13,384,769,568	1.83

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,351,958,806	2.38
合計(純資産総額)		729,793,020,904	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,578,843,765	1.72
	買建	カナダ	479,942,188	0.07
	買建	ドイツ	2,205,269,644	0.30
	買建	イギリス	1,023,401,791	0.14
	買建	オーストラリア	686,042,096	0.09

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

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

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		423,745,840	0.06
	売建		60,525,520	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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	545,058	50,442.24	27,493,947,267	63,701.21	34,720,856,954	4.76
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	1,133,924	26,543.68	30,098,523,851	25,963.78	29,440,960,983	4.03
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	190,578	59,227.04	11,287,372,677	136,808.01	26,072,598,759	3.57
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	717,541	18,263.07	13,104,504,524	27,311.33	19,597,003,201	2.69
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	171,346	39,940.44	6,843,635,301	73,521.66	12,597,643,691	1.73
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	456,849	18,877.79	8,624,303,504	22,852.31	10,440,055,565	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	397,755	18,983.78	7,550,895,721	23,053.68	9,169,719,114	1.26

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	62,224	65,368.23	4,067,473,322	117,790.92	7,329,422,430	1.00
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	120,209.93	4,131,254,954	200,680.32	6,896,780,836	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	222,518	20,747.71	4,616,739,445	30,327.42	6,748,397,511	0.92
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	101,297	48,767.55	4,940,007,102	63,670.93	6,449,674,520	0.88
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	29,544.64	6,535,718,184	26,616.36	5,887,938,940	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	307,151	15,902.59	4,884,497,127	17,599.89	5,405,826,393	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	71,401	73,165.85	5,224,115,163	74,902.52	5,348,115,330	0.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	122,188	34,086.93	4,165,014,206	42,255.50	5,163,115,376	0.71
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	12,515.90	3,166,886,059	19,282.84	4,879,118,734	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	56,646.97	3,674,689,242	72,914.51	4,729,964,504	0.65
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,092	110,670.19	3,440,957,560	145,642.72	4,528,323,699	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	44,285.26	3,412,932,719	58,080.87	4,476,118,871	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	181,466	22,057.40	4,002,669,745	24,566.27	4,457,943,205	0.61
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	185,343	23,347.42	4,327,281,235	23,951.54	4,439,251,742	0.61
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	195,618	16,774.71	3,281,435,984	19,978.54	3,908,163,896	0.54
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,237	77,220.61	2,643,802,165	110,927.50	3,797,825,102	0.52
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	136,294	20,882.46	2,846,154,985	27,571.76	3,757,865,594	0.51
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	124,711	19,059.49	2,376,928,157	27,327.99	3,408,101,073	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	32,540.86	2,429,565,777	45,601.66	3,404,711,423	0.47
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	205,438	18,723.07	3,846,432,109	16,078.34	3,303,102,013	0.45
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	138,024	23,306.54	3,216,862,056	23,883.41	3,296,484,251	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	347,772	7,421.77	2,581,084,839	9,110.33	3,168,321,058	0.43
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	549,785	4,277.60	2,351,763,643	5,741.46	3,156,572,545	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	4.58
		素材	3.76
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	1.57
		運輸	1.70
		自動車・自動車部品	1.60
		耐久消費財・アパレル	1.47
		消費者サービス	1.99
		メディア・娯楽	6.22
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.85
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.18
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	4.20
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
		銀行	5.42
		金融サービス	6.65
		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	9.95
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.48
電気通信サービス	1.08		
公益事業	2.45		
半導体・半導体製造装置	8.20		
不動産管理・開発	0.31		
	小計	95.77	
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.83
合計			97.62

(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 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	313	アメリカドル	81,324,949.8	12,313,410,649	83,078,025	12,578,843,765	1.72

株指 数先物 取引	カナダ モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60	買建	16	カナダド ル	4,222,812	472,152,609	4,292,480	479,942,188	0.07
	ドイツ ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	SWISS MKT IX	買建	37	スイスフ ラン	4,269,999	717,018,232	4,304,950	722,887,204	0.10
	ドイツ ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EURO STOXX	買建	180	ユーロ	8,825,281	1,440,638,870	9,081,000	1,482,382,440	0.20
	オース トラリ ア	SPI 200 FUTU	買建	35	オース トラリア ドル	6,746,520	665,274,337	6,957,125	686,042,096	0.09
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	買建	67	イギリス ポンド	5,171,161.25	988,829,454	5,351,960	1,023,401,791	0.14

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,800,000.00	423,948,000	423,745,840	0.06
	アメリカドル	売建	400,000.00	60,512,000	60,525,520	0.01

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	154,498,574,729	46.36
	中国	29,718,902,103	8.92
	フランス	26,029,119,170	7.81
	イタリア	23,745,876,092	7.13
	ドイツ	20,444,341,110	6.13
	イギリス	16,964,326,313	5.09
	スペイン	15,887,401,015	4.77
	カナダ	6,733,320,794	2.02
	ベルギー	5,771,693,815	1.73
	オランダ	4,890,319,366	1.47
	オーストラリア	4,464,220,653	1.34
	オーストリア	3,945,907,969	1.18
	メキシコ	2,870,507,316	0.86
	ポーランド	1,818,057,885	0.55
	フィンランド	1,722,661,280	0.52
	アイルランド	1,686,273,110	0.51
	マレーシア	1,609,572,076	0.48
シンガポール	1,362,707,119	0.41	

	イスラエル	1,097,287,651	0.33
	デンマーク	881,551,038	0.26
	ニュージーランド	819,569,650	0.25
	スウェーデン	631,824,081	0.19
	ノルウェー	518,563,905	0.16
	小計	328,112,578,240	98.45
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,155,675,118	1.55
合計（純資産総額）		333,268,253,358	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	948,484,317	0.28
	買建	ドイツ	865,932,698	0.26

(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		5,383,280,723	1.62
	売建		771,054,208	0.23

(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 4.375% 08/31/28	14,150,000	15,236.58	2,155,976,539	15,205.17	2,151,531,809	4.375	2028/8/31	0.65
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,340.94	2,147,732,733	15,040.15	2,105,622,192	4.125	2032/11/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,438.26	1,967,934,972	14,186.70	1,933,647,622	3.375	2033/5/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,903.98	1,793,613,458	13,582.54	1,752,147,860	2.750	2032/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,208.58	1,660,983,759	14,250.57	1,665,892,701	2.375	2027/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	14,731.46	1,642,557,905	14,788.49	1,648,917,593	3.000	2025/7/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,366.96	1,609,100,237	14,342.54	1,606,365,460	3.500	2033/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,514.82	1,574,365,526	12,370.37	1,556,193,105	1.375	2031/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,975.24	1,505,133,664	14,233.13	1,532,908,252	1.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	15,134.10	1,513,410,994	15,120.59	1,512,059,508	4.500	2026/7/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,632.40	1,492,505,483	14,798.25	1,509,422,256	3.125	2025/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,997.30	1,523,284,319	12,791.48	1,499,161,867	1.875	2032/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,115.46	1,447,797,647	12,128.76	1,449,387,902	0.625	2030/8/15	0.43

アメリカ	国債証券	T 4.625%	10/15/26	9,520,000	15,363.33	1,462,589,260	15,186.54	1,445,758,727	4.625	2026/10/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875%	05/15/28	10,060,000	14,402.61	1,448,903,509	14,331.31	1,441,729,926	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875%	05/15/32	10,100,000	14,071.66	1,421,238,354	13,749.92	1,388,741,983	2.875	2032/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.125%	08/31/30	9,200,000	14,445.42	1,328,979,326	15,047.55	1,384,374,743	4.125	2030/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.875%	11/15/30	11,150,000	12,307.68	1,372,306,450	12,258.88	1,366,865,903	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.75%	04/30/26	9,500,000	13,699.64	1,301,466,541	13,990.04	1,329,054,512	0.750	2026/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875%	11/30/25	9,000,000	14,501.38	1,305,124,865	14,688.54	1,321,968,994	2.875	2025/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.625%	02/15/53	9,550,000	14,285.08	1,364,225,664	13,299.23	1,270,077,359	3.625	2053/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.625%	12/31/27	9,600,000	13,010.90	1,249,047,336	13,217.02	1,268,834,729	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25%	09/30/28	9,500,000	13,182.42	1,252,330,738	13,288.00	1,262,360,177	1.250	2028/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875%	05/15/52	10,800,000	11,835.95	1,278,283,306	11,461.02	1,237,790,936	2.875	2052/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.125%	11/15/28	8,400,000	14,526.78	1,220,249,854	14,424.16	1,211,630,136	3.125	2028/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.875%	11/30/29	8,130,000	15,009.85	1,220,301,248	14,871.30	1,209,036,765	3.875	2029/11/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 3.875%	08/15/33	8,170,000	14,912.83	1,218,378,737	14,742.36	1,204,451,296	3.875	2033/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25%	06/30/28	9,000,000	13,216.08	1,189,447,653	13,371.09	1,203,398,993	1.250	2028/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	T 2.875%	08/15/28	8,220,000	14,167.28	1,164,550,650	14,299.96	1,175,457,097	2.875	2028/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	T 1.375%	12/31/28	8,680,000	13,265.31	1,151,429,037	13,286.22	1,153,244,546	1.375	2028/12/31	0.35

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.45
合計	98.45

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	25	アメリカドル	2,676,952.91	405,317,440	2,675,390.75	405,080,913	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	15	アメリカドル	1,661,995.17	251,642,689	1,661,953.2	251,636,334	0.08
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	16	アメリカドル	1,919,607.3	290,647,741	1,927,000	291,767,070	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	9	ユーロ	951,333.9	155,295,746	951,300	155,290,212	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	12	ユーロ	1,417,645.2	231,416,402	1,419,000	231,637,560	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	2,928,956.2	478,122,810	2,934,360	479,004,926	0.14

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	16,736,000.00	2,530,167,056	2,529,781,093	0.76
	カナダドル	買建	1,987,000.00	221,593,551	221,836,775	0.07
	ユーロ	買建	3,890,000.00	636,610,998	633,571,691	0.19
	イギリスポンド	買建	610,000.00	116,349,003	116,296,500	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	750,000.00	10,605,000	10,606,650	0.00
	ポーランドズロチ	買建	1,566,000.00	59,392,116	59,328,849	0.02
	ニュージーランドドル	買建	277,000.00	25,038,584	25,047,725	0.01
	シンガポールドル	買建	340,000.00	38,096,490	38,097,204	0.01
	イスラエルシェケル	買建	826,000.00	34,003,033	33,992,956	0.01
	オフショア人民元	買建	82,400,000.00	1,715,861,792	1,714,721,280	0.51
	メキシコペソ	売建	12,118,000.00	110,468,778	110,291,977	0.03
	ユーロ	売建	3,023,000.00	493,093,622	493,181,591	0.15
	イギリスポンド	売建	431,000.00	82,330,051	82,351,170	0.02
	ノルウェークローネ	売建	4,195,000.00	58,406,985	58,438,867	0.02
	デンマーククローネ	売建	110,000.00	2,405,260	2,405,601	0.00
	オーストラリアドル	売建	45,000.00	4,433,760	4,434,565	0.00
	マレーシアリングット	売建	625,000.00	19,954,812	19,950,437	0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	インド	32,914,906,427	17.14
	台湾	31,344,970,872	16.32
	ケイマン	26,228,719,376	13.66
	韓国	23,594,623,326	12.29
	中国	18,564,372,010	9.67
	ブラジル	9,187,970,605	4.78
	サウジアラビア	7,844,892,725	4.08
	南アフリカ	4,718,335,708	2.46
	メキシコ	4,624,420,329	2.41
	インドネシア	3,488,779,691	1.82
	タイ	2,736,419,972	1.42
	マレーシア	2,527,837,231	1.32
	アラブ首長国連邦	2,228,198,301	1.16
	ポーランド	1,651,229,058	0.86
	カタール	1,557,053,184	0.81
	クウェート	1,515,441,663	0.79

	香港	1,462,252,726	0.76
	トルコ	1,260,443,789	0.66
	フィリピン	1,145,939,415	0.60
	ギリシャ	937,098,018	0.49
	チリ	832,269,668	0.43
	バミューダ	677,057,594	0.35
	アメリカ	654,349,893	0.34
	ハンガリー	506,817,249	0.26
	チェコ	248,776,679	0.13
	ルクセンブルク	238,435,299	0.12
	イギリス	227,774,779	0.12
	エジプト	218,154,041	0.11
	コロンビア	186,609,325	0.10
	ペルー	88,794,152	0.05
	シンガポール	80,234,698	0.04
	オランダ	15,623,110	0.01
	ロシア	124	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	183,508,801,037	95.55
投資信託受益証券	ブラジル	389,795,774	0.20
	メキシコ	142,358,279	0.07
	小計	532,154,053	0.28
投資証券	メキシコ	238,292,779	0.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,769,226,235	4.05
合計(純資産総額)		192,048,474,104	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,925,571,591	4.13

(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		336,739,069	0.18
	売建		3,821,980	0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	4,160,389	2,662.80	11,078,313,841	3,635.44	15,124,875,789	7.88
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	806,665	7,931.60	6,398,148,423	9,090.00	7,332,584,850	3.82
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	1,128,100	5,919.41	6,677,695,428	5,875.49	6,628,142,525	3.45
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	2,735,288	1,580.23	4,322,398,293	1,358.63	3,716,258,012	1.94
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	506,553	4,258.26	2,157,037,175	5,447.54	2,759,469,756	1.44
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	91,166	14,532.53	1,324,873,233	20,047.50	1,827,650,385	0.95
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	101,071	16,675.35	1,685,394,859	17,601.41	1,778,992,363	0.93
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	879,852	1,723.29	1,516,244,039	2,005.40	1,764,460,040	0.92
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サー ビス	873,750	2,178.11	1,903,125,566	1,872.11	1,635,757,860	0.85
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	2,185,248	465.19	1,016,571,520	735.12	1,606,433,168	0.84
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	553,283	2,536.73	1,403,533,865	2,742.80	1,517,546,826	0.79
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	16,601,620	86.95	1,443,531,077	91.28	1,515,475,561	0.79
台湾	株式	MEDIA TEK INC	半導体・半 導体製造装 置	253,804	4,331.06	1,099,242,215	5,483.90	1,391,835,756	0.72
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	485,940	2,713.89	1,318,788,274	2,650.20	1,287,841,104	0.67
サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	324,926	2,893.79	940,270,085	3,349.76	1,088,424,443	0.57
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	152,359	6,144.36	936,148,671	7,106.89	1,082,799,644	0.56
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	141,877	6,448.53	914,898,827	7,560.00	1,072,590,120	0.56
ブラジル	株式	VALE SA	素材	581,587	2,124.66	1,235,676,350	1,834.90	1,067,157,787	0.56
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・ 娯楽	338,630	3,418.76	1,157,696,736	3,148.55	1,066,194,164	0.56
インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	86.38	809,423,381	96.72	906,218,040	0.47
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	841,481	892.38	750,927,547	1,044.89	879,262,050	0.46
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信 サービス	389,936	1,735.18	676,611,008	2,249.16	877,029,039	0.46
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	エネルギー	778,040	1,062.40	826,593,013	1,126.94	876,808,848	0.46

ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	414,161	1,953.43	809,036,510	2,086.78	864,265,377	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	54.08	726,737,738	62.46	839,397,697	0.44
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	71.80	779,143,683	76.19	826,881,102	0.43
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	30,591	25,804.42	789,383,137	26,826.82	820,659,388	0.43
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	490,774	1,412.88	693,408,165	1,644.64	807,150,478	0.42
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	379,500	2,041.39	774,710,934	1,986.21	753,769,731	0.39
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,178,000	729.29	859,106,043	639.18	752,962,286	0.39

(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	5.11
		素材	6.88
		資本財	4.70
		商業・専門サービス	0.02
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	3.73
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	2.41
		メディア・娯楽	5.69
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.70
		生活必需品流通・小売り	1.33
		食品・飲料・タバコ	3.28
		家庭用品・パーソナル用品	0.73
		ヘルスケア機器・サービス	0.99
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.33
		銀行	16.40
		金融サービス	2.54
		保険	2.44
		ソフトウェア・サービス	2.41
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9.01
電気通信サービス	2.59		
公益事業	2.63		
半導体・半導体製造装置	11.18		
不動産管理・開発	1.33		
		小計	95.55
投資信託受益証券			0.28
投資証券			0.12

合計	95.95
----	-------

(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	998	アメリカドル	52,694,802	7,978,519,971	52,345,100	7,925,571,591	4.13

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,225,286.94	336,770,977	336,739,069	0.18
	ブラジルレアル	売建	56,149.41	1,706,880	1,693,718	0.00
	カタールリアル	売建	51,160.16	2,129,797	2,128,262	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	13,835,648,069	9.94
	マレーシア	13,632,874,092	9.79
	ブラジル	13,469,484,562	9.67
	インドネシア	13,439,270,017	9.65
	中国	13,407,920,474	9.63
	タイ	12,898,569,999	9.26
	ポーランド	10,938,291,549	7.86
	南アフリカ	10,903,769,373	7.83
	チェコ	8,586,564,091	6.17
	コロンビア	6,243,835,175	4.48
	ルーマニア	5,517,225,696	3.96
	ハンガリー	4,151,048,331	2.98
	ペルー	2,997,337,621	2.15
	チリ	2,337,223,742	1.68
	ウルグアイ	291,423,079	0.21
	ドミニカ共和国	211,020,505	0.15
小計		132,861,506,375	95.42

現金・預金・その他の資産（負債控除後）		6,379,752,576	4.58
合計（純資産総額）		139,241,258,951	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		3,483,543,437	2.50

(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	62,300,000,000	3.73	2,326,718,704	3.83	2,390,266,034	9.850	2027/6/28	1.72
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000	2,974.45	2,031,550,901	3,004.59	2,052,140,759	10.000	2027/1/1	1.47
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,425.15	1,855,246,186	2,552.59	1,952,736,890	0.000	2026/1/1	1.40
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,302.88	1,796,250,005	2,430.90	1,896,107,658	0.000	2026/7/1	1.36
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	209,200,000	831.31	1,739,114,776	821.09	1,717,725,196	10.500	2026/12/21	1.23
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	51,800,000	3,205.00	1,660,192,670	3,229.75	1,673,013,345	3.885	2029/8/15	1.20
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	54,900,000	2,983.57	1,637,980,312	3,016.25	1,655,921,911	10.000	2025/1/1	1.19
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000	3.02	1,560,562,897	3.19	1,648,509,617	7.250	2034/10/18	1.18
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	220,100,000	716.22	1,576,408,587	710.95	1,564,801,390	8.000	2030/1/31	1.12
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,892.36	1,486,677,668	2,952.39	1,517,532,802	10.000	2029/1/1	1.09
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	68,000,000	2,148.82	1,461,204,368	2,190.92	1,489,830,932	0.000	2027/7/1	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	827.33	1,450,322,685	843.89	1,479,354,779	5.750	2026/3/5	1.06
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	818.03	1,440,554,249	838.61	1,476,806,523	7.750	2031/5/29	1.06
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000	3,185.83	1,369,909,023	3,212.39	1,381,330,525	3.733	2028/6/15	0.99
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	47,110,000,000	2.61	1,230,804,953	2.76	1,302,127,685	7.250	2050/10/26	0.94
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	867.41	1,210,916,549	882.82	1,232,425,740	8.500	2029/5/31	0.89
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	45,300,000	2,556.08	1,157,908,370	2,680.51	1,214,275,027	0.000	2025/7/1	0.87
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	180,500,000	674.11	1,216,778,279	667.24	1,204,377,044	8.250	2032/3/31	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	845.91	1,175,817,302	862.47	1,198,846,094	7.500	2027/6/3	0.86
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	184,000,000	652.74	1,201,048,233	638.00	1,173,922,760	8.875	2035/2/28	0.84
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000	3,223.07	1,092,623,269	3,221.68	1,092,150,962	3.955	2025/9/15	0.78

ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	31,500,000	3,322.06	1,046,451,001	3,344.89	1,053,643,352	2.750	2029/10/25	0.76
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.93	1,019,188,410	0.94	1,030,567,968	5.500	2026/4/15	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 11/07/47	130,700,000	775.92	1,014,138,203	786.47	1,027,926,753	8.000	2047/11/7	0.74
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	579.19	1,052,397,497	554.42	1,007,392,224	8.750	2048/2/28	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 05/26/33	124,000,000	800.20	992,257,212	812.36	1,007,327,847	7.500	2033/5/26	0.72
ポーランド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	25,300,000	3,960.28	1,001,952,917	3,947.92	998,824,002	6.000	2033/10/25	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000	800.28	960,338,568	819.98	983,979,576	5.500	2027/3/4	0.71
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	162,300,000	611.29	992,138,756	590.54	958,447,881	9.000	2040/1/31	0.69
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000	756.18	933,885,034	774.67	956,719,290	7.750	2042/11/13	0.69

(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	95.42
合計	95.42

(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	59,840,000.00	535,991,599	542,048,672	0.39
	チェココルナ	買建	52,640,000.00	338,873,364	338,622,592	0.24
	ハンガリーフォリント	買建	400,860,000.00	164,653,325	165,301,430	0.12
	ポーランドズロチ	買建	11,490,000.00	434,258,851	434,092,200	0.31
	マレーシアリングギット	買建	16,740,000.00	532,379,382	533,622,654	0.38
	タイバーツ	買建	122,400,000.00	507,811,843	506,013,840	0.36
	南アフリカランド	買建	54,600,000.00	432,892,883	434,310,240	0.31
	オフショア人民元	買建	25,490,000.00	528,866,664	529,531,809	0.38

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

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

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	117,365,336,300	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,925,618,489	4.03

合計(純資産総額)	122,290,954,789	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	4,907,928,000	4.01

(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	13,331	607,230.62	8,094,991,398	598,000	7,971,938,000	6.52
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	11,738	562,646.21	6,604,341,307	538,000	6,315,044,000	5.16
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	36,954	165,980.91	6,133,658,608	150,300	5,554,186,200	4.54
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	19,907	274,347.22	5,461,430,186	269,000	5,354,983,000	4.38
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	32,886	160,938.6	5,292,626,942	158,700	5,219,008,200	4.27
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	54,775	97,856.14	5,360,070,273	94,700	5,187,192,500	4.24
日本	投資証券	GLP投資法人	38,385	136,124.28	5,225,130,727	125,600	4,821,156,000	3.94
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,225	270,649.96	4,661,945,608	258,800	4,457,830,000	3.65
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	25,563	149,563.07	3,823,280,824	153,200	3,916,251,600	3.20
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	55,329	57,273.68	3,168,895,869	68,000	3,762,372,000	3.08
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,212	324,567.12	3,639,046,561	334,000	3,744,808,000	3.06
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	22,769	170,423.05	3,880,362,431	164,400	3,743,223,600	3.06
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	38,254	67,103.44	2,566,975,353	79,700	3,048,843,800	2.49
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	20,815	133,957.21	2,788,319,407	135,600	2,822,514,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	34,339	78,124.62	2,682,721,471	80,500	2,764,289,500	2.26
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,815	347,037.23	2,712,095,970	332,000	2,594,580,000	2.12
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,946	607,281.36	2,396,332,273	645,000	2,545,170,000	2.08
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,995	399,616.68	2,395,702,005	408,500	2,448,957,500	2.00
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	14,608	149,843.37	2,188,912,044	154,100	2,251,092,800	1.84
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	4,753	466,109.51	2,215,418,523	451,000	2,143,603,000	1.75
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,294	283,931.82	2,070,998,744	274,100	1,999,285,400	1.63
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,018	142,465.63	1,997,083,203	139,300	1,952,707,400	1.60
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,240	451,202.7	1,913,099,471	454,500	1,927,080,000	1.58
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,438	138,758.93	1,864,642,621	136,900	1,839,662,200	1.50
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,619	316,985.6	1,781,142,112	325,500	1,828,984,500	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	16,828	108,697.91	1,829,168,519	105,400	1,773,671,200	1.45
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	10,692	150,846.17	1,612,847,334	153,900	1,645,498,800	1.35

日本	投資証券	森トラストリート投資法人	22,027	73,098.02	1,610,130,236	72,200	1,590,349,400	1.30
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,946	376,836.26	1,486,995,914	383,000	1,511,318,000	1.24
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	11,586	127,712.08	1,479,672,251	122,700	1,421,602,200	1.16

(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	95.97
合計	95.97

(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	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	2,748	円	4,659,777,480	4,907,928,000	4.01

(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	88,587,603,605	76.88
	オーストラリア	8,754,955,696	7.60
	イギリス	5,451,668,933	4.73
	シンガポール	3,685,867,763	3.20
	フランス	2,027,278,278	1.76
	カナダ	1,694,864,780	1.47
	ベルギー	1,200,149,393	1.04
	香港	1,021,686,491	0.89
	スペイン	471,196,592	0.41
	ニュージーランド	339,163,797	0.29
	ガーンジー	332,472,065	0.29
	韓国	216,070,705	0.19
	オランダ	206,976,512	0.18
	イスラエル	131,488,912	0.11
	アイルランド	45,397,044	0.04
	ドイツ	41,433,577	0.04
	イタリア	8,373,105	0.01

	小計	114,216,647,248	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,006,191,079	0.87
合計(純資産総額)		115,222,838,327	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		70,288,862	0.06

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

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

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	513,056	15,679.38	8,044,404,002	19,716.61	10,115,725,163	8.78
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	52,151	114,785.04	5,986,154,993	124,963.21	6,516,956,641	5.66
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	306,360	12,818.37	3,927,036,018	14,147.75	4,334,304,813	3.76
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	180,443	17,254.68	3,113,486,873	23,694.15	4,275,443,671	3.71
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	87,516	37,375.55	3,270,959,377	43,917.98	3,843,526,340	3.34
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	460,323	7,611.38	3,503,693,598	8,191.28	3,770,635,044	3.27
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	167,464	19,342.62	3,239,193,772	21,809.09	3,652,238,520	3.17
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	953,707	2,219.71	2,116,954,014	3,334.00	3,179,663,048	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	116,631	17,922.40	2,090,307,632	22,257.26	2,595,887,657	2.25
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	571,213	4,265.21	2,436,348,940	4,510.50	2,576,458,464	2.24
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,564	25,199.16	1,979,747,302	28,095.63	2,207,305,830	1.92
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	161,311	8,925.61	1,439,800,607	12,144.59	1,959,056,941	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,924	8,139.80	1,554,083,481	9,555.48	1,824,371,437	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	317,636	4,727.02	1,501,471,788	5,391.71	1,712,601,229	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	87,175	14,393.91	1,254,789,912	19,518.26	1,701,504,586	1.48
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	222,165	6,377.38	1,416,832,671	6,592.39	1,464,598,635	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	68,647	17,340.98	1,190,406,755	19,468.29	1,336,440,239	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	35,839	31,537.83	1,130,284,331	37,066.68	1,328,432,820	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,157	18,160.04	1,183,253,918	19,922.52	1,298,092,144	1.13
イギリス	投資証券	SEGO PLC	740,136	1,502.12	1,111,775,343	1,728.24	1,279,137,346	1.11
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,931	2,470.81	973,330,660	3,131.15	1,233,460,517	1.07
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	394,542	2,402.49	947,884,661	2,838.93	1,120,080,079	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	372,317	2,681.71	998,447,518	2,969.15	1,105,465,058	0.96
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	121,890	8,226.10	1,002,679,975	8,545.58	1,041,620,795	0.90
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	148,838	6,811.93	1,013,874,916	6,975.45	1,038,213,322	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	103,898	9,840.13	1,022,370,440	9,750.80	1,013,089,034	0.88
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	177,285	5,220.61	925,537,050	5,568.85	987,275,310	0.86

オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,893,163	253.42	733,207,645	334.28	967,149,384	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	168,680	4,843.60	817,019,444	5,664.24	955,445,370	0.83
香港	投資証券	LINK REIT	1,418,800	764.12	1,084,138,280	650.79	923,342,271	0.80

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.13
合計	99.13

(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	230,000.00	34,824,300	34,807,694	0.03
	オーストラリアドル	買建	360,000.00	35,568,720	35,481,168	0.03

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

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

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	30,016,208,806	99.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		71,664,582	0.24
合計(純資産総額)		30,087,873,388	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		30,112,710,387	100.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	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	4,718,985	5,538.57	26,136,465,559	6,360.73	30,016,208,806	99.76

(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	99.76
合計	99.76

(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	200,133,310.39	30,132,893,159	30,112,710,387	100.08

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

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

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：2017年11月30日
作成基準日：2024年3月29日



基準価額・純資産の推移



基準価額 15,214円

純資産総額 176.14億円

分配の推移

(1万円当たり、税引前)

決算期	分配金
2019年8月	0円
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
2023年8月	0円

設定来
分配金合計額 0円

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

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	22.9%	MICROSOFT CORP APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.1%
外国債券インデックスマザーファンド	21.3%	T 4.375% 08/31/28 T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.375%	2028/08/31	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	14.4%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC SAMSUNG ELECTRONICS CO.LTD	台湾 韓国	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	1.1%
新興国債券インデックスマザーファンド	13.6%	COLOM 9.85% 06/28/27 BNTNF 10% 01/01/27	コロンビア ブラジル	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.3%
ゴールドマザーファンド (海替ヘッジあり)	10.1%	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	-	-	-	10.1%
グローバルREITインデックスマザーファンド	5.0%	PROLOGIS INC EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.4%
J-REITインデックスマザーファンド	4.8%	日本ビルファンド投資法人 ジャパコリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.3%
国内株式インデックスマザーファンド	4.1%	トヨタ自動車 三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	輸送用機器 銀行業	-	-	0.2%
国内債券インデックスマザーファンド	2.8%	第144回利付国債(5年) 第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2025/06/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、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】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

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

ただし、2024年11月5日受付分からは午後3時半までとします。なお、販売会社により受付時限が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

ただし、2024年11月5日受付分からは午後3時半までとします。なお、販売会社により受付時限が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総

額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2017年11月30日設定）

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年11月30日から2018年8月20日までとします。

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受

託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2022年8月23日から2023年8月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル経済コア】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2022年 8月22日現在)	第6期 (2023年 8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,836,855	126,480,117
親投資信託受益証券	11,295,326,745	11,989,215,183
未収入金	54,817,215	71,988,712
流動資産合計	11,472,980,815	12,187,684,012
資産合計	11,472,980,815	12,187,684,012
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,600,352	23,597,879
未払受託者報酬	3,004,538	3,155,344
未払委託者報酬	48,072,518	50,485,413
未払利息	51	298
その他未払費用	300,393	315,471
流動負債合計	65,977,852	77,554,405
負債合計	65,977,852	77,554,405
純資産の部		
元本等		
元本	8,824,493,877	8,970,679,966
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2,582,509,086	3,139,449,641
(分配準備積立金)	1,988,626,089	2,276,579,520
元本等合計	11,407,002,963	12,110,129,607
純資産合計	11,407,002,963	12,110,129,607
負債純資産合計	11,472,980,815	12,187,684,012

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	2021年 8月21日	自	2022年 8月23日
	至	2022年 8月22日	至	2023年 8月21日
営業収益				
受取利息		753		300
有価証券売買等損益		673,112,340		618,212,365
営業収益合計		673,113,093		618,212,665
営業費用				
支払利息		38,751		65,894
受託者報酬		6,020,882		6,211,943
委託者報酬		96,333,986		99,390,861
その他費用		601,964		621,073
営業費用合計		102,995,583		106,289,771
営業利益又は営業損失（ ）		570,117,510		511,922,894
経常利益又は経常損失（ ）		570,117,510		511,922,894
当期純利益又は当期純損失（ ）		570,117,510		511,922,894
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（ ）		40,087,637		3,479,329
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,990,142,272		2,582,509,086
剰余金増加額又は欠損金減少額		357,579,898		354,465,066
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		357,579,898		354,465,066
剰余金減少額又は欠損金増加額		295,242,957		312,926,734
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		295,242,957		312,926,734
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,582,509,086		3,139,449,641

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第6期計算期間は2022年 8月23日から2023年 8月21日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2022年 8月22日現在)	第6期 (2023年 8月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,824,493,877口	8,970,679,966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) 1.2927円 (12,927円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3500円 (13,500円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日			第6期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21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	206,261,243円	費用控除後の配当等収益額	A	235,805,020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	323,768,630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	279,597,203円
収益調整金額	C	593,882,997円	収益調整金額	C	862,870,121円
分配準備積立金額	D	1,458,596,216円	分配準備積立金額	D	1,761,177,297円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,582,509,086円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,139,449,641円
当ファンドの期末残存口数	F	8,824,493,877口	当ファンドの期末残存口数	F	8,970,679,966口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,926円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,499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6期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21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6期 (2023年 8月21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。

第6期 (2023年 8月21日現在)	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第5期 自 2021年 8月21日 至 2022年 8月22日	第6期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,726,658,020円	8,824,493,877円
期中追加設定元本額	1,388,526,736円	1,225,075,777円
期中一部解約元本額	1,290,690,879円	1,078,889,688円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第5期 (2022年 8月22日現在)	第6期 (2023年 8月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	641,866,199	667,120,842
合計	641,866,199	667,120,842

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	272,948,309	573,546,281	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	231,250,610	585,711,545	
	新興国株式インデックス マザーファンド	407,386,494	1,546,398,392	
	国内株式インデックス マザーファンド	212,358,180	483,666,990	
	外国株式インデックス マザーファンド	523,247,337	2,658,044,147	
	国内債券インデックス マザーファンド	232,274,903	311,039,322	
	外国債券インデックス マザーファンド	772,941,053	2,529,681,478	
	新興国債券インデックス マザーファンド	801,353,086	1,685,566,081	
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	1,334,953,683	1,615,560,947	
合計		4,788,713,655	11,989,215,183	

(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

項目	2023年 8月21日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,319,936,142
株式	548,864,109,140
派生商品評価勘定	1,271,400
未収配当金	803,318,855
前払金	44,164,100
差入委託証拠金	117,004,900
流動資産合計	552,149,804,537
資産合計	
552,149,804,537	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,482,800
未払解約金	98,866,435
未払利息	5,478
流動負債合計	144,354,713
負債合計	
144,354,713	
純資産の部	
元本等	
元本	242,361,014,552
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	309,644,435,272
元本等合計	552,005,449,824
純資産合計	
552,005,449,824	
負債純資産合計	
552,149,804,537	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月21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。

2023年 8月21日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,361,014,552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) 2.2776円 (22,776円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	263,601,210,392円
期中追加設定元本額	20,446,408,422円
期中一部解約元本額	41,686,604,262円
期末元本額	242,361,014,552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）	333,390,586円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,485,706,546円
SBI資産設計オープン（分配型）	11,982,129円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,125,630,515円
世界経済インデックスファンド	4,875,252,891円
日本株式インデックス・オープン	3,024,800,245円
DCマイセクション25	5,506,283,905円
DCマイセクション50	17,722,537,263円
DCマイセクション75	18,524,505,460円
DC日本株式インデックス・オープン	6,038,471,246円
DCマイセクションS25	3,230,130,220円
DCマイセクションS50	9,500,544,846円
DCマイセクションS75	8,090,944,467円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,032,507,311円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	131,436,799円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	683,094,682円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	520,978,697円
DC世界経済インデックスファンド	3,713,983,838円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	920,483,452円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,668,401円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,059,381円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	158,858,976円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,072,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,934,767円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	74,963,432円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,846,659円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	48,815,045円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	595,259,946円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	331,838,347円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,240,174,569円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	31,095,300円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	13,271,382円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	348,598,556円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	198,214,876円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	260,050,409円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	21,623,051円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	445,696,595円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,635,142,630円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,315,868円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,241,824,743円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドA	1,593,061,162円
分散投資コア戦略ファンドS	6,059,257,110円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	570,979,842円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	400,879,196円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,233,511円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,632,253円
SMT インデックスバランス・オープン	50,642,898円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	18,946,859,455円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,794,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,744,795円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	203,744,292円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,909,159円

区分	2023年 8月21日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,597,469円
グローバル経済コア	212,358,180円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,451,952円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	965,307,224円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	28,618,283円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	980,337,953円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	226,289,632円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	55,849,253円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	50,071,301円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,889,317円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	21,871,090円
10資産分散投資ファンド	93,091,386円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,399,406,509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）	524,842,063円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	294,694,010円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,880,557円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	614,567,203円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	46,062,668,214円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,378,750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）	203,861,467円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	19,505,058,853
合計	19,505,058,853

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 8月21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	3,178,764,100	-	3,134,600,000	44,164,100
合計		3,178,764,100	-	3,134,600,000	44,164,100

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,100	3,755.00	34,170,500	
ニッセイ	241,400	762.50	184,067,500	

マルハニチロ	35,800	2,465.00	88,247,000
雪国まいたけ	20,600	880.00	18,128,000
カネコ種苗	7,400	1,381.00	10,219,400
サカタのタネ	27,500	3,980.00	109,450,000
ホクト	21,500	1,814.00	39,001,000
ホクリヨウ	2,300	908.00	2,088,400
住石ホールディングス	25,000	356.00	8,900,000
日鉄鉱業	9,700	4,485.00	43,504,500
三井松島ホールディングス	10,900	2,639.00	28,765,100
I N P E X	892,800	1,979.50	1,767,297,600
石油資源開発	28,000	4,675.00	130,900,000
K & O エナジーグループ	10,900	2,313.00	25,211,700
ショーボンドホールディングス	32,900	5,849.00	192,432,100
ミライト・ワン	79,800	1,869.50	149,186,100
タマホーム	15,200	3,450.00	52,440,000
サンヨーホームズ	1,900	723.00	1,373,700
日本アクア	6,700	986.00	6,606,200
ファーストコーポレーション	4,100	733.00	3,005,300
ベステラ	3,500	1,126.00	3,941,000
Robot Home	46,900	191.00	8,957,900
キャンディル	2,900	601.00	1,742,900
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,246.00	4,111,800
第一カッター興業	6,200	1,211.00	7,508,200
安藤・間	139,900	1,148.00	160,605,200
東急建設	68,700	749.00	51,456,300
コムシスホールディングス	77,100	3,047.00	234,923,700
ビーアールホールディングス	38,300	375.00	14,362,500
高松コンストラクショングループ	15,700	2,541.00	39,893,700
東建コーポレーション	6,900	7,390.00	50,991,000
ソネック	1,700	974.00	1,655,800
ヤマウラ	12,200	1,186.00	14,469,200
オリエンタル白石	86,800	309.00	26,821,200
大成建設	158,000	4,796.00	757,768,000
大林組	603,900	1,275.50	770,274,450
清水建設	478,800	971.20	465,010,560
飛島建設	18,600	1,246.00	23,175,600
長谷工コーポレーション	174,300	1,756.00	306,070,800
松井建設	15,800	739.00	11,676,200
銭高組	1,400	3,690.00	5,166,000
鹿島建設	374,400	2,303.00	862,243,200
不動テトラ	11,700	1,794.00	20,989,800
大末建設	4,100	1,419.00	5,817,900

鉄建建設	12,100	1,952.00	23,619,200
西松建設	28,600	3,573.00	102,187,800
三井住友建設	136,200	391.00	53,254,200
大豊建設	7,000	3,825.00	26,775,000
佐田建設	7,200	465.00	3,348,000
ナカノフドー建設	8,000	368.00	2,944,000
奥村組	27,400	4,335.00	118,779,000
東鉄工業	23,200	2,694.00	62,500,800
イチケン	2,500	2,025.00	5,062,500
富士ピー・エス	5,000	446.00	2,230,000
浅沼組	13,500	3,430.00	46,305,000
戸田建設	207,700	801.60	166,492,320
熊谷組	28,300	3,090.00	87,447,000
北野建設	2,100	3,015.00	6,331,500
植木組	3,200	1,501.00	4,803,200
矢作建設工業	23,000	1,205.00	27,715,000
ピーエス三菱	21,400	776.00	16,606,400
日本ハウスホールディングス	36,100	363.00	13,104,300
新日本建設	23,700	1,197.00	28,368,900
東亜道路工業	6,700	4,720.00	31,624,000
日本道路	3,400	9,080.00	30,872,000
東亜建設工業	14,500	3,465.00	50,242,500
日本国土開発	48,000	590.00	28,320,000
若築建設	7,500	2,966.00	22,245,000
東洋建設	56,200	1,074.00	60,358,800
五洋建設	239,400	827.10	198,007,740
世紀東急工業	21,700	1,511.00	32,788,700
福田組	6,300	4,480.00	28,224,000
住友林業	145,800	3,892.00	567,453,600
日本基礎技術	6,800	471.00	3,202,800
巴コーポレーション	12,600	521.00	6,564,600
大和ハウス工業	466,900	3,873.00	1,808,303,700
ライト工業	31,300	2,005.00	62,756,500
積水ハウス	511,900	2,849.00	1,458,403,100
日特建設	16,100	1,063.00	17,114,300
北陸電気工事	11,600	912.00	10,579,200
ユアテック	37,200	868.00	32,289,600
日本リーテック	14,800	1,256.00	18,588,800
四電工	7,100	2,308.00	16,386,800
中電工	26,200	2,320.00	60,784,000
関電工	92,500	1,271.00	117,567,500
きんでん	118,900	1,905.50	226,563,950

東京エネシス	16,800	958.00	16,094,400
トーエネック	5,600	3,735.00	20,916,000
住友電設	16,100	2,900.00	46,690,000
日本電設工業	27,700	2,036.00	56,397,200
エクシオグループ	77,800	2,929.00	227,876,200
新日本空調	9,400	2,337.00	21,967,800
九電工	41,100	4,239.00	174,222,900
三機工業	37,400	1,613.00	60,326,200
日揮ホールディングス	167,000	1,906.50	318,385,500
中外炉工業	5,500	2,020.00	11,110,000
ヤマト	9,400	867.00	8,149,800
太平電業	10,500	3,675.00	38,587,500
高砂熱学工業	40,700	2,786.00	113,390,200
三晃金属工業	1,400	4,050.00	5,670,000
朝日工業社	7,000	2,285.00	15,995,000
明星工業	29,000	917.00	26,593,000
大気社	19,500	4,440.00	86,580,000
ダイダン	11,100	2,894.00	32,123,400
日比谷総合設備	14,400	2,173.00	31,291,200
フィル・カンパニー	3,000	734.00	2,202,000
テスホールディングス	37,400	575.00	21,505,000
インフロニア・ホールディングス	176,900	1,428.50	252,701,650
東洋エンジニアリング	22,300	622.00	13,870,600
レイズネクスト	24,400	1,364.00	33,281,600
ニッポン	45,700	2,015.00	92,085,500
日清製粉グループ本社	156,800	1,853.00	290,550,400
日東富士製粉	3,000	4,790.00	14,370,000
昭和産業	14,800	2,878.00	42,594,400
鳥越製粉	10,100	632.00	6,383,200
中部飼料	23,500	1,105.00	25,967,500
フィード・ワン	24,800	779.00	19,319,200
東洋精糖	2,100	1,995.00	4,189,500
日本甜菜製糖	9,900	1,829.00	18,107,100
D M三井製糖ホールディングス	16,800	2,843.00	47,762,400
塩水港精糖	13,500	243.00	3,280,500
ウェルネオシュガー	8,800	2,106.00	18,532,800
森永製菓	30,900	5,150.00	159,135,000
中村屋	4,200	3,080.00	12,936,000
江崎グリコ	48,500	3,744.00	181,584,000
名糖産業	6,700	1,638.00	10,974,600
井村屋グループ	9,300	2,289.00	21,287,700
不二家	11,600	2,423.00	28,106,800

山崎製パン	113,500	2,715.50	308,209,250
第一屋製パン	2,100	395.00	829,500
モロゾフ	5,500	3,600.00	19,800,000
亀田製菓	10,800	4,295.00	46,386,000
寿スピリッツ	18,000	11,480.00	206,640,000
カルビー	77,600	2,721.50	211,188,400
森永乳業	30,800	5,776.00	177,900,800
六甲バター	12,400	1,354.00	16,789,600
ヤクルト本社	121,100	7,658.00	927,383,800
明治ホールディングス	207,800	3,599.00	747,872,200
雪印メグミルク	41,000	2,386.00	97,826,000
プリマハム	22,800	2,470.00	56,316,000
日本ハム	66,300	4,439.00	294,305,700
林兼産業	3,400	541.00	1,839,400
丸大食品	17,100	1,684.00	28,796,400
S Foods	18,700	3,360.00	62,832,000
柿安本店	6,600	2,428.00	16,024,800
伊藤ハム米久ホールディングス	129,500	760.00	98,420,000
サッポロホールディングス	55,800	4,072.00	227,217,600
アサヒグループホールディングス	391,700	5,302.00	2,076,793,400
キリンホールディングス	706,100	2,013.50	1,421,732,350
宝ホールディングス	115,700	1,267.00	146,591,900
オエノンホールディングス	50,700	356.00	18,049,200
養命酒製造	5,600	1,867.00	10,455,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	132,800	1,908.50	253,448,800
ライフドリンク カンパニー	3,100	3,830.00	11,873,000
サントリー食品インターナショナル	119,400	4,610.00	550,434,000
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,440.00	52,224,000
伊藤園	57,400	4,245.00	243,663,000
キーコーヒー	19,000	2,078.00	39,482,000
ユニカフェ	3,800	917.00	3,484,600
ジャパンフーズ	1,800	1,092.00	1,965,600
日清オイリオグループ	23,900	4,125.00	98,587,500
不二製油グループ本社	39,500	2,189.00	86,465,500
かどや製油	1,400	3,440.00	4,816,000
J - オイルミルズ	17,300	1,747.00	30,223,100
キッコーマン	112,300	7,787.00	874,480,100
味の素	409,300	5,712.00	2,337,921,600
ブルドックソース	9,000	2,008.00	18,072,000
キューピー	91,100	2,364.00	215,360,400
ハウス食品グループ本社	51,900	3,050.00	158,295,000
カゴメ	72,900	3,306.00	241,007,400

焼津水産化学工業	4,400	1,140.00	5,016,000
アリアケジャパン	14,800	5,141.00	76,086,800
ピエトロ	1,600	1,833.00	2,932,800
エバラ食品工業	4,500	2,916.00	13,122,000
やまみ	1,100	1,580.00	1,738,000
ニチレイ	77,700	3,339.00	259,440,300
東洋水産	85,700	5,937.00	508,800,900
イトアンドホールディングス	7,400	2,128.00	15,747,200
大冷	1,400	1,955.00	2,737,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,136.00	12,268,800
日清食品ホールディングス	59,600	12,135.00	723,246,000
永谷園ホールディングス	8,300	2,333.00	19,363,900
一正蒲鉾	4,800	746.00	3,580,800
フジッコ	17,400	1,920.00	33,408,000
ロック・フィールド	19,000	1,525.00	28,975,000
日本たばこ産業	1,030,100	3,082.00	3,174,768,200
ケンコーマヨネーズ	11,700	1,334.00	15,607,800
わらべや日洋ホールディングス	12,500	2,672.00	33,400,000
なとり	10,600	1,965.00	20,829,000
イフジ産業	1,900	1,590.00	3,021,000
ファーマフーズ	24,300	1,624.00	39,463,200
ユーグレナ	109,200	785.00	85,722,000
紀文食品	13,200	1,090.00	14,388,000
ピクルスホールディングス	9,900	1,204.00	11,919,600
ミヨシ油脂	4,400	1,077.00	4,738,800
理研ビタミン	14,600	2,325.00	33,945,000
片倉工業	16,200	1,604.00	25,984,800
ゲンゼ	12,400	4,475.00	55,490,000
東洋紡	75,000	1,005.50	75,412,500
ユニチカ	54,300	202.00	10,968,600
富士紡ホールディングス	6,900	3,290.00	22,701,000
倉敷紡績	13,100	2,169.00	28,413,900
シキボウ	6,400	1,003.00	6,419,200
日本毛織	45,900	1,190.00	54,621,000
トーア紡コーポレーション	4,500	404.00	1,818,000
帝国繊維	19,700	1,797.00	35,400,900
帝人	166,000	1,409.00	233,894,000
東レ	1,156,000	779.50	901,102,000
住江織物	2,500	2,223.00	5,557,500
日本フェルト	7,500	413.00	3,097,500
イチカワ	1,800	1,381.00	2,485,800
日東製網	1,200	1,418.00	1,701,600

アツギ	7,200	422.00	3,038,400
ダイニック	3,000	768.00	2,304,000
セーレン	33,500	2,310.00	77,385,000
ソトー	3,900	747.00	2,913,300
東海染工	1,300	1,008.00	1,310,400
小松マテーレ	25,300	709.00	17,937,700
ワコールホールディングス	31,500	3,080.00	97,020,000
ホギメディカル	23,200	3,145.00	72,964,000
T S Iホールディングス	58,300	699.00	40,751,700
マツオカコーポレーション	3,300	1,336.00	4,408,800
ワールド	22,300	1,593.00	35,523,900
三陽商会	4,400	1,830.00	8,052,000
ナイガイ	4,600	277.00	1,274,200
オンワードホールディングス	112,200	512.00	57,446,400
ルックホールディングス	3,700	2,006.00	7,422,200
ゴールドウイン	30,600	10,010.00	306,306,000
デサント	29,800	3,515.00	104,747,000
キング	5,400	627.00	3,385,800
ヤマトインターナショナル	9,800	296.00	2,900,800
特種東海製紙	7,700	3,265.00	25,140,500
王子ホールディングス	718,400	575.40	413,367,360
日本製紙	89,800	1,202.00	107,939,600
三菱製紙	13,800	520.00	7,176,000
北越コーポレーション	109,000	871.00	94,939,000
中越パルプ工業	4,600	1,205.00	5,543,000
巴川製紙所	3,600	668.00	2,404,800
大王製紙	76,200	1,181.00	89,992,200
阿波製紙	2,800	519.00	1,453,200
レンゴー	157,100	931.30	146,307,230
トーモク	10,000	2,140.00	21,400,000
ザ・パック	12,800	3,040.00	38,912,000
北の達人コーポレーション	72,700	247.00	17,956,900
クラレ	251,300	1,546.00	388,509,800
旭化成	1,076,900	911.70	981,809,730
共和レザー	6,600	584.00	3,854,400
レゾナック・ホールディングス	166,700	2,242.00	373,741,400
住友化学	1,279,300	390.10	499,054,930
住友精化	7,200	4,275.00	30,780,000
日産化学	81,500	6,084.00	495,846,000
ラサ工業	6,600	1,935.00	12,771,000
クレハ	14,700	8,280.00	121,716,000
多木化学	6,700	3,670.00	24,589,000

テイカ	11,600	1,274.00	14,778,400
石原産業	31,200	1,400.00	43,680,000
片倉コープアグリ	2,400	1,147.00	2,752,800
日本曹達	18,500	5,180.00	95,830,000
東ソー	230,200	1,799.50	414,244,900
トクヤマ	55,700	2,285.50	127,302,350
セントラル硝子	27,700	2,851.00	78,972,700
東亜合成	86,500	1,314.50	113,704,250
大阪ソーダ	10,300	7,340.00	75,602,000
関東電化工業	33,300	770.00	25,641,000
デンカ	62,700	2,592.50	162,549,750
信越化学工業	1,433,500	4,507.00	6,460,784,500
日本カーバイド工業	4,400	1,495.00	6,578,000
堺化学工業	13,100	1,848.00	24,208,800
第一稀元素化学工業	15,700	923.00	14,491,100
エア・ウォーター	162,700	1,746.50	284,155,550
日本酸素ホールディングス	167,300	3,226.00	539,709,800
日本化学工業	5,700	1,804.00	10,282,800
東邦アセチレン	2,400	1,503.00	3,607,200
日本パーカライズン	85,400	1,075.00	91,805,000
高压ガス工業	25,000	727.00	18,175,000
チタン工業	1,400	1,379.00	1,930,600
四国化成ホールディングス	22,100	1,394.00	30,807,400
戸田工業	3,900	1,899.00	7,406,100
ステラ ケミファ	10,200	3,005.00	30,651,000
保土谷化学工業	4,900	3,165.00	15,508,500
日本触媒	26,300	5,252.00	138,127,600
大日精化工業	12,000	2,170.00	26,040,000
カネカ	39,400	3,887.00	153,147,800
三菱瓦斯化学	128,800	1,952.00	251,417,600
三井化学	142,200	3,970.00	564,534,000
J S R	161,000	4,050.00	652,050,000
東京応化工業	27,400	9,236.00	253,066,400
大阪有機化学工業	14,400	2,481.00	35,726,400
三菱ケミカルグループ	1,163,700	835.70	972,504,090
K Hネオケム	28,600	2,145.00	61,347,000
ダイセル	240,200	1,146.50	275,389,300
住友ベークライト	25,500	6,517.00	166,183,500
積水化学工業	349,600	2,187.00	764,575,200
日本ゼオン	103,400	1,493.00	154,376,200
アイカ工業	43,500	3,262.00	141,897,000
U B E	88,900	2,394.50	212,871,050

積水樹脂	23,900	2,505.00	59,869,500
タキロンシーアイ	37,700	581.00	21,903,700
旭有機材	11,500	4,190.00	48,185,000
ニチバン	10,700	1,911.00	20,447,700
リケンテクノス	37,100	655.00	24,300,500
大倉工業	8,000	2,377.00	19,016,000
積水化成成品工業	24,200	433.00	10,478,600
群栄化学工業	4,100	3,390.00	13,899,000
タイガースポリマー	5,200	764.00	3,972,800
ミライアル	3,500	1,468.00	5,138,000
ダイキアクシス	4,800	702.00	3,369,600
ダイキョーニシカワ	38,100	784.00	29,870,400
竹本容器	4,400	793.00	3,489,200
森六ホールディングス	8,700	2,077.00	18,069,900
恵和	12,400	1,088.00	13,491,200
日本化薬	131,700	1,258.00	165,678,600
カーリットホールディングス	15,500	810.00	12,555,000
日本精化	9,800	2,489.00	24,392,200
扶桑化学工業	16,000	4,155.00	66,480,000
トリケミカル研究所	23,000	2,660.00	61,180,000
A D E K A	60,100	2,655.50	159,595,550
日油	53,300	6,150.00	327,795,000
新日本理化	15,800	226.00	3,570,800
ハリマ化成グループ	8,100	814.00	6,593,400
花王	389,900	5,671.00	2,211,122,900
第一工業製薬	6,200	1,600.00	9,920,000
石原ケミカル	7,900	1,547.00	12,221,300
日華化学	4,600	836.00	3,845,600
ニイタカ	2,100	1,949.00	4,092,900
三洋化成工業	10,600	4,065.00	43,089,000
有機合成薬品工業	8,500	285.00	2,422,500
大日本塗料	21,000	947.00	19,887,000
日本ペイントホールディングス	915,700	1,080.50	989,413,850
関西ペイント	138,300	2,273.50	314,425,050
神東塗料	9,600	126.00	1,209,600
中国塗料	28,300	1,341.00	37,950,300
日本特殊塗料	7,300	1,191.00	8,694,300
藤倉化成	23,200	440.00	10,208,000
太陽ホールディングス	26,200	2,562.00	67,124,400
D I C	67,400	2,416.00	162,838,400
サカタインクス	38,400	1,304.00	50,073,600
東洋インキＳＣホールディングス	37,500	2,052.00	76,950,000

T & K TOKA	15,400	1,402.00	21,590,800
富士フィルムホールディングス	331,300	8,175.00	2,708,377,500
資生堂	360,500	6,000.00	2,163,000,000
ライオン	226,000	1,517.50	342,955,000
高砂香料工業	11,700	2,775.00	32,467,500
マンダム	37,300	1,405.00	52,406,500
ミルボン	23,500	4,338.00	101,943,000
ファンケル	75,500	2,617.00	197,583,500
コーセー	35,100	12,205.00	428,395,500
コタ	15,900	1,600.00	25,440,000
シーボン	1,500	1,540.00	2,310,000
ポーラ・オルビスホールディングス	88,500	1,899.50	168,105,750
ノエビアホールディングス	15,400	5,560.00	85,624,000
アジュバンホールディングス	2,800	932.00	2,609,600
新日本製薬	9,800	1,587.00	15,552,600
アクシージア	8,700	1,219.00	10,605,300
エステー	13,300	1,508.00	20,056,400
アグロ カネショウ	6,900	1,336.00	9,218,400
コニシ	28,800	2,346.00	67,564,800
長谷川香料	33,000	3,360.00	110,880,000
星光PMC	7,000	554.00	3,878,000
小林製薬	50,200	7,186.00	360,737,200
荒川化学工業	14,600	989.00	14,439,400
メック	14,200	3,615.00	51,333,000
日本高純度化学	4,300	2,455.00	10,556,500
タカラバイオ	46,500	1,399.00	65,053,500
JCU	19,300	3,095.00	59,733,500
新田ゼラチン	7,100	708.00	5,026,800
OATアグリオ	4,300	1,702.00	7,318,600
デクセリアルズ	47,200	3,363.00	158,733,600
アース製薬	15,700	4,840.00	75,988,000
北興化学工業	17,400	872.00	15,172,800
大成ラミック	5,400	2,944.00	15,897,600
クミアイ化学工業	68,600	1,075.00	73,745,000
日本農薬	31,700	633.00	20,066,100
アキレス	10,900	1,445.00	15,750,500
有沢製作所	28,100	1,005.00	28,240,500
日東電工	125,300	9,696.00	1,214,908,800
レック	24,600	954.00	23,468,400
三光合成	21,700	630.00	13,671,000
きもと	16,900	182.00	3,075,800
藤森工業	13,600	3,530.00	48,008,000

前澤化成工業	11,100	1,502.00	16,672,200
未来工業	6,200	2,840.00	17,608,000
ウェブロックホールディングス	3,400	617.00	2,097,800
J S P	12,100	1,900.00	22,990,000
エフピコ	32,700	2,625.50	85,853,850
天馬	14,100	2,480.00	34,968,000
信越ポリマー	31,900	1,309.00	41,757,100
東リ	25,800	369.00	9,520,200
ニフコ	62,300	4,040.00	251,692,000
バルカー	14,400	3,945.00	56,808,000
ユニ・チャーム	359,700	5,747.00	2,067,195,900
ショーエイコーポレーション	3,300	591.00	1,950,300
協和キリン	208,600	2,583.00	538,813,800
武田薬品工業	1,528,100	4,388.00	6,705,302,800
アステラス製薬	1,631,100	2,257.50	3,682,208,250
住友ファーマ	128,100	492.90	63,140,490
塩野義製薬	217,700	6,300.00	1,371,510,000
わかもと製薬	10,800	231.00	2,494,800
日本新薬	40,700	6,069.00	247,008,300
中外製薬	540,500	4,228.00	2,285,234,000
科研製薬	29,600	3,544.00	104,902,400
エーザイ	210,000	9,345.00	1,962,450,000
ロート製薬	167,300	3,638.00	608,637,400
小野薬品工業	333,100	2,779.50	925,851,450
久光製薬	38,400	4,778.00	183,475,200
持田製薬	19,800	3,270.00	64,746,000
参天製薬	314,600	1,337.50	420,777,500
扶桑薬品工業	5,500	2,028.00	11,154,000
日本ケミファ	1,200	1,827.00	2,192,400
ツムラ	54,400	2,598.50	141,358,400
キッセイ薬品工業	26,600	3,420.00	90,972,000
生化学工業	32,900	780.00	25,662,000
栄研化学	28,000	1,404.00	39,312,000
鳥居薬品	9,300	3,615.00	33,619,500
J C R ファーマ	58,400	1,207.00	70,488,800
東和薬品	26,500	2,476.00	65,614,000
富士製薬工業	12,700	1,152.00	14,630,400
ゼリア新薬工業	23,900	2,338.00	55,878,200
そーせいグループ	59,100	1,676.00	99,051,600
第一三共	1,504,200	4,194.00	6,308,614,800
杏林製薬	37,400	1,734.00	64,851,600
大幸薬品	34,200	328.00	11,217,600

ダイト	12,100	2,412.00	29,185,200
大塚ホールディングス	359,100	5,402.00	1,939,858,200
大正製薬ホールディングス	38,400	6,007.00	230,668,800
ペプチドリーム	83,700	1,798.50	150,534,450
あすか製薬ホールディングス	17,700	1,647.00	29,151,900
サワイグループホールディングス	39,500	4,149.00	163,885,500
日本コークス工業	155,700	108.00	16,815,600
ニチレキ	20,400	2,137.00	43,594,800
ユシロ化学工業	8,900	1,341.00	11,934,900
ビーピー・カストロール	4,400	871.00	3,832,400
富士石油	35,200	289.00	10,172,800
MORESCO	3,700	1,171.00	4,332,700
出光興産	191,800	2,953.00	566,385,400
ENEOSホールディングス	2,928,900	513.60	1,504,283,040
コスモエネルギーホールディングス	68,300	4,998.00	341,363,400
横浜ゴム	87,300	2,841.50	248,062,950
TOYO TIRE	99,200	2,093.00	207,625,600
ブリヂストン	505,400	5,513.00	2,786,270,200
住友ゴム工業	169,400	1,395.50	236,397,700
藤倉コンポジット	8,200	1,081.00	8,864,200
オカモト	9,300	4,530.00	42,129,000
フコク	9,100	1,364.00	12,412,400
ニッタ	17,500	3,240.00	56,700,000
住友理工	33,500	982.00	32,897,000
三ツ星ベルト	25,200	4,440.00	111,888,000
バンドー化学	27,300	1,445.00	39,448,500
日東紡績	19,500	3,945.00	76,927,500
AGC	161,100	4,876.00	785,523,600
日本板硝子	88,000	749.00	65,912,000
石塚硝子	1,900	2,100.00	3,990,000
日本山村硝子	4,500	1,748.00	7,866,000
日本電気硝子	70,600	2,460.00	173,676,000
オハラ	8,300	1,312.00	10,889,600
住友大阪セメント	24,400	3,918.00	95,599,200
太平洋セメント	110,000	2,683.50	295,185,000
日本ヒューム	15,400	754.00	11,611,600
日本コンクリート工業	34,000	317.00	10,778,000
三谷セキサン	7,300	4,800.00	35,040,000
アジアパイルホールディングス	27,300	623.00	17,007,900
東海カーボン	159,500	1,117.50	178,241,250
日本カーボン	9,900	4,305.00	42,619,500
東洋炭素	12,200	5,790.00	70,638,000

ノリタケカンパニーリミテド	8,600	5,860.00	50,396,000	
TOTO	114,000	3,842.00	437,988,000	
日本碍子	200,900	1,835.50	368,751,950	
日本特殊陶業	131,500	3,272.00	430,268,000	
MARUWA	6,400	25,680.00	164,352,000	
品川リフラクトリーズ	4,900	6,920.00	33,908,000	
黒崎播磨	3,500	10,100.00	35,350,000	
ヨータイ	9,400	1,446.00	13,592,400	
東京窯業	11,100	333.00	3,696,300	
ニッカトー	5,400	602.00	3,250,800	
フジミインコーポレーテッド	41,300	3,250.00	134,225,000	
クニミネ工業	3,500	984.00	3,444,000	
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,117.00	2,569,100	
ニチアス	43,700	2,914.00	127,341,800	
ニチハ	21,700	3,125.00	67,812,500	
日本製鉄	795,400	3,268.00	2,599,367,200	
神戸製鋼所	357,300	1,682.00	600,978,600	
中山製鋼所	36,600	847.00	31,000,200	
合同製鐵	8,800	3,980.00	35,024,000	
JFEホールディングス	474,700	2,184.00	1,036,744,800	
東京製鐵	49,900	1,601.00	79,889,900	
共英製鋼	20,300	1,884.00	38,245,200	
大和工業	29,300	6,830.00	200,119,000	
東京鐵鋼	8,500	3,205.00	27,242,500	
大阪製鐵	8,200	1,633.00	13,390,600	
淀川製鋼所	20,200	3,415.00	68,983,000	
中部鋼鈹	14,600	2,124.00	31,010,400	
丸一鋼管	54,100	3,485.00	188,538,500	
モリ工業	2,700	3,340.00	9,018,000	
大同特殊鋼	22,400	5,676.00	127,142,400	
日本高周波鋼業	4,100	421.00	1,726,100	
日本冶金工業	13,000	4,270.00	55,510,000	
山陽特殊製鋼	17,600	2,627.00	46,235,200	
愛知製鋼	10,300	3,580.00	36,874,000	
日本金属	2,600	917.00	2,384,200	
大平洋金属	12,600	1,506.00	18,975,600	
新日本電工	105,800	264.00	27,931,200	
栗本鐵工所	8,500	2,821.00	23,978,500	
虹技	1,500	1,360.00	2,040,000	
三菱製鋼	11,200	1,428.00	15,993,600	
日亜鋼業	12,100	307.00	3,714,700	
日本精線	2,400	4,610.00	11,064,000	

エンビプロ・ホールディングス	8,200	521.00	4,272,200
シンニッタン	12,900	236.00	3,044,400
新家工業	2,600	2,660.00	6,916,000
大紀アルミニウム工業所	25,300	1,358.00	34,357,400
日本軽金属ホールディングス	47,900	1,508.00	72,233,200
三井金属鉱業	51,700	3,492.00	180,536,400
東邦亜鉛	10,500	1,659.00	17,419,500
三菱マテリアル	118,500	2,326.50	275,690,250
住友金属鉱山	206,000	4,338.00	893,628,000
D O W Aホールディングス	39,900	4,460.00	177,954,000
古河機械金属	26,100	1,693.00	44,187,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,100	3,100.00	80,910,000
東邦チタニウム	32,200	1,935.00	62,307,000
U A C J	24,900	3,035.00	75,571,500
C Kサンエツ	4,300	3,690.00	15,867,000
古河電気工業	59,200	2,312.00	136,870,400
住友電気工業	613,400	1,735.50	1,064,555,700
フジクラ	190,500	1,131.50	215,550,750
S W C C	19,900	1,870.00	37,213,000
タツタ電線	36,100	709.00	25,594,900
カナレ電気	2,100	1,367.00	2,870,700
平河ヒューテック	10,300	1,479.00	15,233,700
リョービ	18,900	2,749.00	51,956,100
アーレスティ	13,200	706.00	9,319,200
A R Eホールディングス	71,900	1,847.00	132,799,300
稲葉製作所	9,200	1,526.00	14,039,200
宮地エンジニアリンググループ	4,900	5,720.00	28,028,000
トーカロ	47,300	1,386.00	65,557,800
アルファC o	4,300	1,367.00	5,878,100
S U M C O	315,600	1,922.50	606,741,000
川田テクノロジーズ	4,200	5,240.00	22,008,000
R S Technologies	11,900	2,751.00	32,736,900
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,398.00	3,836,800
信和	6,500	756.00	4,914,000
東洋製罐グループホールディングス	106,000	2,335.00	247,510,000
ホッカンホールディングス	9,500	1,505.00	14,297,500
コロナ	9,900	897.00	8,880,300
横河ブリッジホールディングス	22,200	2,662.00	59,096,400
駒井ハルテック	1,900	1,769.00	3,361,100
高田機工	1,000	2,889.00	2,889,000
三和ホールディングス	163,600	2,039.00	333,580,400
文化シャッター	51,100	1,062.00	54,268,200

三協立山	20,300	851.00	17,275,300	
アルインコ	13,500	1,034.00	13,959,000	
東洋シャッター	2,700	599.00	1,617,300	
L I X I L	258,800	1,765.00	456,782,000	
日本フィルコン	7,700	467.00	3,595,900	
ノーリツ	29,400	1,550.00	45,570,000	
長府製作所	17,800	2,072.00	36,881,600	
リンナイ	96,600	2,746.50	265,311,900	
ダイニチ工業	5,900	717.00	4,230,300	
日東精工	25,700	543.00	13,955,100	
三洋工業	1,400	2,055.00	2,877,000	
岡部	31,700	721.00	22,855,700	
ジーテクト	19,800	1,762.00	34,887,600	
東プレ	31,300	1,646.00	51,519,800	
高周波熱錬	27,400	961.00	26,331,400	
東京製網	10,500	1,147.00	12,043,500	
サンコール	10,500	471.00	4,945,500	
モリテック スチール	8,700	292.00	2,540,400	
パイオラックス	24,500	2,139.00	52,405,500	
エイチワン	18,300	728.00	13,322,400	
日本発條	157,100	1,095.50	172,103,050	
中央発條	13,200	691.00	9,121,200	
アドバネクス	1,400	1,015.00	1,421,000	
立川ブラインド工業	8,000	1,322.00	10,576,000	
三益半導体工業	13,700	2,759.00	37,798,300	
日本ドライケミカル	2,800	2,012.00	5,633,600	
日本製鋼所	47,900	2,877.50	137,832,250	
三浦工業	72,600	3,262.00	236,821,200	
タクマ	53,500	1,505.00	80,517,500	
ツガミ	38,700	1,138.00	44,040,600	
オークマ	17,400	6,633.00	115,414,200	
芝浦機械	17,400	4,020.00	69,948,000	
アマダ	277,500	1,433.00	397,657,500	
アイダエンジニアリング	35,900	950.00	34,105,000	
T A K I S A W A	3,100	2,531.00	7,846,100	
F U J I	75,600	2,348.00	177,508,800	
牧野フライス製作所	19,300	6,100.00	117,730,000	
オーエスジー	76,700	1,795.50	137,714,850	
ダイジェット工業	1,300	897.00	1,166,100	
旭ダイヤモンド工業	48,700	877.00	42,709,900	
D M G 森精機	105,500	2,524.50	266,334,750	
ソディック	45,800	647.00	29,632,600	

ディスコ	83,700	26,000.00	2,176,200,000
日東工器	8,500	1,918.00	16,303,000
日進工具	14,600	1,057.00	15,432,200
パンチ工業	10,600	433.00	4,589,800
富士ダイス	5,500	618.00	3,399,000
豊和工業	6,400	783.00	5,011,200
東洋機械金属	8,100	670.00	5,427,000
エンシュウ	2,600	762.00	1,981,200
島精機製作所	27,700	1,819.00	50,386,300
オプトラン	28,600	1,879.00	53,739,400
NCホールディングス	2,400	1,800.00	4,320,000
イワキポンプ	11,600	1,700.00	19,720,000
フリュー	18,300	1,578.00	28,877,400
ヤマシンフィルタ	41,700	315.00	13,135,500
日阪製作所	16,900	929.00	15,700,100
やまびこ	28,400	1,380.00	39,192,000
野村マイクロ・サイエンス	5,900	5,690.00	33,571,000
平田機工	8,300	7,010.00	58,183,000
PEGASUS	19,300	556.00	10,730,800
マルマエ	7,600	1,731.00	13,155,600
タツモ	10,500	2,400.00	25,200,000
ナプテスコ	109,200	2,603.00	284,247,600
三井海洋開発	22,000	1,563.00	34,386,000
レオン自動機	18,300	1,303.00	23,844,900
S M C	56,400	66,490.00	3,750,036,000
ホソカワミクロン	11,200	3,635.00	40,712,000
ユニオンツール	7,700	3,490.00	26,873,000
瑞光	12,600	1,318.00	16,606,800
オイレス工業	24,300	1,975.00	47,992,500
日精エー・エス・ビー機械	6,900	3,930.00	27,117,000
サトーホールディングス	24,800	1,976.00	49,004,800
技研製作所	16,400	1,979.00	32,455,600
日本エアテック	8,800	1,188.00	10,454,400
カワタ	3,400	1,025.00	3,485,000
日精樹脂工業	13,000	1,016.00	13,208,000
オカダアイヨン	3,600	2,172.00	7,819,200
ワイエイシイホールディングス	4,900	2,667.00	13,068,300
小松製作所	814,800	3,898.00	3,176,090,400
住友重機械工業	102,900	3,364.00	346,155,600
日立建機	69,300	4,163.00	288,495,900
日工	25,900	650.00	16,835,000
巴工業	7,500	2,842.00	21,315,000

井関農機	16,400	1,164.00	19,089,600
TOWA	17,800	3,125.00	55,625,000
丸山製作所	2,000	2,139.00	4,278,000
北川鉄工所	6,900	1,370.00	9,453,000
ローツェ	9,100	10,960.00	99,736,000
タカキタ	3,400	479.00	1,628,600
クボタ	920,200	2,159.50	1,987,171,900
荏原実業	9,200	2,746.00	25,263,200
三菱化工機	5,600	2,675.00	14,980,000
月島ホールディングス	23,600	1,259.00	29,712,400
帝国電機製作所	12,300	2,411.00	29,655,300
新東工業	35,300	1,013.00	35,758,900
澁谷工業	16,400	2,429.00	39,835,600
アイチ コーポレーション	24,300	908.00	22,064,400
小森コーポレーション	40,400	1,055.00	42,622,000
鶴見製作所	13,300	2,739.00	36,428,700
日本ギア工業	4,000	426.00	1,704,000
酒井重工業	1,900	4,835.00	9,186,500
荏原製作所	71,400	7,042.00	502,798,800
石井鐵工所	1,400	2,840.00	3,976,000
西島製作所	15,000	1,761.00	26,415,000
北越工業	17,500	1,754.00	30,695,000
ダイキン工業	207,600	23,375.00	4,852,650,000
オルガノ	23,900	3,760.00	89,864,000
トーヨーカネツ	6,600	3,220.00	21,252,000
栗田工業	97,300	5,417.00	527,074,100
椿本チエイン	24,700	3,695.00	91,266,500
大同工業	4,800	710.00	3,408,000
木村化工機	13,400	726.00	9,728,400
アネスト岩田	29,600	1,157.00	34,247,200
ダイフク	269,000	2,594.00	697,786,000
サムコ	4,700	4,930.00	23,171,000
加藤製作所	5,500	1,204.00	6,622,000
油研工業	1,800	2,088.00	3,758,400
タダノ	100,200	1,112.50	111,472,500
フジテック	61,000	3,585.00	218,685,000
C K D	48,100	1,939.00	93,265,900
平和	57,900	2,190.00	126,801,000
理想科学工業	13,900	2,230.00	30,997,000
SANKYO	34,200	6,174.00	211,150,800
日本金銭機械	19,200	1,005.00	19,296,000
マースグループホールディングス	10,300	2,763.00	28,458,900

フクシマガリレイ	12,800	5,050.00	64,640,000
オーイズミ	4,500	419.00	1,885,500
ダイコク電機	9,500	4,515.00	42,892,500
竹内製作所	31,600	4,290.00	135,564,000
アマノ	49,400	3,080.00	152,152,000
J U K I	27,000	578.00	15,606,000
ジャノメ	17,700	631.00	11,168,700
マックス	21,400	2,678.00	57,309,200
グローリー	41,800	2,923.00	122,181,400
新晃工業	17,600	1,850.00	32,560,000
大和冷機工業	26,700	1,343.00	35,858,100
セガサミーホールディングス	139,800	2,903.00	405,839,400
日本ピストンリング	3,900	1,574.00	6,138,600
リケン	6,900	3,085.00	21,286,500
T P R	19,900	1,726.00	34,347,400
ツバキ・ナカシマ	42,800	784.00	33,555,200
ホシザキ	102,600	5,310.00	544,806,000
大豊工業	15,100	800.00	12,080,000
日本精工	319,500	807.40	257,964,300
N T N	342,800	276.90	94,921,320
ジェイテクト	154,800	1,246.00	192,880,800
不二越	12,900	3,795.00	48,955,500
日本トムソン	42,700	547.00	23,356,900
T H K	100,300	2,637.50	264,541,250
ユーシン精機	13,900	675.00	9,382,500
前澤給装工業	12,300	1,176.00	14,464,800
イーグル工業	19,300	1,657.00	31,980,100
前澤工業	6,700	939.00	6,291,300
日本ピラー工業	16,100	4,085.00	65,768,500
キッツ	63,900	967.00	61,791,300
マキタ	216,400	3,952.00	855,212,800
三井E & S	83,200	464.00	38,604,800
日立造船	142,600	828.00	118,072,800
三菱重工業	304,100	7,610.00	2,314,201,000
I H I	109,600	3,442.00	377,243,200
スター精密	32,800	1,772.00	58,121,600
日清紡ホールディングス	130,700	1,072.00	140,110,400
イビデン	99,800	8,015.00	799,897,000
コニカミノルタ	389,000	444.80	173,027,200
ブラザー工業	232,500	2,415.50	561,603,750
ミネベアミツミ	302,600	2,418.50	731,838,100
日立製作所	845,600	9,172.00	7,755,843,200

東芝	334,600	4,600.00	1,539,160,000
三菱電機	1,797,100	1,774.50	3,188,953,950
富士電機	105,700	6,376.00	673,943,200
東洋電機製造	3,800	1,010.00	3,838,000
安川電機	206,000	5,352.00	1,102,512,000
シンフォニアテクノロジー	19,200	1,500.00	28,800,000
明電舎	26,400	2,129.00	56,205,600
オリジン	2,600	1,253.00	3,257,800
山洋電気	7,600	6,870.00	52,212,000
デンヨー	13,200	1,937.00	25,568,400
P H C ホールディングス	24,500	1,386.00	33,957,000
ソシオネクスト	24,700	16,790.00	414,713,000
東芝テック	26,000	3,575.00	92,950,000
芝浦メカトロニクス	3,000	23,310.00	69,930,000
マブチモーター	43,300	4,336.00	187,748,800
ニデック	423,100	7,378.00	3,121,631,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,400	474.00	6,351,600
トレックス・セミコンダクター	8,300	2,164.00	17,961,200
東光高岳	10,600	2,167.00	22,970,200
ダブル・スコープ	56,700	1,093.00	61,973,100
ダイヘン	15,700	5,070.00	79,599,000
ヤーマン	30,400	1,010.00	30,704,000
J V C ケンウッド	159,100	578.00	91,959,800
ミマキエンジニアリング	16,900	717.00	12,117,300
I - P E X	12,300	1,357.00	16,691,100
大崎電気工業	41,200	604.00	24,884,800
オムロン	159,300	6,665.00	1,061,734,500
日東工業	23,400	3,580.00	83,772,000
I D E C	25,700	2,942.00	75,609,400
正興電機製作所	4,200	1,057.00	4,439,400
不二電機工業	2,600	1,125.00	2,925,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,200	2,588.50	148,062,200
サクサホールディングス	2,400	2,175.00	5,220,000
メルコホールディングス	4,500	3,060.00	13,770,000
テクノメディカ	4,400	2,100.00	9,240,000
日本電気	245,900	7,414.00	1,823,102,600
富士通	173,300	17,635.00	3,056,145,500
沖電気工業	78,600	867.00	68,146,200
岩崎通信機	5,100	816.00	4,161,600
電気興業	7,000	2,409.00	16,863,000
サンケン電気	16,200	10,050.00	162,810,000
ナカヨ	1,900	1,253.00	2,380,700

アイホン	10,600	2,887.00	30,602,200
ルネサスエレクトロニクス	1,134,900	2,381.00	2,702,196,900
セイコーエプソン	223,100	2,275.00	507,552,500
ワコム	132,800	568.00	75,430,400
アルバック	41,300	5,459.00	225,456,700
アクセル	4,600	1,640.00	7,544,000
E I Z O	12,700	4,750.00	60,325,000
日本信号	39,600	947.00	37,501,200
京三製作所	36,400	442.00	16,088,800
能美防災	23,700	1,704.00	40,384,800
ホーチキ	13,200	1,601.00	21,133,200
星和電機	5,800	466.00	2,702,800
エレコム	41,800	1,673.00	69,931,400
パナソニック ホールディングス	2,053,800	1,577.00	3,238,842,600
シャープ	209,400	873.50	182,910,900
アンリツ	122,500	1,032.50	126,481,250
富士通ゼネラル	49,300	2,720.00	134,096,000
ソニーグループ	1,217,900	12,000.00	14,614,800,000
T D K	275,400	5,031.00	1,385,537,400
帝国通信工業	8,100	1,800.00	14,580,000
タムラ製作所	74,600	553.00	41,253,800
アルプスアルパイン	155,600	1,170.50	182,129,800
池上通信機	3,700	706.00	2,612,200
日本電波工業	21,100	1,381.00	29,139,100
鈴木	9,700	1,075.00	10,427,500
メイコー	19,100	3,335.00	63,698,500
日本トリム	4,000	2,853.00	11,412,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	3,340.00	32,064,000
フォスター電機	16,100	865.00	13,926,500
S M K	4,200	2,425.00	10,185,000
ヨコオ	14,000	1,617.00	22,638,000
ホシデン	40,800	1,697.00	69,237,600
ヒロセ電機	28,000	17,035.00	476,980,000
日本航空電子工業	35,700	2,867.00	102,351,900
T O A	19,800	1,015.00	20,097,000
マクセル	35,400	1,494.00	52,887,600
古野電気	22,900	1,255.00	28,739,500
スミダコーポレーション	23,500	1,615.00	37,952,500
アイコム	6,700	2,916.00	19,537,200
リオン	7,300	2,133.00	15,570,900
横河電機	190,200	2,695.50	512,684,100
新電元工業	6,700	2,945.00	19,731,500

アズビル	120,300	4,481.00	539,064,300
東亜ディーケーケー	5,800	845.00	4,901,000
日本光電工業	79,600	3,698.00	294,360,800
チノー	7,200	1,979.00	14,248,800
共和電業	10,700	353.00	3,777,100
日本電子材料	11,400	1,484.00	16,917,600
堀場製作所	32,900	7,356.00	242,012,400
アドバンテスト	135,600	18,480.00	2,505,888,000
小野測器	5,500	447.00	2,458,500
エスペック	13,900	2,149.00	29,871,100
キーエンス	172,200	59,210.00	10,195,962,000
日置電機	9,000	7,540.00	67,860,000
シスメックス	148,600	7,453.00	1,107,515,800
日本マイクロニクス	31,100	2,147.00	66,771,700
メガチップス	14,200	3,955.00	56,161,000
O B A R A G R O U P	9,500	3,850.00	36,575,000
澤藤電機	1,600	1,286.00	2,057,600
原田工業	5,500	810.00	4,455,000
コーセル	21,000	1,233.00	25,893,000
イリソ電子工業	15,900	3,720.00	59,148,000
オブテックスグループ	31,800	1,632.00	51,897,600
千代田インテグレ	6,800	2,558.00	17,394,400
レーザーテック	78,900	21,105.00	1,665,184,500
スタンレー電気	122,200	2,528.00	308,921,600
ウシオ電機	87,600	1,817.50	159,213,000
岡谷電機産業	10,200	320.00	3,264,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,300	412.00	4,655,600
エノモト	3,100	1,641.00	5,087,100
日本セラミック	17,600	2,453.00	43,172,800
遠藤照明	5,400	1,181.00	6,377,400
古河電池	13,000	917.00	11,921,000
双信電機	5,700	340.00	1,938,000
山一電機	14,200	1,737.00	24,665,400
図研	15,100	3,895.00	58,814,500
日本電子	43,200	4,466.00	192,931,200
カシオ計算機	128,300	1,241.00	159,220,300
ファナック	839,500	4,033.00	3,385,703,500
日本シイエムケイ	37,300	593.00	22,118,900
エンプラス	5,100	10,180.00	51,918,000
大真空	21,500	723.00	15,544,500
ローム	79,600	12,030.00	957,588,000
浜松ホトニクス	138,200	6,410.00	885,862,000

三井ハイテック	17,800	9,260.00	164,828,000
新光電気工業	61,000	5,790.00	353,190,000
京セラ	267,500	7,190.00	1,923,325,000
太陽誘電	83,900	3,947.00	331,153,300
村田製作所	522,200	7,995.00	4,174,989,000
双葉電子工業	33,500	511.00	17,118,500
北陸電気工業	4,600	1,363.00	6,269,800
ニチコン	35,400	1,328.00	47,011,200
日本ケミコン	17,300	1,368.00	23,666,400
K O A	26,300	1,731.00	45,525,300
市光工業	31,700	498.00	15,786,600
小糸製作所	207,200	2,468.50	511,473,200
ミツバ	32,300	748.00	24,160,400
S C R E E Nホールディングス	29,400	14,395.00	423,213,000
キャノン電子	19,200	1,786.00	34,291,200
キャノン	858,700	3,529.00	3,030,352,300
リコー	431,700	1,165.00	502,930,500
象印マホービン	51,400	1,790.00	92,006,000
M U T O Hホールディングス	1,800	1,926.00	3,466,800
東京エレクトロン	364,400	20,790.00	7,575,876,000
イノテック	11,700	1,489.00	17,421,300
トヨタ紡織	72,500	2,600.50	188,536,250
芦森工業	2,100	1,927.00	4,046,700
ユニプレス	31,000	1,142.00	35,402,000
豊田自動織機	125,900	9,868.00	1,242,381,200
モリタホールディングス	30,300	1,578.00	47,813,400
三櫻工業	26,400	865.00	22,836,000
デンソー	355,100	9,411.00	3,341,846,100
東海理化電機製作所	48,600	2,189.00	106,385,400
川崎重工業	129,700	3,587.00	465,233,900
名村造船所	29,500	898.00	26,491,000
日本車輛製造	6,600	1,999.00	13,193,400
三菱ロジスネクスト	27,500	1,304.00	35,860,000
近畿車輛	1,600	1,735.00	2,776,000
日産自動車	2,445,600	584.70	1,429,942,320
いすゞ自動車	500,500	1,740.50	871,120,250
トヨタ自動車	9,453,500	2,356.50	22,277,172,750
日野自動車	222,000	544.70	120,923,400
三菱自動車工業	671,600	551.90	370,656,040
エフテック	8,000	732.00	5,856,000
レシップホールディングス	4,500	524.00	2,358,000
G M B	2,300	1,717.00	3,949,100

ファルテック	1,900	586.00	1,113,400
武蔵精密工業	42,100	1,668.00	70,222,800
日産車体	30,400	878.00	26,691,200
新明和工業	54,100	1,331.00	72,007,100
極東開発工業	28,400	1,783.00	50,637,200
トピー工業	14,000	2,132.00	29,848,000
ティラド	4,400	2,072.00	9,116,800
曙ブレーキ工業	105,100	132.00	13,873,200
タチエス	27,300	1,617.00	44,144,100
N O K	66,900	1,899.00	127,043,100
フタバ産業	46,300	603.00	27,918,900
K Y B	16,600	4,740.00	78,684,000
大同メタル工業	33,800	503.00	17,001,400
プレス工業	77,000	643.00	49,511,000
ミクニ	13,300	435.00	5,785,500
太平洋工業	39,500	1,338.00	52,851,000
アイシン	132,800	4,580.00	608,224,000
マツダ	569,500	1,399.00	796,730,500
今仙電機製作所	7,400	634.00	4,691,600
本田技研工業	1,399,500	4,428.00	6,196,986,000
スズキ	316,200	5,180.00	1,637,916,000
S U B A R U	544,700	2,634.00	1,434,739,800
安永	5,100	850.00	4,335,000
ヤマハ発動機	248,000	3,723.00	923,304,000
T B K	11,500	392.00	4,508,000
エクセディ	28,200	2,483.00	70,020,600
豊田合成	50,300	2,970.50	149,416,150
愛三工業	28,500	1,171.00	33,373,500
盟和産業	1,700	1,006.00	1,710,200
日本プラスト	9,200	453.00	4,167,600
ヨロズ	16,200	858.00	13,899,600
エフ・シー・シー	30,500	1,874.00	57,157,000
シマノ	69,900	21,235.00	1,484,326,500
テイ・エス テック	78,800	1,709.50	134,708,600
ジャムコ	6,300	1,442.00	9,084,600
テルモ	529,500	4,119.00	2,181,010,500
クリエートメディック	3,800	906.00	3,442,800
日機装	40,100	987.00	39,578,700
日本エム・ディ・エム	10,300	765.00	7,879,500
島津製作所	209,700	4,078.00	855,156,600
J M S	16,000	514.00	8,224,000
長野計器	12,500	2,191.00	27,387,500

ブイ・テクノロジー	8,400	2,184.00	18,345,600
東京計器	13,200	1,431.00	18,889,200
愛知時計電機	6,700	1,480.00	9,916,000
インターアクション	8,200	1,013.00	8,306,600
オーバル	10,200	415.00	4,233,000
東京精密	37,900	7,910.00	299,789,000
マニー	68,900	1,792.00	123,468,800
ニコン	248,900	1,550.00	385,795,000
トプコン	90,600	1,609.50	145,820,700
オリンパス	1,059,800	1,798.00	1,905,520,400
理研計器	10,700	4,795.00	51,306,500
タムロン	12,800	4,650.00	59,520,000
H O Y A	364,700	15,725.00	5,734,907,500
シード	5,800	694.00	4,025,200
ノーリツ鋼機	16,300	2,707.00	44,124,100
A & Dホロンホールディングス	25,100	1,558.00	39,105,800
朝日インテック	192,400	2,736.00	526,406,400
シチズン時計	158,400	850.00	134,640,000
リズム	3,600	1,606.00	5,781,600
大研医器	8,700	530.00	4,611,000
メニコン	59,200	2,047.50	121,212,000
シンシア	1,300	540.00	702,000
松風	7,800	2,053.00	16,013,400
セイコーグループ	26,700	2,676.00	71,449,200
ニプロ	143,500	1,113.00	159,715,500
K Y O R I T S U	17,100	167.00	2,855,700
中本パックス	3,500	1,628.00	5,698,000
スノーピーク	29,400	1,476.00	43,394,400
パラマウントベッドホールディングス	39,800	2,261.00	89,987,800
トランザクション	11,300	1,941.00	21,933,300
粧美堂	3,100	498.00	1,543,800
ニホンフラッシュ	16,100	861.00	13,862,100
前田工織	14,500	3,085.00	44,732,500
永大産業	12,200	216.00	2,635,200
アートネイチャー	17,700	771.00	13,646,700
バンダイナムコホールディングス	471,700	3,404.00	1,605,666,800
アイフィスジャパン	3,200	581.00	1,859,200
S H O E I	38,900	2,321.00	90,286,900
フランスベッドホールディングス	19,800	1,185.00	23,463,000
パイロットコーポレーション	24,200	4,538.00	109,819,600
萩原工業	11,500	1,566.00	18,009,000
フジシールインターナショナル	34,900	1,615.00	56,363,500

タカラトミー	78,900	2,221.00	175,236,900
広済堂ホールディングス	7,700	2,703.00	20,813,100
エステールホールディングス	2,700	623.00	1,682,100
タカノ	4,300	802.00	3,448,600
プロネクサス	14,300	1,026.00	14,671,800
ホクシン	8,800	123.00	1,082,400
ウッドワン	3,800	1,048.00	3,982,400
大建工業	10,500	3,040.00	31,920,000
凸版印刷	211,600	3,253.00	688,334,800
大日本印刷	188,100	3,830.00	720,423,000
共同印刷	4,800	3,130.00	15,024,000
N I S S H A	32,600	1,706.00	55,615,600
光村印刷	1,000	1,219.00	1,219,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,000	2,285.00	25,135,000
アシックス	146,700	5,117.00	750,663,900
ツツミ	3,000	2,362.00	7,086,000
ローランド	12,700	3,740.00	47,498,000
小松ウオール工業	6,300	2,836.00	17,866,800
ヤマハ	108,500	4,466.00	484,561,000
河合楽器製作所	4,600	3,185.00	14,651,000
クリナップ	19,300	680.00	13,124,000
ピジョン	109,700	1,740.00	190,878,000
キングジム	15,200	863.00	13,117,600
リンテック	34,600	2,267.50	78,455,500
イトーキ	35,300	1,311.00	46,278,300
任天堂	1,087,000	6,128.00	6,661,136,000
三菱鉛筆	24,400	1,794.00	43,773,600
タカラスタANDARD	31,700	1,843.00	58,423,100
コクヨ	74,600	2,193.00	163,597,800
ナカバヤシ	18,500	511.00	9,453,500
グローブライド	13,900	1,927.00	26,785,300
オカムラ	51,800	2,175.00	112,665,000
美津濃	17,100	4,430.00	75,753,000
東京電力ホールディングス	1,551,900	607.00	942,003,300
中部電力	634,400	1,837.50	1,165,710,000
関西電力	664,800	1,873.50	1,245,502,800
中国電力	274,200	913.00	250,344,600
北陸電力	162,500	792.40	128,765,000
東北電力	420,900	978.90	412,019,010
四国電力	147,000	1,002.50	147,367,500
九州電力	396,900	910.50	361,377,450
北海道電力	166,300	624.70	103,887,610

沖縄電力	40,300	1,132.00	45,619,600	
電源開発	129,600	2,205.50	285,832,800	
エフオン	11,100	498.00	5,527,800	
イーレックス	30,600	949.00	29,039,400	
レノバ	45,900	1,367.00	62,745,300	
東京瓦斯	364,000	3,264.00	1,188,096,000	
大阪瓦斯	348,700	2,237.00	780,041,900	
東邦瓦斯	67,800	2,511.50	170,279,700	
北海道瓦斯	10,300	2,280.00	23,484,000	
広島ガス	36,300	379.00	13,757,700	
西部ガスホールディングス	16,200	1,982.00	32,108,400	
静岡ガス	39,100	1,010.00	39,491,000	
メタウォーター	20,600	1,846.00	38,027,600	
SBSホールディングス	15,300	3,015.00	46,129,500	
東武鉄道	189,100	3,858.00	729,547,800	
相鉄ホールディングス	56,900	2,774.00	157,840,600	
東急	482,800	1,770.50	854,797,400	
京浜急行電鉄	195,300	1,306.00	255,061,800	
小田急電鉄	261,000	2,106.50	549,796,500	
京王電鉄	91,000	4,858.00	442,078,000	
京成電鉄	111,000	5,532.00	614,052,000	
富士急行	21,200	5,290.00	112,148,000	
東日本旅客鉄道	292,000	8,035.00	2,346,220,000	
西日本旅客鉄道	219,900	6,089.00	1,338,971,100	
東海旅客鉄道	132,600	18,025.00	2,390,115,000	
西武ホールディングス	208,300	1,569.50	326,926,850	
鴻池運輸	29,300	1,943.00	56,929,900	
西日本鉄道	46,000	2,612.00	120,152,000	
ハマキョウレックス	13,500	4,100.00	55,350,000	
サカイ引越センター	8,200	5,130.00	42,066,000	
近鉄グループホールディングス	171,900	4,595.00	789,880,500	
阪急阪神ホールディングス	229,200	4,935.00	1,131,102,000	
南海電気鉄道	82,100	2,925.50	240,183,550	
京阪ホールディングス	94,700	4,051.00	383,629,700	
神戸電鉄	4,700	3,015.00	14,170,500	
名古屋鉄道	190,000	2,252.50	427,975,000	
山陽電気鉄道	12,900	2,155.00	27,799,500	
アルプス物流	13,700	1,458.00	19,974,600	
ヤマトホールディングス	220,100	2,591.00	570,279,100	
山九	43,700	4,970.00	217,189,000	
丸運	5,600	243.00	1,360,800	
丸全昭和運輸	10,600	3,885.00	41,181,000	

センコーグループホールディングス	91,000	997.00	90,727,000
トナミホールディングス	3,800	4,580.00	17,404,000
ニッコンホールディングス	55,000	3,155.00	173,525,000
日本石油輸送	1,200	2,479.00	2,974,800
福山通運	13,100	3,585.00	46,963,500
セイノーホールディングス	96,700	2,038.50	197,122,950
エスライングループ本社	3,200	847.00	2,710,400
神奈川中央交通	4,900	3,225.00	15,802,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	41,500	2,184.00	90,636,000
C & F ロジホールディングス	16,500	1,302.00	21,483,000
九州旅客鉄道	121,500	3,139.00	381,388,500
S Gホールディングス	329,800	2,049.00	675,760,200
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	58,300	7,270.00	423,841,000
日本郵船	460,100	3,801.00	1,748,840,100
商船三井	303,300	3,978.00	1,206,527,400
川崎汽船	129,400	4,750.00	614,650,000
N Sユナイテッド海運	9,500	3,970.00	37,715,000
飯野海運	64,200	1,008.00	64,713,600
共栄タンカー	3,300	831.00	2,742,300
乾汽船	22,600	1,226.00	27,707,600
日本航空	422,200	3,009.00	1,270,399,800
A N Aホールディングス	467,700	3,274.00	1,531,249,800
パスコ	2,200	1,593.00	3,504,600
トランコム	5,000	7,380.00	36,900,000
日新	13,100	2,459.00	32,212,900
三菱倉庫	36,900	3,723.00	137,378,700
三井倉庫ホールディングス	16,000	4,115.00	65,840,000
住友倉庫	46,400	2,446.00	113,494,400
澁澤倉庫	6,900	3,155.00	21,769,500
東陽倉庫	15,200	272.00	4,134,400
日本トランスシティ	34,600	620.00	21,452,000
ケイヒン	2,000	1,659.00	3,318,000
中央倉庫	8,300	1,077.00	8,939,100
川西倉庫	1,900	1,037.00	1,970,300
安田倉庫	11,700	989.00	11,571,300
ファイズホールディングス	2,100	1,123.00	2,358,300
東洋埠頭	3,300	1,358.00	4,481,400
上組	82,400	3,198.00	263,515,200
サンリツ	2,600	715.00	1,859,000
キムラユニティー	5,500	1,283.00	7,056,500
キューソー流通システム	5,900	901.00	5,315,900
東海運	6,700	284.00	1,902,800

エーアイティー	10,800	1,874.00	20,239,200
内外トランスライン	6,900	2,584.00	17,829,600
日本コンセプト	6,100	1,677.00	10,229,700
NEC ネットエスアイ	57,700	1,889.00	108,995,300
クロスキャット	9,900	1,028.00	10,177,200
システナ	290,400	259.00	75,213,600
デジタルアーツ	10,900	4,565.00	49,758,500
日鉄ソリューションズ	29,500	3,800.00	112,100,000
キューブシステム	10,300	1,126.00	11,597,800
コア	7,700	1,690.00	13,013,000
手間いらず	2,900	3,545.00	10,280,500
ラクーンホールディングス	14,400	701.00	10,094,400
ソリトンシステムズ	8,900	1,094.00	9,736,600
ソフトクリエイトホールディングス	14,200	1,783.00	25,318,600
T I S	188,900	3,286.00	620,725,400
J N S ホールディングス	5,400	445.00	2,403,000
グリー	46,400	614.00	28,489,600
G M O ペパボ	2,500	1,329.00	3,322,500
コーエーテクモホールディングス	108,200	2,245.50	242,963,100
三菱総合研究所	8,500	4,935.00	41,947,500
電算	1,400	1,550.00	2,170,000
A G S	4,900	721.00	3,532,900
ファインデックス	13,800	630.00	8,694,000
ブレインパッド	13,000	879.00	11,427,000
K L a b	34,300	275.00	9,432,500
ポルトゥウィンホールディングス	29,500	669.00	19,735,500
ネクソン	385,000	2,802.50	1,078,962,500
アイスタイル	51,300	490.00	25,137,000
エムアップホールディングス	21,200	1,436.00	30,443,200
エイチーム	10,300	648.00	6,674,400
エニグモ	22,100	365.00	8,066,500
テクノスジャパン	9,500	685.00	6,507,500
コロブラ	67,000	617.00	41,339,000
ブロードリーフ	100,600	471.00	47,382,600
クロス・マーケティンググループ	7,000	725.00	5,075,000
デジタルハーツホールディングス	10,800	1,161.00	12,538,800
システム情報	13,800	711.00	9,811,800
メディアドゥ	6,800	1,176.00	7,996,800
じげん	50,400	591.00	29,786,400
ブイキューブ	20,800	371.00	7,716,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	490.00	1,372,000
サイバーリンクス	4,500	678.00	3,051,000

フィックスターズ	19,500	1,189.00	23,185,500
CARTA HOLDINGS	8,100	1,157.00	9,371,700
オブティム	14,200	884.00	12,552,800
セレス	7,000	991.00	6,937,000
SHIFT	11,500	29,925.00	344,137,500
ティーガイア	18,100	1,691.00	30,607,100
セック	1,600	3,160.00	5,056,000
テクマトリックス	31,600	1,498.00	47,336,800
プロシップ	7,600	1,240.00	9,424,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	2,344.50	105,502,500
GMOペイメントゲートウェイ	34,500	9,351.00	322,609,500
ザッパラス	3,300	466.00	1,537,800
システムリサーチ	5,400	2,531.00	13,667,400
インターネットイニシアティブ	94,300	2,460.00	231,978,000
さくらインターネット	19,400	1,182.00	22,930,800
ヴィンクス	2,800	1,316.00	3,684,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,300	2,975.00	15,767,500
SRAホールディングス	8,800	3,185.00	28,028,000
システムインテグレータ	3,500	419.00	1,466,500
朝日ネット	18,600	609.00	11,327,400
eBASE	24,300	678.00	16,475,400
アバントグループ	21,800	1,393.00	30,367,400
アドソル日進	7,300	1,677.00	12,242,100
ODKソリューションズ	2,600	573.00	1,489,800
フリービット	9,100	1,188.00	10,810,800
コムチュア	22,900	2,214.00	50,700,600
サイバーコム	1,900	1,291.00	2,452,900
アステリア	13,600	791.00	10,757,600
アイル	8,100	2,585.00	20,938,500
マークライنز	9,400	2,758.00	25,925,200
メディカル・データ・ビジョン	25,700	620.00	15,934,000
gumi	25,500	652.00	16,626,000
ショーケース	2,800	406.00	1,136,800
モバイルファクトリー	2,500	799.00	1,997,500
テラスカイ	7,500	1,950.00	14,625,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,000	1,799.00	17,990,000
PCIホールディングス	4,400	1,050.00	4,620,000
アイビーシー	1,800	560.00	1,008,000
ネオジャパン	5,800	1,028.00	5,962,400
PR TIMES	4,400	1,635.00	7,194,000
ラクス	81,700	2,182.00	178,269,400
ランドコンピュータ	2,800	1,205.00	3,374,000

ダブルスタンダード	7,000	1,345.00	9,415,000
オープンドア	12,100	1,123.00	13,588,300
アカツキ	8,200	1,908.00	15,645,600
ベネフィットジャパン	700	1,230.00	861,000
U b i c o mホールディングス	5,400	1,320.00	7,128,000
カナミックネットワーク	18,700	517.00	9,667,900
ノムラシステムコーポレーション	12,900	114.00	1,470,600
チェンジホールディングス	42,300	1,957.00	82,781,100
シンクロ・フード	7,300	534.00	3,898,200
オークネット	8,500	1,705.00	14,492,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	798.00	1,835,400
セグエグループ	3,700	904.00	3,344,800
エイトレッド	1,800	1,424.00	2,563,200
マクロミル	33,900	723.00	24,509,700
ビーグリー	2,400	1,040.00	2,496,000
オロ	6,300	2,045.00	12,883,500
ユーザーローカル	6,200	2,130.00	13,206,000
テモナ	2,800	280.00	784,000
ニーズウェル	6,300	732.00	4,611,600
マネーフォワード	38,400	5,122.00	196,684,800
サインポスト	4,400	431.00	1,896,400
S u n A s t e r i s k	12,300	1,400.00	17,220,000
電算システムホールディングス	8,300	2,711.00	22,501,300
A p p i e r G r o u p	58,900	1,650.00	97,185,000
ソルクシーズ	9,400	401.00	3,769,400
フェイス	3,300	483.00	1,593,900
プロトコーポレーション	21,600	1,168.00	25,228,800
ハイマックス	5,400	1,386.00	7,484,400
野村総合研究所	344,000	4,040.00	1,389,760,000
サイバネットシステム	14,500	726.00	10,527,000
C Eホールディングス	6,000	548.00	3,288,000
日本システム技術	4,800	1,987.00	9,537,600
インテージホールディングス	19,500	1,655.00	32,272,500
東邦システムサイエンス	3,200	1,741.00	5,571,200
ソースネクスト	88,000	186.00	16,368,000
インフォコム	22,300	2,792.00	62,261,600
シンプレクス・ホールディングス	29,600	2,598.00	76,900,800
H E R O Z	5,800	1,668.00	9,674,400
ラクスル	41,400	1,333.00	55,186,200
メルカリ	104,400	3,174.00	331,365,600
I P S	5,600	2,185.00	12,236,000
F I G	13,500	284.00	3,834,000

システムサポート	6,700	1,823.00	12,214,100
イーソル	12,300	755.00	9,286,500
東海ソフト	1,700	1,038.00	1,764,600
ウイングアーク1st	17,800	2,622.00	46,671,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,429.00	6,573,400
サーバーワークス	3,500	3,235.00	11,322,500
東名	900	2,369.00	2,132,100
ヴィッツ	1,200	1,070.00	1,284,000
トピラシステムズ	3,300	890.00	2,937,000
Sansan	56,500	1,305.00	73,732,500
Link-U	2,800	875.00	2,450,000
ギフトィ	18,800	1,730.00	32,524,000
メドレー	23,200	5,700.00	132,240,000
ベース	5,900	4,220.00	24,898,000
JMDC	28,400	4,140.00	117,576,000
フォーカスシステムズ	12,600	950.00	11,970,000
クレスコ	13,300	1,877.00	24,964,100
フジ・メディア・ホールディングス	165,900	1,487.50	246,776,250
オービック	57,700	24,150.00	1,393,455,000
ジャストシステム	24,800	3,057.00	75,813,600
TDCソフト	14,600	1,611.00	23,520,600
Zホールディングス	2,457,400	400.00	982,960,000
トレンドマイクロ	81,600	5,941.00	484,785,600
IDホールディングス	11,700	1,273.00	14,894,100
日本オラクル	33,000	10,060.00	331,980,000
アルファシステムズ	5,400	2,875.00	15,525,000
フューチャー	36,900	1,439.00	53,099,100
CAC Holdings	10,600	1,654.00	17,532,400
SBテクノロジー	7,300	2,432.00	17,753,600
トーセ	3,400	744.00	2,529,600
オービックビジネスコンサルタント	34,000	5,730.00	194,820,000
伊藤忠テクノソリューションズ	92,700	4,319.00	400,371,300
アイティフォー	22,800	1,079.00	24,601,200
東計電算	2,400	6,170.00	14,808,000
エクスネット	1,600	1,019.00	1,630,400
大塚商会	85,600	6,088.00	521,132,800
サイボウズ	23,800	2,090.00	49,742,000
電通国際情報サービス	21,000	5,660.00	118,860,000
ACCESS	20,500	914.00	18,737,000
デジタルガレージ	30,700	3,785.00	116,199,500
EMシステムズ	28,800	706.00	20,332,800
ウェザーニューズ	5,300	6,250.00	33,125,000

C I J	28,700	530.00	15,211,000
ビジネスエンジニアリング	2,400	3,250.00	7,800,000
日本エンタープライズ	12,200	127.00	1,549,400
WOWOW	13,000	1,102.00	14,326,000
スカラ	16,000	704.00	11,264,000
インテリジェント ウェイブ	6,200	880.00	5,456,000
ANYCOLOR	6,000	3,245.00	19,470,000
I M A G I C A G R O U P	14,500	608.00	8,816,000
ネットワンシステムズ	64,300	2,658.00	170,909,400
システムソフト	60,600	79.00	4,787,400
アルゴグラフィックス	15,800	3,325.00	52,535,000
マーベラス	28,100	672.00	18,883,200
エイベックス	29,400	1,394.00	40,983,600
B I P R O G Y	63,600	3,648.00	232,012,800
都築電気	9,100	2,139.00	19,464,900
T B S ホールディングス	88,400	2,516.50	222,458,600
日本テレビホールディングス	152,900	1,324.50	202,516,050
朝日放送グループホールディングス	16,200	667.00	10,805,400
テレビ朝日ホールディングス	41,900	1,633.00	68,422,700
スカパーJ S A Tホールディングス	153,300	629.00	96,425,700
テレビ東京ホールディングス	12,400	2,952.00	36,604,800
日本BS放送	4,200	907.00	3,809,400
ビジョン	26,000	1,762.00	45,812,000
スマートバリュー	2,900	377.00	1,093,300
U S E N - N E X T H O L D I N G S	19,400	3,485.00	67,609,000
ワイヤレスゲート	5,200	207.00	1,076,400
日本通信	159,500	223.00	35,568,500
クロップス	1,900	994.00	1,888,600
日本電信電話	55,312,800	161.70	8,944,079,760
K D D I	1,334,300	4,213.00	5,621,405,900
ソフトバンク	2,775,200	1,617.50	4,488,886,000
光通信	20,300	22,340.00	453,502,000
エムティーアイ	11,900	543.00	6,461,700
G M O インターネットグループ	63,800	2,296.00	146,484,800
ファイバーゲート	9,300	1,398.00	13,001,400
アйдママーケティングコミュニケーション	2,800	252.00	705,600
K A D O K A W A	91,300	3,421.00	312,337,300
学研ホールディングス	28,800	824.00	23,731,200
ゼンリン	29,600	864.00	25,574,400
昭文社ホールディングス	5,000	304.00	1,520,000
インプレスホールディングス	10,300	176.00	1,812,800
アイネット	10,500	1,675.00	17,587,500

松竹	9,900	10,700.00	105,930,000
東宝	108,100	5,436.00	587,631,600
東映	4,800	17,540.00	84,192,000
NTTデータグループ	541,800	1,849.00	1,001,788,200
ピー・シー・エー	9,900	1,228.00	12,157,200
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,019.00	14,940,600
D T S	36,800	3,125.00	115,000,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,800	5,358.00	465,074,400
シーイーシー	24,200	1,620.00	39,204,000
カプコン	171,600	5,833.00	1,000,942,800
アイ・エス・ビー	8,800	1,342.00	11,809,600
ジャステック	10,600	1,369.00	14,511,400
S C S K	140,900	2,453.50	345,698,150
N S W	6,700	2,527.00	16,930,900
アイネス	12,100	1,511.00	18,283,100
T K C	27,500	3,550.00	97,625,000
富士ソフト	34,700	4,425.00	153,547,500
N S D	61,600	2,730.00	168,168,000
コナミグループ	73,900	8,079.00	597,038,100
福井コンピュータホールディングス	12,000	2,626.00	31,512,000
J B C Cホールディングス	12,600	2,579.00	32,495,400
ミロク情報サービス	15,700	1,511.00	23,722,700
ソフトバンクグループ	851,800	6,568.00	5,594,622,400
高千穂交易	4,300	3,080.00	13,244,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,800	1,698.00	3,056,400
伊藤忠食品	4,100	5,750.00	23,575,000
エレマテック	16,400	1,715.00	28,126,000
あらた	13,900	5,210.00	72,419,000
トーメンデバイス	2,600	4,755.00	12,363,000
東京エレクトロン デバイス	6,700	9,770.00	65,459,000
円谷フィールズホールディングス	31,300	2,771.00	86,732,300
双日	181,600	2,998.50	544,527,600
アルフレッサ ホールディングス	182,800	2,426.50	443,564,200
横浜冷凍	49,600	1,300.00	64,480,000
ラサ商事	5,600	1,474.00	8,254,400
アルコニックス	24,000	1,340.00	32,160,000
神戸物産	140,900	3,643.00	513,298,700
ハイパー	2,700	358.00	966,600
あい ホールディングス	29,200	2,404.00	70,196,800
ディーブイエックス	3,400	811.00	2,757,400
ダイワボウホールディングス	74,400	2,779.00	206,757,600
マクニカホールディングス	43,100	6,090.00	262,479,000

ラクト・ジャパン	7,100	2,022.00	14,356,200
グリムス	7,600	2,464.00	18,726,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,500	960.00	25,440,000
八洲電機	14,700	1,259.00	18,507,300
メディアスホールディングス	11,700	748.00	8,751,600
レスターホールディングス	17,400	2,251.00	39,167,400
ジューテックホールディングス	2,800	1,163.00	3,256,400
大光	5,100	597.00	3,044,700
OCHIホールディングス	2,800	1,322.00	3,701,600
TOKAIホールディングス	90,000	909.00	81,810,000
黒谷	3,400	625.00	2,125,000
Cominix	2,400	824.00	1,977,600
三洋貿易	20,600	1,302.00	26,821,200
ビューティガレージ	2,900	4,540.00	13,166,000
ウイン・パートナーズ	13,300	1,030.00	13,699,000
ミタチ産業	3,100	1,077.00	3,338,700
シップヘルスケアホールディングス	65,500	2,440.00	159,820,000
明治電機工業	6,800	1,435.00	9,758,000
デリカフーズホールディングス	4,800	627.00	3,009,600
スターティアホールディングス	2,400	1,650.00	3,960,000
コメダホールディングス	44,700	2,805.00	125,383,500
ピーバンドットコム	1,800	456.00	820,800
アセンテック	6,200	603.00	3,738,600
富士興産	2,700	1,763.00	4,760,100
協栄産業	1,100	2,101.00	2,311,100
フルサト・マルカホールディングス	18,100	2,475.00	44,797,500
ヤマエグループホールディングス	10,300	4,085.00	42,075,500
小野建	17,900	1,612.00	28,854,800
南陽	2,300	2,065.00	4,749,500
佐島電機	7,600	1,478.00	11,232,800
エコートレーディング	2,400	1,213.00	2,911,200
伯東	10,400	4,975.00	51,740,000
コンドーテック	14,000	1,144.00	16,016,000
中山福	6,500	342.00	2,223,000
ナガイレーベン	23,000	2,258.00	51,934,000
三菱食品	16,800	3,825.00	64,260,000
松田産業	13,900	2,124.00	29,523,600
第一興商	70,500	2,737.50	192,993,750
メディバルホールディングス	174,200	2,451.00	426,964,200
SPK	8,100	1,883.00	15,252,300
萩原電気ホールディングス	7,400	3,700.00	27,380,000
アズワン	25,900	5,540.00	143,486,000

スズデン	6,400	2,148.00	13,747,200
尾家産業	2,900	1,699.00	4,927,100
シモジマ	12,500	1,109.00	13,862,500
ドウシシャ	19,300	2,249.00	43,405,700
小津産業	2,700	1,570.00	4,239,000
高速	9,500	2,003.00	19,028,500
たけびし	7,000	1,780.00	12,460,000
リックス	2,500	3,015.00	7,537,500
丸文	16,300	1,103.00	17,978,900
ハピネット	15,500	2,408.00	37,324,000
橋本総業ホールディングス	7,200	1,110.00	7,992,000
日本ライフライン	53,400	1,066.00	56,924,400
タカショー	15,900	655.00	10,414,500
I D O M	55,100	786.00	43,308,600
進和	11,200	2,178.00	24,393,600
エスケイジャパン	3,000	701.00	2,103,000
ダイトロン	7,200	2,799.00	20,152,800
シークス	26,000	1,452.00	37,752,000
田中商事	3,500	653.00	2,285,500
オーハシテクニカ	8,800	1,583.00	13,930,400
白銅	6,600	2,243.00	14,803,800
ダイコー通産	1,300	1,135.00	1,475,500
伊藤忠商事	1,122,400	5,450.00	6,117,080,000
丸紅	1,421,400	2,310.50	3,284,144,700
高島	1,900	3,450.00	6,555,000
長瀬産業	83,500	2,432.50	203,113,750
蝶理	9,800	2,800.00	27,440,000
豊田通商	159,600	8,156.00	1,301,697,600
三共生興	26,100	680.00	17,748,000
兼松	70,700	2,005.00	141,753,500
ツカモトコーポレーション	1,700	1,270.00	2,159,000
三井物産	1,292,700	5,251.00	6,787,967,700
日本紙パルプ商事	9,700	4,525.00	43,892,500
カメイ	19,400	1,430.00	27,742,000
東都水産	600	6,300.00	3,780,000
O U Gホールディングス	1,800	2,455.00	4,419,000
スターゼン	13,800	2,464.00	34,003,200
山善	49,100	1,094.00	53,715,400
椿本興業	2,900	4,725.00	13,702,500
住友商事	1,108,900	2,862.00	3,173,671,800
内田洋行	7,400	6,270.00	46,398,000
三菱商事	1,110,600	6,885.00	7,646,481,000

第一実業	6,400	5,150.00	32,960,000
キヤノンマーケティングジャパン	42,200	3,747.00	158,123,400
西華産業	7,200	1,897.00	13,658,400
佐藤商事	12,700	1,407.00	17,868,900
菱洋エレクトロ	15,500	3,260.00	50,530,000
東京産業	16,700	809.00	13,510,300
ユアサ商事	15,700	4,175.00	65,547,500
神鋼商事	4,600	5,510.00	25,346,000
トルク	6,600	238.00	1,570,800
阪和興業	32,700	4,525.00	147,967,500
正栄食品工業	12,100	4,410.00	53,361,000
カナデン	12,200	1,257.00	15,335,400
R Y O D E N	14,700	2,252.00	33,104,400
岩谷産業	41,500	7,292.00	302,618,000
ナイス	3,300	1,513.00	4,992,900
ニチモウ	1,600	3,905.00	6,248,000
極東貿易	10,900	1,788.00	19,489,200
アステナホールディングス	34,200	442.00	15,116,400
三愛オブリ	48,200	1,601.00	77,168,200
稲畑産業	36,800	3,110.00	114,448,000
G S I クレオス	10,600	2,109.00	22,355,400
明和産業	24,300	657.00	15,965,100
クワザワホールディングス	3,900	502.00	1,957,800
ワキタ	33,500	1,330.00	44,555,000
東邦ホールディングス	45,400	2,841.50	129,004,100
サンゲツ	45,700	2,876.00	131,433,200
ミツウロコグループホールディングス	23,300	1,273.00	29,660,900
シナネンホールディングス	5,900	3,995.00	23,570,500
伊藤忠エネクス	45,200	1,432.00	64,726,400
サンリオ	51,600	7,663.00	395,410,800
サンワテクノス	9,300	2,092.00	19,455,600
リョーサン	19,300	3,875.00	74,787,500
新光商事	24,500	1,101.00	26,974,500
トーホー	7,800	3,000.00	23,400,000
三信電気	7,400	2,050.00	15,170,000
東陽テクニカ	18,500	1,300.00	24,050,000
モスフードサービス	26,800	3,330.00	89,244,000
加賀電子	14,800	6,330.00	93,684,000
ソーダニッカ	8,900	849.00	7,556,100
立花エレテック	13,300	2,565.00	34,114,500
フォーバル	7,200	1,181.00	8,503,200
P A L T A C	28,600	4,636.00	132,589,600

三谷産業	31,900	313.00	9,984,700
西本Wismettacホールディングス	4,600	4,310.00	19,826,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,893.00	1,893,000
コア商事ホールディングス	10,300	679.00	6,993,700
KPPグループホールディングス	42,500	571.00	24,267,500
ヤマタネ	8,100	1,782.00	14,434,200
丸紅建材リース	1,100	2,477.00	2,724,700
泉州電業	9,100	3,785.00	34,443,500
トラスコ中山	38,300	2,340.00	89,622,000
オートバックスセブン	63,400	1,582.50	100,330,500
モリト	13,100	1,188.00	15,562,800
加藤産業	22,500	3,965.00	89,212,500
北恵	3,100	796.00	2,467,600
イエローハット	32,200	1,864.00	60,020,800
JKホールディングス	14,000	945.00	13,230,000
日伝	10,800	2,437.00	26,319,600
北沢産業	6,500	316.00	2,054,000
杉本商事	8,100	2,130.00	17,253,000
因幡電機産業	47,200	3,045.00	143,724,000
東テク	6,100	4,880.00	29,768,000
ミスミグループ本社	274,900	2,440.00	670,756,000
アルテック	6,600	242.00	1,597,200
タキヒヨー	3,000	1,093.00	3,279,000
蔵王産業	2,000	2,449.00	4,898,000
スズケン	53,300	4,035.00	215,065,500
ジェコス	10,900	917.00	9,995,300
グローセル	14,700	415.00	6,100,500
ローソン	45,200	6,980.00	315,496,000
サンエー	14,000	4,740.00	66,360,000
カワチ薬品	14,500	2,269.00	32,900,500
エービーシー・マート	26,600	8,108.00	215,672,800
ハードオフコーポレーション	5,200	1,470.00	7,644,000
アスクル	37,900	1,969.00	74,625,100
ゲオホールディングス	18,000	2,447.00	44,046,000
アダストリア	22,200	2,946.00	65,401,200
くら寿司	21,500	3,090.00	66,435,000
キャンドウ	6,700	2,910.00	19,497,000
IKホールディングス	5,100	374.00	1,907,400
パルグループホールディングス	18,000	4,270.00	76,860,000
エディオン	72,400	1,461.00	105,776,400
サーラコーポレーション	38,900	718.00	27,930,200
ワッツ	6,600	626.00	4,131,600

ハローズ	8,400	3,865.00	32,466,000
あみやき亭	4,500	3,400.00	15,300,000
大黒天物産	5,700	6,220.00	35,454,000
ハニーズホールディングス	14,700	1,614.00	23,725,800
ファーマライズホールディングス	3,300	621.00	2,049,300
アルペン	15,300	1,875.00	28,687,500
ハブ	4,500	968.00	4,356,000
クオールホールディングス	25,300	1,830.00	46,299,000
ジーンズホールディングス	10,900	3,440.00	37,496,000
ビックカメラ	97,300	1,099.00	106,932,700
D C Mホールディングス	106,300	1,234.00	131,174,200
Monotaro	258,500	1,661.00	429,368,500
東京一番フーズ	3,700	518.00	1,916,600
きちりホールディングス	2,900	839.00	2,433,100
アークランドサービスホールディングス	15,100	2,998.00	45,269,800
J.フロント リテイリング	226,800	1,544.50	350,292,600
ドトール・日レスホールディングス	32,500	2,254.00	73,255,000
マツキヨココカラ&カンパニー	110,500	8,845.00	977,372,500
ブロンコピリー	10,800	2,911.00	31,438,800
Z O Z O	120,600	2,710.00	326,826,000
トレジャー・ファクトリー	7,900	1,478.00	11,676,200
物語コーポレーション	30,600	4,110.00	125,766,000
三越伊勢丹ホールディングス	307,000	1,686.50	517,755,500
Hamee	6,800	1,075.00	7,310,000
マーケットエンタープライズ	1,500	1,165.00	1,747,500
ウエルシアホールディングス	94,700	2,615.00	247,640,500
クリエイティブSDホールディングス	30,200	3,620.00	109,324,000
丸善CHIホールディングス	15,700	335.00	5,259,500
ミサワ	3,000	614.00	1,842,000
ティーライフ	2,000	1,406.00	2,812,000
チムニー	3,700	1,422.00	5,261,400
シュッピン	14,000	1,200.00	16,800,000
オイシックス・ラ・大地	24,700	1,747.00	43,150,900
ネクステージ	41,700	3,295.00	137,401,500
ジョイフル本田	53,300	1,708.00	91,036,400
鳥貴族ホールディングス	6,900	2,984.00	20,589,600
ホットランド	14,200	1,608.00	22,833,600
すかいらーくホールディングス	249,300	1,996.50	497,727,450
SFPホールディングス	10,000	2,293.00	22,930,000
綿半ホールディングス	14,400	1,344.00	19,353,600
ヨシックスホールディングス	2,600	2,723.00	7,079,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	59,800	1,122.00	67,095,600

ゴルフダイジェスト・オンライン	8,900	739.00	6,577,100	
B E E N O S	8,000	1,598.00	12,784,000	
あさひ	15,600	1,259.00	19,640,400	
日本調剤	12,800	1,310.00	16,768,000	
コスモス薬品	18,100	16,970.00	307,157,000	
トーエル	6,000	749.00	4,494,000	
セブン&アイ・ホールディングス	627,800	5,959.00	3,741,060,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	137,000	1,157.00	158,509,000	
ツルハホールディングス	38,300	10,635.00	407,320,500	
サンマルクホールディングス	14,900	1,848.00	27,535,200	
フェリシモ	3,200	1,003.00	3,209,600	
トリドールホールディングス	45,400	3,820.00	173,428,000	
T O K Y O B A S E	20,200	289.00	5,837,800	
ウイルプラスホールディングス	2,300	1,149.00	2,642,700	
J Mホールディングス	14,000	1,872.00	26,208,000	
サツドラホールディングス	6,100	773.00	4,715,300	
アレンザホールディングス	14,100	1,005.00	14,170,500	
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,538.00	7,997,600	
パロックジャパンリミテッド	12,300	850.00	10,455,000	
クスリのアオキホールディングス	16,300	8,876.00	144,678,800	
力の源ホールディングス	7,000	2,097.00	14,679,000	
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	97,300	2,525.00	245,682,500	
メディカルシステムネットワーク	17,100	378.00	6,463,800	
はるやまホールディングス	6,000	497.00	2,982,000	
ノジマ	59,800	1,245.00	74,451,000	
カッパ・クリエイト	28,600	1,581.00	45,216,600	
ライトオン	9,200	571.00	5,253,200	
良品計画	199,100	1,895.50	377,394,050	
パリミキホールディングス	16,600	340.00	5,644,000	
アドヴァングループ	17,800	958.00	17,052,400	
アルビス	6,100	2,419.00	14,755,900	
コナカ	13,200	427.00	5,636,400	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,605.00	2,889,000	
G - 7ホールディングス	23,100	1,239.00	28,620,900	
イオン北海道	27,100	858.00	23,251,800	
コジマ	30,800	659.00	20,297,200	
ヒマラヤ	4,300	958.00	4,119,400	
コーナン商事	24,700	3,535.00	87,314,500	
エコス	7,000	2,039.00	14,273,000	
ワタミ	22,000	1,008.00	22,176,000	

パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	367,800	2,837.50	1,043,632,500
西松屋チェーン	40,600	1,720.00	69,832,000
ゼンショーホールディングス	99,800	6,711.00	669,757,800
幸楽苑ホールディングス	11,900	974.00	11,590,600
ハークスレイ	5,000	675.00	3,375,000
サイゼリヤ	27,000	4,470.00	120,690,000
V Tホールディングス	70,100	502.00	35,190,200
魚力	5,900	2,130.00	12,567,000
フジ・コーポレーション	10,600	1,890.00	20,034,000
ユナイテッドアローズ	19,600	2,125.00	41,650,000
ハイデイ日高	27,200	2,577.00	70,094,400
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	9,700	182.00	1,765,400
コロワイド	83,900	2,286.50	191,837,350
壱番屋	14,500	5,540.00	80,330,000
P L A N T	3,400	762.00	2,590,800
スギホールディングス	36,800	6,520.00	239,936,000
薬王堂ホールディングス	10,400	2,509.00	26,093,600
スクロール	27,500	968.00	26,620,000
ヨンドシーホールディングス	15,900	1,898.00	30,178,200
木曽路	27,800	2,584.00	71,835,200
S R S ホールディングス	30,500	1,036.00	31,598,000
千趣会	34,700	399.00	13,845,300
リテールパートナーズ	27,300	1,461.00	39,885,300
ケーヨー	29,500	856.00	25,252,000
上新電機	16,500	2,083.00	34,369,500
日本瓦斯	96,700	2,206.00	213,320,200
ロイヤルホールディングス	35,200	2,644.00	93,068,800
いなげや	17,800	1,470.00	26,166,000
チヨダ	17,900	980.00	17,542,000
ライフコーポレーション	16,000	3,580.00	57,280,000
リンガーハット	23,500	2,406.00	56,541,000
M r M a x H D	26,300	596.00	15,674,800
A O K I ホールディングス	34,000	965.00	32,810,000
オークワ	29,300	846.00	24,787,800
コメリ	28,200	3,040.00	85,728,000
青山商事	39,300	1,397.00	54,902,100
しまむら	21,400	15,220.00	325,708,000
はせがわ	7,000	345.00	2,415,000
高島屋	137,400	2,197.50	301,936,500
松屋	31,000	1,112.00	34,472,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	88,800	1,688.00	149,894,400

近鉄百貨店	8,000	2,431.00	19,448,000
丸井グループ	134,400	2,408.00	323,635,200
アクシアル リテイリング	12,500	3,570.00	44,625,000
イオン	617,500	3,040.00	1,877,200,000
イズミ	27,700	3,592.00	99,498,400
平和堂	30,500	2,343.00	71,461,500
フジ	28,000	1,842.00	51,576,000
ヤオコー	20,600	7,607.00	156,704,200
ゼビオホールディングス	25,100	986.00	24,748,600
ケーズホールディングス	129,100	1,308.50	168,927,350
Olympicグループ	5,400	515.00	2,781,000
日産東京販売ホールディングス	16,600	438.00	7,270,800
シルバーライフ	3,900	1,172.00	4,570,800
Genky DrugStores	8,100	5,060.00	40,986,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,075.00	2,580,000
ブックオフグループホールディングス	8,300	1,213.00	10,067,900
ギフトホールディングス	8,000	2,400.00	19,200,000
アインホールディングス	25,200	4,934.00	124,336,800
元気寿司	5,300	4,850.00	25,705,000
ヤマダホールディングス	748,000	459.00	343,332,000
アークランズ	26,900	1,636.00	44,008,400
ニトリホールディングス	73,700	16,115.00	1,187,675,500
グルメ杵屋	15,200	1,109.00	16,856,800
愛眼	9,000	179.00	1,611,000
ケーユーホールディングス	11,000	1,161.00	12,771,000
吉野家ホールディングス	71,500	2,789.00	199,413,500
松屋フーズホールディングス	8,700	4,125.00	35,887,500
サガミホールディングス	29,600	1,346.00	39,841,600
関西フードマーケット	16,800	1,403.00	23,570,400
王将フードサービス	12,100	6,830.00	82,643,000
ミニストップ	13,300	1,472.00	19,577,600
アークス	33,600	2,537.00	85,243,200
パローホールディングス	35,000	2,076.00	72,660,000
ベルク	9,100	6,550.00	59,605,000
大庄	7,000	1,127.00	7,889,000
ファーストリテイリング	82,000	33,070.00	2,711,740,000
サンドラッグ	69,300	4,203.00	291,267,900
サクスパー ホールディングス	17,800	932.00	16,589,600
ヤマザワ	2,600	1,276.00	3,317,600
やまや	2,700	2,863.00	7,730,100
ベルーナ	44,500	681.00	30,304,500
いよぎんホールディングス	201,800	954.80	192,678,640

しずおかフィナンシャルグループ	376,700	1,133.00	426,801,100
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	142,800	919.80	131,347,440
楽天銀行	59,000	1,903.00	112,277,000
島根銀行	3,900	494.00	1,926,600
じもとホールディングス	10,000	396.00	3,960,000
めぶきフィナンシャルグループ	841,400	384.90	323,854,860
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,700	3,535.00	76,709,500
九州フィナンシャルグループ	298,300	643.70	192,015,710
ゆうちょ銀行	465,800	1,153.50	537,300,300
富山第一銀行	53,800	772.00	41,533,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	909,800	610.00	554,978,000
西日本フィナンシャルホールディングス	105,200	1,390.00	146,228,000
三十三フィナンシャルグループ	15,200	1,660.00	25,232,000
第四北越フィナンシャルグループ	26,600	3,485.00	92,701,000
ひろぎんホールディングス	221,200	836.80	185,100,160
おきなわフィナンシャルグループ	15,600	2,136.00	33,321,600
十六フィナンシャルグループ	22,000	3,420.00	75,240,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,900	4,835.00	86,546,500
プロクレアホールディングス	20,800	1,946.00	40,476,800
あいちフィナンシャルグループ	23,700	2,400.00	56,880,000
あおぞら銀行	106,600	2,778.00	296,134,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,619,100	1,093.50	11,611,985,850
りそなホールディングス	2,143,100	715.00	1,532,316,500
三井住友トラスト・ホールディングス	304,700	5,160.00	1,572,252,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,205,100	6,295.00	7,586,104,500
千葉銀行	472,500	983.10	464,514,750
群馬銀行	329,000	623.90	205,263,100
武蔵野銀行	21,800	2,456.00	53,540,800
千葉興業銀行	26,400	695.00	18,348,000
筑波銀行	74,400	211.00	15,698,400
七十七銀行	54,300	2,911.00	158,067,300
秋田銀行	11,400	1,769.00	20,166,600
山形銀行	18,800	1,067.00	20,059,600
岩手銀行	11,600	2,158.00	25,032,800
東邦銀行	134,100	259.00	34,731,900
東北銀行	5,500	1,044.00	5,742,000
ふくおかフィナンシャルグループ	135,400	3,283.00	444,518,200
スルガ銀行	149,500	591.00	88,354,500
八十二銀行	358,100	734.40	262,988,640
山梨中央銀行	17,400	1,384.00	24,081,600
大垣共立銀行	32,300	1,899.00	61,337,700
福井銀行	15,200	1,483.00	22,541,600

清水銀行	6,700	1,503.00	10,070,100
富山銀行	1,700	1,708.00	2,903,600
滋賀銀行	28,200	2,930.00	82,626,000
南都銀行	25,500	2,518.00	64,209,000
百五銀行	159,500	481.00	76,719,500
京都銀行	53,700	7,876.00	422,941,200
紀陽銀行	60,700	1,444.00	87,650,800
ほくほくフィナンシャルグループ	107,800	1,220.50	131,569,900
山陰合同銀行	106,100	867.00	91,988,700
鳥取銀行	3,600	1,198.00	4,312,800
百十四銀行	15,500	2,152.00	33,356,000
四国銀行	26,900	894.00	24,048,600
阿波銀行	23,800	2,134.00	50,789,200
大分銀行	10,200	2,301.00	23,470,200
宮崎銀行	11,100	2,460.00	27,306,000
佐賀銀行	9,900	1,728.00	17,107,200
琉球銀行	38,900	1,005.00	39,094,500
セブン銀行	607,400	306.20	185,985,880
みずほフィナンシャルグループ	2,452,200	2,259.00	5,539,519,800
高知銀行	3,900	956.00	3,728,400
山口フィナンシャルグループ	166,300	1,096.50	182,347,950
名古屋銀行	11,200	3,945.00	44,184,000
北洋銀行	256,900	283.00	72,702,700
大光銀行	3,400	1,170.00	3,978,000
愛媛銀行	22,800	855.00	19,494,000
トマト銀行	3,700	1,072.00	3,966,400
京葉銀行	77,600	558.00	43,300,800
栃木銀行	77,600	272.00	21,107,200
北日本銀行	5,900	2,087.00	12,313,300
東和銀行	31,100	550.00	17,105,000
福島銀行	11,900	212.00	2,522,800
大東銀行	4,400	660.00	2,904,000
トモニホールディングス	137,000	379.00	51,923,000
フィデアホールディングス	17,500	1,450.00	25,375,000
池田泉州ホールディングス	217,100	248.00	53,840,800
F P G	57,500	1,390.00	79,925,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,000	1,430.00	20,020,000
マーキュリアホールディングス	6,000	741.00	4,446,000
S B I ホールディングス	245,600	2,837.50	696,890,000
ジャフコ グループ	56,700	1,729.00	98,034,300
大和証券グループ本社	1,212,700	767.40	930,625,980
野村ホールディングス	3,055,400	536.00	1,637,694,400

岡三証券グループ	149,100	540.00	80,514,000
丸三証券	56,700	485.00	27,499,500
東洋証券	56,700	326.00	18,484,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	184,900	421.00	77,842,900
光世証券	2,800	575.00	1,610,000
水戸証券	45,900	402.00	18,451,800
いちよし証券	31,500	661.00	20,821,500
松井証券	100,300	802.00	80,440,600
マネックスグループ	183,000	503.00	92,049,000
極東証券	21,300	729.00	15,527,700
岩井コスモホールディングス	19,400	1,671.00	32,417,400
アイザワ証券グループ	24,700	813.00	20,081,100
マネーパートナーズグループ	12,300	286.00	3,517,800
スパークス・グループ	19,000	1,436.00	27,284,000
かんぽ生命保険	197,400	2,225.50	439,313,700
S O M P Oホールディングス	291,000	6,158.00	1,791,978,000
アニコム ホールディングス	57,600	653.00	37,612,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	345,100	5,100.00	1,760,010,000
第一生命ホールディングス	828,400	2,599.50	2,153,425,800
東京海上ホールディングス	1,676,000	3,101.00	5,197,276,000
T & Dホールディングス	455,000	2,230.50	1,014,877,500
アドバンスクリエイト	9,800	1,100.00	10,780,000
全国保証	44,400	5,005.00	222,222,000
あんしん保証	6,600	276.00	1,821,600
イントラスト	4,700	920.00	4,324,000
日本モーゲージサービス	6,900	555.00	3,829,500
C a s a	4,800	848.00	4,070,400
アルヒ	21,300	919.00	19,574,700
プレミアグループ	28,800	1,540.00	44,352,000
ネットプロテクションズホールディングス	57,200	361.00	20,649,200
クレディセゾン	107,600	2,089.00	224,776,400
芙蓉総合リース	15,600	11,450.00	178,620,000
みずほリース	25,300	4,510.00	114,103,000
東京センチュリー	31,700	5,257.00	166,646,900
日本証券金融	62,600	1,126.00	70,487,600
アイフル	281,800	326.00	91,866,800
リコーリース	16,200	4,135.00	66,987,000
イオンフィナンシャルサービス	97,600	1,240.50	121,072,800
アコム	303,600	333.70	101,311,320
ジャックス	18,100	4,790.00	86,699,000
オリエントコーポレーション	44,600	1,078.00	48,078,800
オリックス	1,113,100	2,594.00	2,887,381,400

三菱HCキャピタル	661,500	893.20	590,851,800
九州リースサービス	5,700	807.00	4,599,900
日本取引所グループ	476,600	2,509.50	1,196,027,700
イー・ギャランティ	27,700	1,914.00	53,017,800
アサックス	5,600	640.00	3,584,000
NECキャピタルソリューション	8,400	3,025.00	25,410,000
大東建託	62,200	15,375.00	956,325,000
いちご	197,700	279.00	55,158,300
日本駐車場開発	182,600	216.00	39,441,600
スター・マイカ・ホールディングス	20,300	587.00	11,916,100
SREホールディングス	8,500	3,285.00	27,922,500
ADワークスグループ	28,500	201.00	5,728,500
ヒューリック	396,100	1,240.00	491,164,000
三栄建築設計	8,700	2,019.00	17,565,300
野村不動産ホールディングス	106,200	3,517.00	373,505,400
三重交通グループホールディングス	37,400	583.00	21,804,200
サムティ	27,300	2,220.00	60,606,000
ディア・ライフ	29,700	832.00	24,710,400
地主	13,300	1,842.00	24,498,600
プレサンスコーポレーション	27,100	1,840.00	49,864,000
ハウスコム	2,500	898.00	2,245,000
JPMC	10,400	1,060.00	11,024,000
サンセイランディック	4,000	946.00	3,784,000
フージャースホールディングス	26,100	1,033.00	26,961,300
オープンハウスグループ	62,200	4,775.00	297,005,000
東急不動産ホールディングス	510,600	871.30	444,885,780
飯田グループホールディングス	148,800	2,317.50	344,844,000
イーランド	2,200	1,480.00	3,256,000
ムゲンエステート	8,300	913.00	7,577,900
And Doホールディングス	10,100	1,026.00	10,362,600
シーアールイー	9,900	1,405.00	13,909,500
ケイアイスター不動産	8,300	4,440.00	36,852,000
グッドコムアセット	16,500	855.00	14,107,500
ジェイ・エス・ビー	4,300	5,600.00	24,080,000
ロードスターキャピタル	11,400	1,607.00	18,319,800
テンポイノベーション	4,000	1,181.00	4,724,000
フェイスネットワーク	3,500	1,309.00	4,581,500
パーク24	110,500	2,065.00	228,182,500
パラカ	6,300	2,018.00	12,713,400
三井不動産	723,800	3,008.00	2,177,190,400
三菱地所	1,023,500	1,749.50	1,790,613,250
平和不動産	27,700	3,700.00	102,490,000

東京建物	148,500	1,829.50	271,680,750
京阪神ビルディング	29,000	1,250.00	36,250,000
住友不動産	306,700	3,570.00	1,094,919,000
テオオーシー	31,800	607.00	19,302,600
東京楽天地	3,000	4,070.00	12,210,000
レオパレス21	190,900	336.00	64,142,400
スターツコーポレーション	24,600	2,939.00	72,299,400
フジ住宅	24,700	685.00	16,919,500
空港施設	21,700	571.00	12,390,700
明和地所	6,000	997.00	5,982,000
ゴールドクレスト	16,500	1,885.00	31,102,500
エスリード	8,200	2,833.00	23,230,600
日神グループホールディングス	28,500	503.00	14,335,500
日本エスコン	37,900	801.00	30,357,900
MIRARTHホールディングス	85,700	452.00	38,736,400
AVANTIA	7,100	901.00	6,397,100
イオンモール	88,300	1,734.00	153,112,200
毎日コムネット	5,100	725.00	3,697,500
ファースト住建	5,200	1,126.00	5,855,200
カチタス	45,800	2,300.00	105,340,000
トーセイ	28,600	1,711.00	48,934,600
穴吹興産	2,500	1,970.00	4,925,000
サンフロンティア不動産	28,700	1,398.00	40,122,600
FJネクストホールディングス	18,500	1,025.00	18,962,500
インテリックス	2,800	500.00	1,400,000
ランドビジネス	4,100	260.00	1,066,000
サンネクスタグループ	4,000	934.00	3,736,000
グランディハウス	10,600	576.00	6,105,600
日本空港ビルデング	60,100	7,042.00	423,224,200
明豊ファシリティワークス	6,300	741.00	4,668,300
LIFULL	61,500	237.00	14,575,500
MIXI	40,400	2,404.00	97,121,600
ジェイエイシーリクルートメント	16,100	2,564.00	41,280,400
日本M&Aセンターホールディングス	304,100	740.40	225,155,640
メンバーズ	5,400	1,225.00	6,615,000
中広	2,400	411.00	986,400
UTグループ	26,100	2,383.00	62,196,300
アイティメディア	6,900	1,091.00	7,527,900
E・Jホールディングス	10,500	1,595.00	16,747,500
オープンアップグループ	53,200	2,051.00	109,113,200
コシダカホールディングス	53,200	1,248.00	66,393,600
アルトナー	3,000	1,672.00	5,016,000

パソナグループ	21,700	1,581.00	34,307,700
C D S	3,100	1,679.00	5,204,900
リンクアンドモチベーション	51,000	419.00	21,369,000
エス・エム・エス	67,400	2,694.50	181,609,300
サニーサイドアップグループ	4,000	712.00	2,848,000
パーソルホールディングス	195,300	2,476.50	483,660,450
リニカル	7,100	688.00	4,884,800
クックパッド	50,400	160.00	8,064,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	660.00	4,158,000
学情	9,200	1,819.00	16,734,800
スタジオアリス	9,000	2,195.00	19,755,000
シミックホールディングス	8,700	1,716.00	14,929,200
エプコ	3,600	731.00	2,631,600
N J S	4,000	3,000.00	12,000,000
総合警備保障	328,800	891.00	292,960,800
カカクコム	130,000	1,711.00	222,430,000
アイロムグループ	6,500	1,813.00	11,784,500
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	2,500	636.00	1,590,000
ルネサンス	12,700	908.00	11,531,600
ディップ	31,100	3,340.00	103,874,000
デジタルホールディングス	14,100	1,004.00	14,156,400
新日本科学	18,900	2,113.00	39,935,700
キャリアデザインセンター	2,600	2,003.00	5,207,800
ベネフィット・ワン	82,200	1,147.50	94,324,500
エムスリー	349,800	2,843.50	994,656,300
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	498.00	3,784,800
アウトソーシング	113,800	1,038.50	118,181,300
ウェルネット	9,500	584.00	5,548,000
ワールドホールディングス	8,100	2,338.00	18,937,800
ディー・エヌ・エー	71,000	1,475.00	104,725,000
博報堂D Yホールディングス	225,900	1,308.00	295,477,200
ぐるなび	33,300	325.00	10,822,500
タカミヤ	24,600	496.00	12,201,600
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	707.00	6,221,600
ファンコミュニケーションズ	35,400	383.00	13,558,200
ライク	6,800	1,509.00	10,261,200
ビジネス・ブレークスルー	5,100	407.00	2,075,700
エスプール	51,400	470.00	24,158,000
W D Bホールディングス	9,200	2,011.00	18,501,200
ティア	7,600	452.00	3,435,200
C D G	1,500	1,293.00	1,939,500

アドウェイズ	24,800	598.00	14,830,400
バリューコマース	15,800	1,177.00	18,596,600
インフォーマート	184,500	413.00	76,198,500
J Pホールディングス	51,800	319.00	16,524,200
エコナックホールディングス	23,800	84.00	1,999,200
C Lホールディングス	5,300	795.00	4,213,500
プレステージ・インターナショナル	75,000	559.00	41,925,000
アミューズ	9,800	1,550.00	15,190,000
ドリームインキュベータ	5,500	2,773.00	15,251,500
クイック	13,700	2,030.00	27,811,000
T A C	7,200	199.00	1,432,800
電通グループ	174,000	4,162.00	724,188,000
イオンファンタジー	7,700	3,180.00	24,486,000
シーティーエス	20,000	694.00	13,880,000
ネクシィーズグループ	4,100	678.00	2,779,800
H . U . グループホールディングス	51,900	2,541.50	131,903,850
アルプス技研	16,900	2,478.00	41,878,200
日本空調サービス	19,400	768.00	14,899,200
オリエンタルランド	936,700	5,114.00	4,790,283,800
ダスキン	39,500	3,204.00	126,558,000
明光ネットワークジャパン	21,900	656.00	14,366,400
ファルコホールディングス	8,200	2,011.00	16,490,200
ラウンドワン	148,500	564.00	83,754,000
リゾートトラスト	70,000	2,284.00	159,880,000
ビー・エム・エル	21,900	2,744.00	60,093,600
リソー教育	81,600	244.00	19,910,400
早稲田アカデミー	10,000	1,343.00	13,430,000
ユー・エス・エス	182,100	2,491.00	453,611,100
東京個別指導学院	21,600	480.00	10,368,000
サイバーエージェント	391,300	893.30	349,548,290
楽天グループ	1,515,000	539.00	816,585,000
クリーク・アンド・リバー社	10,500	2,092.00	21,966,000
S B I グローバルアセットマネジメント	29,400	541.00	15,905,400
テー・オー・ダブリュー	35,700	300.00	10,710,000
山田コンサルティンググループ	9,200	1,514.00	13,928,800
セントラルスポーツ	6,800	2,387.00	16,231,600
フルキャストホールディングス	17,000	2,042.00	34,714,000
エン・ジャパン	32,100	2,475.00	79,447,500
リソルホールディングス	1,100	4,780.00	5,258,000
テクノプロ・ホールディングス	104,800	3,504.00	367,219,200
アトラグループ	3,400	262.00	890,800
アイ・アールジャパンホールディングス	9,400	2,154.00	20,247,600

KeepEr 技研	11,000	6,230.00	68,530,000
ファーストロジック	3,800	559.00	2,124,200
三機サービス	2,100	1,066.00	2,238,600
Gunosy	14,600	555.00	8,103,000
デザインワン・ジャパン	4,700	165.00	775,500
イー・ガーディアン	6,800	2,626.00	17,856,800
リブセンス	6,600	323.00	2,131,800
ジャパンマテリアル	54,300	2,478.00	134,555,400
ベクトル	28,000	1,257.00	35,196,000
ウチヤマホールディングス	5,900	329.00	1,941,100
チャーム・ケア・コーポレーション	15,000	1,168.00	17,520,000
キャリアリンク	6,600	2,457.00	16,216,200
I B J	14,000	639.00	8,946,000
アサンテ	8,900	1,625.00	14,462,500
バリューHR	15,700	1,196.00	18,777,200
M&Aキャピタルパートナーズ	14,400	2,551.00	36,734,400
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,021.00	6,738,600
E R Iホールディングス	3,200	2,001.00	6,403,200
アビスト	1,900	3,380.00	6,422,000
シグマクシス・ホールディングス	27,100	1,562.00	42,330,200
ウィルグループ	15,000	1,044.00	15,660,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,600	139.00	2,029,400
メドピア	15,900	987.00	15,693,300
レアジョブ	2,600	1,133.00	2,945,800
リクルートホールディングス	1,310,300	4,778.00	6,260,613,400
エラン	23,800	778.00	18,516,400
土木管理総合試験所	6,400	330.00	2,112,000
日本郵政	2,129,800	1,077.50	2,294,859,500
ベルシステム24ホールディングス	24,000	1,501.00	36,024,000
鎌倉新書	20,500	663.00	13,591,500
S M N	3,500	375.00	1,312,500
グローバルキッズCOMPANY	2,600	622.00	1,617,200
エアトリ	13,100	2,312.00	30,287,200
アトラエ	10,800	929.00	10,033,200
ストライク	7,600	2,989.00	22,716,400
ソラスト	49,200	657.00	32,324,400
セラク	5,600	1,302.00	7,291,200
インソース	38,700	1,087.00	42,066,900
ベイカレント・コンサルティング	140,100	4,580.00	641,658,000
Orchestra Holdings	4,100	1,071.00	4,391,100
アイモバイル	8,100	1,192.00	9,655,200
キャリアインデックス	5,100	242.00	1,234,200

MS - J a p a n	4,100	1,098.00	4,501,800
船場	2,800	799.00	2,237,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	63,300	2,229.00	141,095,700
フルテック	1,900	1,090.00	2,071,000
GameWith	4,500	324.00	1,458,000
MS&Consulting	1,800	678.00	1,220,400
ウェルビー	13,600	525.00	7,140,000
エル・ティー・エス	2,400	3,370.00	8,088,000
ミダックホールディングス	10,900	1,625.00	17,712,500
日総工産	13,600	793.00	10,784,800
キュービーネットホールディングス	8,600	1,571.00	13,510,600
RPAホールディングス	24,800	357.00	8,853,600
スプリックス	3,800	781.00	2,967,800
マネジメントソリューションズ	9,800	3,555.00	34,839,000
プロレド・パートナーズ	4,900	484.00	2,371,600
テノ・ホールディングス	1,900	587.00	1,115,300
フロンティア・マネジメント	6,100	1,230.00	7,503,000
ピアラ	2,900	404.00	1,171,600
コプロ・ホールディングス	2,100	2,490.00	5,229,000
ギークス	2,000	662.00	1,324,000
アンビスホールディングス	19,000	2,861.00	54,359,000
カーブスホールディングス	48,700	721.00	35,112,700
フォーラムエンジニアリング	10,600	1,226.00	12,995,600
Fast Fitness Japan	6,200	1,434.00	8,890,800
ダイレクトマーケティングミックス	21,500	541.00	11,631,500
ポピンズ	2,800	1,341.00	3,754,800
LITALICO	13,900	2,032.00	28,244,800
コンフィデンス・インターワークス	900	1,585.00	1,426,500
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	452.00	2,666,800
リログループ	98,700	1,656.00	163,447,200
東祥	12,500	1,216.00	15,200,000
ID&Eホールディングス	10,800	3,325.00	35,910,000
ビーウィズ	4,600	2,483.00	11,421,800
TREホールディングス	37,500	1,125.00	42,187,500
人・夢・技術グループ	6,800	1,604.00	10,907,200
大栄環境	45,100	2,170.00	97,867,000
日本管財ホールディングス	18,700	2,610.00	48,807,000
エイチ・アイ・エス	51,600	2,004.00	103,406,400
ラックランド	8,100	2,995.00	24,259,500
共立メンテナンス	30,400	6,233.00	189,483,200
イチネンホールディングス	19,000	1,305.00	24,795,000
建設技術研究所	9,200	4,140.00	38,088,000

スペース	13,100	922.00	12,078,200
燦ホールディングス	7,700	2,099.00	16,162,300
スバル興業	800	10,690.00	8,552,000
東京テアトル	4,300	1,122.00	4,824,600
タナベコンサルティンググループ	4,900	1,029.00	5,042,100
ナガワ	4,800	6,850.00	32,880,000
東京都競馬	14,900	3,835.00	57,141,500
カナモト	27,600	2,418.00	66,736,800
ニシオホールディングス	16,500	3,580.00	59,070,000
トランス・コスモス	22,100	3,125.00	69,062,500
乃村工藝社	77,500	832.00	64,480,000
藤田観光	7,800	4,815.00	37,557,000
KNT-CTホールディングス	10,600	1,479.00	15,677,400
トーカイ	15,800	1,843.00	29,119,400
セコム	180,300	10,090.00	1,819,227,000
セントラル警備保障	9,600	2,902.00	27,859,200
丹青社	34,700	764.00	26,510,800
メイテック	69,200	2,479.50	171,581,400
応用地質	16,600	2,666.00	44,255,600
船井総研ホールディングス	36,900	2,389.00	88,154,100
進学会ホールディングス	4,900	289.00	1,416,100
オオバ	7,700	857.00	6,598,900
いであ	3,300	1,615.00	5,329,500
学究社	7,200	1,947.00	14,018,400
ベネッセホールディングス	66,200	1,827.50	120,980,500
イオンディライト	19,700	3,125.00	61,562,500
ナック	8,100	967.00	7,832,700
ダイセキ	36,200	4,275.00	154,755,000
ステップ	6,600	1,758.00	11,602,800
合計	254,326,100		548,864,109,140

(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

	2023年 8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2023年 8月21日現在
項目	金額（円）
流動資産	
コール・ローン	1,471,526,272
国債証券	541,712,146,830
地方債証券	32,816,247,744
特殊債券	36,897,383,474
社債券	29,214,788,000
未収入金	494,850,800
未収利息	1,455,162,727
前払費用	46,573,962
流動資産合計	644,108,679,809
資産合計	644,108,679,809
負債の部	
流動負債	
未払金	1,573,167,300
未払解約金	161,914,156
未払利息	3,474
流動負債合計	1,735,084,930
負債合計	1,735,084,930
純資産の部	
元本等	
元本	479,700,304,301
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	162,673,290,578
元本等合計	642,373,594,879
純資産合計	642,373,594,879
負債純資産合計	644,108,679,809

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月21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 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	479,700,304,301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 99,569,000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 1.3391円 (1万口当たり純資産額) (13,391円)

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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 8月21日現在
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	455,042,574,024円
期中追加設定元本額	52,132,940,155円
期中一部解約元本額	27,475,209,878円
期末元本額	479,700,304,301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)	5,440,140,262円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,687,439円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,722,755,009円
世界経済インデックスファンド	5,858,835,769円
DCマイセレクション25	28,103,288,718円
DCマイセレクション50	33,559,707,689円
DCマイセレクション75	10,711,956,590円
DC日本債券インデックス・オープン	413,399,525円
DC日本債券インデックス・オープンS	90,651,910,280円
DC日本債券インデックス・オープンP	64,184,748,962円
DCマイセレクションS25	15,646,565,926円
DCマイセレクションS50	18,032,090,600円
DCマイセレクションS75	4,424,878,600円

区分	2023年 8月21日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2025	593,306,843円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,568,988,729円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	994,108,160円
DC世界経済インデックスファンド	4,436,643,065円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,105,261円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,793,161円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,961,710円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	65,407,639円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	107,192,131円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	27,699,115円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,405,141円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,301,974,886円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	734,023,820円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,154,757,788円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	63,921,454円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	50,028,540円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	920,681,974円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,023,500,086円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,352,713,392円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	102,932,901円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,522,701,272円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,842,207,120円
分散投資コア戦略ファンドA	19,359,832,385円
分散投資コア戦略ファンドS	26,054,049,871円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	274,160,154円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,772,464,820円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,237,106円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,538,010円
SMT インデックスバランス・オープン	73,496,345円
SMT 世界経済インデックス・オープン	44,705,565円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	97,930,147円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	155,098,104円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,369,567円
グローバル経済コア	232,274,903円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	41,340,365円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	26,653,981円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	111,792,716円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	63,984,160円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	18,606,216円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	12,665,229円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	455,473,303円
10資産分散投資ファンド	302,797,964円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	90,246,114,711円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	40,276,724円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,574,104円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	461,517,270円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	12,754,956,420
地方債証券	370,533,018
特殊債券	413,689,138
社債券	209,363,000
合計	13,748,541,576

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第440回利付国債(2年)	470,000,000	470,408,900	
	第441回利付国債(2年)	440,000,000	440,387,200	
	第442回利付国債(2年)	2,400,000,000	2,401,992,000	
	第443回利付国債(2年)	3,300,000,000	3,302,310,000	
	第444回利付国債(2年)	2,925,000,000	2,926,784,250	
	第445回利付国債(2年)	1,160,000,000	1,160,580,000	
	第446回利付国債(2年)	3,060,000,000	3,061,162,800	
	第448回利付国債(2年)	50,000,000	50,004,000	
	第449回利付国債(2年)	1,150,000,000	1,149,896,500	
	第450回利付国債(2年)	50,000,000	49,986,000	
	第451回利付国債(2年)	740,000,000	739,711,400	
	第141回利付国債(5年)	8,820,000,000	8,836,669,800	
	第142回利付国債(5年)	3,910,000,000	3,917,507,200	
	第143回利付国債(5年)	4,480,000,000	4,488,108,800	
	第144回利付国債(5年)	5,050,000,000	5,058,736,500	
	第145回利付国債(5年)	5,120,000,000	5,127,424,000	
	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,806,672,000	
	第147回利付国債(5年)	4,540,000,000	4,534,733,600	
	第148回利付国債(5年)	6,210,000,000	6,200,312,400	
	第149回利付国債(5年)	5,370,000,000	5,358,400,800	
	第150回利付国債(5年)	6,480,000,000	6,461,661,600	
	第151回利付国債(5年)	4,510,000,000	4,493,899,300	
	第152回利付国債(5年)	210,000,000	209,962,200	
	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	5,783,390,200	
	第154回利付国債(5年)	5,180,000,000	5,170,520,600	
	第155回利付国債(5年)	2,730,000,000	2,745,834,000	
	第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,655,475,000	
	第157回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,460,321,200	
	第158回利付国債(5年)	3,730,000,000	3,713,923,700	
	第159回利付国債(5年)	950,000,000	944,775,000	
	第160回利付国債(5年)	300,000,000	299,640,000	
	第1回利付国債(40年)	550,000,000	653,548,500	

第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,292,934,700	
第3回利付国債（40年）	650,000,000	742,800,500	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,085,004,500	
第5回利付国債（40年）	1,150,000,000	1,261,216,500	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,354,915,800	
第7回利付国債（40年）	1,340,000,000	1,374,558,600	
第8回利付国債（40年）	1,490,000,000	1,415,604,300	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,568,394,800	
第10回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,660,968,000	
第11回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,192,367,000	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	896,163,000	
第13回利付国債（40年）	2,330,000,000	1,598,473,200	
第14回利付国債（40年）	2,170,000,000	1,588,657,000	
第15回利付国債（40年）	2,970,000,000	2,388,266,100	
第16回利付国債（40年）	1,030,000,000	905,740,800	
第335回利付国債（10年）	3,710,000,000	3,733,039,100	
第336回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,289,267,200	
第337回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,812,824,000	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,589,776,800	
第339回利付国債（10年）	3,970,000,000	3,998,623,700	
第340回利付国債（10年）	4,430,000,000	4,464,022,400	
第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	5,050,320,800	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,766,092,800	
第343回利付国債（10年）	2,670,000,000	2,672,990,400	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,904,484,000	
第345回利付国債（10年）	4,280,000,000	4,281,412,400	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,748,965,000	
第347回利付国債（10年）	3,550,000,000	3,546,592,000	
第348回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,252,204,200	
第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	5,105,664,000	
第350回利付国債（10年）	6,670,000,000	6,641,252,300	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	4,808,407,500	
第352回利付国債（10年）	4,230,000,000	4,200,263,100	
第353回利付国債（10年）	4,385,000,000	4,346,938,200	
第354回利付国債（10年）	4,720,000,000	4,670,770,400	
第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,602,635,400	
第356回利付国債（10年）	4,630,000,000	4,565,133,700	
第357回利付国債（10年）	3,390,000,000	3,336,471,900	
第358回利付国債（10年）	3,900,000,000	3,829,917,000	
第359回利付国債（10年）	4,145,000,000	4,060,980,850	
第360回利付国債（10年）	5,070,000,000	4,953,339,300	
第361回利付国債（10年）	4,690,000,000	4,570,264,300	

第362回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,626,053,600	
第363回利付国債(10年)	5,490,000,000	5,322,555,000	
第364回利付国債(10年)	5,050,000,000	4,883,602,500	
第365回利付国債(10年)	6,367,000,000	6,141,226,180	
第366回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,007,986,400	
第367回利付国債(10年)	4,900,000,000	4,745,601,000	
第368回利付国債(10年)	4,930,000,000	4,762,232,100	
第369回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,624,654,300	
第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	4,802,943,600	
第371回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,709,575,000	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	126,305,300	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	180,840,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	135,190,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	129,229,100	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	56,483,000	
第6回利付国債(30年)	350,000,000	402,668,000	
第7回利付国債(30年)	380,000,000	436,194,400	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	941,876,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	257,301,600	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	167,016,000	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	286,143,000	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	216,573,400	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	452,264,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	879,000,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	402,403,600	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	237,014,000	
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,328,834,800	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	367,390,800	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	618,568,300	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	571,454,400	
第21回利付国債(30年)	500,000,000	584,160,000	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	644,149,800	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	513,248,000	
第24回利付国債(30年)	780,000,000	932,037,600	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	702,474,000	
第26回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,835,696,000	
第27回利付国債(30年)	1,870,000,000	2,241,064,100	
第28回利付国債(30年)	2,020,000,000	2,422,384,000	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,981,538,500	
第30回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,426,102,100	
第31回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,411,064,200	
第32回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,767,741,900	

第33回利付国債(30年)	2,120,000,000	2,382,328,800
第34回利付国債(30年)	1,865,000,000	2,149,729,550
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,776,806,400
第36回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,705,826,200
第37回利付国債(30年)	2,295,000,000	2,520,919,800
第38回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,630,347,000
第39回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,610,296,800
第40回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,357,070,400
第41回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,345,184,000
第42回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,481,284,000
第43回利付国債(30年)	1,340,000,000	1,417,385,000
第44回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,426,356,000
第45回利付国債(30年)	1,440,000,000	1,467,259,200
第46回利付国債(30年)	1,830,000,000	1,861,860,300
第47回利付国債(30年)	1,660,000,000	1,718,365,600
第48回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,793,934,000
第49回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,722,664,800
第50回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,520,635,400
第51回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,302,633,400
第52回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,330,014,800
第53回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,224,436,500
第54回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,495,970,000
第55回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,378,895,700
第56回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,366,210,200
第57回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,293,240,000
第58回利付国債(30年)	2,260,000,000	1,942,786,400
第59回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,145,813,200
第60回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,188,544,800
第61回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,129,194,400
第62回利付国債(30年)	1,165,000,000	914,979,350
第63回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,103,754,500
第64回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,151,506,400
第65回利付国債(30年)	1,405,000,000	1,061,210,550
第66回利付国債(30年)	1,465,000,000	1,101,255,150
第67回利付国債(30年)	1,695,000,000	1,341,575,550
第68回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,269,823,100
第69回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,156,684,100
第70回利付国債(30年)	1,990,000,000	1,605,830,500
第71回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,214,417,500
第72回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,341,110,200
第73回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,498,113,100
第74回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,753,097,400
第75回利付国債(30年)	1,410,000,000	1,318,744,800

第76回利付国債(30年)	1,960,000,000	1,878,464,000	
第77回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,877,480,000	
第78回利付国債(30年)	1,220,000,000	1,167,491,200	
第79回利付国債(30年)	500,000,000	454,565,000	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	644,798,700	
第73回利付国債(20年)	360,000,000	369,784,800	
第74回利付国債(20年)	200,000,000	205,702,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	134,331,600	
第76回利付国債(20年)	270,000,000	278,145,900	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	299,207,500	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	175,885,400	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	279,841,500	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	228,421,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	405,962,700	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	625,806,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	303,896,800	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	491,432,000	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	305,288,800	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	539,513,700	
第87回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,931,180,700	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	446,552,400	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	371,140,000	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	671,126,400	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	480,757,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	938,696,000	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	437,670,900	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	653,346,600	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	898,931,500	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,709,933,700	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	975,195,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	474,980,000	
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,635,934,000	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	523,876,800	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	786,850,350	
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,303,805,600	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	440,056,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	174,492,800	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,290,778,400	
第106回利付国債(20年)	680,000,000	747,252,000	
第107回利付国債(20年)	700,000,000	767,893,000	
第108回利付国債(20年)	840,000,000	912,643,200	
第109回利付国債(20年)	520,000,000	566,399,600	

第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,210,231,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,075,545,700
第112回利付国債(20年)	790,000,000	871,441,100
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,234,402,800
第114回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,584,855,400
第115回利付国債(20年)	700,000,000	780,906,000
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,856,178,800
第117回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,645,404,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	730,903,800
第119回利付国債(20年)	530,000,000	579,888,900
第120回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,372,184,200
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,620,675,000
第122回利付国債(20年)	900,000,000	986,058,000
第123回利付国債(20年)	1,820,000,000	2,035,215,000
第124回利付国債(20年)	760,000,000	844,474,000
第125回利付国債(20年)	1,280,000,000	1,444,083,200
第126回利付国債(20年)	730,000,000	812,584,900
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,127,926,200
第128回利付国債(20年)	970,000,000	1,074,313,800
第129回利付国債(20年)	740,000,000	813,992,600
第130回利付国債(20年)	1,685,000,000	1,855,825,300
第131回利付国債(20年)	1,320,000,000	1,443,565,200
第132回利付国債(20年)	660,000,000	722,455,800
第133回利付国債(20年)	990,000,000	1,091,593,800
第134回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,634,171,600
第135回利付国債(20年)	630,000,000	690,454,800
第136回利付国債(20年)	1,050,000,000	1,141,686,000
第137回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,316,724,000
第138回利付国債(20年)	980,000,000	1,058,370,600
第139回利付国債(20年)	830,000,000	903,745,500
第140回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,735,240,100
第141回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,758,576,000
第142回利付国債(20年)	1,175,000,000	1,301,853,000
第143回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,984,801,000
第144回利付国債(20年)	710,000,000	767,510,000
第145回利付国債(20年)	2,335,000,000	2,569,784,250
第146回利付国債(20年)	2,760,000,000	3,038,428,800
第147回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,574,500,400
第148回利付国債(20年)	2,130,000,000	2,301,166,800
第149回利付国債(20年)	2,860,000,000	3,088,714,200
第150回利付国債(20年)	2,830,000,000	3,024,336,100
第151回利付国債(20年)	2,415,000,000	2,527,152,600
第152回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,863,683,600

第153回利付国債（20年）	2,510,000,000	2,647,020,900	
第154回利付国債（20年）	2,635,000,000	2,745,037,600	
第155回利付国債（20年）	2,650,000,000	2,694,334,500	
第156回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,585,217,400	
第157回利付国債（20年）	3,070,000,000	2,811,536,700	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,610,575,000	
第159回利付国債（20年）	2,840,000,000	2,722,395,600	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	2,013,835,200	
第161回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,267,092,800	
第162回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,167,835,800	
第163回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,157,586,800	
第164回利付国債（20年）	1,860,000,000	1,728,498,000	
第165回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,879,516,100	
第166回利付国債（20年）	1,850,000,000	1,757,685,000	
第167回利付国債（20年）	2,290,000,000	2,104,235,200	
第168回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,063,085,600	
第169回利付国債（20年）	2,000,000,000	1,764,080,000	
第170回利付国債（20年）	2,440,000,000	2,142,539,600	
第171回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,713,294,800	
第172回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,018,050,800	
第173回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,070,843,500	
第174回利付国債（20年）	2,640,000,000	2,315,992,800	
第175回利付国債（20年）	2,050,000,000	1,821,917,000	
第176回利付国債（20年）	2,660,000,000	2,353,860,600	
第177回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,016,265,500	
第178回利付国債（20年）	2,280,000,000	2,001,247,200	
第179回利付国債（20年）	2,495,000,000	2,181,777,700	
第180回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,162,846,000	
第181回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,175,847,200	
第182回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,314,224,000	
第183回利付国債（20年）	2,440,000,000	2,470,036,400	
第184回利付国債（20年）	1,720,000,000	1,649,583,200	
第185回利付国債（20年）	1,130,000,000	1,080,743,300	
国債証券合計	545,912,000,000	541,712,146,830	
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	99,603,000	
第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	78,835,000	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,978,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	116,005,000	
第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	113,285,000	
第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	108,573,000	
第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	105,592,000	

第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	216,756,000	
第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,796,000	
第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	109,546,000	
第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	79,333,000	
第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	217,038,000	
第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	216,148,000	
第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,280,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	100,475,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	99,911,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,734,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	297,147,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	194,600,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	288,444,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,100,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,732,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,999,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	197,640,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	195,888,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	100,012,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	201,512,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	98,201,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	238,258,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,328,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	218,654,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	109,994,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,236,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	105,066,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	200,972,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,673,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,069,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,875,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,734,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,538,000	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	218,860,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	217,912,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,312,000	
第389回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,545,000	
第395回大阪府公募公債（10年）	151,000,000	151,785,200	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,757,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,729,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,603,760	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,866,000	

第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	197,620,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	98,749,000	
第458回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	96,683,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	153,870,400	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	174,603,520	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	191,704,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	110,082,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	108,672,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,789,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	91,101,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	93,563,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,534,730	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	108,394,000	
第3回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	100,724,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	104,688,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,659,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,499,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	442,288,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,529,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	91,851,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	292,719,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,198,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	99,965,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	84,116,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,280,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,834,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,738,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,772,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,848,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,754,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	300,855,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	110,399,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,521,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,123,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,673,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	199,684,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	278,634,000	

平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,261,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	82,930,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	194,360,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,046,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	156,934,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,827,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	109,807,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	219,854,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,121,637	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,738,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	377,730,600	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,856,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	99,195,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	108,222,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	109,380,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	88,115,000	
第7回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	220,932,000	
第8回埼玉県公募公債（15年）	200,000,000	184,214,000	
第10回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	218,654,000	
第18回埼玉県公募公債（20年）	200,000,000	182,926,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,710,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,629,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,066,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,752,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,672,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,465,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,325,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,364,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,587,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,388,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	110,157,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,142,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	111,386,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,478,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,254,000	

平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,698,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	82,930,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	92,520,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	291,789,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,196,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	90,893,000	
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	98,966,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,690,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	218,760,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	110,089,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,280,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,496,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,758,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,630,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,815,200	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	291,318,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,900,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,440,300	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,714,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,839,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,443,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,911,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	217,196,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	98,687,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,647,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,567,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,088,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,970,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,530,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,409,470	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,717,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,757,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,806,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,747,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,348,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,214,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	398,440,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,465,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,846,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,052,000	

第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,464,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,229,407	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,689,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,717,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,052,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,398,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,576,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,914,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,019,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,790,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,886,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	98,158,870	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,712,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,685,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,538,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	220,102,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	78,211,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	300,000,000	274,992,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	94,262,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	192,560,000	
第1回名古屋市公募公債（12年）	100,000,000	101,667,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,223,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,746,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	108,720,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	104,638,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,964,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	291,705,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	199,692,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	127,966,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	219,020,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	110,716,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,339,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,479,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	78,375,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	103,743,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	328,908,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,759,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,829,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,921,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,312,000	

	平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,488,000	
	第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	209,646,000	
	令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	291,732,000	
	令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,277,000	
	平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	104,360,000	
	平成26年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,458,000	
	平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,057,000	
	令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	196,444,000	
	第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	108,591,000	
	第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,801,000	
	第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,632,000	
	平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,477,000	
	平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,727,000	
	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,722,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	109,777,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	106,365,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,130,000	
	平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,498,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,807,850	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,243,500	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	535,298,500	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,121,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,212,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	287,340,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,238,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	98,208,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,742,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,676,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,412,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,402,000	
	地方債証券合計	32,680,430,000	32,816,247,744	
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	99,670,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,901,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,765,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	64,132,000	

第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,240,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,214,000	
第21回道路債券	100,000,000	117,150,000	
第28回道路債券	200,000,000	236,844,000	
第33回道路債券	200,000,000	239,220,000	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,030,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,018,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,574,000	
第42回道路債券	200,000,000	206,542,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,673,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,823,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	219,622,000	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,104,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,241,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,702,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,689,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,855,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,479,000	
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	108,987,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,915,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,600,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,130,000	
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	107,832,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,011,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	557,616,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,220,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	84,394,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,364,000	

第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,561,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,324,000	
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	100,593,000	
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	260,401,190	
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	301,059,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	402,024,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,491,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,084,000	
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	100,498,000	
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	112,784,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,852,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,987,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	78,475,000	
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	106,371,910	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,069,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	204,438,300	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,262,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,369,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,784,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,486,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	296,502,000	
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	99,657,000	
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	119,491,200	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,398,000	
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	278,127,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	212,459,200	
	100,000,000	97,571,000	

第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,177,000	
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	116,101,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	343,083,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,823,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	354,180,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	235,748,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	116,065,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	218,992,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,250,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	154,868,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	106,692,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	217,486,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	107,797,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	535,030,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,590,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,527,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,535,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	421,995,850	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,910,500	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,358,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	208,034,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,550,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,987,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,668,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,412,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,491,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,670,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	250,362,460	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,775,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,727,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,682,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,562,200	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,976,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,996,920	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,310,000	

第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,355,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,980,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,533,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	712,306,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,799,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,154,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,566,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,191,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,098,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,082,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,631,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,426,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,398,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,532,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,423,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	103,183,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,840,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,112,000	
第19回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,696,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,816,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	110,757,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,581,680	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,726,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	208,670,700	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	185,730,270	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	219,892,200	
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,835,000	
第117回都市再生債券	200,000,000	201,926,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	128,530,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	71,012,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	149,826,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,777,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,113,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	104,109,000	103,337,552	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,010,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	71,402,000	71,089,973	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	107,037,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,972,000	9,992,741	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	123,840,000	122,649,897	

第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	141,411,000	139,643,362
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	50,324,000	49,797,107
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,324,000	10,405,249
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	177,867,000	176,049,199
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	122,068,000	120,728,914
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,431,000	10,531,450
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,260,000
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,932,000	14,489,001
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,718,000	14,240,518
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,499,000	16,217,843
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,733,000	18,554,037
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,899,000	19,829,208
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,367,000	20,279,573
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,076,000	41,902,664
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,175,000	18,942,348
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,534,000	19,274,803
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,143,000	18,882,690
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,175,000	17,858,736
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,216,000	10,319,488
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,394,000	37,699,816
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,089,000	19,777,349
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,605,000	26,441,003
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,295,000	25,090,418
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,487,000	25,307,559
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,784,000	54,368,047
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,324,000	66,642,891
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,945,000	34,567,890
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,801,000	35,720,442
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,479,000	36,450,060
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,773,000	31,590,946
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,722,000	30,288,798
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,081,000	36,080,457
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	165,190,500
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,878,000	93,626,438
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,396,000	126,656,275
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,278,000	36,782,264
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,674,000	38,197,291
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,435,000	38,832,417
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,778,000

第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,347,000	122,456,111	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,394,000	41,602,211	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,858,000	87,548,739	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,190,000	49,115,231	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,855,000	52,545,269	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	313,893,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,946,000	51,906,001	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,937,000	162,288,403	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,420,000	109,440,789	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,230,000	53,216,160	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,474,000	57,387,214	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,661,000	61,465,332	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,338,000	67,143,452	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,804,000	66,433,702	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,202,000	67,056,738	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,852,000	67,964,598	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,007,000	67,968,396	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,162,000	69,839,826	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,347,000	70,070,963	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,051,000	69,576,048	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,057,000	69,578,239	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,896,000	70,384,732	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,342,000	142,854,829	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,858,000	70,310,155	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,930,000	143,949,780	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,607,000	71,928,608	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,762,000	143,180,449	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,078,000	72,354,920	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,472,000	145,544,900	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,316,000	146,304,087	

第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,023,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,021,000	74,376,098	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,302,000	73,855,757	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,771,000	73,621,853	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,776,000	151,413,556	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,536,000	75,729,407	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,643,000	75,002,615	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,588,000	151,832,023	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,480,000	76,894,305	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,649,000	230,494,913	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,420,000	155,127,567	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,222,000	80,037,008	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,074,000	80,579,540	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,550,000	165,921,993	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,412,000	83,885,305	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,890,000	167,732,404	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	179,094,000	169,435,460	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,981,000	84,416,274	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,966,000	170,468,694	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,968,000	170,177,091	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,549,000	85,981,708	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,068,000	86,887,333	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,656,000	259,137,936	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,236,000	87,104,911	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,440,000	89,361,344	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,048,000	90,983,747	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,851,000	91,864,556	

第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,394,000	183,899,804	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,292,000	95,192,438	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,262,000	195,322,531	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,594,000	98,688,650	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,135,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,125,000	99,267,740	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,901,000	99,863,037	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,490,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	79,375,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	289,428,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,203,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,421,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,778,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,856,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,448,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,568,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,890,000	
い第876号商工債	300,000,000	298,812,000	
第360回信金中金債(5年)	200,000,000	199,710,000	
第376回信金中金債(5年)	100,000,000	99,522,000	
第379回信金中金債(5年)	100,000,000	99,392,000	
第385回信金中金債(5年)	400,000,000	396,816,000	
第16号商工債(10年)	100,000,000	100,381,000	
第2回信金中金債(10年)	100,000,000	100,637,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	108,008,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,217,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	195,100,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	485,075,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,143,000	
第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	499,540,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,588,000	
第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,330,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,920,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,790,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,848,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,484,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,626,000	
第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	299,907,000	

	第7 1回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,814,000	
	第7 4回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,978,000	
	第7 7回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,438,000	
	第7 8回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,536,000	
	第9 2回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,464,000	
	第1 2 7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,828,000	
	特殊債券合計	36,817,807,000	36,897,383,474	
社債券	第2 4回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	100,000,000	99,891,000	
	第2 9回フランス相互信用連合銀行（BF C M）円貨社債	300,000,000	299,220,000	
	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	99,667,000	
	第1 4回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,911,000	
	第3 2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,244,000	
	第3 3回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,984,000	
	第1 9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,172,000	
	第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	400,000,000	398,516,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債（2 0 2 3）	100,000,000	99,581,000	
	第5 2回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,166,000	
	第3 9回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,141,000	
	第2 4回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,318,000	
	第3 2回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,941,000	
	第1 1回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,617,000	
	第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,235,000	
	第2 4回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,948,000	
	第2 5回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,428,000	
	第2 9回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,962,000	
	第2回D M三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,870,000	
	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	100,087,000	
	第1 9回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,930,000	
	第1 0回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,619,000	
	第1 6回キリンホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,808,000	
	第1 9回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,688,000	
	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	299,751,000	

第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,958,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,804,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,810,000	
第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,718,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,820,000	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,968,000	
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	100,311,000	
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	199,388,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,699,000	
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	99,109,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,444,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,602,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,452,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,806,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	95,894,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,779,000	
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	198,060,000	
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	199,546,000	
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	99,125,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	82,577,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,824,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,885,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,346,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,486,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,892,000	
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	99,754,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,625,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,060,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	100,821,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,086,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,473,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,703,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,417,000	

第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,778,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,628,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,736,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,556,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,358,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,538,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,861,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,554,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,969,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,885,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,353,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,761,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,742,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,098,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,553,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	94,926,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,770,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,216,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,482,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,287,000	
第22回JA三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,399,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,494,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,460,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,859,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,311,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	86,033,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,610,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	109,517,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,858,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,566,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,389,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,770,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,872,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	96,558,000	
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	99,358,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	110,405,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,869,000	

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	100,149,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,410,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,792,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,388,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,390,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,255,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,261,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,544,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,702,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,925,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,708,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,838,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,362,000	
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	99,669,000	
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	99,311,000	
第82回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,510,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,274,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,060,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,485,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,630,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,592,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,769,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,379,000	
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	199,258,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,256,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,577,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,174,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,818,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
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	98,858,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,018,000	

第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,810,000	
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	198,506,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,606,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	198,518,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	86,071,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,151,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,579,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,849,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,347,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,631,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,146,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,464,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,313,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	78,030,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,921,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,097,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,553,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	218,958,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,243,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,304,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,662,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,105,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,563,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,345,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	72,037,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,583,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,806,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	76,459,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,473,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,125,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	85,143,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,076,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,449,000	

第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,462,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	80,180,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,957,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	60,674,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,924,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	81,455,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	156,904,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,632,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,351,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	175,540,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,483,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,362,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,465,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,556,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	83,814,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,801,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	199,688,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,457,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,118,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,273,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,815,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,520,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,053,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,747,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,333,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,742,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,702,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	294,450,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,870,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,603,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,576,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,314,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,499,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,264,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,279,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,990,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,998,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	94,992,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,494,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,804,000	

第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,027,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,586,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,006,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	94,897,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	195,784,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,927,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	89,287,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,814,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,879,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	90,765,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,665,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,789,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,682,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,814,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,155,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	199,008,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,342,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,595,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,975,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,621,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	271,716,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,455,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,717,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	77,170,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,766,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,010,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,875,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	198,658,000	
社債券合計	30,000,000,000	29,214,788,000	
合計		640,640,566,048	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,978,949,518
コール・ローン	722,629,686
株式	551,430,980,498
投資信託受益証券	170,378,170
投資証券	11,241,965,868
派生商品評価勘定	509,283
未収入金	2,413,773
未収配当金	798,291,701
前払金	265,076,840
差入委託証拠金	4,550,993,003
流動資産合計	577,162,188,340
資産合計	577,162,188,340
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	265,967,041
未払解約金	517,795,242
未払利息	1,706
流動負債合計	783,763,989
負債合計	783,763,989
純資産の部	
元本等	
元本	113,463,591,898
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	462,914,832,453
元本等合計	576,378,424,351
純資産合計	576,378,424,351
負債純資産合計	577,162,188,340

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

2023年 8月21日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	113,463,591,898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 5.0799円 (1万口当たり純資産額) (50,799円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p>

	2023年 8月21日現在
	「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	127,919,434,305円
期中追加設定元本額	14,631,493,321円
期中一部解約元本額	29,087,335,728円
期末元本額	113,463,591,898円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,583,601,353円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,440,412円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,008,230,628円
世界経済インデックスファンド	12,295,614,802円
外国株式インデックス・オープン	885,617,445円
D C マイセクション 2 5	652,167,582円
D C マイセクション 5 0	3,525,699,514円
D C マイセクション 7 5	4,354,382,362円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,555,051,482円
D C マイセクション S 2 5	413,199,907円
D C マイセクション S 5 0	1,892,655,717円
D C マイセクション S 7 5	1,869,231,740円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	29,528,417円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	153,557,967円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	117,150,325円
D C 世界経済インデックスファンド	9,361,466,602円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	987,153,969円
マイセクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,777,533円
マイセクション 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）	23,418,554円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,128,323円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	35,548,191円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	7,702,248円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	22,324,805円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	180,327,835円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	137,611,536円
バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用）	1,045,124,142円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	69,652,340円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	17,797,112円
バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用）	122,396,098円
バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用）	39,940,341円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	829,639,486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）	901,199,820円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,125,042,103円

区分	2023年 8月21日現在
コア投資戦略ファンド（安定型）	113,740,322円
コア投資戦略ファンド（成長型）	283,481,970円
分散投資コア戦略ファンドA	1,536,388,239円
分散投資コア戦略ファンドS	7,718,437,187円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,437,232,105円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	998,897,366円
コア投資戦略ファンド（切替型）	133,649,708円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	513,005,246円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,287,642円
SMT インデックスバランス・オープン	128,399,117円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	76,157,099円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	4,291,568,581円
SMT 世界経済インデックス・オープン	243,286,185円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	985,056,127円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	168,936,802円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,240,881円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	972,615,037円
グローバル経済コア	523,247,337円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,283,615円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,443,049円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	116,500,119円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,636,361円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	150,181,859円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	136,544,707円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	56,729,239円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	58,835,344円
10資産分散投資ファンド	53,273,628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）	53,434,274円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	23,713,968円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	449,457,334円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,425,698,702円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,799,064円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	68,475,569円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,722,889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）	70,003,316円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	194,200,383円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	186,765,260円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	185,818,200円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	189,041,134円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	187,171,165円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	85,911,878円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	120,414,728円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	12,151,146,087
投資信託受益証券	13,106,969
投資証券	32,465,640
合計	12,170,504,758

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,837,243,410	-	13,572,166,570	265,076,840
合計		13,837,243,410	-	13,572,166,570	265,076,840

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年 8月21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	296,777,200	-	296,396,282	380,918
	アメリカドル	189,293,000	-	188,899,230	393,770
	ユーロ	107,484,200	-	107,497,052	12,852
合計		296,777,200	-	296,396,282	380,918

(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	44.22	1,034,394.24	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.26	2,726,726.32	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	163.90	2,966,426.10	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	85.93	728,858.26	
	CHEVRON CORP	133,788	160.90	21,526,489.20	
	CONOCOPHILLIPS	90,080	117.29	10,565,483.20	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.78	1,515,287.88	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	49.99	2,512,297.44	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	148.04	1,964,046.68	
	EOG RESOURCES INC	43,691	130.63	5,707,355.33	
	EQT CORPORATION	27,026	43.47	1,174,820.22	
	EXXON MOBIL	301,729	110.04	33,202,259.16	

HALLIBURTON CO	70,302	39.40	2,769,898.80
HESS CORP	19,804	155.56	3,080,710.24
HF SINCLAIR CORP	13,429	57.61	773,644.69
KINDER MORGAN INC	144,061	17.43	2,510,983.23
MARATHON OIL CORP	50,360	26.39	1,329,000.40
MARATHON PETROLEUM CORP	32,827	144.62	4,747,440.74
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,406	64.07	3,421,722.42
ONEOK INC	31,321	65.60	2,054,657.60
OVINTIV INC	14,661	48.28	707,833.08
PHILLIPS 66	34,260	114.24	3,913,862.40
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	237.86	4,132,579.64
SCHLUMBERGER	105,564	58.03	6,125,878.92
TARGA RESOURCES CORP	17,298	84.75	1,466,005.50
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,907.73	1,016,820.09
VALERO ENERGY CORP	26,571	133.58	3,549,354.18
WILLIAMS COS	90,577	34.77	3,149,362.29
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	16,508	284.82	4,701,808.56
ALBEMARLE CORP	8,403	183.39	1,541,026.17
ALCOA CORP	15,500	28.97	449,035.00
AMCOR PLC	110,292	9.57	1,055,494.44
AVERY DENNISON CORP	6,638	177.15	1,175,921.70
BALL CORP	21,539	54.57	1,175,383.23
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	117.70	1,010,101.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13,149	79.05	1,039,428.45
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.96	643,280.00
CORTEVA INC	51,304	50.76	2,604,191.04
CROWN HOLDINGS INC	9,940	87.55	870,247.00
DOW INC	51,372	54.02	2,775,115.44
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	75.40	2,572,572.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	83.63	738,620.16
ECOLAB INC	18,665	179.35	3,347,567.75
FMC CORP	8,264	89.00	735,496.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	105,762	38.84	4,107,796.08
INT'L PAPER CO	25,191	34.51	869,341.41
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	63.69	1,229,662.83
LINDE PLC	36,447	375.10	13,671,269.70
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	97.39	1,922,965.55
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,371	431.17	1,884,644.07
MOSAIC CO/THE	27,732	39.51	1,095,691.32
NEWMONT CORPORATION	61,808	38.20	2,361,065.60
NUCOR CORP	18,727	168.34	3,152,503.18
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,893	146.98	866,153.14

PPG INDUSTRIES INC	17,495	139.53	2,441,077.35
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	278.47	1,148,967.22
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	100.86	1,054,592.16
SEALED AIR CORP	11,690	34.46	402,837.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,250	270.15	4,930,237.50
STEEL DYNAMICS INC	11,618	105.24	1,222,678.32
VULCAN MATERIALS CO	10,153	211.80	2,150,405.40
WESTLAKE CORP	2,222	130.36	289,659.92
WESTROCK CO	21,356	32.11	685,741.16
3 M COMPANY	40,676	100.01	4,068,006.76
AECOM	10,456	86.89	908,521.84
AERCAP HOLDINGS NV	11,968	61.29	733,518.72
ALLEGION PLC	5,598	107.63	602,512.74
AMETEK INC	17,753	154.45	2,741,950.85
AXON ENTERPRISE INC	5,367	200.10	1,073,936.70
BOEING CO	42,311	226.65	9,589,788.15
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	134.14	1,476,881.40
CARLISLE COS INC	3,456	266.59	921,335.04
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	53.39	3,313,543.57
CATERPILLAR	38,381	273.80	10,508,717.80
CUMMINS INC	10,414	233.62	2,432,918.68
DEERE&CO	20,925	397.02	8,307,643.50
DOVER CORP	10,657	140.57	1,498,054.49
EATON CORP	29,584	214.65	6,350,205.60
EMERSON ELECTRIC CO	42,473	95.79	4,068,488.67
FASTENAL CO	44,011	57.49	2,530,192.39
FERGUSON PLC	14,498	155.30	2,251,539.40
FORTIVE CORP	25,894	76.08	1,970,015.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	66.51	685,718.10
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	113.35	590,666.85
GENERAL DYNAMICS CORP	17,004	224.42	3,816,037.68
GENERAL ELECTRIC CO	81,042	111.79	9,059,685.18
GRACO INC	13,378	75.47	1,009,637.66
GRAINGER (WW) INC	3,363	703.55	2,366,038.65
HEICO CORP	3,640	164.35	598,234.00
HEICO CORP-CLASS A	4,690	130.63	612,654.70
HONEYWELL INTL INC	49,482	186.58	9,232,351.56
HOWMET AEROSPACE INC	26,751	48.78	1,304,913.78
HUBBELL INC	3,709	303.53	1,125,792.77
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	219.44	544,650.08
IDEX CORP	5,916	219.42	1,298,088.72
ILLINOIS TOOL WORKS	22,658	235.78	5,342,303.24

INGERSOLL-RAND INC	31,562	66.49	2,098,557.38
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	45.21	574,167.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	59.29	2,980,271.14
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	181.48	2,664,489.36
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	348.60	880,563.60
LOCKHEED MARTIN CORP	16,942	450.06	7,624,916.52
MASCO CORP	15,277	56.79	867,580.83
NORDSON CORP	4,121	232.33	957,431.93
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,740	430.17	4,620,025.80
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	83.73	2,571,934.41
OWENS CORNING	6,460	136.37	880,950.20
PACCAR INC	38,842	84.66	3,288,363.72
PARKER HANNIFIN CORP	9,535	397.76	3,792,641.60
PENTAIR PLC	10,813	66.60	720,145.80
QUANTA SERVICES INC	10,250	203.07	2,081,467.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	291.54	2,468,177.64
RTX CORP	108,761	85.80	9,331,693.80
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	37.71	521,453.88
SMITH (A.O.) CORP	9,016	68.92	621,382.72
SNAP-ON INC	4,000	268.55	1,074,200.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	89.72	1,130,292.56
TEXTRON	13,437	75.25	1,011,134.25
TORO CO	8,812	98.28	866,043.36
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	196.95	3,353,664.60
TRANSDIGM GROUP INC	4,084	857.13	3,500,518.92
UNITED RENTALS INC	5,364	451.41	2,421,363.24
WABTEC CORP	13,304	111.35	1,481,400.40
WATSCO INC	2,656	344.63	915,337.28
XYLEM INC	16,864	99.46	1,677,293.44
AUTOMATIC DATA PROCESS	30,799	251.05	7,732,088.95
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	113.77	1,051,234.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,290	179.00	1,483,910.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	69.86	745,266.48
CINTAS CORP	6,804	485.44	3,302,933.76
CLARIVATE PLC	27,357	7.09	193,961.13
COPART INC	31,883	86.84	2,768,719.72
EQUIFAX INC	9,160	192.16	1,760,185.60
JACOBS SOLUTIONS INC	8,667	133.55	1,157,477.85
LEIDOS HOLDINGS	8,529	96.10	819,636.90
PAYCHEX INC	24,118	120.48	2,905,736.64
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	281.32	1,191,390.20
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	191.49	655,470.27

REPUBLIC SERVICES INC	16,455	146.28	2,407,037.40
ROBERT HALF INC	7,185	74.65	536,360.25
ROLLINS INC	17,468	40.31	704,135.08
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	55.05	847,880.10
TRANSUNION	15,741	77.25	1,215,992.25
VERISK ANALYTICS INC	10,738	230.94	2,479,833.72
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	138.00	2,728,950.00
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	158.87	4,803,593.32
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	94.99	794,781.33
CSX CORP	152,261	30.87	4,700,297.07
DELTA AIR LINES INC	9,648	41.49	400,295.52
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	115.83	1,422,392.40
FEDEX CORP	17,749	262.65	4,661,774.85
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.24	366,155.64
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	191.01	1,097,925.48
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	56.39	768,200.97
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	212.11	3,588,901.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	393.49	2,894,512.44
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	32.15	435,085.95
U-HAUL HOLDING CO	6,606	53.65	354,411.90
UBER TECHNOLOGIES INC	134,723	44.69	6,020,770.87
UNION PACIFIC CORP	45,361	225.26	10,218,018.86
UNITED PARCEL SERVICE B	53,764	171.24	9,206,547.36
APTIV PLC	19,053	95.88	1,826,801.64
BORGWARNER INC	19,781	39.64	784,118.84
FORD MOTOR COMPANY	290,797	11.96	3,477,932.12
GENERAL MOTORS CO	103,664	33.12	3,433,351.68
LEAR CORP	3,648	141.97	517,906.56
LUCID GROUP INC	61,234	6.18	378,426.12
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	20.78	1,066,762.08
TESLA INC	212,019	215.49	45,687,974.31
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	557.29	1,171,980.87
DR HORTON INC	22,973	117.31	2,694,962.63
GARMIN LTD	10,561	101.55	1,072,469.55
HASBRO INC	10,572	63.76	674,070.72
LENNAR CORP-CL A	18,864	117.00	2,207,088.00
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	381.29	3,286,338.51
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	97.61	406,350.43
NIKE B	91,582	104.81	9,598,709.42
NVR INC	247	6,078.96	1,501,503.12
PULTE GROUP INC	16,747	79.30	1,328,037.10
VF CORP	25,718	20.01	514,617.18

WHIRLPOOL CORP	3,785	135.15	511,542.75
AIRBNB INC-CLASS A	30,729	125.06	3,842,968.74
ARAMARK	16,686	36.70	612,376.20
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,058.43	8,560,545.57
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	52.10	914,876.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	15.59	1,119,517.90
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,047	1,849.20	3,785,312.40
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	158.47	1,459,033.29
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	378.83	1,078,907.84
DOORDASH INC - A	19,212	77.82	1,495,077.84
EXPEDIA GROUP INC	11,638	107.21	1,247,709.98
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,175	150.80	2,891,590.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	112.71	426,832.77
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	53.34	1,363,370.40
MARRIOTT INTL A	19,516	202.09	3,943,988.44
MCDONALD'S CORP	54,264	281.74	15,288,339.36
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	42.54	967,955.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	99.20	1,697,907.20
STARBUCKS CORP	85,428	97.23	8,306,164.44
VAIL RESORTS INC	3,014	224.91	677,878.74
WYNN RESORTS LTD	6,702	93.88	629,183.76
YUM BRANDS INC	19,972	129.12	2,578,784.64
ACTIVISION BLIZZARD INC	55,381	90.47	5,010,319.07
ALPHABET INC-CL A	442,712	127.46	56,428,071.52
ALPHABET INC-CL C	399,244	128.11	51,147,148.84
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	420.47	3,024,020.24
COMCAST CORP-CL A	312,679	45.76	14,308,191.04
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	118.36	2,335,597.88
FOX CORP - CLASS A	21,544	33.45	720,646.80
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.29	323,695.05
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.35	922,330.85
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	89.59	820,017.27
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	66.39	1,021,011.81
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	23.80	323,299.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	84.39	980,021.07
MATCH GROUP INC	22,730	44.40	1,009,212.00
META PLATFORMS INC-CLASS A	164,626	283.25	46,630,314.50
NETFLIX INC	33,103	404.53	13,391,156.59
NEWS CORP-CLASS A	33,479	20.76	695,024.04
OMNICOM GROUP	14,048	79.91	1,122,575.68
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	14.81	481,443.48
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	26.45	1,210,537.15

ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	27.51	784,117.53
ROKU INC	9,122	79.30	723,374.60
SEA LTD-ADR	28,338	38.68	1,096,113.84
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.49	271,501.32
SNAP INC - A	63,578	9.18	583,646.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	137.46	1,768,697.82
THE WALT DISNEY CO	135,788	85.96	11,672,336.48
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	72.18	2,424,020.94
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	12.78	2,267,338.14
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	17.43	382,327.05
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	69.83	322,335.28
AMAZON.COM	686,233	133.22	91,419,960.26
AUTOZONE INC	1,368	2,458.39	3,363,077.52
BATH & BODY WORKS INC	13,528	36.52	494,042.56
BEST BUY COMPANY INC	15,285	78.59	1,201,248.15
BURLINGTON STORES INC	5,108	172.23	879,750.84
CARMAX INC	10,695	82.49	882,230.55
CHEWY INC - CLASS A	6,878	27.49	189,076.22
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	146.62	725,769.00
EBAY	41,952	42.99	1,803,516.48
ETSY INC	10,294	73.78	759,491.32
GENUINE PARTS CO	9,903	154.87	1,533,677.61
HOME DEPOT	75,273	327.37	24,642,122.01
LKQ CORP	19,286	52.39	1,010,393.54
LOWES COMPANIES	44,328	219.35	9,723,346.80
MERCADOLIBRE INC	3,353	1,199.59	4,022,225.27
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	938.00	4,293,226.00
POOL CORP	2,664	349.49	931,041.36
ROSS STORES INC	25,425	118.72	3,018,456.00
TJX COMPANIES INC	85,671	89.52	7,669,267.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	219.32	1,720,784.72
ULTA BEAUTY INC	3,920	452.93	1,775,485.60
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	21.83	545,750.00
COSTCO WHOLESALE CORP	32,965	544.94	17,963,947.10
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	162.99	2,654,618.13
DOLLAR TREE INC	16,318	142.81	2,330,373.58
KROGER CO	50,664	47.57	2,410,086.48
SYSCO CORP	36,197	71.47	2,586,999.59
TARGET (DAYTON HUDSON)	34,220	131.21	4,490,006.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	26.54	1,368,588.18
WALMART INC	110,203	157.93	17,404,359.79
ALTRIA GROUP INC	132,765	42.91	5,696,946.15

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	82.83	3,364,388.94
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	67.86	1,629,047.16
BUNGE LIMITED	11,604	112.53	1,305,798.12
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	42.83	679,669.27
COCA-COLA CO	305,497	60.95	18,620,042.15
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	62.57	963,202.58
CONAGRA BRANDS INC	33,324	30.19	1,006,051.56
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,979	257.07	3,079,441.53
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	63.83	845,236.86
GENERAL MILLS INC	43,531	70.21	3,056,311.51
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	218.78	2,393,890.76
HORMEL FOODS CORP	23,338	39.29	916,950.02
JM SMUCKER CO	7,850	142.05	1,115,092.50
KELLOGG CO	18,819	61.85	1,163,955.15
KEURIG DR PEPPER INC	65,371	33.75	2,206,271.25
KRAFT HEINZ CO/THE	56,982	33.66	1,918,014.12
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	94.75	1,125,251.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	84.97	1,537,277.24
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	63.03	924,587.07
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	101,324	71.13	7,207,176.12
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	57.36	3,346,841.28
PEPSICO INC	102,377	178.18	18,241,533.86
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	115,372	94.36	10,886,501.92
TYSON FOODS INC	23,306	54.63	1,273,206.78
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	93.09	1,800,919.14
CLOROX COMPANY	9,570	153.85	1,472,344.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	74.55	4,380,632.55
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	156.69	2,659,499.37
KIMBERLY-CLARK CORP	24,643	128.24	3,160,218.32
PROCTER & GAMBLE CO	175,356	152.54	26,748,804.24
ABBOTT LABORATORIES	129,183	103.71	13,397,568.93
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	350.36	1,840,441.08
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,469	180.40	2,249,407.60
BAXTER INTERNATIONAL	34,687	41.79	1,449,569.73
BECTON DICKINSON & CO	21,103	273.69	5,775,680.07
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,838	50.19	5,362,199.22
CARDINAL HEALTH	19,151	85.85	1,644,113.35
CENTENE CORP	40,934	63.70	2,607,495.80
CVS HEALTH CORP	95,131	66.81	6,355,702.11
DAVITA INC	4,627	101.56	469,918.12
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	37.30	662,970.20
DEXCOM INC	28,772	106.05	3,051,270.60

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	76.58	3,450,082.16
ELEVANCE HEALTH INC	17,637	462.78	8,162,050.86
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	68.36	2,045,399.56
HCA HEALTHCARE INC	15,457	269.04	4,158,551.28
HENRY SCHEIN INC	8,755	76.52	669,932.60
HOLOGIC INC	18,875	73.15	1,380,706.25
HUMANA INC	9,297	490.39	4,559,155.83
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	483.73	2,983,646.64
INSULET CORP	5,246	205.10	1,075,980.83
INTUITIVE SURGICAL INC	26,035	285.95	7,444,708.25
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	214.43	1,404,087.64
MASIMO CORP	2,669	109.68	292,735.92
MCKESSON CORP	10,179	420.43	4,279,556.97
MEDTRONIC PLC	98,891	81.52	8,061,594.32
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	314.23	1,428,175.35
NOVOCURE LTD	7,933	31.05	246,319.65
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	133.50	1,158,646.50
RESMED INC	10,920	165.67	1,809,116.40
STERIS PLC	6,933	223.87	1,552,090.71
STRYKER CORP	25,363	277.91	7,048,631.33
TELEFLEX INC	3,934	217.61	856,077.74
THE CIGNA GROUP	22,079	276.01	6,094,024.79
THE COOPER COS INC	3,504	368.96	1,292,835.84
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,339	498.44	34,561,331.16
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	128.56	600,632.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	186.97	2,104,347.35
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	119.18	1,817,971.72
ABBVIE INC	131,130	150.14	19,687,858.20
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	119.25	2,598,576.75
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	186.03	1,793,887.29
AMGEN	39,709	261.82	10,396,610.38
AVANTOR INC	49,647	21.43	1,063,935.21
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	380.43	704,936.79
BIO-TECHNE CORP	12,980	78.24	1,015,555.20
BIOGEN INC	10,740	261.15	2,804,751.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	89.05	1,316,426.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	156,340	62.06	9,702,460.40
CATALENT INC	13,739	44.36	609,462.04
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	198.90	836,175.60
DANAHER CORP	51,486	251.41	12,944,095.26
ELI LILLY & CO	60,041	546.43	32,808,203.63
EXACT SCIENCES CORP	12,208	83.37	1,017,780.96

GILEAD SCIENCES INC	92,825	75.88	7,043,561.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	15,618	103.86	1,622,085.48
ILLUMINA INC	11,423	167.22	1,910,154.06
INCYTE CORP	15,212	64.04	974,176.48
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	213.98	2,960,627.28
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	138.47	688,334.37
JOHNSON & JOHNSON	193,140	172.49	33,314,718.60
MERCK & CO	188,628	109.20	20,598,177.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,184.68	1,927,474.36
MODERNA INC	24,153	101.62	2,454,427.86
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	106.96	721,124.32
PFIZER	419,551	36.66	15,380,739.66
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,992	812.40	6,492,700.80
REPLIGEN CORP	4,353	157.80	686,903.40
REVVITY INC	8,524	113.22	965,087.28
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	29.34	882,635.22
SEAGEN INC	9,758	192.74	1,880,756.92
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	9.56	880,867.96
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,670	532.38	15,263,334.60
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	229.80	831,416.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,147	344.82	6,602,268.54
VIATRIS INC	89,720	11.26	1,010,247.20
WATERS CORP	4,749	270.00	1,282,230.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	387.77	2,236,269.59
ZOETIS INC	34,383	181.57	6,242,921.31
BANK OF AMERICA CORP	535,131	29.11	15,577,663.41
CITIGROUP	144,682	42.25	6,112,814.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	27.71	1,095,154.62
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.59	1,392,607.80
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,394.58	1,068,248.28
FIRST HORIZON CORP	44,308	12.74	564,483.92
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	11.14	1,271,207.68
JPMORGAN CHASE & CO	217,897	148.97	32,460,116.09
KEY CORP	71,223	10.83	771,345.09
M & T BANK CORP	11,807	127.68	1,507,517.76
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	123.20	3,653,865.60
REGIONS FINL CORP	70,810	19.54	1,383,627.40
TRUIST FINANCIAL CORP	96,574	28.78	2,779,399.72
US BANCORP	113,859	36.84	4,194,565.56
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	41.86	597,467.78
WELLS FARGO & CO	279,720	42.50	11,888,100.00
ALLY FINANCIAL INC	21,529	27.23	586,234.67

AMERICAN EXPRESS	47,011	160.23	7,532,572.53
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	332.37	2,597,803.92
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	28,767	81.16	2,334,729.72
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	99.19	1,267,648.20
BANK NEW YORK CO	61,254	44.02	2,696,401.08
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	96,495	352.56	34,020,277.20
BLACKROCK INC	11,143	670.25	7,468,595.75
BLACKSTONE INC	52,505	98.72	5,183,293.60
BLOCK INC	39,463	56.88	2,244,655.44
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,372	105.04	2,875,154.88
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	29.62	464,115.78
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,144	150.12	1,072,457.28
CME GROUP INC	26,740	203.73	5,447,740.20
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,895	73.19	797,405.05
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	93.34	1,772,246.58
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	27.55	770,931.65
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	429.40	1,351,751.20
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	42,810	55.39	2,371,245.90
FISERV INC	46,319	120.08	5,561,985.52
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	262.23	1,327,932.72
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.26	684,598.20
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	48.14	207,772.24
GLOBAL PAYMENTS INC	18,535	124.06	2,299,452.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,812	324.93	8,062,163.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,604	113.75	4,732,455.00
INVESCO LTD	26,420	15.24	402,640.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	155.03	808,171.39
KKR & CO INC	44,805	60.20	2,697,261.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,307	225.11	1,194,658.77
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	248.20	795,977.40
MASTERCARD INC-CLASS A	63,267	392.17	24,811,419.39
MOODY'S CORP	12,261	327.02	4,009,592.22
MORGAN STANLEY	93,231	84.89	7,914,379.59
MSCI INC	5,952	520.17	3,096,051.84
NASDAQ INC	24,183	51.80	1,252,679.40
NORTHERN TRUST CORP	15,902	76.74	1,220,319.48
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	59.42	4,711,174.12
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	107.61	1,700,883.66
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	105.10	1,627,578.60
S&P GLOBAL INC	24,377	382.00	9,312,014.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,693	59.52	6,647,967.36
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	61.24	584,842.00

STATE STREET CORP	26,059	67.95	1,770,709.05
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	33.17	968,431.32
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.80	443,433.80
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	83.29	754,690.69
VISA INC-CLASS A SHARES	120,784	238.17	28,767,125.28
AFLAC	43,196	74.85	3,233,220.60
ALLSTATE CORP	18,556	106.19	1,970,461.64
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	114.15	721,313.85
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	57.95	3,160,245.30
AON PLC	15,249	324.06	4,941,590.94
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,510	75.24	1,994,612.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,913	220.55	3,509,612.15
ASSURANT INC	4,726	140.71	664,995.46
BROWN & BROWN INC	16,344	71.39	1,166,798.16
CHUBB LTD	30,784	199.90	6,153,721.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	103.87	1,153,995.70
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	281.28	609,252.48
EVEREST GROUP LTD	3,288	348.40	1,145,539.20
FNF GROUP	20,461	40.60	830,716.60
GLOBE LIFE INC	5,948	112.44	668,793.12
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	71.82	1,776,180.42
LOEWS CORP	12,757	61.59	785,703.63
MARKEL GROUP INC	1,007	1,495.11	1,505,575.77
MARSH & MCLENNAN COS	36,799	188.84	6,949,123.16
METLIFE INC	48,925	62.26	3,046,070.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	76.47	1,417,447.92
PROGRESSIVE CORP	43,513	133.93	5,827,696.09
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	92.80	2,461,148.80
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	162.47	2,785,873.09
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,429	198.94	1,477,925.26
WR BERKLEY CORP	17,572	61.94	1,088,409.68
WEYERHAEUSER CO	52,615	32.30	1,699,464.50
ACCENTURE PLC-CL A	46,943	302.94	14,220,912.42
ADOBE INC	34,096	508.13	17,325,200.48
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	100.90	1,158,735.60
ANSYS INC	6,794	292.59	1,987,856.46
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	191.83	459,241.02
ATLASSIAN CORP-CL A	10,436	186.30	1,944,226.80
AUTODESK INC	15,965	199.68	3,187,891.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	45.91	680,064.83
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	110.97	825,949.71
BLACK KNIGHT INC	11,543	74.40	858,799.20

CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,308	220.55	4,478,929.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,186	131.62	814,201.32
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	58.98	1,196,291.34
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,307	68.80	2,497,921.60
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,571	146.80	2,432,622.80
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	150.00	465,000.00
DATADOG INC - CLASS A	17,716	93.63	1,658,749.08
DOCUSIGN INC	14,969	48.28	722,703.32
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	26.74	616,838.32
DYNATRACE INC	14,790	46.42	686,551.80
EPAM SYSTEMS INC	4,768	239.39	1,141,411.52
FAIR ISAAC CORP	1,816	846.13	1,536,572.08
FORTINET INC	48,642	57.16	2,780,376.72
GARTNER INC	5,655	328.15	1,855,688.25
GEN DIGITAL INC	43,555	20.37	887,215.35
GODADDY INC - CLASS A	11,388	69.95	796,590.60
HUBSPOT INC	3,646	504.93	1,840,974.78
INTL BUSINESS MACHINES CORP	67,426	141.41	9,534,710.66
INTUIT INC	20,854	485.96	10,134,209.84
MICROSOFT CORP	525,636	316.48	166,353,281.28
MONDAY.COM LTD	231	161.07	37,207.17
MONGODB INC	5,325	350.83	1,868,169.75
OKTA INC	11,505	71.72	825,196.12
ORACLE CORP	120,407	116.46	14,022,599.22
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	130,741	14.40	1,882,670.40
PALO ALTO NETWORKS INC	22,493	209.69	4,716,557.17
PTC INC	8,226	139.93	1,151,064.18
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,898	484.34	3,825,317.32
SALESFORCE INC	74,331	204.83	15,225,218.73
SERVICENOW INC	15,145	541.50	8,201,017.50
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19,326	147.63	2,853,097.38
SPLUNK INC	11,101	97.49	1,082,236.49
SYNOPSYS INC	11,321	426.02	4,822,972.42
TWILIO INC - A	12,842	59.31	761,659.02
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	372.17	1,242,675.63
UIPATH INC - CLASS A	28,419	14.82	421,169.58
UNITY SOFTWARE INC	16,437	34.41	565,597.17
VERISIGN INC	6,723	201.34	1,353,608.82
VMWARE INC-CLASS A	17,149	154.87	2,655,865.63
WIX.COM LTD	5,010	87.03	436,020.30
WORKDAY INC-CLASS A	15,164	224.42	3,403,104.88
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	66.29	1,096,900.63

ZSCALER INC	7,204	136.21	981,256.84
AMPHENOL CORPORATION	44,247	85.23	3,771,171.81
APPLE INC	1,176,051	174.49	205,209,138.99
ARISTA NETWORKS INC	19,289	180.54	3,482,436.06
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	128.78	558,647.64
CDW CORP/DE	9,584	200.30	1,919,675.20
CISCO SYSTEMS	304,444	55.04	16,756,597.76
COGNEX CORP	14,352	46.02	660,479.04
CORNING	58,221	32.15	1,871,805.15
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	54.93	995,551.32
F5 INC	4,851	155.32	753,457.32
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	17.00	1,656,344.00
HP INC	68,329	31.06	2,122,298.74
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	28.20	714,052.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	129.37	1,790,222.06
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,202	277.68	3,388,251.36
NETAPP INC	15,191	75.31	1,144,034.21
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,756	64.35	820,848.60
TE CONNECTIVITY LTD	22,795	127.70	2,910,921.50
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	403.63	1,340,051.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	52.78	935,156.04
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	39.74	1,024,894.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	271.98	1,131,980.76
AT&T INC	529,966	14.05	7,446,022.30
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	17.67	274,167.72
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	18.91	356,812.79
T-MOBILE US INC	44,785	136.14	6,097,029.90
VERIZON COMMUNICATIONS	312,179	33.18	10,358,099.22
AES CORP	54,375	18.01	979,293.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	50.62	1,051,782.36
AMEREN CORPORATION	20,898	80.57	1,683,751.86
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,118	79.02	2,933,064.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	138.96	2,010,473.28
ATMOS ENERGY CORP	11,302	116.96	1,321,881.92
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.19	1,338,066.54
CMS ENERGY CORP	23,697	56.93	1,349,070.21
CONSOLIDATED EDISON INC	24,527	89.32	2,190,751.64
CONSTELLATION ENERGY	25,114	104.77	2,631,193.78
DOMINION ENERGY INC	60,549	48.43	2,932,388.07
DTE ENERGY COMPANY	15,851	105.59	1,673,707.09
DUKE ENERGY CORP	57,283	91.20	5,224,209.60
EDISON INTL	25,571	69.04	1,765,421.84

ENERGY CORP	16,181	95.58	1,546,579.98
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.51	765,166.49
EVERGY INC	18,475	56.40	1,041,990.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	64.47	1,769,701.50
EXELON CORP	73,907	40.01	2,957,019.07
FIRSTENERGY CORP	39,425	36.17	1,426,002.25
NEXTERA ENERGY INC	150,399	67.83	10,201,564.17
NISOURCE INC	32,351	26.44	855,360.44
NRG ENERGY INC	19,068	36.45	695,028.60
PG&E CORP	129,525	16.72	2,165,658.00
PPL CORPORATION	58,459	25.30	1,479,012.70
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,683	60.82	2,170,240.06
SEMPRA	22,943	141.43	3,244,828.49
SOUTHERN CO	81,133	67.81	5,501,628.73
UGI CORP	18,019	23.22	418,401.18
VISTRA CORP	22,676	29.86	677,105.36
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	85.99	2,016,207.53
XCEL ENERGY INC	39,963	58.19	2,325,446.97
ADVANCED MICRO DEVICES	119,628	105.45	12,614,772.60
ANALOG DEVICES	37,601	175.75	6,608,375.75
APPLIED MATERIALS	62,818	142.66	8,961,615.88
BROADCOM INC	30,991	825.84	25,593,607.44
ENPHASE ENERGY INC	9,617	130.34	1,253,479.78
ENTEGRIS INC	10,321	94.75	977,914.75
FIRST SOLAR INC	7,921	181.91	1,440,909.11
INTEL CORP	310,036	32.75	10,153,679.00
KLA CORP	10,294	477.96	4,920,120.24
LAM RESEARCH CORP	10,237	652.94	6,684,146.78
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	87.48	960,355.44
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	57.59	3,668,137.46
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	79.41	3,233,416.38
MICRON TECHNOLOGY	81,347	63.59	5,172,855.73
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	482.29	1,702,965.99
NVIDIA CORP	183,596	432.99	79,495,232.04
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	196.57	3,795,766.70
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	90.73	2,904,358.03
QORVO INC	6,249	98.96	618,401.04
QUALCOMM	82,879	110.10	9,124,977.90
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	104.70	1,177,037.40
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,156	162.34	674,685.04
TERADYNE INC	12,318	101.06	1,244,857.08
TEXAS INSTRUMENTS	67,444	166.49	11,228,751.56

	WOLFSPEED INC	10,256	42.63	437,213.28
	CBRE GROUP INC-A	22,995	82.29	1,892,258.55
	COSTAR GROUP INC	29,397	78.29	2,301,491.13
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.55	350,385.00
	ZILLOW GROUP INC-C	8,809	50.87	448,113.83
	アメリカドル 小計	25,326,097		2,816,227,282.29 (409,282,310,935)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	37,400	20.57	769,318.00
	CAMECO CORP	31,793	46.95	1,492,681.35
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,307	83.40	6,864,403.80
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	26.19	2,914,763.67
	ENBRIDGE	150,513	47.25	7,111,739.25
	IMPERIAL OIL	16,488	76.12	1,255,066.56
	KEYERA CORP	18,607	32.72	608,821.04
	PARKLAND CORP	4,564	36.46	166,403.44
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	41.50	1,582,436.50
	SUNCOR ENERGY	98,973	44.84	4,437,949.32
	TC ENERGY CORP	75,669	48.44	3,665,406.36
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	69.26	1,732,123.34
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	62.62	2,260,582.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	21.15	2,828,326.05
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,275	60.35	499,396.25
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	33.34	1,445,622.40
	FRANCO-NEVADA CORP	13,695	183.61	2,514,538.95
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.57	599,869.79
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.26	678,903.26
	LUNDIN MINING CORP	31,977	9.77	312,415.29
	NUTRIEN LTD	37,152	83.27	3,093,647.04
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	20.64	462,666.24
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	52.95	1,873,688.70
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	104.17	365,115.85
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	55.56	1,772,697.36
	CAE INC	25,999	32.07	833,787.93
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	110.17	574,316.21
	WSP GLOBAL INC	9,951	188.43	1,875,066.93
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	46.10	644,063.10
	RB GLOBAL INC	14,445	76.69	1,107,787.05
	THOMSON REUTERS CORP	11,033	171.44	1,891,497.52
	AIR CANADA	13,805	22.69	313,235.45
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	153.95	6,502,386.15
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	69,248	106.43	7,370,064.64
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	176.28	1,028,946.36

MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	75.36	1,526,341.44
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	106.25	326,187.50
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	40.50	397,710.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	93.08	2,147,634.84
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.58	480,016.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	155.57	702,087.41
DOLLARAMA INC	22,000	86.38	1,900,360.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	56,821	69.50	3,949,059.50
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	35.46	245,737.80
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	115.72	1,494,292.36
METRO INC	18,840	70.20	1,322,568.00
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	150.64	787,244.64
SAPUTO INC	20,898	27.62	577,202.76
BANK MONTREAL	52,757	113.26	5,975,257.82
BANK NOVA SCOTIA	88,533	62.42	5,526,229.86
CANADIAN IMPERIAL BANK	67,344	53.76	3,620,413.44
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	100.33	2,419,056.63
ROYAL BANK OF CANADA	103,016	121.47	12,513,353.52
TORONTO-DOMINION BANK	135,406	83.93	11,364,625.58
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	45.50	1,319,545.50
BROOKFIELD CORP	104,769	44.83	4,696,794.27
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.59	670,801.61
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.31	294,412.35
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	23.93	102,922.93
ONEX CORP	6,603	82.30	543,426.90
TMX GROUP LTD	23,425	29.60	693,380.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,121.97	1,967,935.38
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.64	919,168.32
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	83.37	581,672.49
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	195.50	2,591,352.50
MANULIFE FINANCIAL CORP	130,818	24.45	3,198,500.10
POWER CORP OF CANADA	43,577	37.03	1,613,656.31
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	64.51	2,813,539.14
CGI INC - CL A	16,084	134.87	2,169,249.08
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,490	2,643.72	3,939,142.80
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	97.11	678,216.24
OPEN TEXT CORP	20,463	50.02	1,023,559.26
SHOPIFY INC - CLASS A	88,987	71.98	6,405,284.26
BCE INC	6,203	55.14	342,033.42
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	53.55	1,493,027.55
TELUS CORP	32,908	22.83	751,289.64
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	9.76	505,743.68

	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	26.24	640,124.80
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	38.13	430,678.35
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	32.24	332,845.76
	EMERA INC	17,459	51.48	898,789.32
	FORTIS INC	35,547	53.71	1,909,229.37
	HYDRO ONE LTD	20,587	36.73	756,160.51
	NORTHLAND POWER INC	17,854	24.58	438,851.32
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	198.61	534,260.90
	カナダドル 小計	3,016,123		175,980,706.31 (18,888,009,208)
ユーロ	ENI	174,687	14.03	2,451,557.35
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	12.31	488,437.53
	NESTE OIL OYJ	32,766	32.19	1,054,737.54
	OMV AG	12,549	41.98	526,807.02
	REPSOL SA	89,536	13.86	1,240,968.96
	TENARIS SA	40,648	15.27	620,898.20
	TOTALENERGIES SE	175,847	57.01	10,025,037.47
	AIR LIQUIDE	38,920	160.64	6,252,108.80
	AKZO NOBEL	12,357	74.02	914,665.14
	ARCELORMITTAL	32,320	23.70	765,984.00
	ARKEMA	4,369	95.22	416,016.18
	BASF SE	64,204	45.55	2,924,813.22
	COVESTRO AG	14,454	47.90	692,346.60
	CRH PLC	55,581	51.76	2,876,872.56
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	83.11	1,139,188.77
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.62	282,652.12
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	76.32	821,584.80
	OCI NV	7,248	23.45	169,965.60
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	35.59	694,147.36
	SOLVAY SA	5,356	102.45	548,722.20
	STORA ENSO OYJ R	42,169	10.70	451,419.14
	SYMRISE AG	10,018	88.52	886,793.36
	UMICORE	17,605	23.53	414,245.65
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.09	1,231,205.16
	VOESTALPINE AG	7,152	27.52	196,823.04
	WACKER CHEMIE AG	1,770	130.30	230,631.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	31.30	513,413.90
	AIRBUS SE	44,063	126.70	5,582,782.10
	ALSTOM	24,388	24.93	607,992.84
	BOUYGUES ORD	16,606	31.20	518,107.20
	BRENTAG SE	12,514	71.58	895,752.12
	CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.97	969,881.22

DAIMLER TRUCK HOLDING AG	34,575	33.25	1,149,618.75
DASSAULT AVIATION SA	2,130	170.40	362,952.00
EIFFAGE	5,924	90.18	534,226.32
FERROVIAL SE	37,026	28.82	1,067,089.32
GEA GROUP AG	13,382	35.26	471,849.32
IMCD NV	4,641	123.40	572,699.40
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	73.22	907,781.56
KNORR-BREMSE AG	5,022	62.64	314,578.08
KONE OYJ-B	26,369	43.14	1,137,558.66
LEGRAND SA	19,340	89.06	1,722,420.40
METSO CORPORATION	51,970	10.08	524,117.45
MTU AERO ENGINES AG	3,962	201.70	799,135.40
PRYSMIAN SPA	21,155	34.54	730,693.70
RATIONAL AG	483	662.50	319,987.50
RHEINMETALL AG	2,795	249.40	697,073.00
SAFRAN SA	24,910	143.42	3,572,592.20
SAINT-GOBAIN	36,177	59.25	2,143,487.25
SCHNEIDER ELECTRIC SE	40,328	154.32	6,223,416.96
SIEMENS	56,492	134.40	7,592,524.80
SIEMENS ENERGY AG	36,841	13.12	483,353.92
THALES SA	8,524	129.45	1,103,431.80
VINCI S.A.	39,327	101.00	3,972,027.00
WARTSILA OYJ	41,917	10.78	452,074.84
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.36	610,778.28
RANDSTAD NV	6,064	52.76	319,936.64
TELEPERFORMANCE	4,734	115.60	547,250.40
WOLTERS KLUWER	18,738	109.10	2,044,315.80
ADP	2,382	117.60	280,123.20
AENA SME SA	5,508	139.50	768,366.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	8.45	383,556.43
DHL GROUP	74,810	42.90	3,209,723.05
GETLINK	21,115	14.87	314,085.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,611	98.25	2,418,030.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	90.65	452,434.15
CONTINENTAL AG	8,168	65.80	537,454.40
DR ING HC F PORSCHE AG	7,331	102.10	748,495.10
FERRARI NV	9,370	279.60	2,619,852.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,618	67.02	4,263,678.36
MICHELIN	47,236	28.47	1,344,808.92
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	48.98	575,270.10
RENAULT SA	11,597	36.65	425,088.03
STELLANTIS NV	162,367	16.35	2,655,349.91

VALEO SA	16,596	17.93	297,566.28
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	114.46	1,754,442.88
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	133.90	332,875.40
ADIDAS AG	11,414	183.60	2,095,610.40
HERMES INTERNATIONAL	2,355	1,862.60	4,386,423.00
KERING	5,534	492.60	2,726,048.40
LVMH	20,525	776.90	15,945,872.50
MONCLER SPA	14,605	62.46	912,228.30
PUMA SE	9,220	62.28	574,221.60
SEB SA	2,282	99.95	228,085.90
ACCOR	14,436	32.60	470,613.60
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	32,105	61.52	1,975,099.60
DELIVERY HERO SE	13,414	35.47	475,861.65
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	156.80	2,044,985.60
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	13.11	204,180.06
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.38	262,537.04
SODEXO	6,173	96.10	593,225.30
BOLLORE SE	83,646	5.34	446,669.64
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.00	1,222,407.00
SCOUT24 SE	3,716	60.66	225,412.56
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	23.02	1,515,314.52
VIVENDI SE	61,243	8.03	491,781.29
D'IETTEREN GROUP	2,217	148.40	329,002.80
INDITEX	81,082	33.99	2,755,977.18
PROSUS	59,578	63.79	3,800,480.62
ZALANDO SE	17,664	26.46	467,389.44
CARREFOUR	39,746	18.11	719,998.79
HELLOFRESH SE	13,805	25.90	357,549.50
JERONIMO MARTINS	14,298	23.36	334,001.28
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.25	346,431.75
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.53	2,164,931.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,422	51.11	3,241,498.42
DANONE (GROUPE)	47,639	53.19	2,533,918.41
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	11.61	393,149.43
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	73.95	703,412.40
HEINEKEN NV	20,157	89.12	1,796,391.84
JDE PEET'S BV	7,000	26.90	188,300.00
KERRY GROUP PLC-A	10,592	84.36	893,541.12
PERNOD-RICARD	15,339	192.55	2,953,524.45
REMY COINTREAU	1,032	146.25	150,930.00
BEIERSDORF AG	7,430	119.50	887,885.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	64.02	562,095.60

HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	71.98	821,651.70
LOREAL	17,902	398.20	7,128,576.40
AMPLIFON SPA	11,650	29.23	340,529.50
BIOMERIEUX	3,044	92.50	281,570.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	88.64	304,035.20
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	89.80	185,886.00
ESSILORLUXOTTICA	21,384	173.50	3,710,124.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	44.57	757,021.45
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	29.18	983,045.02
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	20.42	1,466,666.50
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	45.51	981,514.17
ARGENX SE	4,177	448.70	1,874,219.90
BAYER	72,310	50.32	3,638,639.20
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	53.94	551,266.80
GRIFOLS SA	27,685	13.25	366,826.25
IPSEN	3,532	116.10	410,065.20
MERCK KGAA	9,080	159.05	1,444,174.00
ORION OYJ-CLASS B	3,129	34.36	107,512.44
QIAGEN N.V.	17,038	39.57	674,193.66
RECORDATI SPA	5,163	44.65	230,527.95
SANOFI	84,347	98.00	8,266,006.00
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	354.20	646,060.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	247.50	389,565.00
UCB (GROUPE)	9,389	80.50	755,814.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.30	368,348.92
AIB GROUP PLC	88,299	4.15	366,617.44
BANCO BILBAO VIZCAYA	441,393	7.06	3,116,234.58
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.55	4,343,594.59
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.26	818,733.79
BNP PARIBAS	82,574	58.22	4,807,458.28
CAIXABANK	336,789	3.80	1,281,482.14
COMMERZBANK AG	81,889	10.05	823,393.89
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	11.33	1,126,802.49
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	33.15	841,214.40
FINECOBANK SPA	41,585	12.51	520,228.35
ING GROEP NV-CVA	269,040	12.92	3,476,534.88
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.41	3,007,734.55
KBC GROEP NV	18,057	62.20	1,123,145.40
MEDIOBANCA	25,262	11.63	293,797.06
SOCIETE GENERALE	53,019	25.30	1,341,645.79
UNICREDIT SPA	139,080	21.58	3,001,346.40
ADYEN NV	1,609	872.00	1,403,048.00

AMUNDI SA	4,626	51.95	240,320.70
DEUTSCHE BANK NAMEN	134,445	9.87	1,326,972.15
DEUTSCHE BOERSE	14,123	162.95	2,301,342.85
EDENRED	20,131	56.66	1,140,622.46
EURAZEO SA	3,357	52.80	177,249.60
EURONEXT NV	6,480	65.55	424,764.00
EXOR NV	7,825	79.62	623,026.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	71.86	611,887.90
NEXI SPA	48,458	6.61	320,404.29
SOFINA	1,238	196.70	243,514.60
WENDEL	2,023	83.25	168,414.75
WORLDLINE SA	20,332	30.35	617,076.20
AEGON	148,741	4.70	700,272.62
AGEAS	11,086	36.81	408,075.66
ALLIANZ SE-REG	29,979	221.15	6,629,855.85
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	18.40	1,311,098.58
AXA SA	136,364	27.17	3,705,691.70
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	194.75	867,611.25
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	355.30	3,700,094.20
NN GROUP NV	16,208	34.11	552,854.88
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.95	458,140.32
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.07	1,327,599.24
TALANX AG	5,053	59.75	301,916.75
BECHTLE AG	7,659	44.64	341,897.76
CAPGEMINI SA	12,235	160.25	1,960,658.75
DASSAULT SYSTEMES SA	47,353	35.75	1,693,106.51
NEMETSCHKE SE	5,455	60.98	332,645.90
SAP SE	77,618	124.18	9,638,603.24
NOKIA OYJ	396,129	3.50	1,387,837.95
CELLNEX TELECOM SA	41,890	34.37	1,439,759.30
DEUTSCHE TELEKOM	240,920	19.00	4,579,407.36
ELISA A	10,227	45.62	466,555.74
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.12	337,770.00
KPN (KON.)	216,358	3.23	699,269.05
ORANGE	128,563	10.26	1,319,570.63
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.27	236,242.15
TELEFONICA	373,259	3.62	1,353,437.13
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	1.72	170,135.30
ACCIONA SA	2,181	124.65	271,861.65
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	25.56	138,969.72
E.ON SE	166,881	11.19	1,868,232.79
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	16.50	358,908.00

	ELIA GROUP SA/NV	987	100.50	99,193.50
	ENAGAS	21,663	15.33	332,202.10
	ENDESA	25,972	18.64	484,118.08
	ENEL	596,378	5.92	3,532,943.27
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.14	1,131,023.04
	ENGIE	129,254	14.58	1,885,557.35
	FORTUM OYJ	32,550	11.86	386,043.00
	IBERDROLA SA	444,395	10.62	4,721,696.87
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	25.44	254,654.40
	REDEIA CORP SA	30,678	14.62	448,665.75
	RWE STAMM	44,929	38.35	1,723,027.15
	SNAM SPA	147,559	4.53	668,737.38
	TERNA SPA	95,819	7.23	692,771.37
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	27.59	1,373,457.79
	VERBUND AG	6,430	74.80	480,964.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	425.05	1,445,170.00
	ASML HOLDING NV	29,993	598.20	17,941,812.60
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	31.99	3,105,754.65
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	42.15	2,119,554.90
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	58.68	309,537.00
	VONOVIA SE	52,580	19.75	1,038,455.00
	ユーロ 小計	13,658,431		342,847,584.74 (54,211,060,099)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.73	6,227,103.20
	SHELL PLC-NEW	508,994	23.60	12,012,258.40
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	19.72	1,840,781.74
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	13.75	410,669.28
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	52.06	568,703.44
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	15.70	276,382.80
	GLENCORE PLC	793,369	4.16	3,300,811.72
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	15.99	269,483.76
	MONDI PLC	41,710	12.60	525,754.55
	RIO TINTO PLC REG	83,678	46.00	3,849,606.39
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	53.28	1,775,129.76
	BAE SYSTEMS PLC	219,532	9.63	2,114,971.28
	BUNZL PLC	22,799	27.14	618,764.86
	DCC PLC	6,622	42.64	282,362.08
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	2.01	1,279,448.90
	SMITHS GROUP PLC	26,476	15.58	412,628.46
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	99.06	546,216.84
	EXPERIAN PLC	67,859	27.00	1,832,193.00
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	40.55	563,239.50

RELX PLC	141,442	24.81	3,509,176.02
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	5.88	1,069,911.25
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.33	317,403.87
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	39.91	277,454.32
BURBERRY GROUP PLC	29,776	21.49	639,886.24
PERSIMMON PLC	25,686	10.22	262,510.92
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.12	297,381.10
COMPASS GROUP PLC	129,701	19.59	2,540,842.59
ENTAIN PLC	49,630	11.74	582,904.35
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	58.28	662,235.64
PEARSON	55,305	8.21	454,496.49
WHITBREAD PLC	17,434	33.88	590,663.92
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.98	433,322.76
INFORMA PLC	110,598	7.06	781,043.07
MPP PLC	85,821	7.44	639,023.16
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.49	309,617.02
KINGFISHER PLC	153,717	2.27	349,245.02
NEXT PLC	7,832	68.36	535,395.52
OCADO GROUP PLC	54,753	7.61	416,670.33
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.62	388,637.70
TESCO PLC	525,585	2.49	1,312,385.74
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.60	504,504.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,888	25.25	3,986,672.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	22.92	411,643.20
DIAGEO	167,595	32.60	5,463,597.00
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.56	1,202,816.07
HALEON PLC	346,790	3.22	1,117,704.17
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	52,885	56.54	2,990,117.90
UNILEVER PLC	187,760	39.80	7,472,848.00
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.69	733,623.52
ASTRAZENECA	115,201	106.58	12,278,122.58
GSK PLC	304,379	13.49	4,106,072.71
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,620	20.88	138,225.60
BARCLAYS	1,129,529	1.44	1,629,232.62
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,029	5.83	8,671,084.33
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.42	2,039,789.68
NATWEST GROUP PLC	426,244	2.26	966,295.14
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.21	1,371,807.02
3I GROUP PLC	74,757	18.88	1,411,412.16
ABRDN PLC	153,430	1.61	248,403.17
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.63	252,392.77
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	29,849	80.38	2,399,262.62

	M&G PLC	131,539	1.85	243,478.68
	SCHRODERS PLC	39,932	4.04	161,644.73
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	8.58	351,295.58
	WISE PLC - A	49,048	6.63	325,188.24
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	23.61	383,780.55
	AVIVA PLC	193,334	3.82	740,082.55
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.18	893,411.54
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.08	259,187.08
	PRUDENTIAL	212,226	9.47	2,009,780.22
	SAGE GROUP PLC	76,660	9.43	723,210.44
	HALMA PLC	31,069	20.35	632,254.15
	BT GROUP PLC	464,863	1.12	522,738.44
	VODAFONE GROUP PLC	1,564,850	0.70	1,109,478.65
	CENTRICA PLC	453,631	1.43	649,372.77
	NATIONAL GRID PLC	260,089	9.51	2,474,486.74
	SEVERN TRENT PLC	17,468	23.15	404,384.20
	SSE PLC	81,692	15.85	1,295,226.66
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.13	461,997.72
	イギリスポンド 小計	20,310,344		128,113,342.19 (23,736,840,040)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.53	235,394.94
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	654.00	375,396.00
	GIVAUDAN-REG	678	2,751.00	1,865,178.00
	HOLCIM LTD	41,204	59.34	2,445,045.36
	SIG GROUP AG	26,203	21.84	572,273.52
	SIKA AG-BR	10,856	247.50	2,686,860.00
	ABB LTD	116,833	32.57	3,805,250.81
	GEBERIT AG-REG	2,530	442.80	1,120,284.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	185.60	380,108.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	196.45	607,423.40
	VAT GROUP AG	1,956	344.60	674,037.60
	ADECCO GROUP AG-REG	8,571	36.61	313,784.31
	SGS SA	10,147	80.58	817,645.26
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	269.00	1,017,089.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	38,748	122.65	4,752,442.20
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	248.20	616,280.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	47.15	185,676.70
	DUFREY AG-REG	7,820	40.44	316,240.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,554.00	435,120.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	103,400.00	827,200.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,340.00	847,880.00
	NESTLE SA - REGISTERED	204,409	103.86	21,229,918.74

	ALCON INC	38,399	72.26	2,774,711.74	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	230.80	897,119.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	130.95	1,118,313.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	79.50	147,075.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	471.90	2,612,438.40	
	NOVARTIS	152,294	89.39	13,613,560.66	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	272.60	603,809.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	52,222	255.05	13,319,221.10	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	95.35	237,135.45	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	58.84	899,604.76	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,574	923.40	1,453,431.60	
	UBS GROUP AG	249,657	20.65	5,155,417.05	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,379	134.20	319,261.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	130.80	386,514.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	536.80	1,298,519.20	
	SWISS RE LTD	22,063	83.88	1,850,644.44	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,184	405.70	4,537,348.80	
	TEMENOS AG - REG	5,150	68.32	351,848.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,702	58.16	622,428.32	
	SWISSCOM	1,856	528.40	980,710.40	
	BKW AG	1,744	152.80	266,483.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	82.50	468,517.50	
	スイスフラン 小計	1,103,720		100,040,643.06 (16,491,700,008)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	283.80	6,315,117.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	394.50	2,123,593.50	
	SCA SV CELLULOSA B	35,790	136.80	4,896,072.00	
	ALFA LAVAL AB	18,955	367.70	6,969,753.50	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	239.10	18,166,100.70	
	ATLAS COPCO A	207,097	140.30	29,055,709.10	
	ATLAS COPCO B	108,178	122.30	13,230,169.40	
	BEIJER REF AB	26,868	125.30	3,366,560.40	
	EPIROC AB-A	53,479	203.10	10,861,584.90	
	EPIROC AB-B	28,804	173.00	4,983,092.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	93.10	3,604,087.20	
	INDUTRADE AB	22,644	205.80	4,660,135.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	196.40	2,749,992.80	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	200.60	3,604,782.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	78.88	9,690,250.24	
	SAAB AB-B	6,388	548.40	3,503,179.20	
	SANDVIK AB	75,334	202.40	15,247,601.60	
	SKANSKA B	25,507	156.20	3,984,193.40	

	SKF AB-B	21,050	180.60	3,801,630.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	228.40	3,086,597.60	
	VOLVO B	114,238	223.45	25,526,481.10	
	SECURITAS B	28,375	87.22	2,474,867.50	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	44.96	2,240,761.44	
	EVOLUTION AB	13,186	1,159.20	15,285,211.20	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	28.73	1,527,179.04	
	HENNES & MAURITZ B	41,351	164.86	6,817,125.86	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	261.10	12,917,661.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	182.70	3,251,329.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	204.40	2,930,074.00	
	NORDEA BANK ABP	236,636	119.82	28,353,725.52	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	110,001	125.65	13,821,625.65	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	91.78	11,081,150.08	
	SWEDBANK AB-A	58,652	191.95	11,258,251.40	
	EQT AB	31,471	224.50	7,065,239.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	280.80	3,318,494.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	279.60	3,122,572.80	
	INVESTOR AB-A SHS	26,088	203.20	5,301,081.60	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	204.50	26,286,021.00	
	KINNEVIK AB - B	18,792	125.95	2,366,852.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	440.50	3,206,840.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	53.80	11,550,268.20	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	98.32	14,637,684.96	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	76.78	3,590,386.36	
	TELIA CO AB	123,760	21.32	2,638,563.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	47.62	2,700,054.00	
	SAGAX AB-B	17,402	222.90	3,878,905.80	
	スウェーデンクローナ 小計	2,691,864		381,048,609.95 (5,048,894,081)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	18,105	283.50	5,132,767.50	
	EQUINOR ASA	73,436	321.80	23,631,704.80	
	NORSK HYDRO	100,517	59.22	5,952,616.74	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	389.90	4,872,970.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	430.00	3,717,350.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	74.00	1,414,658.00	
	MOWI ASA	31,968	181.65	5,806,987.20	
	ORKLA	37,417	80.20	3,000,843.40	
	SALMAR ASA	5,423	474.00	2,570,502.00	
	DNB BANK ASA	71,795	209.40	15,033,873.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	156.60	2,908,688.40	
	TELENOR ASA	51,193	109.30	5,595,394.90	

	ノルウェークローネ 小計	448,688		79,638,356.14 (1,088,656,328)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	452.50	3,838,557.50
	NOVOZYMES A/S	17,111	300.00	5,133,300.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,694.00	1,278,970.00
	VESTAS WIND SYSSYEMS A/S	72,778	156.38	11,381,023.64
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	13,040.00	2,855,760.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	13,355.00	4,086,630.00
	DSV A/S	14,203	1,307.50	18,570,422.50
	PANDORA A/S	7,957	699.80	5,568,308.60
	CARLSBERG AS-B	6,810	1,009.50	6,874,695.00
	COLOPLAST-B	9,208	800.00	7,366,400.00
	DEMANT A/S	8,512	275.50	2,345,056.00
	GENMAB A/S	4,628	2,455.00	11,361,740.00
	NOVO NORDISK A/S-B	123,050	1,251.20	153,960,160.00
	DANSKE BANK A/S	46,499	160.05	7,442,164.95
	TRYG A/S	29,772	128.30	3,819,747.60
ORSTED A/S	12,910	530.80	6,852,628.00	
	デンマーククローネ 小計	363,201		252,735,563.79 (5,363,048,663)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	32.57	671,886.53
	SANTOS	218,974	7.77	1,701,427.98
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	38.40	5,419,584.00
	BHP GROUP LTD	377,956	43.69	16,512,897.64
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.56	714,871.20
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	122,505	20.33	2,490,526.65
	IGO LTD	56,345	12.35	695,860.75
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,156	45.20	1,272,651.20
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	63.37	913,098.33
	NEWCREST MINING LIMITED	60,966	24.99	1,523,540.34
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	10.36	763,345.52
	ORICA LTD	38,288	15.27	584,657.76
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.73	990,864.05
	RIO TINTO LTD	28,272	105.69	2,988,067.68
	SOUTH32 LTD	346,773	3.69	1,279,592.37
	REECE LTD	16,814	20.46	344,014.44
	BRAMBLES LTD	108,007	14.07	1,519,658.49
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	24.72	1,096,974.72
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.71	443,682.61
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.27	532,950.00
TRANSURBAN GROUP	224,973	13.17	2,962,894.41	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	40.20	1,857,642.00	

	IDP EDUCATION LTD	17,793	22.58	401,765.94
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.14	935,546.82
	REA GROUP LTD	3,586	159.29	571,213.94
	SEEK LTD	28,001	23.51	658,303.51
	WESFARMERS LTD	84,329	49.41	4,166,695.89
	COLES GROUP LTD	108,486	17.30	1,876,807.80
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.57	612,148.57
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	37.57	3,459,107.47
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.80	754,728.00
	COCHLEAR LIMITED	4,783	261.70	1,251,711.10
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	55.72	674,602.04
	SONIC HEALTHCARE LTD	27,240	32.57	887,206.80
	CSL LIMITED	35,855	270.57	9,701,287.35
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	221,609	24.49	5,427,204.41
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	125,501	99.05	12,430,874.05
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	233,298	27.68	6,457,688.64
	WESTPAC BANKING	255,840	21.27	5,441,716.80
	ASX LTD	14,549	59.02	858,681.98
	MACQUARIE GROUP LIMITED	27,105	168.80	4,575,324.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.00	441,984.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.84	973,306.08
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.47	805,675.01
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	14.99	1,560,204.17
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.25	1,256,948.00
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	83.98	1,159,007.98
	XERO LTD	11,340	114.29	1,296,048.60
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.00	1,233,868.00
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.67	949,200.27
	オーストラリアドル 小計	5,120,036		118,099,545.89 (11,006,877,676)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.25	680,303.25
	EBOS GROUP LTD	14,283	34.59	494,048.97
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	22.38	894,752.40
	SPARK NEW ZEALAND LTD	97,207	5.08	493,811.56
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.59	425,799.67
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.38	595,279.44
	ニュージーランドドル 小計	409,088		3,583,995.29 (308,653,674)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,496	41.15	7,221,660.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	78.55	8,404,850.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.28	1,037,760.00
	MTR CORP	125,000	32.90	4,112,500.00

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.76	1,771,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	50.75	8,830,500.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	26.05	5,157,900.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	17.06	2,489,054.00	
	WH GROUP LTD	658,301	3.92	2,580,539.92	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	21.60	6,080,400.00	
	HANG SENG BANK	59,400	102.00	6,058,800.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	292.40	25,818,920.00	
	AIA GROUP LTD	865,600	69.65	60,289,040.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	38.20	1,432,500.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	58.80	5,997,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.87	5,310,336.59	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	39.15	4,384,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	42.50	5,184,830.00	
	ESR GROUP LTD	157,000	11.42	1,792,940.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	10.08	1,743,840.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.35	2,673,617.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	16.86	2,299,282.50	
	SINO LAND CO	315,400	8.89	2,803,906.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	88.35	9,276,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	10,000	63.20	632,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	17.42	1,675,804.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	31.95	3,929,850.00	
	香港ドル 小計	5,609,853		188,991,181.21 (3,507,676,323)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	32.51	260,080.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.68	753,504.00	
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.13	292,779.57	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.85	567,490.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.88	745,324.16	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.92	270,840.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.60	642,960.00	
	DBS GROUP	130,200	32.72	4,260,144.00	
	OCBC BANK	257,100	12.27	3,154,617.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	27.93	2,625,420.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.55	630,300.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	13.30	341,810.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	555,643	2.34	1,300,204.62	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	127,200	3.08	391,776.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.62	283,336.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.53	310,175.00	
		4,346,866		16,830,760.35	

シンガポールドル 小計				(1,802,574,433)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	23.10	1,372,763.70
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	761.10	1,633,320.60
	BANK HAPOALIM BM	98,310	31.85	3,131,173.50
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	29.27	3,293,226.24
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.30	1,920,350.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	128.30	1,604,134.90
	NICE LTD	4,991	746.80	3,727,278.80
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	116.30	1,163,000.00
	AZRIELI GROUP	1,537	200.60	308,322.20
イスラエルシェケル 小計		400,926		18,153,569.94 (694,679,030)
合 計		82,805,237		551,430,980,498 (551,430,980,498)

(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	775,429.90	
		LENLEASE GROUP	64,786	515,696.56	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,291,126.46 (120,332,986)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,696,400.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,696,400.00 (50,045,184)	
投資信託受益証券合計			463,076	170,378,170 (170,378,170)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,439,095.30	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	876,587.40	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	34,641	6,112,404.45	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	714,378.20	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,083	1,807,982.73	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	712,694.70	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	822,866.31	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,230,914.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,366	2,592,550.44	
		EQUINIX INC	6,951	5,211,651.27	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	941,212.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,652,757.25	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,229,993.55	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	1,990,813.98	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	831,284.30	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	512,240.00	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	909,373.85	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	914,613.03	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,505,967.68	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,378,799.86	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	914,353.73	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,322,057.10	
	PROLOGIS INC	68,641	8,337,822.27	
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,239,443.68	
	REALTY INCOME CORP	49,099	2,793,733.10	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	767,049.41	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,567	1,683,733.17	
	SIMON PROPERTY GROUP	23,439	2,709,548.40	
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,018,846.08	
	UDR INC	23,815	914,734.15	
	VENTAS INC	31,565	1,324,467.40	
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,245,261.44	
	WELLTOWER INC	36,855	2,992,626.00	
	WP CAREY INC	16,024	1,024,414.32	
	アメリカドル 小計	900,424	66,676,270.60	(9,690,062,406)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	238,681.08	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	297,098.20	
	カナダドル 小計	20,377	535,779.28	(57,505,190)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	197,487.60	
	GECINA SA	3,139	291,613.10	
	KLEPIERRE	17,225	406,682.25	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	493,476.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	316,909.56	
	ユーロ 小計	48,695	1,706,168.51	(269,779,364)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	79,414	246,659.88	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	329,740.96	
	SEGRO PLC	78,133	549,274.99	
	イギリスポンド 小計	213,836	1,125,675.83	(208,565,217)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	728,256.60	
	GOODMAN GROUP	116,335	2,605,904.00	
	GPT GROUP	167,884	693,360.92	
	MIRVAC GROUP	266,683	632,038.71	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,006,587.12	
	STOCKLAND	207,412	854,537.44	
	VICINITY CENTERS	305,149	562,999.90	

オーストラリアドル 小計		1,538,836	7,083,684.69 (660,199,413)
香港ドル	LINK REIT	166,900	6,392,270.00
香港ドル 小計		166,900	6,392,270.00 (118,640,531)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	770,013.98
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	643,205.10
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	467,261.85
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	334,400.00
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,214,880.93 (237,213,747)
投資証券合計		4,014,924	11,241,965,868 (11,241,965,868)
合計			11,412,344,038 (11,412,344,038)

(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 605銘柄	97.7%			72.7%
	投資証券 34銘柄			2.3%	1.7%
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 221銘柄	99.5%			9.6%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79銘柄	99.1%			4.2%
	投資証券 3銘柄			0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 44銘柄	100.0%			2.9%
スウェーデンクローナ	株式 46銘柄	100.0%			0.9%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%			1.0%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.4%			2.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 7銘柄			5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 27銘柄	95.4%			0.6%

	投資信託受 1銘柄 益証券		1.4%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	88.4%			0.3%
	投資証券 4銘柄			11.6%	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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	790,562,828
コール・ローン	1,189,906,568
国債証券	280,366,440,941
派生商品評価勘定	5,677,736
未収入金	8,261,142
未収利息	1,682,047,923
前払金	7,999,642
前払費用	111,964,384
差入委託証拠金	117,018,430
流動資産合計	284,279,879,594
資産合計	284,279,879,594
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,975,209
未払金	116,066
未払解約金	125,598,043
未払利息	2,809
流動負債合計	134,692,127
負債合計	134,692,127
純資産の部	
元本等	
元本	86,820,791,837
剰余金	
剰余金又は欠損金()	197,324,395,630
元本等合計	284,145,187,467
純資産合計	284,145,187,467
負債純資産合計	284,279,879,594

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2023年 8月21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、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 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	86,820,791,837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) 3.2728円 (32,728円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21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債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券

	2023年 8月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	100,884,333,021円
期中追加設定元本額	15,664,598,540円
期中一部解約元本額	29,728,139,724円
期末元本額	86,820,791,837円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,181,992,551円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	536,868,803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）	2,475,987,355円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,295,880円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	8,829,467,398円
世界経済インデックスファンド	17,815,682,092円
D C マイセレクション 2 5	2,009,783,953円
D C マイセレクション 5 0	1,783,976,592円
D C マイセレクション 7 5	1,351,309,527円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,265,757,138円
D C マイセレクション S 2 5	1,060,305,023円
D C マイセレクション S 5 0	956,793,654円
D C マイセレクション S 7 5	514,695,729円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	21,780,113円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	100,557,900円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	53,061,086円
D C 世界経済インデックスファンド	13,530,613,375円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	395,413,099円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	918,807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）	18,965,564円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	30,441,408円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	54,793,682円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	58,893,873円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	56,884,660円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	945,132,382円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	393,963,370円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,613,957,455円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	56,615,690円

区分	2023年 8月21日現在
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	33,833,114円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	379,419,971円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	142,724,427円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	189,941,839円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	664,839,829円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,946,391,574円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	639,382,227円
外国債券ファンド・シリーズ1	736,844,114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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	667,277,734円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,323,648,179円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	240,080,601円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,008,928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）	1,323,827,136円
SMT インデックスバランス・オープン	179,681,796円
SMT 世界経済インデックス・オープン	349,971,556円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	459,050,980円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	727,375,730円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,285,661円
グローバル経済コア	772,941,053円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,763,405円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,233,786円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	57,957,122円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	68,415,693円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,988,058円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	36,593,902円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	264,241,558円
10資産分散投資ファンド	26,157,930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）	12,165,551,447円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	190,172,303円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	514,216,666円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	121,999,715円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	58,116,954円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,550,903,180
合計	3,550,903,180

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 8月21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	877,349,401	-	869,349,759
合計		877,349,401	-	869,349,759

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2023年 8月21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	929,053,579	-	933,755,748	4,702,169
	アメリカドル	479,451,964	-	483,489,716	4,037,752
	カナダドル	38,467,707	-	38,496,528	28,821
	ユーロ	294,576,542	-	294,839,908	263,366
	イギリスポンド	51,120,986	-	51,679,684	558,698
	オフショア人民元	65,436,380	-	65,249,912	186,468
	合計	929,053,579	-	933,755,748	4,702,169

(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	3,586,095.70	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,484,347.64	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,752,109.38	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,726,074.23	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,259,125.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,196,250.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,396,718.72	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,690,361.33	
		T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,764,485.85	
		T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,264,911.46	
		T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,375,036.70	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,714,941.41	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,613,125.00	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,049,472.64	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,710,792.60	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,542,123.83	

T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,018,271.48	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	5,984,376.57	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	3,982,297.64	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,371,777.32	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,535,693.35	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,146,699.19	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,126,718.72	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,318,199.15	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,817,963.28	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,129,980.47	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,157,937.53	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,244,423.86	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,427,421.86	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,562,246.07	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,594,531.24	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,631,738.09	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,276,487.09	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,205,937.52	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,362,500.00	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,826,792.91	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,428,523.41	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,279,300.00	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,004,443.37	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,923,593.76	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,033,948.83	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,114,515.61	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,323,248.21	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,367,828.14	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,934,218.72	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,797,330.09	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,188,476.54	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,765,839.81	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,369,037.33	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,141,796.87	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,296,445.33	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,403,770.49	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,789,609.36	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,972,906.25	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,030,156.23	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,075,793.74	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,740,976.54	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,203,185.55	

T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,420,039.04
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,439,096.46
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,848,437.50
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,155,517.61
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,394,546.86
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,486,474.60
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,190,718.73
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,093,188.29
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,937,254.69
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,798,671.87
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,554,179.68
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,854,566.38
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,353,254.31
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,239,101.54
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,994,466.78
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,074,723.44
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,587,617.18
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,734,467.21
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,362,125.00
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,937,441.39
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,654,921.88
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,797,810.33
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,794,507.20
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,961,050.77
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	5,949,316.38
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,571,093.76
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,026,183.41
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,363,468.76
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,659,212.97
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,830,371.10
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,141,121.06
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,809,949.20
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,050,878.92
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,657,508.57
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,921,423.06
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,099,600.77
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,628,710.91
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,079,376.96
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,784,639.68
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,159,203.13
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,000,048.80
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,190,222.63
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,003,290.99

T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,413,828.12	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,449,078.11	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,831,972.23	
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,403,600.37	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,488,197.28	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,859,020.50	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,781,673.82	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,814,355.45	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,012,113.67	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,735,767.57	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,626,574.20	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,025,648.43	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,459,713.68	
T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,054,403.91	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,972,602.53	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,243,484.38	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,539,912.50	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,104,548.84	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,227,857.42	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,283,115.25	
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,238,335.97	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	6,693,902.32	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,986,242.18	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,612,005.86	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,621,525.76	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,246,575.19	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,858,046.88	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,050,244.15	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,402,956.25	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,073,429.73	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,143,603.52	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,583,274.96	
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	5,722,562.50	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,680,405.85	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,250,984.37	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,653,332.82	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,755,906.25	
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	1,895,312.50	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,080,456.65	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,704,355.45	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,259,980.48	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,824,070.31	

T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,969,946.87
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,243,851.57
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	863,912.11
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,626,953.12
T 3.125% 05/15/48	5,580,000.00	4,409,289.82
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,854,554.66
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,479,618.74
T 3.125% 08/31/27	1,850,000.00	1,757,825.19
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,678,826.15
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,907,484.39
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,468,573.23
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,824,628.91
T 3.375% 05/15/33	7,800,000.00	7,255,218.75
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,524,167.18
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,954,550.78
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,383,576.15
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,642,812.50
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	695,270.89
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,095,218.74
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,304,292.92
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,751,718.76
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,733,007.81
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,672,226.57
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,365,556.66
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,732,859.37
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,350,425.77
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,443,825.38
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,907,536.53
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,239,500.00
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	772,167.97
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	772,148.44
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,968,039.06
T 3% 05/15/45	700,000.00	547,531.25
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,484,489.85
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,654,726.52
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,507,705.07
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,021,062.50
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,041,515.60
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,806,640.60
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,198,875.00
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,058,283.20
T 4.125% 11/15/32	7,550,000.00	7,459,458.96
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	886,746.09

	T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,811,998.02	
	T 4.25% 11/15/40	740,000.00	722,612.89	
	T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,007,128.91	
	T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,887,902.33	
	T 4.375% 05/15/41	650,000.00	642,420.89	
	T 4.375% 11/15/39	960,000.00	956,400.00	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,122,636.13	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	560,022.46	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,721,050.77	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,415,551.17	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	777,773.43	
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,383,837.91	
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,072,851.57	
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,414,906.25	
	T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,312,347.66	
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	430,773.43	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,349,562.50	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,084,595.70	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,748,144.52	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,542,267.57	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,165,294.92	
	アメリカドル 小計	1,076,150,000.00	937,734,385.68 (136,280,938,270)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,049,912.38	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,766,941.92	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,512,381.43	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	667,974.21	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,363,950.07	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,696,212.38	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,375,875.44	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,383,385.53	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	842,431.95	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,361,550.53	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,156,965.08	
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,039,616.54	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,936,495.21	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	723,177.84	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,385,746.76	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,225,815.56	
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	220,642.29	
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,078,508.73	
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	294,914.00	

	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	821,564.39
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,516,838.86
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	906,023.58
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	389,459.22
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	513,391.81
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	375,794.84
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,321,239.10
	CAN 2% 12/01/51	3,450,000.00	2,496,641.72
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,132,254.55
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,029,599.98
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	1,995,182.94
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,290,677.85
	CAN 3% 10/01/25	510,000.00	492,908.92
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,108,058.58
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	771,012.58
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,634,846.35
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,884,367.00
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	715,816.02
	カナダドル 小計	58,410,000.00	52,478,176.14 (5,632,482,645)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,021,233.25
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,337,963.87
	MBONO 5.5% 03/04/27	20,900,000.00	18,263,674.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,158,995.40
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,168,300.80
	MBONO 7.5% 05/26/33	18,500,000.00	16,411,442.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,390,322.30
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	37,159,385.40
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,489,444.75
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,929,334.50
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,400,000.00	31,242,996.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,670,000.00	13,639,065.75
	MBONO 8% 07/31/53	14,950,000.00	13,042,454.75
	MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,495,303.26
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,593,880.00
	メキシコペソ 小計	359,700,000.00	331,343,796.53 (2,828,118,706)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	854,075.30
	BGB 0.35% 06/22/32	1,570,000.00	1,229,933.29
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	307,701.27
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,373,884.08
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	166,026.08
	BGB 0.8% 06/22/25	1,900,000.00	1,819,987.20

BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,391,504.26
BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,446,752.00
BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,451,169.44
BGB 0% 10/22/27	780,000.00	690,070.68
BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,296,856.87
BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	733,074.18
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	627,200.22
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	624,620.80
BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	735,643.08
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	738,870.00
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	529,322.30
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,380,026.31
BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,086,186.55
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	614,187.20
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	494,211.43
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	362,602.00
BGB 3.3% 06/22/54	690,000.00	638,129.94
BGB 3.45% 06/22/43	360,000.00	350,574.48
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	950,515.80
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,093,913.95
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	921,238.75
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,017,334.35
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,179,051.84
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,147,142.52
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,259,569.28
BGB 5% 03/28/35	1,730,000.00	1,993,200.47
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,765,828.83
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,371,635.87
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,613,512.55
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	795,652.80
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,436,087.63
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	553,008.54
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,726,360.04
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,771,047.50
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,111,771.70
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,428,151.90
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,157,097.00
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,327,882.40
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	664,997.52
BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,192,895.50
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,824,995.91
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,337,260.84
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,675,508.72

BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,038,491.84	
BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,150,749.44	
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,447,108.20	
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	714,753.75	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,331,039.15	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,806,772.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,574,457.30	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	847,889.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,216,201.80	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,916,887.65	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	736,042.28	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,320,278.11	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,022,181.12	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,579,569.35	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,164,138.42	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	949,555.68	
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	444,626.82	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,612,287.80	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,577,663.22	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,379,376.00	
BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	329,196.40	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	630,027.99	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,163,351.71	
BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,614,942.85	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,884,638.80	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	684,366.91	
BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,148,735.51	
BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,906,950.56	
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,665,141.85	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,685,970.88	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	819,661.74	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	560,138.58	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,464,748.28	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,353,852.14	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	982,812.56	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,101,994.36	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,107,309.66	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,183,484.80	
BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	830,440.32	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,854,812.46	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,015,234.08	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,524,766.88	

BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	907,006.49
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,306,885.84
BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	294,936.30
BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,149,817.25
BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,354,399.65
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,306,193.03
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,846,517.96
BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,071,699.00
BTPS 4.35% 11/01/33	470,000.00	472,832.22
BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	405,922.52
BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	829,513.03
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,122,484.00
BTPS 4.5% 10/01/53	650,000.00	629,020.60
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,746,388.02
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,525,236.00
BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,727,783.45
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	851,008.86
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,245,402.41
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,817,719.84
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,920,014.43
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,555,231.11
BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,189,326.02
BTPS 5% 08/01/34	3,080,000.00	3,252,997.44
BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,577,081.50
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,993,301.00
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,292,709.84
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,549,590.00
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,783,484.19
DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,675,132.46
DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,345,821.92
DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,963,206.40
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,830,212.99
DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,608,019.70
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	321,945.75
DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,248,598.89
DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	936,869.44
DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	2,956,200.30
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,747,191.32
DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,587,109.55
DBR 0% 08/15/26	1,050,000.00	967,686.30
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,535,616.45
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,972,070.65
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,244,338.41

DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,724,985.62
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,157,995.13
DBR 0% 08/15/52	2,200,000.00	1,028,077.60
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,167,998.14
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,741,636.06
DBR 1.25% 08/15/48	3,230,000.00	2,393,442.92
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,942,190.68
DBR 1.8% 08/15/53	2,380,000.00	1,933,961.82
DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,508,097.80
DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,956,636.00
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,335,256.73
DBR 2.1% 11/15/29	3,160,000.00	3,071,930.80
DBR 2.3% 02/15/33	3,130,000.00	3,052,933.14
DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,671,727.34
DBR 2.5% 08/15/46	3,040,000.00	2,925,039.36
DBR 2.6% 08/15/33	150,000.00	149,739.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,955,890.82
DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,782,966.40
DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,257,399.50
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,569,606.32
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,548,600.38
DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,238,940.26
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,705,295.15
DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,649,588.75
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,518,632.50
DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,138,277.40
FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,282,513.56
FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,424,852.35
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,199,260.50
FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,440,536.90
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,684,311.22
FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	345,614.48
FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	836,382.04
FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,263,426.40
FRTR 0.75% 05/25/28	5,490,000.00	4,954,434.03
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,487,328.36
FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,557,491.32
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,860,177.60
FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,133,023.17
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,723,927.00
FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,108,911.12
FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,551,458.00

FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,514,015.04
FRTR 0% 11/25/29	3,580,000.00	2,979,283.16
FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,243,260.73
FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,291,149.50
FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,556,081.78
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,491,318.70
FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	824,341.00
FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,641,015.94
FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,873,579.05
FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	928,458.76
FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,340,891.00
FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,077,985.60
FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,323,760.65
FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,083,535.16
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,410,797.64
FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	444,366.00
FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	884,964.60
FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	493,770.50
FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,300,186.51
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,143,999.00
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,641,198.20
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	2,952,586.56
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,779,286.60
FRTR 3% 05/25/33	1,880,000.00	1,854,375.60
FRTR 3% 05/25/54	1,210,000.00	1,076,337.35
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,900,884.32
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,779,999.36
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,091,579.96
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,930,865.68
FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	2,938,496.00
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,681,075.20
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,335,894.30
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,011,773.20
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	604,832.67
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	641,871.09
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	371,070.17
IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	447,092.18
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	224,667.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	702,354.73
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	668,992.50
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	958,668.24
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	366,848.91
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	419,686.50

IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	532,232.00
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	476,085.46
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	949,415.00
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	765,048.64
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	765,184.00
IRISH 3% 10/18/43	470,000.00	444,991.30
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,199,497.53
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,811,123.12
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	817,527.25
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	931,567.62
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,324,577.13
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	830,422.55
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	830,448.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,538,177.00
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,107,938.07
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,669,229.60
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,381,951.55
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	620,613.88
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	773,922.42
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,112,043.60
NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,257,148.41
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	390,926.00
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,498,863.95
NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	714,100.00
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,768,341.20
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	581,328.00
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,865,092.10
NETHER 4% 01/15/37	1,760,000.00	1,941,876.28
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,691,502.21
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,849,712.64
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,188,714.18
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,313,776.92
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,348,991.80
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,755,861.31
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,321,116.79
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,363,081.85
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,354,562.11
OBL 2.4% 10/19/28	670,000.00	662,796.19
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	486,046.80
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,230,518.28
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	995,895.94
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	115,290.28

RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	796,774.00
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	401,726.76
RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,315,852.89
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	89,924.25
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,024,008.21
RAGB 0% 02/20/30	1,280,000.00	1,049,460.48
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,323,862.44
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	976,885.99
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	624,215.70
RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	265,194.21
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,143,392.46
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	757,337.11
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	149,439.87
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	969,453.54
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	342,729.44
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	444,325.70
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	674,564.53
RAGB 2.9% 02/20/33	640,000.00	623,017.60
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	218,517.20
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	677,131.70
RAGB 3.15% 10/20/53	270,000.00	259,085.65
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	459,259.08
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,698,248.59
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,115,241.74
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,317,373.24
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	295,946.42
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	198,785.32
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	292,332.93
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	179,880.30
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	580,886.06
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	290,866.32
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	489,477.06
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	645,150.64
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	456,850.05
RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	480,942.06
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	420,271.28
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	404,992.56
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	273,591.00
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	517,047.68
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	300,708.62
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	330,481.90
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	353,298.82
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	496,878.12

RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	469,106.04
RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	268,781.80
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	544,398.25
RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	452,260.68
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	587,811.44
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,708,327.87
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,281,961.00
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,029,390.22
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,035,046.78
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,741,599.20
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,219,372.76
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,375,274.00
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	987,384.59
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,171,736.48
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,454,743.76
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,601,455.61
SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,104,169.65
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,882,857.09
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,379,644.60
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,717,819.74
SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,492,583.48
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	1,994,403.60
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,875,676.07
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,432,183.51
SPGB 1.45% 10/31/27	2,210,000.00	2,053,171.77
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	295,967.99
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,408,179.00
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,407,744.33
SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,785,093.00
SPGB 1.9% 10/31/52	1,380,000.00	860,529.36
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,219,842.07
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,841,149.20
SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	536,469.75
SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	942,880.16
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,532,367.10
SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,289,757.60
SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,824,049.26
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,337,184.09
SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,338,236.10
SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	985,202.00
SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,615,933.76
SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,635,792.70

	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	665,502.74
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,181,128.13
	SPGB 3.55% 10/31/33	1,240,000.00	1,227,461.12
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,017,290.83
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,019,845.10
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,907,299.48
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,042,347.40
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,918,040.62
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,410,580.08
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,635,852.78
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,343,483.00
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,205,771.78
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,030,457.61
	ユーロ 小計	649,440,000.00	588,098,679.37 (92,990,163,181)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,122,015.88
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,232,038.59
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,758,512.80
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,930,197.50
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,235,167.52
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,599,342.00
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,736,152.00
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	477,790.08
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,292,130.00
	UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,065,458.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	393,974.00
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	739,319.40
	UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,141,869.11
	UKT 0.875% 10/22/29	1,810,000.00	1,447,916.01
	UKT 1.125% 01/31/39	1,950,000.00	1,162,611.84
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	355,755.75
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	829,967.50
	UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,097,485.48
	UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,110,269.44
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,452,684.96
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	891,437.50
	UKT 1.5% 07/31/53	970,000.00	461,889.94
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	921,048.08
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	655,777.77
	UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	515,152.60
UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	328,312.56	
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	779,064.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,298,634.87	

	UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	2,946,833.16	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	856,842.20	
	UKT 2.75% 09/07/24	1,440,000.00	1,403,352.00	
	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,232,586.58	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,498,925.21	
	UKT 3.25% 01/31/33	2,030,000.00	1,810,634.95	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,596,146.00	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,197,318.02	
	UKT 3.5% 10/22/25	690,000.00	663,124.50	
	UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,243,962.63	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,092,564.00	
	UKT 3.75% 10/22/53	1,620,000.00	1,333,908.00	
	UKT 4.125% 01/29/27	2,800,000.00	2,713,047.95	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,796,692.59	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,463,775.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,179,648.39	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,128,367.13	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,340,396.82	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,439,919.90	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,454,531.96	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,614,050.60	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,363,658.38	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,707,832.80	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,472,062.52	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,382,802.40	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,087,206.00	
	UKT 4% 10/22/63	560,000.00	485,454.14	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,174,165.84	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,426,829.04	
	イギリスポンド 小計	94,680,000.00	74,138,613.89 (13,736,402,381)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,637,426.74	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,814,812.83	
	SGB 0.75% 11/12/29	5,260,000.00	4,637,918.51	
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,451,229.72	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,452,654.14	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,273,414.04	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,602,405.75	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,200,000.00	4,500,342.00	
	スウェーデンクローナ 小計	44,280,000.00	41,370,203.73 (548,155,199)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	2,996,421.60	

	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,383,475.20	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,832,330.00	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,906,235.80	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,024,831.82	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,745,503.75	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,908,846.08	
	NGB 2% 04/26/28	2,630,000.00	2,404,112.45	
	NGB 3% 08/15/33	3,310,000.00	3,056,599.64	
ノルウェークローネ 小計		37,010,000.00	33,258,356.34	(454,641,731)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,537,566.28	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,225,851.97	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,316,802.63	
	DGB 0% 11/15/24	3,950,000.00	3,797,794.51	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,215,354.38	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,371,858.53	
	DGB 2.25% 11/15/33	930,000.00	880,561.20	
	DGB 4.5% 11/15/39	10,510,000.00	12,613,226.51	
デンマーククローネ 小計		46,610,000.00	42,959,016.01	(911,590,319)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,927,520.10	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,299,408.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,133,179.45	
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,790,000.00	2,057,485.50	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,782,137.68	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,522,851.90	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,278,764.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,873,000.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,168,532.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,876,457.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,323,706.16	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	609,270.00	
	POLGB 6% 10/25/33	2,100,000.00	2,161,005.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	910,000.00	987,042.59	
ポーランドズロチ 小計		44,550,000.00	40,000,359.88	(1,418,284,760)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,672,140.80	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,935,609.64	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,092,010.28	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,917,905.97	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,978,492.41	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	947,031.97	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,479,113.12	

	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,169,217.12
	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,624,701.06
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,373,211.69
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,124,558.24
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,180,000.00	922,543.00
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,029,214.77
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,843,130.58
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,565,525.06
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,357,111.36
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,046,016.46
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,616,921.59
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	964,637.93
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,350,746.97
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,084,923.76
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,426,581.88
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,117,536.19
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,653,181.74
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,500,000.00	1,513,152.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,750,322.44
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,387,299.95
	オーストラリアドル 小計	49,300,000.00	43,942,837.98 (4,095,472,499)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	521,708.29
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	590,955.65
	NZGB 1.5% 05/15/31	790,000.00	614,407.15
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	275,682.84
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	812,983.30
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	481,411.21
	NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	332,545.84
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	417,932.01
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,025,327.90
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	587,164.63
	NZGB 4.25% 05/15/34	320,000.00	298,273.68
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	824,061.44
	NZGB 4.5% 05/15/30	370,000.00	359,653.45
	ニュージーランドドル 小計	8,440,000.00	7,142,107.39 (615,078,288)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	553,420.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	759,132.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	499,968.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	624,470.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	259,665.60
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	609,084.00

	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	586,625.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	881,829.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	426,722.40
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	704,664.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	230,000.00	220,110.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	618,240.00
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	606,343.50
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	640,575.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	415,464.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	618,471.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	843,446.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	746,068.00
	SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	227,656.00
	SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	894,420.00
	シンガポールドル 小計	12,310,000.00	11,736,373.50 (1,256,965,601)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,515,192.88
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,502,448.76
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	693,311.13
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,936,104.36
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,256,768.31
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,743,649.14
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,874,608.55
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,380,981.37
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,173,224.16
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,142,767.30
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,993,960.71
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,496,859.52
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,807.06
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,705,548.00
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,287,670.40
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,949,257.87
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,552,021.16
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,784,097.70
	MGS 4.392% 04/15/26	1,910,000.00	1,951,496.27
	MGS 4.498% 04/15/30	1,100,000.00	1,146,339.91
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	363,233.67
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	925,791.27
	MGS 4.696% 10/15/42	1,450,000.00	1,549,842.36
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,049,529.04
MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,450,674.64	
MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,013,436.37	

	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,848,953.06
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,128,121.71
マレーシアリングット 小計		46,280,000.00	47,022,696.68 (1,469,830,750)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,942,539.32
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,036,454.53
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,270,812.08
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,210,000.00	976,924.10
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,289,940.77
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,201,472.58
	ILGOV 1% 03/31/30	2,220,000.00	1,847,222.47
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,508,747.39
	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	374,973.95
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,494,263.04
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,484,247.97
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,196,049.80
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,426,976.05
イスラエルシェケル 小計		23,780,000.00	22,050,624.05 (843,806,820)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,806,745.30
	CGB 2.18% 08/25/25	19,000,000.00	19,032,750.30
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,291,400.79
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,426,954.95
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,243,179.29
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,975,688.77
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,338,914.92
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,662,741.00
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,648,262.64
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,126,702.00
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,200,214.02
	CGB 2.6% 09/01/32	21,800,000.00	21,758,433.50
	CGB 2.62% 04/15/28	15,050,000.00	15,268,148.24
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,105,080.00
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,635,319.18
	CGB 2.68% 05/21/30	25,830,000.00	26,166,487.41
	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000.00	64,882,155.78
	CGB 2.69% 08/15/32	20,220,000.00	20,369,836.26
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,756,819.65
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,844,568.44
	CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,831,298.63
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,192,874.50
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,481,331.19
CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,318,360.00	

	CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,059,290.40	
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,102,022.67	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,571,724.32	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,858,568.94	
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,906,345.06	
	CGB 2% 06/15/25	3,600,000.00	3,595,270.32	
	CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,419,393.80	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,442,374.04	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,240,923.92	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,706,825.96	
	CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,744,427.14	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,223,135.94	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,699,000.78	
	CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,620,294.40	
	CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	18,135,282.62	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,322,688.53	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,940,000.00	9,158,327.89	
	CGB 3.81% 09/14/50	18,550,000.00	21,445,853.47	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,961,803.48	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,838,082.07	
	オフショア人民元 小計	848,970,000.00	869,415,902.51 (17,284,509,791)	
	合計		280,366,440,941 (280,366,440,941)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 207銘柄	100.0%	48.6%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 359銘柄	100.0%	33.2%
イギリスポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	4.9%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%

マレーシアリングット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	44銘柄	100.0%	6.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,928,488,178
コール・ローン	174,561,684
株式	147,082,911,124
投資信託受益証券	456,204,305
投資証券	128,013,987
未収入金	7,112,548
未収配当金	466,669,127
前払金	326,462,046
差入委託証拠金	977,604,203
流動資産合計	154,548,027,202
資産合計	154,548,027,202
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	326,716,482
未払金	3,352,370
未払解約金	43,412,086
未払利息	412
流動負債合計	373,481,350
負債合計	373,481,350
純資産の部	
元本等	
元本	40,615,994,191
剰余金	
剰余金又は欠損金()	113,558,551,661
元本等合計	154,174,545,852
純資産合計	154,174,545,852
負債純資産合計	154,548,027,202

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

2023年 8月21日現在	
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,615,994,191口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.7959円 (37,959円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2023年 8月21日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月21日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	31,497,822,404円
期中追加設定元本額	12,886,702,696円
期中一部解約元本額	3,768,530,909円
期末元本額	40,615,994,191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	7,706,948,229円
世界経済インデックスファンド	9,423,904,736円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,972,907,084円
DC 世界経済インデックスファンド	7,137,533,504円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	102,647,462円
コア投資戦略ファンド(安定型)	50,323,436円
コア投資戦略ファンド(成長型)	125,428,063円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,106,711,142円
DC 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	769,819,461円
コア投資戦略ファンド(切替型)	59,134,295円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	395,448,904円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,486,028円
SMT インデックスバランス・オープン	97,037,857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セクション(SMA専用)	1,906,572,221円
SMT 世界経済インデックス・オープン	230,425,080円

区分	2023年 8月21日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	951,496,587円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	161,852,976円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,365,715円
グローバル経済コア	407,386,494円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	185,874,557円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	51,001,497円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,615,652円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	96,253,991円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	87,107,028円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	36,069,751円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	37,094,954円
10資産分散投資ファンド	13,164,952円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,390,057,619円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	100,931,802円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,120,268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）	10,376,837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）	23,352,061円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,533,368,309	
投資信託受益証券	38,292,213	
投資証券	2,282,585	
合計	6,573,943,107	

(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 8月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,805,864,212	-	6,479,402,166	326,462,046
合計		6,805,864,212	-	6,479,402,166	326,462,046

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2023年 8月21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	122,312,400	-	122,057,964	254,436
	アメリカドル	122,312,400	-	122,057,964	254,436

合計	122,312,400	-	122,057,964	254,436
----	-------------	---	-------------	---------

(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取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取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取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	1.38	192,372.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.74	131,038.20	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,749	77.25	1,216,610.25	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	24.12	1,539,603.72	
	NIO INC - ADR	201,974	10.67	2,155,062.58	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	43.92	1,324,583.28	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	6.67	528,717.56	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	52.76	3,506,007.52	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	30.60	375,859.80	
	IQIYI INC-ADR	59,454	5.24	311,538.96	
	JOYY INC	6,185	31.96	197,672.60	
	KANZHUN LTD	38,815	14.71	570,968.65	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	6.53	741,461.91	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	12.65	66,399.85	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	20.15	216,128.90	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	76.98	6,233,378.52	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	14.93	816,312.68	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	-	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,037	66.36	533,335.32	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.20	487,103.40	
CREDICORP LTD	10,882	138.80	1,510,421.60		
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-		
LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.30	148,372.90		
QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	15.96	331,217.88		

	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.37	334,023.48	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	35.14	275,321.90	
	KE HOLDINGS INC	92,870	14.76	1,370,761.20	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.57	88,105.69	
	アメリカドル 小計	2,059,883		25,202,380.35 (3,662,661,936)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,214,261	13.26	29,361,100.86	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	81.44	39,815,364.48	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	217.93	7,627,550.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	36.97	6,601,067.44	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	10.26	3,216,510.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	133.46	13,612,920.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	457.15	15,348,811.25	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	303.02	18,175,139.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	165.96	7,084,002.60	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	590,690	15.87	9,374,250.30	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	67.16	55,560,124.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	162.50	13,304,687.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	197.79	61,935,960.60	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	282.61	7,336,555.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	88.75	16,134,750.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.25	6,953,850.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	52.02	7,423,254.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	145.17	59,853,591.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	36.97	10,044,749.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,969,540	16.61	82,544,059.40	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.15	3,570,765.00		
	メキシコペソ 小計	11,688,330		474,879,063.43 (4,053,235,270)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	18.01	2,919,421.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	594,100	34.49	20,490,509.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	31.52	22,947,820.80	
	PRIO SA	130,000	45.17	5,872,100.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	18.30	1,383,480.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.22	1,214,668.00	
	GERDAU SA-PREF	155,590	25.50	3,967,545.00	
	SUZANO SA	121,779	50.68	6,171,759.72	
	VALE SA	525,387	61.22	32,164,192.14	
	WEG SA	255,844	36.26	9,276,903.44	
	CCR SA	248,600	12.79	3,179,594.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	93,140	62.97	5,865,025.80	
	RUMO SA	244,300	22.27	5,440,561.00	

	LOJAS RENNER S.A.	216,447	17.36	3,757,519.92	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.00	916,500.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	17.83	3,084,590.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.85	1,571,310.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	26.70	5,053,776.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	13.43	2,038,674.00	
	AMBEV SA	756,200	14.36	10,859,032.00	
	JBS SA	110,000	19.21	2,113,100.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	16.24	1,629,001.92	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.63	4,839,063.02	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	29.74	2,846,118.00	
	HYPERA SA	54,500	41.40	2,256,300.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.38	4,362,187.74	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	15.19	12,580,084.58	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	47.79	7,479,135.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	26.96	21,036,375.76	
	ITAUSA SA	774,657	9.37	7,258,536.09	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	13.66	12,122,006.94	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	29.88	3,253,932.00	
	TOTVS SA	57,900	27.92	1,616,568.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	42.63	3,811,122.00	
	TIM SA	96,100	14.90	1,431,890.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	38.14	1,411,180.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	34.65	7,335,405.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.01	2,544,042.27	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	59.84	3,021,920.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	34.41	935,952.00	
	ENEVA SA	102,200	12.76	1,304,072.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	41.80	1,933,250.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	31.90	5,266,690.00	
	ブラジルリアル 小計	11,721,498		260,562,914.14 (7,616,410,318)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,400.00	578,707,200.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,620.00	220,263,300.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	55,096.00	1,170,845,096.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	61.00	150,132,468.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,179.90	154,417,576.30	
	CENCOSUD SA	306,432	1,820.00	557,706,240.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,644.00	49,065,940.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	94.00	712,821,082.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	25,200.00	176,122,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	40.05	462,584,268.45	

	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	101.95	355,939,564.25	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	56.90	145,736,718.20	
	チリペソ 小計	28,286,435		4,734,342,253.20 (791,563,087)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	27,002	30,550.00	824,911,100.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	27,830.00	1,713,353,950.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	16,330.00	824,844,630.00	
	コロンビアペソ 小計	139,078		3,363,109,680.00 (118,569,794)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	21.64	112,549.64	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	35.20	714,384.00	
	OPAP SA	20,586	15.07	310,231.02	
	JUMBO SA	19,341	27.06	523,367.46	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.44	379,681.92	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.50	641,705.33	
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	6.20	456,568.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.33	375,546.31	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	9.71	542,711.32	
	TERNA ENERGY SA	13,651	16.25	221,828.75	
	ユーロ 小計	926,142		4,278,573.75 (676,528,081)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	127.00	18,108,930.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	41.90	10,846,569.20	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	26.26	3,494,339.42	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	25.70	431,323.10	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	52.35	6,178,556.40	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	70.65	7,034,337.90	
	KOC HOLDING AS	89,884	135.00	12,134,340.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	49.44	14,770,101.12	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	899.90	6,462,181.90	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	251.40	21,775,011.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	892.70	14,613,499.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	277.90	8,782,473.70	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	235.00	19,088,580.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	28.66	16,800,004.78	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	58.50	12,365,262.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	16.61	6,385,930.43	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	15.90	5,900,919.30	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	51.70	7,397,804.70	
	トルコリラ 小計	3,076,763		192,570,163.95 (1,032,927,102)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	712.50	9,478,387.50	

	MONETA MONEY BANK AS	60,710	85.50	5,190,705.00
	CEZ AS	25,283	946.50	23,930,359.50
	チェココルナ 小計	99,296		38,599,452.00 (253,988,254)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,652.00	118,074,996.00
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,230.00	265,279,430.00
	OTP BANK NYRT	40,021	14,100.00	564,296,100.00
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		947,650,526.00 (392,393,653)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	62.57	6,443,396.03
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	106.30	2,145,771.80
	LPP SA	124	12,950.00	1,605,800.00
	CD PROJEKT SA	6,704	154.00	1,032,416.00
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	14.19	512,411.11
	ALLEGRO.EU SA	83,795	34.48	2,889,251.60
	PEPCO GROUP NV	22,887	31.36	717,736.32
	DINO POLSKA SA	9,471	396.20	3,752,410.20
	BANK PEKAO SA	27,684	105.90	2,931,735.60
	M BANK SA	1,423	419.50	596,948.50
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	36.77	4,791,020.69
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	370.40	2,719,847.20
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	39.23	3,394,532.67
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	8.88	886,623.20
	ポーランドズロチ 小計	635,320		34,419,900.92 (1,220,419,542)
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	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	5.47	1,799,630.00

CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	9.23	2,233,660.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.24	16,406,256.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	455,500	21.85	9,952,675.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	8.33	183,260.00
PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.61	18,052,980.00
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	10.94	4,693,260.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.39	1,152,600.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	21.10	5,011,250.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	7.13	3,960,715.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.18	3,043,040.00
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	2.85	820,800.00
CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.65	3,766,500.00
DONGYUE GROUP	147,000	6.76	993,720.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	41.05	2,218,342.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	12.02	2,812,680.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.40	1,601,600.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	14.92	1,417,400.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.08	1,824,480.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.94	10,805,700.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.50	962,500.00
BOC AVIATION LTD	23,800	59.20	1,408,960.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.37	660,520.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	8.15	1,980,450.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	4.26	545,280.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.53	3,198,180.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.91	3,938,220.00
CITIC LTD	1,038,000	7.61	7,899,180.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	3.93	3,678,480.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.83	1,391,040.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	16.90	1,318,200.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	11.50	1,840,000.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	408,800	9.68	3,957,184.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	25.70	1,601,110.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	2.82	1,085,908.68
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.88	1,258,320.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.37	1,083,760.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	9.41	1,557,797.27
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.29	2,565,420.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	7.51	3,890,555.50
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.46	1,118,452.04
JD LOGISTICS INC	326,200	10.54	3,438,148.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	6.70	2,157,400.00

ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	120.70	2,112,250.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.20	882,799.40
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.90	1,829,000.00
BYD CO LTD-H	158,000	225.20	35,581,600.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	2.99	795,340.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	35.65	2,081,960.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.46	8,968,080.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.31	4,596,812.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.21	1,508,628.24
LI AUTO INC-CLASS A	171,642	155.40	26,673,166.80
MINTH GROUP LTD	176,000	22.70	3,995,200.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	61.00	10,196,882.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	16.16	3,781,440.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	79.15	15,735,020.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.21	1,405,980.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	22.70	7,050,620.00
LI NING CO LTD	380,000	39.10	14,858,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	74.60	9,108,660.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.86	1,296,900.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	36.20	1,592,800.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	21.65	5,066,100.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	235,000	13.52	3,177,200.00
MEITUAN-CLASS B	787,350	129.90	102,276,765.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	40.40	9,877,800.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	17.12	2,855,616.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.24	1,124,960.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	299.60	26,262,037.20
BAIDU INC-CLASS A	351,450	126.10	44,317,845.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	116.90	3,109,540.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	31.55	1,627,980.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.80	2,282,400.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	29.60	5,067,520.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	63.60	23,684,640.00
NETEASE INC	313,630	156.50	49,083,095.00
TENCENT HOLDINGS LTD	968,500	325.00	314,762,500.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,575,888	87.00	224,102,256.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	6.95	722,800.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	111.10	999,900.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	11.94	3,008,880.00
JD.COM INC - CL A	360,461	131.20	47,292,483.20
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	21.25	1,372,750.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.69	2,742,900.00

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	21.70	1,996,400.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.35	3,410,400.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	41.15	7,960,467.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	17.48	938,676.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	132.80	2,018,560.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.37	2,464,680.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	458,000	25.25	11,564,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	46.00	11,316,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	3.56	875,760.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.25	11,939,850.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	7.70	1,501,500.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	10.98	4,567,680.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	66.20	7,679,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	5.92	473,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	556,000	5.43	3,019,080.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	16.52	792,960.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	28.95	2,533,125.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	17.44	436,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	40.30	3,038,620.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	12.90	851,400.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	8.11	3,237,512.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	12.96	1,664,064.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	21.20	4,053,440.00
3SBIO INC	445,500	6.82	3,038,310.00
AKESO INC	61,000	32.50	1,982,500.00
BEIGENE LTD	110,905	114.70	12,720,803.50
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	10.98	2,712,060.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	5.65	7,843,104.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.46	1,850,940.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	2.91	1,414,260.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	17.62	2,325,840.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	40.70	207,570.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	9.62	1,173,640.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	31.45	6,384,350.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	50,175	17.06	855,985.50
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	18.88	1,378,240.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.99	5,893,290.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	63,688	81.90	5,216,047.20
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	567,000	40.05	22,708,350.00
ZAI LAB LTD	128,250	18.16	2,329,020.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	2.55	10,034,250.00

BANK OF CHINA LTD-H	12,394,200	2.64	32,720,688.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.33	5,938,486.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.47	5,431,244.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	14,601,620	4.08	59,574,609.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.22	832,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	30.95	19,248,516.85
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.75	1,854,600.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	3.41	29,764,236.15
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	3.98	4,278,500.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.77	640,640.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.19	2,023,770.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	16.80	5,900,160.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	15.68	4,480,952.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.19	1,245,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	11.58	1,025,988.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.04	1,800,288.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	10.68	2,840,880.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,109,000	11.58	12,842,220.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	18.00	6,958,800.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	7.83	1,440,907.92
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	19.82	2,089,028.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.64	4,957,920.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	8.29	9,925,517.52
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	45.45	45,631,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	23.30	2,705,130.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	4.85	1,338,600.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	10.60	1,343,020.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	12.40	6,113,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	16.28	1,164,020.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	29.55	4,742,775.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	18.50	1,239,500.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	6.79	468,510.00
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	7.29	8,660,520.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	65.15	7,785,425.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	11.74	28,225,308.00
ZTE CORP-H	82,908	24.65	2,043,682.20
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.79	5,594,780.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	29.15	1,734,425.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.73	1,055,300.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.96	2,798,880.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	8.29	3,866,456.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	6.37	2,879,240.00

	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.97	1,978,020.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	106,800	23.60	2,520,480.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	16.06	4,133,844.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	83.00	9,711,000.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.13	2,733,980.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.36	3,069,440.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.61	3,074,280.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	20.10	1,286,400.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.43	4,503,070.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	19.28	1,735,200.00	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	18.90	812,700.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	6.88	6,164,390.56	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	19.86	1,816,276.44	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.12	701,008.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	16.08	9,399,403.20	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	8.25	1,856,250.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.80	17,207,329.80	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	33.65	4,004,350.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	9.56	3,016,180.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	7.11	2,424,510.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	7.32	530,700.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	3.71	667,800.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	16.54	5,681,490.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	9.33	2,991,198.00	
	香港ドル 小計	128,836,254		1,791,782,678.52 (33,255,486,513)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.16	893,522.88	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	22.50	1,989,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.80	2,831,520.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.75	3,598,600.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.48	714,560.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.11	709,690.06	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	6.82	731,656.42	
	MISC BHD	217,540	7.09	1,542,358.60	
	GENTING BHD	271,600	4.40	1,195,040.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.58	953,826.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.56	473,382.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.98	1,075,953.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	22.66	2,588,814.36	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	132.00	950,400.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	16.02	1,177,149.60	

	QL RESOURCES BHD	124,800	5.43	677,664.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.39	1,084,531.94
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	6.00	1,375,800.00
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.80	406,444.50
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.86	1,160,702.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	5.55	5,106,011.10
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.90	2,413,710.80
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	18.44	306,712.52
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.00	7,933,545.00
	PUBLIC BANK BERHAD	2,122,900	4.13	8,767,577.00
	RHB BANK BHD	219,347	5.65	1,239,310.55
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.60	1,406,831.40
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.38	2,181,240.00
	MAXIS BHD	267,900	3.93	1,052,847.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.04	1,368,622.08
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.00	2,522,800.00
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.95	4,395,661.25
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.01	826,847.00
	マレーシアリングット 小計	12,038,592		65,652,331.26 (2,052,154,005)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	8.65	14,819,180.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	158.50	31,826,800.00
	PTT PCL-NVDR	1,377,500	36.00	49,590,000.00
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	51.75	15,194,058.75
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	30.50	6,295,200.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	36.50	17,743,891.00
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	36.75	7,449,225.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	314.00	40,945,600.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	70.75	46,334,175.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.80	7,189,600.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.10	5,747,450.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.98	3,224,994.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	32.75	11,879,669.50
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	39.00	7,105,800.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.50	11,341,822.50
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	20.10	15,927,240.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	35.00	6,216,000.00
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	62.00	59,296,800.00
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	34.25	8,148,417.50
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	76.00	3,518,800.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	19.40	10,794,160.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	29.00	8,499,900.00

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	28.00	52,866,800.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	261.00	21,584,700.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	128.50	10,691,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.50	8,553,675.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,200	113.50	9,216,200.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	45.25	4,592,875.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	38.00	3,412,400.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	46.00	3,509,800.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	99.50	49,352,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	222.00	45,243,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	75.75	9,230,137.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.80	13,706,202.40	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	35.75	11,475,750.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	132.50	9,434,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	57.25	12,589,275.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	52.75	3,597,550.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	48.00	19,339,200.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	35.25	12,550,762.50	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	66.75	25,258,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.35	7,281,200.00	
	タイパーツ 小計	20,515,990		722,574,310.65	(2,977,006,159)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	47.05	11,195,077.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	590.00	32,101,900.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	38.05	22,301,980.15	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	860.00	31,205,100.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	213.80	32,739,194.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	243.80	14,874,238.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	117.60	11,237,856.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	111.10	26,086,502.20	
	BDO UNIBANK INC	394,773	138.20	54,557,628.60	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	56.95	9,185,294.65	
	PLDT INC	10,460	1,215.00	12,708,900.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	350.00	18,613,000.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	29.50	37,786,550.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	30.00	46,600,500.00	
	フィリピンペソ 小計	4,913,210		361,193,720.60	(934,046,961)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,540.00	5,492,242,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	26,800.00	5,384,120,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,950.00	1,922,310,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	895.00	2,588,527,055.00	

	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	9,375.00	2,289,375,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,180.00	5,162,084,460.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,075.00	1,848,015,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,725.00	2,655,729,400.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,525.00	21,384,382,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	92.00	12,386,871,168.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,900.00	6,202,230,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	5,225.00	4,980,992,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,700.00	7,012,980,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,050.00	3,025,155,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,690.00	4,270,806,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,845.00	7,727,782,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,250.00	80,376,025,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,775.00	35,237,848,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	9,050.00	11,695,315,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,575.00	61,104,241,150.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,010.00	2,869,006,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	3,760.00	27,447,248,000.00	
	インドネシアルピア 小計	193,375,608		313,063,286,533.00 (2,974,101,222)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	58,600.00	303,548,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	73,000.00	466,251,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	174,100.00	1,605,898,400.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	35,150.00	642,401,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	34,150.00	382,104,350.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	465,500.00	560,462,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	115,900.00	219,978,200.00	
	LG CHEM LTD	8,087	569,000.00	4,601,503,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	334,500.00	293,356,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	130,000.00	301,080,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	417,500.00	1,986,465,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	549,000.00	6,469,965,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	89,200.00	208,549,600.00	
	SKC CO LTD	1,432	90,700.00	129,882,400.00	
	CJ CORP	1,230	70,400.00	86,592,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	53,700.00	231,339,600.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	16,020.00	1,313,688,060.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	312,000.00	2,568,384,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	37,400.00	246,578,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	107,600.00	626,877,600.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	121,000.00	255,915,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	114,000.00	714,666,000.00	

HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	34,700.00	338,949,600.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	84,400.00	243,325,200.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	46,950.00	629,881,200.00
LG CORP	16,658	79,700.00	1,327,642,600.00
LG ENERGY SOLUTION	5,668	529,000.00	2,998,372,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	13,780	81,500.00	1,123,070,000.00
SAMSUNG C&T CORP	11,910	102,400.00	1,219,584,000.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	35,500.00	657,318,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	8,310.00	790,854,390.00
SK INC	6,394	138,800.00	887,487,200.00
SK SQUARE CO LTD	11,660	43,950.00	512,457,000.00
HMM CO LTD	35,545	17,560.00	624,170,200.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	171,300.00	478,440,900.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	23,650.00	634,340,300.00
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	4,400.00	130,838,400.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	39,650.00	280,166,900.00
HANON SYSTEMS	19,000	9,400.00	178,600,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	229,500.00	2,328,966,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	20,743	186,100.00	3,860,272,300.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	104,400.00	630,784,800.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	101,700.00	350,763,300.00
KIA CORP	39,244	78,400.00	3,076,729,600.00
COWAY CO LTD	9,036	40,950.00	370,024,200.00
F&F CO LTD / NEW	3,017	103,600.00	312,561,200.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	98,300.00	1,696,068,200.00
KANGWON LAND INC	28,528	15,170.00	432,769,760.00
HYBE CO LTD	2,474	236,500.00	585,101,000.00
KAKAO CORP	52,020	48,450.00	2,520,369,000.00
KAKAO GAMES CORP	3,021	27,750.00	83,832,750.00
KRAFTON INC	3,793	158,000.00	599,294,000.00
NAVER CORP	21,578	212,500.00	4,585,325,000.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	250,000.00	677,250,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	44,100.00	108,706,500.00
PEARL ABYSS CORP	4,605	57,000.00	262,485,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	87,800.00	383,071,400.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	160,200.00	261,446,400.00
EMART	3,594	71,100.00	255,533,400.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	303,500.00	558,136,500.00
KT&G CORP	13,993	85,400.00	1,195,002,200.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	122,400.00	384,580,800.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	122,000.00	458,964,000.00
LG H&H CO LTD	1,321	447,500.00	591,147,500.00

	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	68,600.00	1,053,696,000.00	
	HLB INC	23,903	29,900.00	714,699,700.00	
	CELLTRION INC	17,544	150,400.00	2,638,617,600.00	
	CELLTRION PHARM INC	2,066	73,300.00	151,437,800.00	
	HANMI PHARM CO LTD	1,179	303,000.00	357,237,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	771,000.00	2,062,425,000.00	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	86,500.00	276,540,500.00	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	75,800.00	159,180,000.00	
	YUHAN CORPORATION	13,195	73,300.00	967,193,500.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	51,249	37,550.00	1,924,399,950.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,440.00	295,765,200.00	
	KAKAObANK CORP	35,459	25,600.00	907,750,400.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	52,000.00	3,359,148,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	34,800.00	2,358,674,400.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	11,380.00	876,874,520.00	
	KAKAOPAY CORP	3,065	44,550.00	136,545,750.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	50,500.00	232,401,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	49,550.00	841,111,250.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,560.00	203,458,400.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	10,270.00	124,338,890.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	36,200.00	577,281,400.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	81,900.00	825,060,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	251,000.00	1,038,889,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	66,000.00	800,646,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	136,400.00	993,537,600.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,780	153,000.00	578,340,000.00	
	L&F CO LTD	4,327	211,000.00	912,997,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	13,150.00	503,658,150.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	256,000.00	690,176,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	49,900.00	108,083,400.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	144,600.00	1,335,091,800.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	743,174	66,300.00	49,272,436,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	125,351	54,500.00	6,831,629,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	597,000.00	5,267,331,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	10,210.00	225,896,250.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	17,940.00	793,665,600.00	
	SK HYNIX INC	83,801	117,200.00	9,821,477,200.00	
	韓国ウォン 小計	2,403,127		164,057,859,570.00 (17,816,683,549)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	111,240	79.00	8,787,960.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	39.10	17,758,281.60	
	CHINA STEEL	1,779,261	27.20	48,395,899.20	

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	62.10	33,661,988.10
FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	80.30	48,005,267.20
NAN YA PLASTICS CORP	770,752	66.40	51,177,932.80
TAIWAN CEMENT	913,419	35.15	32,106,677.85
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	897.00	16,645,629.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	28.75	10,408,305.00
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,545.00	13,905,000.00
WALSIN LIHWA CORP	502,213	36.40	18,280,553.20
CHINA AIRLINES LTD	465,000	23.65	10,997,250.00
EVA AIRWAYS CORP	386,000	33.20	12,815,200.00
EVERGREEN MARINE	183,215	107.00	19,604,005.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.35	13,853,200.00
WAN HAI LINES LIMITED	74,635	50.50	3,769,067.50
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	43.90	9,526,300.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	37.75	6,684,052.75
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	482.00	19,249,634.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	168.50	13,294,818.50
GIANT MANUFACTURING	35,713	203.00	7,249,739.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	304.50	9,439,500.00
POU CHEN	273,780	29.35	8,035,443.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	692.00	37,409,520.00
MOMO.COM INC	6,600	529.00	3,491,400.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	270.00	23,906,880.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	72.40	56,210,998.00
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	329.00	8,225,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	17.15	10,433,682.70
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	23.35	61,672,883.95
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,002,537	24.60	49,262,410.20
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	26.20	43,317,979.60
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	20.80	31,581,908.80
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,684,994	35.70	60,154,285.80
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	17.10	30,633,692.40
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	17.65	35,311,490.15
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	13.65	10,647,000.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	26.55	40,221,285.30
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	42.50	29,324,362.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	220,702	180.00	39,726,360.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,433,822	23.95	34,340,036.90
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	45.20	69,203,776.40
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	11.90	30,657,089.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,110,906	62.40	69,320,534.40
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	9.39	18,140,221.74

ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	411.50	28,805,000.00
ACER INC	617,803	37.40	23,105,832.20
ADVANTECH CO LTD	76,261	345.50	26,348,175.50
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	384.00	48,803,328.00
AUO CORP	1,268,072	17.65	22,381,470.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	166.50	19,763,550.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	34.75	28,000,160.00
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	341.50	103,441,374.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	181.00	26,064,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	106.00	205,454,288.00
INNOLUX CORP	1,390,080	14.35	19,947,648.00
INVENTEC CO LTD	280,511	57.00	15,989,127.00
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,025.00	30,456,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	146.00	51,603,992.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	173.00	17,300,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	231.00	4,851,000.00
PEGATRON CORP	340,474	76.90	26,182,450.60
QUANTA COMPUTER INC	408,270	256.00	104,517,120.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	59.70	12,065,370.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	174.50	36,819,500.00
WISTRON CORP	344,000	120.50	41,452,000.00
WIWYNN CORP	16,000	1,645.00	26,320,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	53.70	13,999,160.40
YAGEO CORPORATION	42,588	461.50	19,654,362.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	95.10	13,116,382.20
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	117.50	68,657,012.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	71.40	15,422,400.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	93.90	23,024,280.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	107.00	55,031,705.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	1,820.00	21,840,000.00
GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,345.00	17,485,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	456.00	19,152,000.00
MEDIATEK INC	241,804	674.00	162,975,896.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	64.60	16,731,400.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	386.00	37,073,370.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	818.00	6,544,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	27.25	15,696,000.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	417.50	25,861,620.00
SILERGY CORP	53,000	290.00	15,370,000.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,828,389	539.00	2,063,501,671.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	43.80	74,503,800.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	70.40	13,235,200.00

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	132.00	4,224,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	25.65	8,951,850.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	33.20	10,294,855.20
	新台湾ドル 小計	54,058,888		4,868,861,852.84 (22,160,137,837)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	352.70	32,995,085.00
	COAL INDIA LTD	181,265	227.45	41,228,724.25
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	261.20	15,521,810.00
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	91.37	54,551,179.32
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	175.20	94,565,601.60
	PETRONET LNG LTD	83,779	219.30	18,372,734.70
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	471,182	2,556.70	1,204,671,019.40
	ACC LTD	14,288	1,932.45	27,610,845.60
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	453.35	33,336,185.55
	ASIAN PAINTS LTD	56,921	3,161.45	179,952,895.45
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	705.05	20,763,017.45
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,790.90	83,891,128.70
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	439.65	78,983,122.50
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	640.75	44,707,690.50
	JSW STEEL LTD	99,332	787.05	78,179,250.60
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,759.80	48,114,160.60
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,477.10	72,232,236.00
	SHREE CEMENT LTD	1,387	23,515.90	32,616,553.30
	SRF LTD	19,164	2,275.75	43,612,473.00
	TATA STEEL LTD	1,137,948	115.75	131,717,481.00
	ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	8,219.05	137,175,944.50
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	578.55	40,296,586.05
	VEDANTA LTD	107,173	233.40	25,014,178.20
	ABB LTD INDIA	5,256	4,276.05	22,474,918.80
	ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	2,577.10	59,278,454.20
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	127.10	64,491,175.50
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	429.65	30,249,937.90
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,284.70	45,820,110.20
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	10,646	3,787.20	40,318,531.20
	LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,639.90	284,026,841.00
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,606.35	39,760,008.75
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	642.95	14,783,349.35
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	835.85	87,414,864.70
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	654.45	17,313,474.75
	INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,453.40	64,894,883.40
	BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,613.75	44,495,005.00
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,380.10	21,018,663.10

BHARAT FORGE LTD	30,322	969.50	29,397,179.00
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,349.35	59,859,583.20
HERO MOTOCORP LTD	13,719	2,927.60	40,163,744.40
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,552.25	233,011,352.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,464.10	201,859,788.90
MRF LTD	432	107,691.30	46,522,641.60
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	94.21	49,105,549.35
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	566.40	33,581,289.60
TATA MOTORS LTD	277,381	615.75	170,797,350.75
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,783.65	58,879,764.80
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,341.55	55,344,303.70
PAGE INDUSTRIES LTD	886	40,283.15	35,690,870.90
TITAN CO LTD	56,531	3,049.15	172,371,498.65
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	381.20	62,706,256.40
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	480.75	21,119,347.50
ZOMATO LTD	842,242	89.38	75,279,589.96
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,188.75	60,133,695.00
TRENT LTD	37,950	1,972.30	74,848,785.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,540.05	101,217,109.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	4,535.65	68,465,636.75
ITC LTD	480,447	441.90	212,309,529.30
MARICO LTD	81,711	550.95	45,018,675.45
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	21,832.55	112,350,302.30
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	842.65	78,567,843.35
UNITED SPIRITS LTD	32,483	994.80	32,314,088.40
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	899.10	72,249,877.80
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,995.20	51,875,200.00
DABUR INDIA LTD	79,726	565.50	45,085,053.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,026.25	65,060,145.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,554.70	330,838,759.40
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	4,841.70	70,504,835.40
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	533.45	64,115,888.95
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	857.95	30,384,299.25
CIPLA LTD	88,546	1,235.30	109,380,873.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,653.40	80,126,368.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,872.10	107,582,744.10
LUPIN LTD	26,552	1,068.15	28,361,518.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,134.10	164,621,419.60
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,979.65	24,191,323.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	711.00	21,425,274.00
AXIS BANK LTD	359,795	942.95	339,268,695.25
BANDHAN BANK LTD	74,811	229.45	17,165,383.95

	BANK OF BARODA	248,313	191.65	47,589,186.45	
	HDFC BANK LTD	461,405	1,591.15	734,164,565.75	
	ICICI BANK LTD	812,223	950.95	772,383,461.85	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,750.45	294,275,151.30	
	STATE BANK OF INDIA	268,868	573.05	154,074,807.40	
	YES BANK LTD	2,352,478	16.89	39,733,353.42	
	BAJAJ FINANCE LTD	44,172	6,861.70	303,095,012.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,459.60	80,278,000.00	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	6,934.55	20,768,977.25	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,016.65	55,724,619.80	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,242.05	15,429,987.15	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	841.80	51,093,051.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,820.60	70,247,851.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	625.50	87,651,315.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,327.15	44,633,381.65	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	537.30	24,348,286.80	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,281.80	93,233,004.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	139,039	1,174.20	163,259,593.80	
	INFOSYS LTD	513,793	1,388.75	713,530,028.75	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,085.60	79,838,834.40	
	MPHASIS LTD	19,317	2,291.10	44,257,178.70	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,367.65	482,183,494.65	
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,008.55	29,288,730.45	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,210.30	114,732,809.10	
	WIPRO LTD	182,000	411.75	74,938,500.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	856.00	307,282,600.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	995.35	42,382,003.00	
	ADANI POWER LTD	85,623	304.65	26,085,046.95	
	GAIL INDIA LTD	504,548	112.55	56,786,877.40	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	429.00	11,464,596.00	
	NTPC LTD	664,141	215.15	142,889,936.15	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	600,735	240.65	144,566,877.75	
	TATA POWER CO LTD	199,512	230.00	45,887,760.00	
	DLF LTD	87,983	473.70	41,677,547.10	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,525.75	19,413,643.00	
	インドルピー 小計	17,904,972		12,558,793,627.30 (22,103,476,784)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.26	974,201.64	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.80	1,784,974.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.90	843,901.42	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	13.01	3,680,776.19	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	6.08	3,230,857.28	

	DUKHAN BANK	319,751	4.28	1,368,534.28	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.39	2,740,013.09	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.15	2,177,509.95	
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	20.22	5,248,404.30	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.18	11,994,266.36	
	OOREDOO QSC	72,800	11.13	810,264.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	18.20	1,756,518.40	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.70	560,223.00	
	カタールリアル 小計	4,842,933		37,170,443.91 (1,484,215,825)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	146.42	5,010,053.14	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	175.31	2,571,797.70	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	663.00	6,624,033.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	306.64	20,680,721.52	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	220.63	31,814,846.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	66.31	6,621,782.91	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	95.56	14,414,939.32	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	391.00	2,100,452.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	123.76	5,949,019.44	
	SASOL LTD	88,115	240.76	21,214,567.40	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	28.82	11,381,709.68	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	266.02	13,381,604.06	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	83.21	3,372,418.09	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	141.10	4,022,761.00	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,221.14	98,537,893.74	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	16.44	7,818,502.32	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	102.96	3,866,559.84	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	75.95	13,391,200.20	
	BID CORP LTD	58,066	404.57	23,491,761.62	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	271.80	9,627,699.60	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	252.71	21,536,957.04	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	188.74	10,603,790.68	
	ABSA GROUP LTD	140,135	175.74	24,627,324.90	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,652.16	24,121,536.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	204.51	12,906,830.61	
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	187.82	38,243,720.58	
	FIRSTRAND LTD	816,636	70.10	57,246,183.60	
REINET INVESTMENTS SCA	17,187	423.51	7,278,866.37		
REMGRO LTD	74,679	154.04	11,503,553.16		
DISCOVERY LIMITED	58,396	146.79	8,571,948.84		
OLD MUTUAL LTD	974,656	12.73	12,407,370.88		
OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	37.93	2,736,004.69		

	SANLAM LTD	307,490	62.59	19,245,799.10	
	MTN GROUP LTD	255,377	128.53	32,823,605.81	
	VODACOM GROUP	79,334	109.92	8,720,393.28	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	63,952	115.85	7,408,839.20	
	南アフリカランド 小計	5,273,289		605,877,047.32	(4,647,076,952)
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.56	1,849,939.76	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	4.09	1,764,614.14	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.87	1,718,365.14	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.75	4,125,012.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.78	2,002,719.18	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.65	2,967,063.60	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	16.90	4,567,394.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.94	10,092,824.86	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	21.30	11,896,816.80	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.12	3,716,254.72	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.78	7,516,769.04	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	5,964,783		52,217,773.74	(2,069,390,373)
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.60	195,325.14	
	BOUBYAN BANK K.S.C	162,047	0.62	100,469.14	
	GULF BANK	144,000	0.26	37,440.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.75	977,493.63	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,101,927	0.93	1,024,792.11	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.51	153,164.28	
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.85	121,260.37	
	クウェートディナール 小計	3,462,996		2,609,944.67	(1,234,712,624)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.28	921,276.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	27.35	2,434,150.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	14.03	897,920.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.62	592,490.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.68	768,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	16.12	1,550,744.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.59	1,804,841.28	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	8.24	655,904.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	15.57	154,143.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	16.84	522,882.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	27.31	764,680.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.92	972,656.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	25.68	756,019.20	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.22	2,298,290.00	

CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	28.42	594,830.60
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	24.88	512,528.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	14.30	1,318,460.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	23.39	486,512.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	58.30	600,490.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	50.00	560,000.00
GEM CO LTD-A	289,800	6.55	1,898,190.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	34.86	865,434.36
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.52	538,692.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.26	1,070,850.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.31	1,922,151.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	62.82	150,768.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	13.46	134,600.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.81	834,410.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.30	258,000.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.61	258,903.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	68.48	694,387.20
LB GROUP CO LTD-A	15,300	17.22	263,466.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	13.66	643,386.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	13.66	1,081,872.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.90	76,050.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	17.99	856,324.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.77	570,256.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	14.55	807,161.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	23.83	172,815.16
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	32.17	577,129.80
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.14	899,924.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	36.80	597,632.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	7.64	837,939.92
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	4.13	567,462.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	11.61	572,373.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	49.04	529,632.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	111.55	107,088.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	22.42	1,118,758.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	77.61	771,443.40
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	59.12	673,968.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	14.14	138,572.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.13	1,037,908.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	91.80	3,699,540.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	28.58	421,612.16
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	47.83	788,477.55
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	49.18	89,507.60

YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	88.80	364,080.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	23.55	880,770.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	48.50	359,385.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	16.13	2,087,222.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	12.08	3,250,728.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	39.55	450,870.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	39.42	611,010.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	26.48	222,432.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	10.71	685,440.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	28.16	1,554,854.40
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.36	1,423,316.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.03	1,847,703.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.85	3,290,040.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	235.87	9,382,908.60
CRRC CORP LTD-A	185,800	6.15	1,142,670.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	17.74	766,368.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	54.30	2,143,383.90
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.01	137,028.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	81.09	194,616.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	10.61	213,377.71
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	151.60	571,532.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	25.03	145,174.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	61.93	390,159.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	33.65	885,668.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	43.82	325,757.88
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	65.63	751,857.28
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	14.31	588,141.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	14.65	704,665.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.83	1,267,347.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	16.52	598,024.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	23.01	1,932,379.80
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	94.82	563,230.80
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	40.50	507,627.00
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	52.07	607,917.25
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	16.18	653,672.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.60	913,920.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	152.20	418,854.40
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.75	659,925.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.52	2,199,884.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	67.92	1,928,452.56
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	9.29	232,807.40
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	107.13	1,071,300.00

SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	14.68	597,476.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	196.50	804,864.00
TBEA CO LTD-A	29,274	15.09	441,744.66
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	12.10	522,720.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.26	1,248,244.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	25.75	813,700.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	52.60	434,476.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	26.50	193,450.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.38	755,876.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.37	510,237.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	43.32	476,520.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.83	228,697.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.37	2,132,427.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.55	182,000.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	9.57	1,756,095.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.28	1,168,440.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	46.07	2,446,317.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	45.12	239,993.28
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.20	230,880.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.98	834,386.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	10.10	220,584.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	80.22	866,376.00
BYD CO LTD -A	17,000	240.29	4,084,930.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	136.51	1,228,590.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.29	576,148.08
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	37.63	696,155.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.45	632,835.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	139.57	1,172,388.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	18.03	528,279.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	67.05	46,935.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.21	605,346.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.78	854,952.12
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	72.00	201,600.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	35.48	1,543,380.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	26.85	745,356.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	41.27	327,353.64
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	97.23	748,671.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.91	2,316,201.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.86	433,092.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	48.00	384,000.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	45.23	1,185,026.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.56	361,608.00

SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.29	411,469.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	24.97	611,765.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.50	455,600.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.15	996,710.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	390.00	1,131,000.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2,800	13.05	36,540.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	29.22	476,286.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	13.55	308,940.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.33	327,795.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	114.09	2,363,944.80
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	7.45	823,225.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	28.30	630,835.30
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	38.00	539,448.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	35.67	381,669.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	265.79	425,264.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	59.40	130,680.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	68.17	1,247,511.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	136.14	408,420.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.60	392,700.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	92.32	729,328.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	5,980	17.93	107,221.40
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	41.35	2,235,256.95
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	20.24	554,576.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	46.74	794,580.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	25.28	1,986,502.40
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	26.95	924,438.90
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	58.80	1,017,240.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	134.05	1,219,855.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	95.04	532,224.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	32.78	376,970.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	35.35	247,450.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,802.59	20,729,785.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	229.70	4,226,480.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	41.01	1,376,213.58
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.57	310,076.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	33.55	1,684,210.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	225.76	2,117,628.80
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	67.50	769,500.00
TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	9.83	1,450,908.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	17.10	652,536.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	163.53	6,786,495.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	35.64	359,964.00

YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.55	82,415.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	19.34	574,398.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	18.08	1,658,821.92
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.19	499,040.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	63.09	179,049.42
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	37.63	365,763.60
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	22.04	272,194.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	15,496	9.58	148,451.68
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	18.79	278,092.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.57	163,198.80
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	27.00	194,643.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,900	271.80	2,147,220.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	106.10	212,200.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	123.50	34,580.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	83,180	24.18	2,011,292.40
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	56.28	1,598,352.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	60.77	637,294.99
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	45.10	726,110.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	54.03	297,165.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	97.35	882,672.45
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	137.82	303,204.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	48.18	491,436.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	44.79	665,131.50
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	51.67	1,146,712.31
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	63.01	504,080.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	21.81	411,118.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	430.72	895,897.60
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	39.95	1,562,124.90
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	15,562	25.38	394,963.56
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	12.99	359,589.18
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	39.25	748,811.50
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.07	453,187.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	28.21	306,924.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	27.84	194,880.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	22.89	216,081.60
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	26.65	299,332.80
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	25.53	434,010.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	77.77	1,280,405.28
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	52.68	523,639.20
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	282.90	1,103,310.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.63	159,022.60
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	26.15	1,738,975.00

ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	16.06	559,658.88
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	33.40	323,980.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.49	3,602,029.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.52	262,160.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	13.86	2,181,564.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.57	2,851,283.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	11.63	1,310,701.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.12	1,635,748.80
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	8.46	1,247,850.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	27.35	1,594,505.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.08	276,640.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	5.96	744,404.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.06	2,556,018.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	31.88	5,929,680.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.97	1,086,192.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.65	1,063,127.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.58	666,252.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.61	2,667,346.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	15.94	3,275,670.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.56	1,380,264.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.89	691,935.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.07	3,091,711.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.84	470,400.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	11.90	944,860.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	8.59	492,464.70
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.49	129,151.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.99	419,833.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.93	427,893.80
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	23.97	3,381,687.60
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	26.91	648,531.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	16.07	1,887,051.89
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	17.67	63,612.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	6.33	381,066.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	15.85	960,510.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	7.20	1,236,088.80
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.92	2,232,992.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	15.30	1,106,190.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.42	1,128,211.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	173.98	939,492.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	17.24	543,060.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.96	795,319.20
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	10.63	431,322.88

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.82	998,704.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	8.90	2,737,640.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.53	516,420.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.83	473,271.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	7.87	2,477,476.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	28.52	2,857,704.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	47.52	4,980,096.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	10.88	292,672.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	27.88	114,308.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	368.41	1,776,841.43
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	13.34	458,869.32
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	50.39	1,625,883.74
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	6.58	366,506.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	37.23	616,603.26
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	56.68	612,144.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	10.80	358,560.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	109.18	327,540.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	49.00	467,019.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	80.42	442,310.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	17.10	225,207.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	21.38	810,302.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.86	442,356.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	25.24	507,324.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	31.46	880,880.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	11.27	392,196.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	89.46	814,086.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	20.10	906,510.00
GOERTEK INC -A	26,900	16.01	430,669.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.81	290,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	54.63	382,410.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	40.91	806,417.92
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.36	190,848.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	31.01	1,440,414.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	115.55	199,670.40
NINESTAR CORP-A	18,543	30.50	565,561.50
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	14.45	351,135.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	71.40	339,864.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	124.88	803,602.80
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	18.83	536,655.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	8.70	408,900.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	25.24	462,901.60
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	43.24	181,608.00

WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.61	408,733.10
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	124.94	587,218.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	34.74	547,155.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	19.62	594,486.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	115.51	1,004,937.00
ZTE CORP-A	76,400	34.61	2,644,204.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	5.06	2,139,368.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.23	1,256,574.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.14	1,240,282.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.06	3,968,152.80
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.51	1,029,156.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.56	1,123,892.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	13.04	2,306,776.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	15.03	1,387,269.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	134.50	954,546.50
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	84.84	860,107.92
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	151.40	1,729,290.80
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	54.42	1,144,561.44
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	93.77	588,125.44
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	30.40	643,507.20
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	25.58	191,850.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	73.80	553,500.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	28.11	961,418.22
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	30.40	905,920.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	10.71	246,180.06
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	27.91	2,800,489.40
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	48.62	1,023,694.10
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	257.00	796,700.00
SG MICRO CORP-A	4,095	74.28	304,176.60
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	88.70	700,730.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	199.00	557,200.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	26.09	962,068.75
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.88	290,820.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	18.87	423,933.42
TONGWEI CO LTD-A	31,600	32.45	1,025,420.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	34.88	886,579.84
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	87.43	599,682.37
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	88.23	643,196.70
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	35.00	497,000.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	55.97	952,721.34
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.90	760,330.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	14.31	768,447.00

	GEMDALE CORP-A	45,500	7.81	355,355.00
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	4.06	2,122,568.00
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	14.16	1,158,288.00
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	14.58	186,624.00
	オフショア人民元 小計	25,698,238		360,165,656.68 (7,160,309,354)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	10.64	478,150.96
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	35.00	14,569,590.00
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	42.30	498,082.50
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	13.20	421,449.60
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	137.20	5,133,063.60
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	36.90	1,743,192.90
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	41.30	8,707,857.20
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	142.60	1,333,167.40
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	88.00	12,666,192.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	25.15	2,145,873.45
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	12.48	1,290,818.88
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	43.70	2,232,152.30
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	176.60	742,956.20
	JARIR MARKETING CO	125,000	15.10	1,887,500.00
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	154.60	994,232.60
	ALMARAI CO	30,130	66.80	2,012,684.00
	SAVOLA	36,289	37.00	1,342,693.00
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	151.80	1,037,249.40
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	261.80	3,067,510.60
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	113.60	1,808,966.40
	AL RAJHI BANK	291,473	73.10	21,306,676.30
	ALINMA BANK	161,322	36.05	5,815,658.10
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	26.25	2,258,313.75
	BANK AL-JAZIRA	97,894	17.96	1,758,176.24
	BANK ALBILAD	89,702	41.95	3,762,998.90
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	38.70	3,670,114.50
	RIYAD BANK	234,479	30.50	7,151,609.50
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	36.00	5,324,220.00
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	16.74	1,182,513.60
	THE SAUDI NATIONAL BANK	437,009	35.90	15,688,623.10
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	183.60	2,011,705.20
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	209.80	2,983,985.40
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	327.00	1,444,359.00	
ELM CO	2,436	706.00	1,719,816.00	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	45.20	2,207,748.80	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	12.92	1,169,363.36	

	SAUDI TELECOM CO	301,319	40.75	12,278,749.25	
	ACWA POWER CO	16,922	188.80	3,194,873.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	21.10	3,420,499.90	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	18.48	1,866,313.68	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.00	415,683.00	
	サウジアラビアリアル 小計	3,940,254		164,745,384.17 (6,395,415,813)	
	合計	1,302,500,520		147,082,911,124 (147,082,911,124)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	14,393,702.40	
		メキシコペソ 小計	97,360	14,393,702.40 (122,854,568)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,149,210.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,213,596.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,793,330.00	
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,248,000.00	
ブラジルリアル 小計	383,600	11,404,136.00 (333,349,737)			
投資信託受益証券合計			480,960	456,204,305 (456,204,305)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	9,964,848.00	
		メキシコペソ 小計	391,700	9,964,848.00 (85,052,967)	
	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 (42,961,020)	
投資証券合計			870,433	128,013,987 (128,013,987)	
合計				584,218,292 (584,218,292)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	------------------------	----------------	----------------

アメリカドル	株式	34銘柄	100.0%			2.5%
メキシコペソ	株式	21銘柄	95.1%			2.7%
	投資信託受 益証券	1銘柄		2.9%		0.1%
	投資証券	1銘柄			2.0%	0.1%
ブラジルレアル	株式	43銘柄	95.8%			5.2%
	投資信託受 益証券	4銘柄		4.2%		0.2%
チリペソ	株式	12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式	3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式	10銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式	18銘柄	100.0%			0.7%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式	14銘柄	100.0%			0.8%
ロシアルーブル	株式	14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式	194銘柄	100.0%			22.5%
マレーシアリングギット	株式	33銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%			2.0%
フィリピンペソ	株式	14銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式	101銘柄	100.0%			12.1%
新台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%			15.0%
インドルピー	株式	114銘柄	100.0%			15.0%
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%			4.8%
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 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,248,722,699
コール・ローン	1,236,879,394
国債証券	110,175,922,257
未収利息	1,555,071,137
前払費用	187,213,737
流動資産合計	114,403,809,224
資産合計	114,403,809,224
負債の部	
流動負債	
未払解約金	488,174,689
未払利息	2,920
流動負債合計	488,177,609
負債合計	488,177,609
純資産の部	
元本等	
元本	54,157,444,415
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,758,187,200
元本等合計	113,915,631,615
純資産合計	113,915,631,615
負債純資産合計	114,403,809,224

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取場の仲値によって計算しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	54,157,444,415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 2.1034円 (1万口当たり純資産額) (21,034円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年 8月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2023年 8月21日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	47,678,167,518円
期中追加設定元本額	12,656,425,232円
期中一部解約元本額	6,177,148,335円
期末元本額	54,157,444,415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	4,635,971,693円
世界経済インデックスファンド	18,420,751,902円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,766,938,865円
DC 世界経済インデックスファンド	14,014,152,421円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	9,320,334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)	690,190,396円
DC 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,471,944,085円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	248,830,277円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	107,772,474円
SMT インデックスバランス・オープン	186,297,018円
SMT 世界経済インデックス・オープン	451,048,138円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	591,152,069円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	936,874,822円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,458,338円

区分	2023年 8月21日現在
グローバル経済コア	801,353,086円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	94,732,020円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	78,318,057円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	30,780,371円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	30,667,053円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	105,732,114円
10資産分散投資ファンド	42,833,626円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	247,088,406円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	157,327,920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）	10,090,654円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	235,564,617円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	227,691,967円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	226,537,396円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	229,306,395円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	227,038,587円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	146,802,093円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,760,790,392
合計		3,760,790,392

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	31,800,000.00	33,552,657.00	
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,623,343.72	
		MBONO 5.5% 03/04/27	109,000,000.00	95,250,740.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	159,169,907.23	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	53,185,200.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	47,000,000.00	41,693,935.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	129,649,470.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	161,057,538.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	72,329,887.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	25,176,757.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	105,600,000.00	101,829,024.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	91,391,967.50	
		MBONO 8% 07/31/53	62,500,000.00	54,525,312.50	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,548,598.34	

	MBONO 8% 11/07/47	96,000,000.00	84,268,800.00	
メキシコペソ 小計		1,425,350,000.00	1,313,253,137.79 (11,209,009,506)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	60,772,960.17	
	BLTN 0% 07/01/24	37,250,000.00	34,014,843.45	
	BLTN 0% 07/01/25	46,400,000.00	38,715,401.35	
	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00	58,999,202.34	
	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000.00	54,862,233.74	
	BNTNF 10% 01/01/27	50,400,000.00	49,821,952.97	
	BNTNF 10% 01/01/29	49,700,000.00	48,064,025.74	
	BNTNF 10% 01/01/31	19,850,000.00	18,893,320.76	
	BNTNF 10% 01/01/33	18,400,000.00	17,229,115.31	
	BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,404,340.00	
ブラジルレアル 小計		433,200,000.00	382,777,395.83 (11,188,812,946)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	533,126,284.37	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,832,170,044.72	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,960,000,000.00	1,912,609,616.68	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	1,610,000,000.00	1,515,771,993.68	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,089,581,851.50	
	BTPCL 5% 10/01/28	820,000,000.00	792,261,831.30	
	BTPCL 6% 01/01/43	1,800,000,000.00	1,908,659,588.40	
	BTPCL 6% 04/01/33	1,500,000,000.00	1,542,921,141.00	
	BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	543,903,870.02	
チリペソ 小計		14,000,000,000.00	13,671,006,221.67 (2,285,737,556)	
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	62,916,550,000.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	18,000,000,000.00	16,738,289,280.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	45,100,000,000.00	34,741,961,023.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	34,900,000,000.00	23,497,251,781.00	
コロンビアペソ 小計		163,300,000,000.00	137,894,052,084.00 (4,861,592,700)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	4,130,969.33	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	7,250,000.00	6,396,982.61	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,669,724.86	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,800,000.00	8,670,994.99	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,947,187.00	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	5,150,000.00	5,218,671.85	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	9,550,000.00	9,427,849.96	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,250,000.00	11,442,019.83	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,400,000.00	9,663,975.21	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,550,000.00	2,699,874.92	

ペルーソル 小計		70,900,000.00	69,268,250.56 (2,711,630,351)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,627,594.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,596,483.58	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	25,000,000.00	25,867,500.00	
ウルグアイペソ 小計		67,000,000.00	66,091,577.58 (254,155,161)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	39,703,379.84	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	41,000,000.00	42,004,500.00	
ドミニカペソ 小計		73,000,000.00	81,707,879.84 (209,172,172)	
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,903,990.50	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	59,421,348.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	54,992,535.00	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	22,338,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	77,822,682.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	55,048,500.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	22,659,100.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	41,612,000.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	20,500,000.00	15,359,625.00	
	CZGB 1% 06/26/26	53,800,000.00	48,382,340.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	71,786,764.20	
	CZGB 2.5% 08/25/28	78,700,000.00	71,521,773.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	73,237,290.00	
	CZGB 2% 10/13/33	74,500,000.00	60,015,114.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	20,172,900.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,677,347.50	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	49,637,500.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	72,467,250.00	
	CZGB 5.7% 05/25/24	36,700,000.00	36,632,472.00	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	82,560,000.00	
CZGB 6% 02/26/26	63,000,000.00	65,173,500.00		
チェココルナ 小計		1,167,300,000.00	1,054,422,031.20 (6,938,202,407)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	512,270,550.00	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	423,150,500.00	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	712,797,750.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	470,632,000.00	
	HGB 2.25% 06/22/34	221,000,000.00	139,163,700.00	
	HGB 2.5% 10/24/24	578,000,000.00	535,285,800.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	485,500,000.00	409,045,110.70	
	HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	304,526,950.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	617,282,400.00	

	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	208,965,750.00	
	HGB 3% 06/26/24	292,500,000.00	277,768,237.50	
	HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	476,394,375.00	
	HGB 3% 10/27/27	822,000,000.00	686,657,700.00	
	HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	226,271,000.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	263,000,000.00	231,592,014.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	570,000,000.00	467,186,215.80	
	HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	621,875,166.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	731,650,887.50	
ハンガリーフォリント 小計		9,911,500,000.00	8,052,516,106.50 (3,334,305,344)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,778,372.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	13,253,240.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	14,118,182.10	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	16,740,115.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,237,025.20	
	POLGB 2.5% 04/25/24	22,000,000.00	21,569,394.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	19,660,560.30	
	POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	15,820,640.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,730,005.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	22,483,114.20	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,171,795.00	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	19,930,975.60	
	POLGB 6% 10/25/33	9,600,000.00	9,878,880.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	10,600,000.00	11,497,419.32	
ポーランドズロチ 小計		265,500,000.00	239,869,718.22 (8,505,012,624)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,578,150.86	
	ROMGB 3.25% 04/29/24	7,300,000.00	7,161,665.00	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	5,994,329.70	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	4,000,000.00	3,782,380.04	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	9,967,360.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,192,523.44	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,724,581.60	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,211,295.44	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,359,634.00	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	5,300,000.00	4,113,828.20	
	ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,170,144.21	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,422,410.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	5,997,054.87	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,523,750.00	
ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,162,040.18		

	ROMGB 5.8% 07/26/27	6,500,000.00	6,341,725.00	
	ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,578,523.10	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,741,304.84	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	5,400,000.00	5,812,133.40	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	5,500,000.00	6,002,245.70	
	ROMGB 8.75% 10/30/28	4,500,000.00	4,912,980.75	
	ROMGB 8% 04/29/30	2,300,000.00	2,445,283.41	
	ルーマニアレイ 小計	139,200,000.00	131,195,343.74 (4,194,734,964)	
マレーシア リングgit	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000.00	31,497,646.09	
	MGS 3.478% 06/14/24	8,650,000.00	8,670,900.13	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,561,735.52	
	MGS 3.582% 07/15/32	13,500,000.00	13,182,676.42	
	MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	19,039,584.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	26,153,649.73	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,077,922.58	
	MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,321,837.12	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,424,282.69	
	MGS 3.899% 11/16/27	15,500,000.00	15,688,523.40	
	MGS 3.9% 11/30/26	17,450,000.00	17,639,756.53	
	MGS 3.906% 07/15/26	15,600,000.00	15,776,983.56	
	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	28,964,040.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	15,450,000.00	15,542,584.12	
	MGS 4.065% 06/15/50	16,750,000.00	16,091,227.86	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,156,267.12	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,440,662.22	
	MGS 4.504% 04/30/29	14,600,000.00	15,152,033.30	
	MGS 4.696% 10/15/42	8,800,000.00	9,405,939.84	
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,520,173.99	
MGS 4.893% 06/08/38	12,900,000.00	14,115,939.81		
MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,584,424.94		
	マレーシアリングgit 小計	363,150,000.00	364,008,791.57 (11,378,150,406)	
タイパーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,341,603.42	
	THAIGB 0.75% 09/17/24	70,000,000.00	68,950,746.20	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	138,868,154.46	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	164,000,000.00	162,360,783.92	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,379,654.21	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,416,960.49	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	104,100,000.00	98,622,561.97	
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	154,722,119.98	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	201,575,417.66	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,115,957.20	

	THAIGB 2.65% 06/17/28	70,000,000.00	70,567,889.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	95,185,657.31	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	102,869,994.80	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	66,779,370.36	
	THAIGB 2% 12/17/31	113,000,000.00	107,788,169.93	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	155,489,344.60	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	71,000,000.00	74,919,555.00	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	46,000,000.00	48,547,217.80	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	166,265,048.04	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	52,000,000.00	54,049,507.20	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	116,500,000.00	124,679,395.10	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	196,712,892.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	109,054,871.48	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	134,888,026.95	
	タイパーツ 小計	2,676,800,000.00	2,686,150,899.08 (11,066,941,704)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,510,875.20	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	29,510,875.20 (76,315,123)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,997,980,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,213,250,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	61,091,730,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	59,000,000,000.00	58,265,450,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	16,002,720,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,808,900,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	62,097,960,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,897,146,601.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	43,500,000,000.00	43,917,600,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	75,386,750,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	50,399,500,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	20,246,000,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	16,000,000,000.00	16,728,880,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	38,800,000,000.00	40,229,101,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	13,500,000,000.00	14,119,717,500.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	41,000,000,000.00	44,165,200,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	21,226,750,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	58,700,000,000.00	63,161,200,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,689,840,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	61,000,000,000.00	63,298,785,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,748,736,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	55,000,000,000.00	56,661,000,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,510,424,000.00	

	INDOGB 8.25% 05/15/29	46,200,000,000.00	50,413,440,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	38,330,380,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	15,016,040,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/24	35,600,000,000.00	36,105,520,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	49,784,490,800.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	28,117,980,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	42,628,706,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	27,022,740,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,587,660,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	32,193,714,140.00	
	インドネシアルピア 小計	1,146,200,000,000.00	1,198,065,291,041.00	(11,381,620,264)
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	198,400,000.00	205,934,240.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	45,540,150.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	58,100,000.00	33,918,780.00	
	SAGB 7% 02/28/31	83,700,000.00	67,001,850.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000.00	138,523,500.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	129,700,000.00	97,845,680.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	80,612,000.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	130,278,900.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	122,536,500.00	
	SAGB 8% 01/31/30	190,600,000.00	168,990,725.00	
	SAGB 9% 01/31/40	118,300,000.00	89,529,440.00	
	南アフリカランド 小計	1,461,200,000.00	1,180,711,765.00	(9,056,059,237)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,584,030.74	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,217,581.74	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,007,586.70	
	CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	21,087,872.40	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,102,112.00	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,434,209.54	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,036,482.40	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,867,776.43	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	18,058,009.22	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	5,026,270.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,000,000.00	10,109,619.00	
	CGB 2.67% 05/25/33	2,000,000.00	2,019,805.40	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,655,637.10	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,153,702.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,074,103.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,836,380.09	
CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,051,620.09		
CGB 2.76% 05/15/32	4,500,000.00	4,555,219.05		

	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,178,038.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,208,664.40	
	CGB 2.8% 03/25/30	9,000,000.00	9,143,262.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,046,743.74	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,774,926.80	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,756,424.56	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,613,598.08	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,214,314.40	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,145,139.40	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,264,904.80	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,093,575.66	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,794,844.60	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,450,674.92	
	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,957,341.30	
	CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	4,768,023.74	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,637,054.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,623,822.01	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,322,144.16	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,182,428.88	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,707,429.80	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,759,339.83	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,198,392.80	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,104,911.95	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,873,592.62	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,275,686.40	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,830,826.72	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,804,255.30	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	19,075,826.55	
	オフショア人民元 小計	564,200,000.00	579,684,204.32 (11,524,469,792)	
	合計		110,175,922,257 (110,175,922,257)	

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%	10.2%
ブラジルリアル	国債証券 10銘柄	100.0%	10.2%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券 4銘柄	100.0%	4.4%

ペルーソル	国債証券	10銘柄	100.0%	2.5%
ウルグアイペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券	21銘柄	100.0%	6.3%
ハンガリーフォリント	国債証券	18銘柄	100.0%	3.0%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	7.7%
ルーマニアレイ	国債証券	22銘柄	100.0%	3.8%
マレーシアリンギット	国債証券	22銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券	24銘柄	100.0%	10.0%
フィリピンペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアアルピア	国債証券	33銘柄	100.0%	10.3%
南アフリカランド	国債証券	11銘柄	100.0%	8.2%
オフショア人民元	国債証券	46銘柄	100.0%	10.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,998,081,568
投資証券	136,026,951,800
未収入金	157,842,263
未収配当金	1,013,730,176
前払金	17,440,800
差入委託証拠金	220,848,000
流動資産合計	140,434,894,607
資産合計	140,434,894,607
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,440,800
未払金	534,748,149
未払解約金	3,530,485
未払利息	7,079
流動負債合計	555,726,513
負債合計	555,726,513
純資産の部	
元本等	
元本	66,568,277,606
剰余金	
剰余金又は欠損金()	73,310,890,488
元本等合計	139,879,168,094
純資産合計	139,879,168,094
負債純資産合計	140,434,894,607

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,568,277,606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 8月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</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 8月21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</p> <p>売買目的有価証券</p> <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)デリバティブ取引</p> <p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

2023年 8月21日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	54,578,193,107円
期中追加設定元本額	17,341,698,308円
期中一部解約元本額	5,351,613,809円
期末元本額	66,568,277,606円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,926,074,189円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,232,029円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	17,033,725,510円
J リートインデックス・オープン（SMA専用）	35,910,119,692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）	2,252,990,018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	1,874,236,312円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,065,600,194円
S M T インデックスバランス・オープン	24,396,519円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	256,354,957円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	10,874,791円
グローバル経済コア	272,948,309円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,806,115円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	672,228,737円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	155,626,702円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	434,807,338円
10 資産分散投資ファンド	23,177,769円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	500,851,483円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,138,352円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	504,418,156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）	100,144,431円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	518,940,668円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2018 - 11（適格機関投資家専用）	250,777,286円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	285,973,461円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	6,095,980,763	
合計	6,095,980,763	

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

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2023年 8月21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	3,802,816,800	-	3,785,376,000	17,440,800
合計		3,802,816,800	-	3,785,376,000	17,440,800

(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	2,640	299,112,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	4,160	383,968,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	6,479	820,889,300	
	東海道リート投資法人	1,932	228,942,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,484	2,905,632,000	
	森ヒルズリート投資法人	15,270	2,192,772,000	
	産業ファンド投資法人	19,813	2,789,670,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	12,335	4,181,565,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,533	2,095,353,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,812	2,717,988,000	
	G L P 投資法人	43,864	6,013,754,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	6,386	2,097,801,000	
	日本プロロジスリート投資法人	22,621	6,342,928,400	
	星野リゾート・リート投資法人	2,396	1,528,648,000	
	O n e リート投資法人	2,265	572,365,500	
	イオンリート投資法人	15,929	2,317,669,500	
	ヒューリックリート投資法人	12,149	1,983,931,700	
	日本リート投資法人	4,218	1,421,466,000	
	積水ハウス・リート投資法人	39,021	3,203,624,100	
	トーセイ・リート投資法人	2,734	365,535,800	
ケネディクス商業リート投資法人	5,645	1,581,164,500		
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,202	462,368,800		

サムティ・レジデンシャル投資法人	3,538	394,840,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	41,993	7,113,614,200	
いちごホテルリート投資法人	2,151	243,708,300	
ラサルロジポート投資法人	16,599	2,453,332,200	
スターアジア不動産投資法人	20,013	1,088,707,200	
マリモ地方創生リート投資法人	2,001	248,324,100	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	5,401	2,551,972,500	
大江戸温泉リート投資法人	1,986	128,494,200	
投資法人みらい	16,606	775,500,200	
三菱地所物流リート投資法人	4,484	1,746,518,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,590	917,878,000	
ザイマックス・リート投資法人	2,106	245,349,000	
タカラレーベン不動産投資法人	6,157	583,683,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,690	734,010,000	
日本ビルファンド投資法人	15,149	8,847,016,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	13,339	7,656,586,000	
日本都市ファンド投資法人	62,243	5,994,000,900	
オリックス不動産投資法人	25,874	4,665,082,200	
日本プライムリアルティ投資法人	8,881	3,161,636,000	
N T T 都市開発リート投資法人	12,483	1,686,453,300	
東急リアル・エステート投資法人	8,706	1,574,044,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	9,589	1,097,940,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	29,048	4,406,581,600	
森トラストリート投資法人	25,030	1,807,166,000	
インヴィンシブル投資法人	62,871	3,753,398,700	
フロンティア不動産投資法人	4,818	2,228,325,000	
平和不動産リート投資法人	9,702	1,351,488,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,318	2,462,128,000	
福岡リート投資法人	6,716	1,094,708,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	7,556	2,519,926,000	
いちごオフィスリート投資法人	10,640	941,640,000	
大和証券オフィス投資法人	2,690	1,751,190,000	
阪急阪神リート投資法人	6,191	861,787,200	
スタートプロシード投資法人	2,251	474,961,000	
大和ハウスリート投資法人	19,574	5,418,083,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	41,876	3,128,137,200	
大和証券リビング投資法人	18,016	1,972,752,000	
ジャパンエクセレント投資法人	11,285	1,438,837,500	
合計	801,049	136,026,951,800	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 8月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	266,315,447
コール・ローン	294,243,821
投資証券	90,751,479,048
派生商品評価勘定	1,260
未収入金	10,311,917
未収配当金	203,112,526
流動資産合計	91,525,464,019
資産合計	91,525,464,019
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	466,466
未払解約金	62,018,334
未払利息	694
流動負債合計	62,485,494
負債合計	62,485,494
純資産の部	
元本等	
元本	36,111,716,588
剰余金	
剰余金又は欠損金()	55,351,261,937
元本等合計	91,462,978,525
純資産合計	91,462,978,525
負債純資産合計	91,525,464,019

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月21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

	2023年 8月21日現在
	<p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		36,111,716,588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)	2.5328円 (25,328円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	41,017,034,631円
期中追加設定元本額	6,023,744,898円
期中一部解約元本額	10,929,062,941円
期末元本額	36,111,716,588円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	55,859,963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）	1,580,896,582円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,230,928円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,208,748,907円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	14,077,855,954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	1,109,821,859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	113,394,514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	9,460,262円
グローバル経済コア	231,250,610円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	13,976,742円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	351,309,947円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,610,538円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	142,796,038円
10資産分散投資ファンド	12,825,323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）	1,362,487,583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）	174,138,872円
FOfs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,789,731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）	36,084,610円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	94,617,784円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,985,353円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,513,618円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	92,104,212円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	91,193,091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）	72,210,338円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	59,950,939円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		21,136,514
合計		21,136,514

(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 8月21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		
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	267,823,400	-	267,358,194	465,206
	アメリカドル	267,823,400	-	267,358,194	465,206
合計		267,823,400	-	267,358,194	465,206

(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	713,997.05	
		AGREE REALTY CORP	47,425	2,910,472.25	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	36,043	646,971.85	
		ALEXANDER'S INC	886	162,102.56	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	79,087	9,102,913.70	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	96,501.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,042	606,977.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	160,402	5,630,110.20	
		AMERICOLD REALTY TRUST	138,421	4,430,856.21	
		APARTMENT INCOME REIT CO	73,779	2,441,347.11	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	69,944	553,257.04	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	104,891	1,542,946.61	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	363,458.34	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	48,450.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	71,997	12,909,782.07	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	26,448.00	
		BOSTON PROPERTIES	72,655	4,599,061.50	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	69,741.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	376,034.71	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	148,786	3,210,801.88	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	95,237	1,526,649.11	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	91,800.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	54,497	5,787,036.43	
		CARETRUST REIT INC	52,232	1,032,626.64	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	252,118.78	
		CENTERSPACE	7,349	444,467.52	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	236,192.88	

CITY OFFICE REIT INC	15,298	73,889.34
CLIPPER REALTY INC	7,300	44,530.00
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	354,263.00
CORPORATE OFFICE PPTYS	59,276	1,484,271.04
COUSINS PROPERTIES INC	74,825	1,638,667.50
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	138,852.00
CUBESMART	114,379	4,726,140.28
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	112,866	887,126.76
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	94,764.00
DIGITAL REALTY TRUST INC	146,417	17,766,238.78
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	344,560.00
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	82,382	1,066,846.90
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	49,311	666,684.72
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,674	3,995,385.54
ELME COMMUNITIES	47,407	727,697.45
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	62,623	520,397.13
EPR PROPERTIES	38,177	1,663,371.89
EQUINIX INC	47,061	35,284,925.97
EQUITY COMMONWEALTH	57,330	1,077,230.70
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	88,540	5,914,472.00
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	171,092	10,924,224.20
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	74,641	1,753,317.09
ESSEX PROPERTY TRUST	32,393	7,654,789.83
EXTRA SPACE STORAGE INC	107,050	13,580,363.00
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	248,390.37
FEDERAL REALTY INVS TRUST	36,331	3,503,035.02
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	66,879	3,391,434.09
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,562	1,057,240.08
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	83,211.13
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,802	6,100,923.88
GETTY REALTY CORP	22,990	694,987.70
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	262,756.00
GLADSTONE LAND CORP	15,061	233,746.72
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26,431	243,958.13
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	524,707.96
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	190,423	3,208,627.55
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	276,817	5,561,253.53
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,211	124,487.28
HIGHWOODS PROPERTIES INC	53,689	1,203,707.38
HOST HOTELS AND RESORTS INC	359,759	5,795,717.49
	61,023	356,984.55

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC			
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	111,096	1,783,090.80	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	130,342.38	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	14,642	1,116,745.34	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	32,229	750,613.41	
INVITATION HOMES INC	291,851	9,765,334.46	
IRON MOUNTAIN INC	146,534	8,661,624.74	
JBG SMITH PROPERTIES	46,081	654,350.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	92,529.00	
KILROY REALTY CORPORATION	52,622	1,823,352.30	
KIMCO REALTY CORP	313,435	5,983,474.15	
KITE REALTY GROUP TRUST	108,393	2,388,981.72	
LTC PROPERTIES INC	22,125	704,681.25	
LXP INDUSTRIAL TRUST	144,466	1,366,648.36	
MACERICH CO/THE	112,250	1,305,467.50	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	65,977.95	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	295,942	2,050,878.06	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	58,819	8,456,995.82	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	43,098	1,398,530.10	
NATL HEALTH INVESTORS INC	23,139	1,158,338.34	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	442,232.86	
NETSTREIT CORP	27,610	474,892.00	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490	166,362.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	401,875.14	
NNN REIT INC	93,618	3,623,016.60	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	158,042.82	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	116,063	3,529,475.83	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	167,766.49	
ORION OFFICE REIT INC	34,844	208,018.68	
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	379,237.92	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	109,726	1,411,076.36	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,648	914,660.80	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	57,873	1,981,571.52	
PHYSICIANS REALTY TRUST	119,855	1,634,822.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	379,678.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,962	392,649.32	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	100,030.00	
PRIME US REIT	295,000	46,610.00	
PROLOGIS INC	466,292	56,640,489.24	
PUBLIC STORAGE	79,728	21,800,824.32	
REALTY INCOME CORP	339,235	19,302,471.50	

REGENCY CENTERS CORP	82,452	5,055,132.12
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	66,925	898,133.50
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	102,676	5,260,091.48
RLJ LODGING TRUST	76,182	737,441.76
RPT REALTY	39,523	383,373.10
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,109	2,534,274.53
SABRA HEALTH CARE REIT INC	117,928	1,413,956.72
SAFEHOLD INC	21,624	432,480.00
SAUL CENTERS INC	6,846	252,138.18
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,293	739,346.04
SIMON PROPERTY GROUP	165,491	19,130,759.60
SITE CENTERS CORP	96,944	1,267,058.08
SL GREEN REALTY CORP	31,274	1,008,899.24
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	71,857	2,719,787.45
STAG INDUSTRIAL INC	88,787	3,115,535.83
STAR HOLDINGS	6,183	81,739.26
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	297,691.40
SUN COMMUNITIES INC	62,748	7,589,998.08
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,395	887,491.80
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,858	1,316,573.06
TERRENO REALTY CORP	37,611	2,176,924.68
UDR INC	157,031	6,031,560.71
UMH PROPERTIES INC	25,129	378,191.45
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,281	291,626.83
URBAN EDGE PROPERTIES	57,394	906,825.20
VENTAS INC	201,590	8,458,716.40
VERIS RESIDENTIAL INC	43,050	782,218.50
VICI PROPERTIES INC	508,755	15,303,350.40
VORNADO REALTY TRUST	80,077	1,689,624.70
WELLTOWER INC	250,438	20,335,565.60
WHITESTONE REIT	23,074	224,740.76
WP CAREY INC	108,417	6,931,098.81
XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,932	620,182.28
アメリカドル 小計	12,997,610	487,857,587.87 (70,900,343,245)
カナダドル		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	611,684.19
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	208,973.70
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	136,800.00
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,093	752,105.40
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	161,975.00
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	65,000.00

CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	40,850	1,995,114.00	
CHOICE PROPERTIES REIT	82,975	1,095,270.00	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	344,969.46	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	404,580.70	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	66,102	897,004.14	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,339	68,072.25	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	60,945.00	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,125	694,627.50	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,255,652.80	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	642,527.99	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	29,406.00	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	420,685.50	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,096	523,728.00	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	151,515.00	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	110,878.64	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	126,838.80	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	378,546.96	
PRIMARIS REIT	22,050	294,367.50	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	83,040.00	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	78,439	1,504,460.02	
SLATE GROCERY REIT	8,419	107,258.06	
SLATE OFFICE REI	17,000	27,710.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,154	857,406.06	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	64,758.00	
カナダドル 小計	881,567	14,075,900.67 (1,510,766,418)	
ユーロ			
AEDIFICA	23,987	1,372,056.40	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	35,568.00	
ALTAREA	1,959	163,380.60	
CARE PROPERTY INVEST	17,887	221,798.80	
CARMILA	26,392	377,933.44	
COFINIMMO	15,898	1,069,140.50	
COVIVIO(FP)	23,027	916,474.60	
CROMWELL REIT EUR	170,400	260,712.00	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,490	449,550.60	
GECINA SA	28,030	2,603,987.00	
HAMBORNER REIT AG	37,000	242,350.00	
ICADE	17,300	555,676.00	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	78,054.90	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,184	808,045.60	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	163,592.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	194,040.00	
	KLEPIERRE	100,775	2,379,297.75	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	195,500.00	
	MERCIALYS	36,384	289,070.88	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	166,888	1,321,752.96	
	MONTEA NV	6,890	482,989.00	
	NSI NV	7,359	136,288.68	
	RETAIL ESTATES	5,335	296,626.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	54,250	2,560,600.00	
	VASTNED RETAIL	10,650	204,267.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	78,709	1,931,518.86	
	WERELDHAVE NV	22,376	349,960.64	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	12,191	317,575.55	
	ユーロ 小計	1,334,451	19,977,807.76 (3,158,890,963)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	123,848	56,103.14	
	AEW UK REIT PLC	68,000	64,736.00	
	ASSURA PLC	1,556,822	685,313.04	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	248,608.80	
	BIG YELLOW GROUP PLC	87,773	908,450.55	
	BRITISH LAND CO PLC	468,934	1,456,509.00	
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	95,150.08	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	186,717.97	
	DERWENT LONDON PLC	56,125	1,053,466.25	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	75,900.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	261,630.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	121,885	477,789.20	
	HAMMERSON PLC	1,931,365	486,703.98	
	HELICAL PLC	45,400	105,328.00	
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	162,293	138,760.51	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	383,635	2,247,333.83	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	499,236	872,664.52	
	LXI REIT PLC	918,439	810,063.19	
	NEWRIVER REIT PL	126,000	103,320.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	179,560.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	690,955	614,949.95	
PRS REIT PLC/THE	260,002	191,881.47		

	REGIONAL REIT LTD	222,000	93,573.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	107,256	875,745.24	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	86,860.00	
	SEGRO PLC	619,040	4,351,851.20	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,016,907	1,208,085.51	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	675,749	486,539.28	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	118,719.02	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	932,234	1,256,651.43	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	203,797.94	
	UNITE GROUP PLC	217,400	1,964,209.00	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	252,018.88	
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	191,490.18	
	WORKSPACE GROUP PLC	65,316	319,787.13	
	イギリスbond 小計	14,910,677	22,881,934.08 (4,239,564,746)	
オーストラ リアルドル	ABACUS GROUP	194,329	231,251.51	
	ABACUS STORAGE KING	194,329	237,081.38	
	ARENA REIT	192,648	708,944.64	
	BWP TRUST	237,407	835,672.64	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	348,575	498,462.25	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	270,296	821,699.84	
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	269,186.28	
	CHARTER HALL GROUP	243,752	2,535,020.80	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	330,964	1,168,302.92	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	275,874	951,765.30	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	422,861.12	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	338,067.20	
	DEXUS	543,275	4,204,948.50	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	301,710.00	
	GDI PROPERTY GROUP	185,597	121,566.03	
	GOODMAN GROUP	861,449	19,296,457.60	
	GPT GROUP	953,138	3,936,459.94	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	331,755.90	
	HEALTHCO REIT	194,021	285,210.87	
	HMC CAPITAL LTD	122,191	621,952.19	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	839,293	965,186.95	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	316,334.48	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	699,793.38	
	MIRVAC GROUP	1,987,126	4,709,488.62	
	NATIONAL STORAGE REIT	603,590	1,327,898.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	133,448.00	
	REGION RE GROUP	588,421	1,294,526.20	
	RURAL FUNDS GROUP	181,331	353,595.45	

	SCENTRE GROUP	2,629,933	6,943,023.12	
	STOCKLAND	1,191,357	4,908,390.84	
	VICINITY CENTERS	1,985,803	3,663,806.53	
	WAYPOINT REIT LTD	336,956	845,759.56	
オーストラリアドル 小計		17,241,610	64,279,628.04 (5,990,861,333)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	488,215.26	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	556,435	1,251,978.75	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	676,815.23	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	651,295	833,657.60	
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	429,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	241,387	557,603.97	
ニュージーランドドル 小計		2,910,148	4,237,270.81 (364,913,762)	
香港ドル	CHAMPION REIT	927,000	2,447,280.00	
	FORTUNE REIT	735,000	3,858,750.00	
	LINK REIT	1,295,300	49,609,990.00	
	PROSPERITY REIT	492,000	787,200.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,464,210.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,894,657.00	
香港ドル 小計		5,316,960	60,062,087.00 (1,114,752,334)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	335,500.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,688,518	4,575,883.78	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,092,277	1,103,199.77	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	601,411.63	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,559,744	4,863,513.60	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	421,774.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	190,472.00	
	EC WORLD REIT	180,000	52,200.00	
	ESR-LOGOS REIT	3,029,264	954,218.16	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	332,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	137,215.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	529,862	1,160,397.78	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,448,796	1,695,091.32	
	KEPPEL DC REIT	661,303	1,388,736.30	
	KEPPEL REIT	1,047,300	911,151.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	871,250	527,106.25	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,029,063	2,274,229.23	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,642,585	2,710,265.25	

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,142,873	1,737,166.96	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	331,147.44	
	PARAGON REIT	519,600	470,238.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	197,500	754,450.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	204,102.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	663,000	324,870.00	
	SUNTEC REIT	1,134,100	1,372,261.00	
	シンガポールドル 小計	23,729,100	29,428,700.97 (3,151,813,873)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	84,014,000.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	65,802,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	315,599,200.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	15,754	67,584,660.00	
	JR REIT XXVII	76,683	292,545,645.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	25,433	135,049,230.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	244,982,400.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	172,014,750.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	45,818,685.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	217,916,200.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	44,449,130.00	
	SK REITS CO LTD	39,229	169,076,990.00	
	韓国ウォン 小計	460,839	1,854,852,890.00 (201,437,023)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	573,480.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,629,090.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	884,580.00	
	イスラエルシェケル 小計	578,500	3,087,150.00 (118,135,351)	
	合計	80,361,462	90,751,479,048 (90,751,479,048)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 142銘柄	100.0%	78.1%
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 37銘柄	100.0%	4.7%
オーストラリアドル	投資証券 32銘柄	100.0%	6.6%

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%	1.2%
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	12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

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 8月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,766,843
コール・ローン	56,818,531
投資信託受益証券	31,052,781,011
流動資産合計	31,116,366,385
資産合計	31,116,366,385
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	714,448,079
未払金	17,553,559
未払解約金	612,532
未払利息	134
流動負債合計	732,614,304
負債合計	732,614,304
純資産の部	
元本等	
元本	25,106,860,700
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,276,891,381
元本等合計	30,383,752,081
純資産合計	30,383,752,081
負債純資産合計	31,116,366,385

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2023年 8月21日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2023年 8月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,106,860,700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)
	1.2102円 (12,102円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

2023年 8月21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、当該規定に従い為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2.金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月21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 8月21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 8月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 8月23日
期首元本額	27,864,700,277円
期中追加設定元本額	4,121,909,908円
期中一部解約元本額	6,879,749,485円
期末元本額	25,106,860,700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）	3,730,430,735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	7,439,587,857円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,758,421,008円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	524,744,204円
グローバル経済コア	1,334,953,683円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,435,471,888円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	969,067,164円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	220,618,257円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	588,577,101円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	564,017,610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）	103,268,209円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 8月21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	598,837,867	
合計	598,837,867	

(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 8月21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	30,660,379,792	-	31,374,827,871	714,448,079
	アメリカドル	30,660,379,792	-	31,374,827,871	714,448,079
合計		30,660,379,792	-	31,374,827,871	714,448,079

(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	5,971,795	213,670,825.10	
		アメリカドル 小計	5,971,795	213,670,825.10 (31,052,781,011)	
		合計	5,971,795	31,052,781,011 (31,052,781,011)	

(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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(2023年8月22日から2024年2月21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。

【グローバル経済コア】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2023年 8月21日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,480,117	211,201,701
親投資信託受益証券	11,989,215,183	15,170,444,773
未収入金	71,988,712	-
流動資産合計	12,187,684,012	15,381,646,474
資産合計	12,187,684,012	15,381,646,474
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,597,879	10,738,496
未払受託者報酬	3,155,344	3,601,022
未払委託者報酬	50,485,413	46,358,923
未払利息	298	40
その他未払費用	315,471	360,044
流動負債合計	77,554,405	61,058,525
負債合計	77,554,405	61,058,525
純資産の部		
元本等		
元本	8,970,679,966	10,458,953,843
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	3,139,449,641	4,861,634,106
(分配準備積立金)	2,276,579,520	2,156,859,626
元本等合計	12,110,129,607	15,320,587,949
純資産合計	12,110,129,607	15,320,587,949
負債純資産合計	12,187,684,012	15,381,646,474

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2022年 8月23日 至 2023年 2月22日	第7期中間計算期間 自 2023年 8月22日 至 2024年 2月21日
営業収益		
受取利息	212	543
有価証券売買等損益	318,407,066	1,139,817,881
営業収益合計	318,406,854	1,139,818,424
営業費用		
支払利息	35,731	22,657
受託者報酬	3,056,599	3,601,022
委託者報酬	48,905,448	46,358,923
その他費用	305,602	360,048
営業費用合計	52,303,380	50,342,650
営業利益又は営業損失（ ）	370,710,234	1,089,475,774
経常利益又は経常損失（ ）	370,710,234	1,089,475,774
中間純利益又は中間純損失（ ）	370,710,234	1,089,475,774
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（ ）	15,010,474	21,611,800
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,582,509,086	3,139,449,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	141,218,262	832,309,167
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	141,218,262	832,309,167
剰余金減少額又は欠損金増加額	156,036,449	177,988,676
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	156,036,449	177,988,676
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,211,991,139	4,861,634,106

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月21日から翌年8月20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7期中間計算期間は2023年 8月22日から2024年 2月21日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第6期 (2023年 8月21日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,970,679,966口	10,458,953,843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) 1.3500円 (13,500円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4648円 (14,648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7期中間計算期間 (2024年 2月21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6期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日	第7期中間計算期間 自 2023年 8月22日 至 2024年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,824,493,877円	8,970,679,966円
期中追加設定元本額	1,225,075,777円	1,995,010,848円
期中一部解約元本額	1,078,889,688円	506,736,971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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,456,836,402
株式	650,836,012,390
派生商品評価勘定	96,823,450
未収入金	1,169,700
未収配当金	935,495,540
差入委託証拠金	178,926,946
流動資産合計	656,505,264,428
資産合計	656,505,264,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	949,950
前受金	95,956,000
未払解約金	1,058,002,264
未払利息	847
流動負債合計	1,154,909,061
負債合計	1,154,909,061
純資産の部	
元本等	
元本	242,774,172,757
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	412,576,182,610
元本等合計	655,350,355,367
純資産合計	655,350,355,367
負債純資産合計	656,505,264,428

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,774,172,757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 2.6994円 (1万口当たり純資産額) (26,994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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	242,361,014,552円
期中追加設定元本額	12,621,042,092円
期中一部解約元本額	12,207,883,887円
期末元本額	242,774,172,757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）	300,228,318円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,323,692,092円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,832,876円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,635,649,150円
世界経済インデックスファンド	5,485,017,349円
日本株式インデックス・オープン	2,896,656,791円
DCマイセレクション25	5,161,553,123円
DCマイセレクション50	16,530,302,543円
DCマイセレクション75	18,639,047,535円
DC日本株式インデックス・オープン	5,991,821,138円
DCマイセレクションS25	2,883,860,038円
DCマイセレクションS50	9,225,200,055円
DCマイセレクションS75	8,406,639,363円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,319,188,659円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	90,343,484円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	623,847,752円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	490,232,258円
DC世界経済インデックスファンド	3,872,297,962円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	779,900,215円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,315,406円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,119,126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）	145,837,773円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,942,020円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	13,916,110円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	66,062,210円

区分	2024年 2月21日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,768,203円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	41,964,694円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	461,496,312円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	296,607,962円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,022,522,920円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	28,436,332円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	11,549,460円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	306,897,276円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	167,048,030円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,137,584円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	18,043,662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）	393,927,922円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,447,230,955円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,912,533,154円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,066,009,806円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,532,570,159円
分散投資コア戦略ファンドA	1,836,701,973円
分散投資コア戦略ファンドS	6,134,390,087円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	625,605,332円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,228,812円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,126,863,232円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	190,482,840円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,488,308円
SMT インデックスバランス・オープン	46,495,864円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,882,707,441円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	257,305,573円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,722,491円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	217,686,084円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,201,050円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,796,995円
グローバル経済コア	230,522,768円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,171,403円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,565,814,267円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,743,442円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	936,907,080円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	236,546,406円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,022,400円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	54,129,701円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,873,476円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	28,639,350円
10資産分散投資ファンド	87,067,994円
グローバル10資産バランスファンド	20,497,928円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	34,725円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	37,911円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	34,844円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,400円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	19,911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）	41,836,473,861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）	464,553,669円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	288,619,452円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	16,904,339円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	139,797,804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）	48,798,533,705円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,873,463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）	203,574,847円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,847,544,000	-	3,943,500,000	95,956,000
合計		3,847,544,000	-	3,943,500,000	95,956,000

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2024年 2月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	916,682,052
国債証券	556,611,202,800
地方債証券	32,820,900,351
特殊債券	37,880,990,150
社債券	30,115,362,000
未収入金	348,738,000
未収利息	1,538,646,204
前払費用	54,302,936
流動資産合計	660,286,824,493
資産合計	660,286,824,493
負債の部	
流動負債	
未払金	758,927,000
未払解約金	414,203,097
未払利息	174
流動負債合計	1,173,130,271
負債合計	1,173,130,271
純資産の部	
元本等	
元本	493,121,238,389
剰余金	
剰余金又は欠損金()	165,992,455,833
元本等合計	659,113,694,222
純資産合計	659,113,694,222
負債純資産合計	660,286,824,493

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月21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。

2024年 2月21日現在	
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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	493,121,238,389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 99,355,000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 1.3366円 (1万口当たり純資産額) (13,366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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	479,700,304,301円
期中追加設定元本額	29,091,908,851円
期中一部解約元本額	15,670,974,763円
期末元本額	493,121,238,389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)	5,151,124,058円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,633,860円
SMT 国内債券インデックス・オープン	17,193,600,001円
世界経済インデックスファンド	6,763,280,358円
DCマイセレクション25	28,733,761,134円
DCマイセレクション50	36,444,932,231円
DCマイセレクション75	11,308,078,883円
DC日本債券インデックス・オープン	406,006,531円
DC日本債券インデックス・オープンS	88,319,692,906円
DC日本債券インデックス・オープンP	62,747,754,990円
DCマイセレクションS25	17,477,712,288円

区分	2024年 2月21日現在
DCマイセレクションS50	20,565,131,020円
DCマイセレクションS75	5,297,796,021円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	469,203,406円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,805,210,213円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,116,935,406円
DC世界経済インデックスファンド	4,668,090,342円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,091,932円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	22,266,643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）	57,897,813円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	108,206,471円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	27,533,508円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,848,337円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,071,634,312円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	753,790,389円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,322,108,714円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	66,341,926円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	49,378,534円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	935,755,410円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,028,010,373円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,354,508,809円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	95,425,368円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,074,185,130円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,679,500,286円
分散投資コア戦略ファンドA	18,505,094,073円
分散投資コア戦略ファンドS	26,151,867,452円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	306,160,086円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,966,219,112円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	88,952,994円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	45,221,327円
SMT インデックスバランス・オープン	66,176,359円
SMT 世界経済インデックス・オープン	58,174,066円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	135,862,246円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	208,977,413円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	17,445,774円
グローバル経済コア	337,135,248円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	45,068,219円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	34,430,904円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	139,937,211円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	79,060,308円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,982,933円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	17,065,633円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	872,141,569円
10資産分散投資ファンド	327,498,386円
グローバル10資産バランスファンド	266,828,889円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	149,986円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	135,136円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	126,226円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	126,226円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	149,429円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	207,418円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	219,038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）	98,715,512,002円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	41,196,637円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,568,959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）	482,907,915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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,611,728,727
コール・ローン	821,477,237
株式	665,378,378,160
投資信託受益証券	121,417,076
投資証券	12,831,223,496
派生商品評価勘定	304,010,676
未収入金	4,222,893
未収配当金	613,780,410
差入委託証拠金	5,610,852,648
流動資産合計	687,297,091,323
資産合計	687,297,091,323
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,692,459
前受金	301,383,605
未払金	24,140,339
未払解約金	703,645,769
未払利息	156
流動負債合計	1,031,862,328
負債合計	1,031,862,328
純資産の部	
元本等	
元本	115,104,315,548
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	571,160,913,447
元本等合計	686,265,228,995
純資産合計	686,265,228,995
負債純資産合計	687,297,091,323

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月21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 2月21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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,104,315,548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 5.9621円 (1万口当たり純資産額) (59,621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 2月21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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	113,463,591,898円
期中追加設定元本額	6,332,346,082円
期中一部解約元本額	4,691,622,432円
期末元本額	115,104,315,548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）	1,521,570,831円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,796,259円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,236,731,862円
世界経済インデックスファンド	13,175,740,652円
外国株式インデックス・オープン	884,793,798円
D Cマイセクション25	629,406,189円
D Cマイセクション50	3,233,645,211円
D Cマイセクション75	4,290,896,083円
D C外国株式インデックス・オープン	12,971,758,512円
D CマイセクションS25	323,451,308円
D CマイセクションS50	1,811,002,838円
D CマイセクションS75	1,922,664,300円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	20,457,351円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	141,221,370円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	110,978,813円
D C世界経済インデックスファンド	9,368,646,394円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	917,926,065円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,014,261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）	21,849,038円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	6,274,054円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	29,668,119円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	6,614,760円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	18,799,225円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	144,514,495円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	117,783,314円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	917,593,292円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	63,931,678円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	15,576,725円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	103,970,311円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	32,263,324円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	735,306,519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）	781,709,769円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,179,318,821円
コア投資戦略ファンド（安定型）	120,638,147円
コア投資戦略ファンド（成長型）	290,213,250円
分散投資コア戦略ファンドA	1,491,590,936円
分散投資コア戦略ファンドS	6,952,080,946円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,485,722,157円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,019,872,619円
コア投資戦略ファンド（切替型）	130,977,347円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	439,141,803円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	23,925,767円
S M T インデックスバランス・オープン	109,795,682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）	5,073,214,982円

区分	2024年 2月21日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	241,164,275円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,055,784,345円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	175,579,058円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,382,857円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,730,686,577円
グローバル経済コア	576,208,135円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,960,048円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,983,643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・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	152,183,308円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	146,146,060円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	65,206,142円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	77,788,082円
10資産分散投資ファンド	48,693,256円
グローバル10資産バランスファンド	9,273,322円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	23,675円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	25,847円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	27,150円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	27,150円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	23,756円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	15,277円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	13,575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）	54,244,246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）	201,676,776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）	622,686,730円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,399,563,159円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,983,480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）	76,978,155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）	80,129,160円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	179,358,397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）	174,601,806円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	172,871,024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）	91,215,580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 2月21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	7,457,850,313	-	7,759,233,918	301,383,605
合計		7,457,850,313	-	7,759,233,918	301,383,605

（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

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	49,608,900	-	49,545,177	63,723
	アメリカドル	49,608,900	-	49,545,177	63,723
	売建	55,514,800	-	55,516,465	1,665
	アメリカドル	55,514,800	-	55,516,465	1,665
合計		105,123,700	-	105,061,642	65,388

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年 2月21日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	917,690,174
コール・ローン	4,174,937,477
国債証券	313,396,011,095
派生商品評価勘定	5,018,088
未収入金	2,871,499
未収利息	2,174,410,161
前払金	6,236,914
前払費用	190,803,069
差入委託証拠金	235,355,662
流動資産合計	321,103,334,139
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,227,805
未払金	2,849,333,641
未払解約金	44,238,839
未払利息	793
流動負債合計	2,900,801,078
負債合計	
2,900,801,078	
純資産の部	
元本等	
元本	91,325,895,061
剰余金	
剰余金又は欠損金()	226,876,638,000
元本等合計	318,202,533,061
純資産合計	
318,202,533,061	
負債純資産合計	
321,103,334,139	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月21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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	91,325,895,061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 3.4843円 (1万口当たり純資産額) (34,843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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	86,820,791,837円
期中追加設定元本額	7,974,410,869円
期中一部解約元本額	3,469,307,645円
期末元本額	91,325,895,061円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,121,745,835円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	507,709,679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）	2,377,025,037円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,040,358円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,658,373,133円
世界経済インデックスファンド	20,276,165,663円
DCマイセクション25	1,931,326,665円
DCマイセクション50	1,764,081,937円
DCマイセクション75	1,368,898,850円
DC外国債券インデックス・オープン	2,250,728,078円
DCマイセクションS25	1,116,214,773円
DCマイセクションS50	997,082,989円
DCマイセクションS75	549,324,502円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	15,971,357円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	100,421,887円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	54,243,565円
DC世界経済インデックスファンド	14,161,351,213円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	699,011,622円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,094,444円
マイセクション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）	15,047,126円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,158,124円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	49,709,449円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	53,313,350円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,533,464円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	785,535,149円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	364,461,557円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,529,639,425円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	53,493,651円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	30,406,983円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	349,732,489円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	129,434,332円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	171,859,380円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	635,980,303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）	1,484,562,517円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,872,812円
外国債券ファンド・シリーズ1	780,512,760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）	737,060,390円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,419,733,694円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	219,854,292円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,457,356円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,297,059,481円
SMT インデックスバランス・オープン	163,823,052円
SMT 世界経済インデックス・オープン	404,171,836円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	566,364,519円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	871,098,705円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,971,364円
グローバル経済コア	955,388,022円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,961,840円

区分	2024年 2月21日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,594,709円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,934,900円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	77,579,162円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	39,219,769円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	51,291,347円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	546,642,661円
10資産分散投資ファンド	26,422,405円
グローバル10資産バランスファンド	15,185,130円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	22,068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）	12,704,968,821円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	171,705,029円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	279,564,730円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	129,005,606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）	130,263,977円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 2月21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	2,135,321,219	-	2,129,084,305	6,236,914
合計		2,135,321,219	-	2,129,084,305	6,236,914

（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 2月21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	5,073,758,901	-	5,077,786,098	4,027,197
	アメリカドル	2,436,151,044	-	2,436,479,550	328,506
	カナダドル	138,749,551	-	138,450,721	298,830
	メキシコペソ	32,882,080	-	32,866,746	15,334
	ユーロ	1,627,478,763	-	1,630,694,122	3,215,359
	イギリスポンド	271,792,047	-	272,235,737	443,690
	デンマーククローネ	9,793,800	-	9,795,555	1,755
	ポーランドズロチ	22,485,398	-	22,468,773	16,625
	オーストラリアドル	39,338,400	-	39,339,160	760

シンガポールドル	14,514,760	-	14,516,385	1,625
マレーシアリン ギット	18,128,480	-	18,135,730	7,250
イスラエルシェケ ル	12,222,000	-	12,219,630	2,370
オフショア人民元	450,222,578	-	450,583,989	361,411
合計	5,073,758,901	-	5,077,786,098	4,027,197

(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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,624,733,445
コール・ローン	106,760,462
株式	170,388,600,897
投資信託受益証券	540,115,765
投資証券	187,500,208
派生商品評価勘定	279,124,413
未収入金	124,594
未収配当金	245,485,008
差入委託証拠金	1,572,233,137
流動資産合計	181,944,677,929
資産合計	181,944,677,929
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,682,854
前受金	276,445,310
未払金	1,278
未払解約金	116,533,387
未払利息	20
流動負債合計	395,662,849
負債合計	395,662,849
純資産の部	
元本等	
元本	43,535,269,546
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	138,013,745,534
元本等合計	181,549,015,080
純資産合計	181,549,015,080
負債純資産合計	181,944,677,929

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月21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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,535,269,546口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4,1702円 (41,702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 2月21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

	2024年 2月21日現在
	「(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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	40,615,994,191円
期中追加設定元本額	3,929,302,346円
期中一部解約元本額	1,010,026,991円
期末元本額	43,535,269,546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	7,468,597,357円
世界経済インデックスファンド	10,772,816,643円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,129,408,283円
DC世界経済インデックスファンド	7,484,453,410円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	77,605,723円
コア投資戦略ファンド(安定型)	56,489,423円
コア投資戦略ファンド(成長型)	136,653,244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)	1,234,668,009円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	787,554,975円
コア投資戦略ファンド(切替型)	61,643,166円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	362,028,092円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,173,080円
SMT インデックスバランス・オープン	88,078,389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)	2,461,319,140円
SMT 世界経済インデックス・オープン	266,497,944円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,166,759,655円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	194,028,573円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,957,933円
グローバル経済コア	535,181,609円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	306,803,937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)	14,488,359円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	102,512,085円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	98,499,700円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	44,001,118円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	52,580,506円
10資産分散投資ファンド	13,305,211円
グローバル10資産バランスファンド	13,180,556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)	1,546,623,117円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	90,583,611円

区分	2024年 2月21日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	85,071,139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）	12,585,591円
F O F s 用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,086,480円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 2月21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	10,731,050,758	-	11,007,496,068	276,445,310
合計		10,731,050,758	-	11,007,496,068	276,445,310

（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 2月21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	595,300,589	-	595,409,703	109,114
	アメリカドル	595,300,589	-	595,409,703	109,114
	売建	25,148,589	-	25,261,454	112,865
	ブラジルリアル	25,148,589	-	25,261,454	112,865
合計		620,449,178	-	620,671,157	3,751

（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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	963,329,798
コール・ローン	2,916,475,073
国債証券	128,457,320,141
派生商品評価勘定	6,831,165
未収入金	1,884,055

2024年 2月21日現在	
項目	金額（円）
未収利息	1,908,594,339
前払費用	118,986,067
流動資産合計	134,373,420,638
資産合計	134,373,420,638
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,293,115
未払金	1,485,762,161
未払解約金	20,698,766
未払利息	554
流動負債合計	1,508,754,596
負債合計	1,508,754,596
純資産の部	
元本等	
元本	59,040,894,921
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,823,771,121
元本等合計	132,864,666,042
純資産合計	132,864,666,042
負債純資産合計	134,373,420,638

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月21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）

2024年 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	59,040,894,921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) 2,2504円 (22,504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 2月21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。

2024年 2月21日現在	
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 提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引 のリスクの大きさを示すものではありません。

(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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	54,157,444,415円
期中追加設定元本額	5,940,297,994円
期中一部解約元本額	1,056,847,488円
期末元本額	59,040,894,921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	5,085,717,112円
世界経済インデックスファンド	20,858,891,582円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,874,178,592円
DC世界経済インデックスファンド	14,639,092,012円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,508,262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)	759,324,238円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,566,889,645円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	228,702,342円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	106,214,058円
SMT インデックスバランス・オープン	170,498,785円
SMT 世界経済インデックス・オープン	476,725,725円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	668,029,051円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,027,463,787円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,527,844円
グローバル経済コア	950,257,739円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	99,613,297円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	85,720,414円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	36,290,164円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	41,461,198円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	212,237,579円
10資産分散投資ファンド	43,246,585円
グローバル10資産バランスファンド	23,644,486円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	202,512,593円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	152,155,212円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	22,452,812円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	227,231,446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)	221,204,889円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	219,012,057円

区分	2024年 2月21日現在
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	141,790,532円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 2月21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	3,418,617,646	-	3,423,155,696	4,538,050
	アメリカドル	450,120,000	-	450,133,500	13,500
	メキシコペソ	460,266,940	-	459,758,271	508,669
	チェココルナ	285,473,140	-	285,568,754	95,614
	ハンガリーフォリント	120,410,208	-	121,150,025	739,817
	ポーランドズロチ	344,598,825	-	347,400,252	2,801,427
	ルーマニアレイ	32,555,218	-	32,600,500	45,282
	マレーシアリングット	428,389,870	-	426,807,664	1,582,206
	タイバーツ	324,885,100	-	326,225,398	1,340,298
	南アフリカランド	510,838,565	-	511,851,112	1,012,547
	オフショア人民元	461,079,780	-	461,660,220	580,440
合計		3,418,617,646	-	3,423,155,696	4,538,050

（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 2月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,259,779,868
投資証券	109,904,505,750
未収配当金	950,567,210
前払金	204,901,360
差入委託証拠金	243,697,993
流動資産合計	114,563,452,181
資産合計	114,563,452,181
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	205,006,520
未払金	429,772,654
未払解約金	25,844,256
未払利息	619

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	660,624,049
負債合計	660,624,049
純資産の部	
元本等	
元本	57,182,294,142
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,720,533,990
元本等合計	113,902,828,132
純資産合計	113,902,828,132
負債純資産合計	114,563,452,181

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,182,294,142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 1.9919円 (1万口当たり純資産額) (19,919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 2月21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。

2024年 2月21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。

（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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	66,568,277,606円
期中追加設定元本額	5,731,383,590円
期中一部解約元本額	15,117,367,054円
期末元本額	57,182,294,142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）	1,845,565,420円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,797,767円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	17,210,722,588円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	27,790,820,994円
コア投資戦略ファンド（安定型）	994,368,691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
S M T インデックスバランス・オープン	22,019,122円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	211,531,584円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	12,589,710円
グローバル経済コア	360,907,267円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,108,666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）	133,905,607円
My S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	825,694,024円
10資産分散投資ファンド	23,441,503円
グローバル10資産バランスファンド	24,804,141円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	343,795,463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）	8,730,244円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	689,306,473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）	73,714,990円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	508,440,551円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	280,278,387円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
			うち1年超	
市場取引	不動産投信指数先物取引			
	買建	4,148,818,360	-	3,943,917,000
	合計	4,148,818,360	-	3,943,917,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	192,882,885
コール・ローン	215,112,462
投資証券	110,326,066,890
派生商品評価勘定	13,517
未収入金	10,794,314
未収配当金	192,750,524
流動資産合計	110,937,620,592
資産合計	110,937,620,592
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,565
未払解約金	217,007,851
未払利息	40
流動負債合計	217,010,456
負債合計	217,010,456
純資産の部	
元本等	
元本	39,405,288,895
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,315,321,241
元本等合計	110,720,610,136
純資産合計	110,720,610,136
負債純資産合計	110,937,620,592

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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

	2024年 2月21日現在
	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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		39,405,288,895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)	2.8098円 (28,098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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	36,111,716,588円
期中追加設定元本額	8,075,124,124円
期中一部解約元本額	4,781,551,817円
期末元本額	39,405,288,895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	52,864,691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）	1,518,943,948円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,715,922円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,257,054,520円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,340,617,773円
コア投資戦略ファンド（安定型）	448,238,308円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,227,996,779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）	555,506,587円
SMT インデックスバランス・オープン	103,146,486円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円

区分	2024年 2月21日現在
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	10,352,489円
グローバル経済コア	272,446,250円
SBI 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,755,532円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	404,702,572円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	104,627,417円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	221,727,707円
10 資産分散投資ファンド	12,954,787円
グローバル10 資産バランスファンド	19,041,097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）	1,017,764,604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）	210,515,141円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	72,443,734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）	46,833,700円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	89,154,296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）	86,789,890円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	85,929,475円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	78,969,031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 2月21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	96,045,900	-	96,034,948	10,952
	アメリカドル	96,045,900	-	96,034,948	10,952
合計		96,045,900	-	96,034,948	10,952

(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 2月21日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,389,963
コール・ローン	78,726,662
投資信託受益証券	28,325,344,124
流動資産合計	28,405,460,749
資産合計	28,405,460,749
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	621,243,400

2024年 2月21日現在	
項目	金額（円）
未払金	4,175,387
未払解約金	158,400
未払利息	14
流動負債合計	625,577,201
負債合計	625,577,201
純資産の部	
元本等	
元本	22,157,563,023
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,622,320,525
元本等合計	27,779,883,548
純資産合計	27,779,883,548
負債純資産合計	28,405,460,749

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月21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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,157,563,023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 1.2537円 (1万口当たり純資産額) (12,537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 2月21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。

2024年 2月21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>(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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	25,106,860,700円
期中追加設定元本額	1,472,854,299円
期中一部解約元本額	4,422,151,976円
期末元本額	22,157,563,023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	7,752,717,524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	1,179,391,097円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,157,688,800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	41,343,082円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	612,686,931円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	521,612,735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）	73,216,947円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 2月21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	27,777,377,299	-	28,398,620,699	621,243,400
	アメリカドル	27,777,377,299	-	28,398,620,699	621,243,400
合計		27,777,377,299	-	28,398,620,699	621,243,400

(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】

【グローバル経済コア】

【純資産額計算書】

(2024年 3月29日現在)

資産総額	17,646,255,161円
負債総額	32,014,327円
純資産総額(-)	17,614,240,834円
発行済口数	11,578,010,991口
1口当たり純資産額(/)	1.5214円
(1万口当たり純資産額)	(15,214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 3月29日現在)

資産総額	676,203,749,033円
負債総額	1,335,433,150円
純資産総額(-)	674,868,315,883円
発行済口数	235,007,874,679口
1口当たり純資産額(/)	2.8717円
(1万口当たり純資産額)	(28,717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 3月29日現在)

資産総額	677,726,781,217円
負債総額	7,626,379,038円
純資産総額(-)	670,100,402,179円
発行済口数	501,918,750,868口
1口当たり純資産額(/)	1.3351円
(1万口当たり純資産額)	(13,351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 3月29日現在)

資産総額	730,643,685,637円
負債総額	850,664,733円
純資産総額(-)	729,793,020,904円
発行済口数	115,282,640,037口

1口当たり純資産額（ / ）	6.3305円
（1万口当たり純資産額）	（63,305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 3月29日現在）

資産総額	340,998,582,554円
負債総額	7,730,329,196円
純資産総額（ - ）	333,268,253,358円
発行済口数	94,172,499,508口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5389円
（1万口当たり純資産額）	（35,389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 3月29日現在）

資産総額	192,139,602,916円
負債総額	91,128,812円
純資産総額（ - ）	192,048,474,104円
発行済口数	44,555,386,150口
1口当たり純資産額（ / ）	4.3103円
（1万口当たり純資産額）	（43,103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 3月29日現在）

資産総額	139,318,597,821円
負債総額	77,338,870円
純資産総額（ - ）	139,241,258,951円
発行済口数	61,441,406,284口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2662円
（1万口当たり純資産額）	（22,662円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 3月29日現在）

資産総額	122,828,888,229円
負債総額	537,933,440円
純資産総額（ - ）	122,290,954,789円
発行済口数	58,019,973,399口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1077円

（1万口当たり純資産額）	（21,077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 3月29日現在）

資産総額	115,272,398,455円
負債総額	49,560,128円
純資産総額（ - ）	115,222,838,327円
発行済口数	39,358,089,469口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9276円
（1万口当たり純資産額）	（29,276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 3月29日現在）

資産総額	30,404,747,236円
負債総額	316,873,848円
純資産総額（ - ）	30,087,873,388円
発行済口数	22,018,860,964口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3665円
（1万口当たり純資産額）	（13,665円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）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 3月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

また、監査等委員以外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 5月21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 3月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,768,608
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	216,733
単体型公社債投資信託	51	173,672
合計	642	15,159,012

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、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

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

7. 収益及び費用の計上基準

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

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

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

8. ヘッジ会計の会計処理

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21項に定める経過措置に従って、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おります。

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年3月31日）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	126
小計	1,585	1,711	126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
為替予約取引				
売建				
米ドル	5,498	-	54	54
英ポンド	277	-	1	1
カナダドル	111	-	1	1
スイスフラン	139	-	2	2
香港ドル	190	-	1	1
ユーロ	676	-	18	18
買建				
ユーロ	21	-	0	0
合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
	合計		5,082	-	88

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
退職給付債務の期末残高	820	911

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

- (1) 営業収益
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
- (2) 有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載してあります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売 代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売 代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

資産の部

流動資産

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

固定資産

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

投資その他の資産

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

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

負債の部

流動負債

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

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位:百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

純資産の部

株主資本

資本金		2,000
-----	--	-------

資本剰余金

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

資本剰余金合計		17,239
---------	--	--------

利益剰余金

利益準備金		500
-------	--	-----

その他利益剰余金

別途積立金		2,100
-------	--	-------

繰越利益剰余金		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

評価・換算差額等

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

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

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

中間損益計算書

(単位:百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

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

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
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16,243百万円です。

(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

区 分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

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

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末にお

いて存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

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

[関連情報]

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1) 自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の実行条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の実行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 5月21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SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインター

ネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年11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」に掲げられているグローバル経済コアの2022年8月23日から2023年8月21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、グローバル経済コアの2023年8月21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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

田中洋一

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年4月30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 公認会計士 山田信之
業務執行社員

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」に掲げられているグローバル経済コアの2023年8月22日から2024年2月21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、グローバル経済コアの2024年2月21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8月22日から2024年2月21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。