

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年7月22日提出
【計算期間】	第19期(自 2023年10月21日至 2024年4月22日)
【ファンド名】	SMT インデックスバランス・オープン
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、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。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

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

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

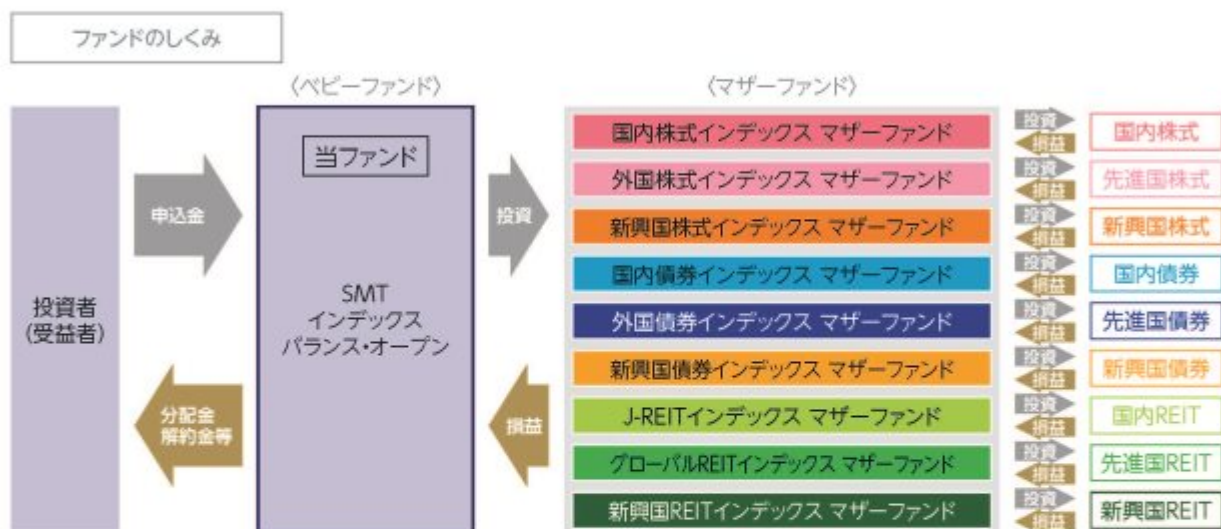
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

#### < ファンドの特色 >

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ? DR(預託証券)とは

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

### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

### ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

- 基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

### リバランス実施

ファンドマネジャー

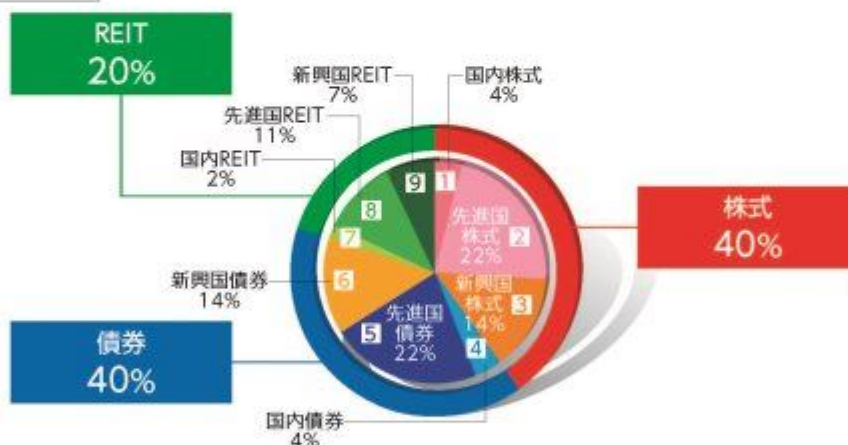
- 資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## 特色2

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

基本資産配分比率  
(2024年5月末現在)



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

資産	インデックス
1 国内株式	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
2 先進国株式	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
3 新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)
4 国内債券	NOMURA-BPI総合
5 先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
6 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)
7 国内REIT	東証REIT指数(配当込み)
8 先進国REIT	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)
9 新興国REIT	S&P新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)

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

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



- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPM総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る商標又は商標は、株式会社JPM総研又は株式会社JPM総研の関連会社(以下「JPM」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る商標又は商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPM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、JPM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JPMは責任を負いません。
- ※2 「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※3 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「NOMURA-BP(総合)」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※5 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド」とは、新興国の現地通貨建て債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
- ※7 「東証REIT指数」とは、株式会社JPM総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、株式会社JPM総研又は株式会社JPM総研の関連会社(以下「JPM」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る商標又は商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPM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、JPM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JPMは責任を負いません。
- ※8 「S&P先進国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任を負いません。
- ※9 「S&P新興国REIT指数」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJI」)が公表する指数で、新興国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。S&P新興国REIT指数(以下「当インデックス」)は、S&P Globalの一部門であるSPDJIの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任を負いません。

### 特色3 世界経済全体の発展を享受します。

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



(出所)IMF「世界経済見通し2023年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

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

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

※当ファンドの地域別構成比は、2024年5月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

#### 分配方針

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

#### 主な投資制限

- 株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。
- 投資信託証券(REITを除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

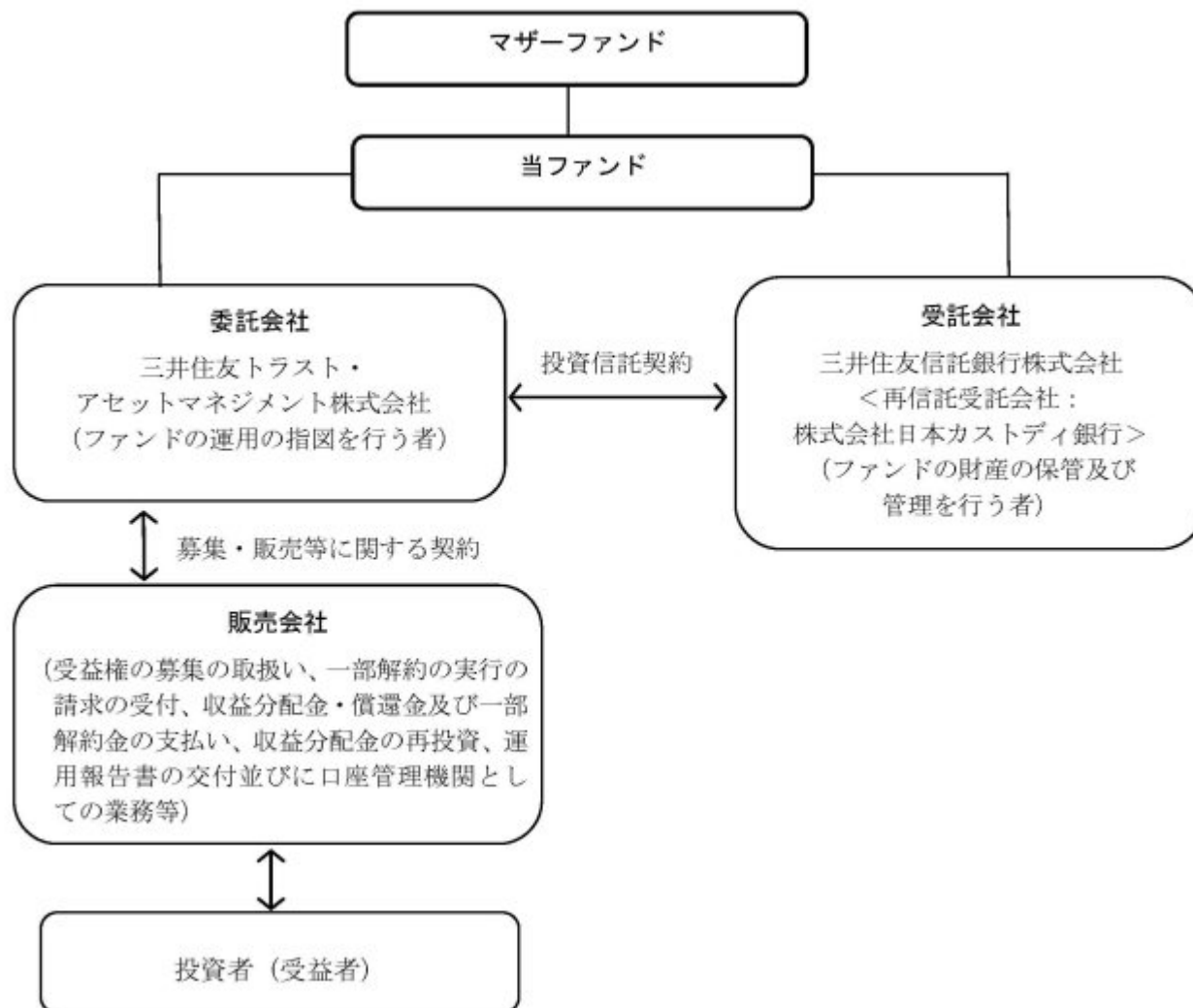
#### (2) 【ファンドの沿革】

2014年11月28日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



## 委託会社の概況（2024年 5月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

## ロ．委託会社の沿革

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

## ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

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

### 投資態度

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 1. 有価証券
  - 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）
  - 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「新興国REITインデックス マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券(「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### (参考) マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

#### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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



同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

ては、上記の運用ができない場合があります。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、ならびに投



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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

す。

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

## 「新興国REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

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

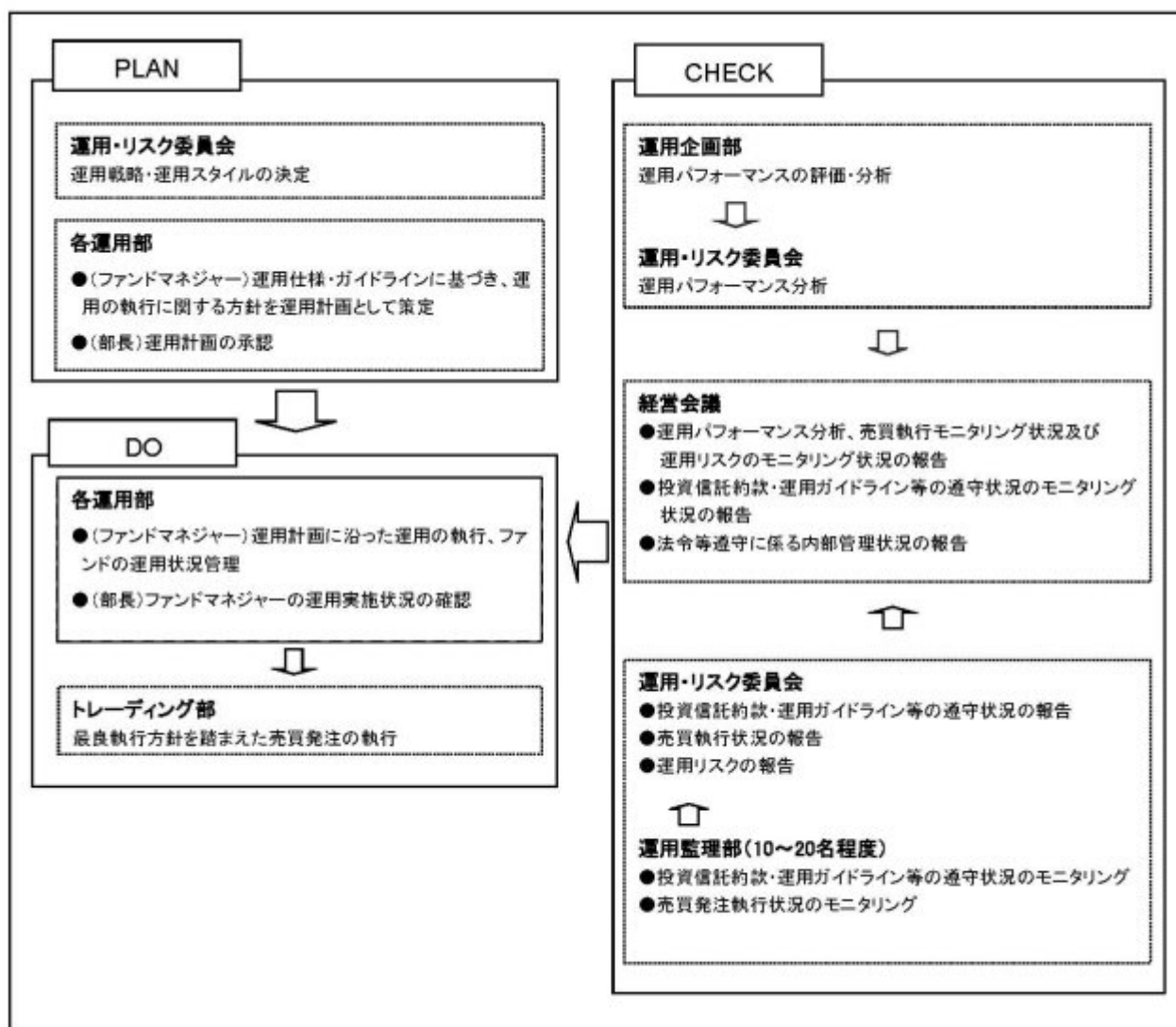
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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



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

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

### （４）【分配方針】

- ・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## (5)【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ．株式等への投資割合

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

#### ロ．投資信託証券への投資割合

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

#### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### ニ．投資する株式等の範囲

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

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

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象



資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

#### チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- (ロ) 上記(イ) a. 及びb. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

#### カ．資金の借入れ

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

解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

(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。

##### リートの価格変動リスク

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

##### 為替変動リスク

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

##### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 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>

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

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

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

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

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

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

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

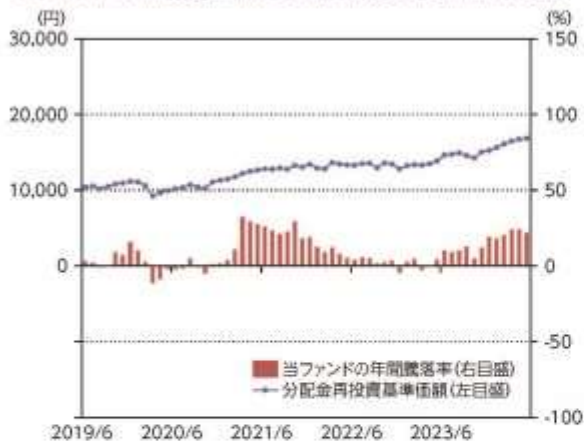
## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2019年6月～2024年5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協賛が算出、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、投資対象としての競争性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの特定総額加重方式により算出されます。(配当込み)指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は権限は、株式会社JPX協賛又は株式会社JPX協賛の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、算出、算出結果の公表、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権限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差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募定期付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・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該事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤差、誤算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その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPEMエマージングマーケットインデックス エマージング マーケットグローバル・ディベロップメント	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、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 0.55%（税抜0.5%）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 0.22% （税抜 0.2%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.275% （税抜 0.25%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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7月23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、毎計算期末又は信託



終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び

譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

## 二．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。

二．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5月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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



## (参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.73%	0.55%	0.18%

※対象期間は2023年10月21日～2024年4月22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5月31日現在の状況について記載してあります。

## 【SMT インデックスバランス・オープン】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,081,742,327	99.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		28,395,080	0.91
合計(純資産総額)		3,110,137,407	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	113,775,378	6.1626	701,152,145	6.5672	747,185,662	24.02
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	178,376,990	3.5493	633,128,068	3.6255	646,705,777	20.79
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	95,729,040	4.2790	409,627,199	4.5570	436,237,235	14.03
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	184,853,637	2.2706	419,736,096	2.3370	432,002,949	13.89
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	112,294,205	2.7762	311,751,292	2.9245	328,404,402	10.56
日本	親投資信託受益証券	新興国REITインデックス マザーファンド	230,182,140	0.8725	200,852,461	0.8774	201,961,809	6.49
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	49,946,547	2.7649	138,099,087	2.8785	143,771,135	4.62
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	73,392,403	1.3188	96,791,845	1.2988	95,322,053	3.06
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	24,391,472	2.1119	51,513,628	2.0561	50,151,305	1.61

(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	99.09

合計	99.09
----	-------

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2015年 4月20日)	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末	(2015年10月20日)	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末	(2016年 4月20日)	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末	(2016年10月20日)	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末	(2017年 4月20日)	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末	(2017年10月20日)	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
第7期計算期間末	(2018年 4月20日)	3,051,290,712	3,051,290,712	10,234	10,234
第8期計算期間末	(2018年10月22日)	2,916,459,886	2,916,459,886	10,043	10,043
第9期計算期間末	(2019年 4月22日)	2,897,788,604	2,897,788,604	10,631	10,631
第10期計算期間末	(2019年10月21日)	2,862,769,922	2,862,769,922	10,703	10,703
第11期計算期間末	(2020年 4月20日)	2,311,876,858	2,311,876,858	9,578	9,578
第12期計算期間末	(2020年10月20日)	2,413,136,341	2,413,136,341	10,586	10,586
第13期計算期間末	(2021年 4月20日)	2,520,767,080	2,520,767,080	12,311	12,311
第14期計算期間末	(2021年10月20日)	2,749,895,621	2,749,895,621	13,320	13,320
第15期計算期間末	(2022年 4月20日)	2,792,857,082	2,792,857,082	13,960	13,960
第16期計算期間末	(2022年10月20日)	2,684,376,098	2,684,376,098	13,327	13,327
第17期計算期間末	(2023年 4月20日)	2,616,683,538	2,616,683,538	13,549	13,549
第18期計算期間末	(2023年10月20日)	2,682,687,407	2,682,687,407	14,410	14,410
第19期計算期間末	(2024年 4月22日)	2,859,938,837	2,859,938,837	16,189	16,189
	2023年 5月末日	2,651,506,899		13,850	
	6月末日	2,782,000,634		14,649	
	7月末日	2,793,883,380		14,731	
	8月末日	2,835,137,451		14,913	
	9月末日	2,765,915,672		14,576	
	10月末日	2,657,343,587		14,255	
	11月末日	2,768,285,918		15,041	
	12月末日	2,692,726,525		15,244	
	2024年 1月末日	2,677,702,257		15,633	
	2月末日	2,730,791,292		16,105	
	3月末日	2,910,119,274		16,486	

4月末日	2,950,044,134		16,719
5月末日	3,110,137,407		16,866

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	0
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	0
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	0
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	0
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	0
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	0
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	0
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	0
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	0
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	0
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	0
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	0
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	0
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	0
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	0
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	0
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	0
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	0
第19期計算期間	2023年10月21日～2024年 4月22日	0

## 【収益率の推移】

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

第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	1.7
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	6.4
第19期計算期間	2023年10月21日～2024年 4月22日	12.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	473,012,411	582,449,995	2,981,411,595
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	199,195,642	276,588,300	2,904,018,937
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	166,800,463	345,148,199	2,725,671,201
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	156,918,897	207,929,245	2,674,660,853
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	163,015,795	423,953,521	2,413,723,127
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	126,592,041	260,782,440	2,279,532,728
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	92,056,120	324,043,645	2,047,545,203
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	106,905,068	90,001,351	2,064,448,920
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	85,522,955	149,318,352	2,000,653,523
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	91,167,976	77,540,998	2,014,280,501
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	68,352,579	151,322,378	1,931,310,702
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	64,015,814	133,663,352	1,861,663,164
第19期計算期間	2023年10月21日～2024年 4月22日	137,192,336	232,222,034	1,766,633,466

(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	662,299,598,730	98.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,430,567,549	1.55
合計(純資産総額)		672,730,166,279	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	10,006,920,000	1.49

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,304,300	3,389.70	31,538,841,000	3,401.00	31,643,924,300	4.70
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,163,300	1,636.96	16,636,948,600	1,658.00	16,850,751,400	2.50
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,186,600	12,495.00	14,826,567,000	12,895.00	15,301,207,000	2.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	822,500	15,854.24	13,040,117,500	16,145.00	13,279,262,500	1.97
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	358,600	35,375.82	12,685,772,000	33,630.00	12,059,718,000	1.79
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,168,700	10,040.00	11,733,748,000	10,290.00	12,025,923,000	1.79
日本	株式	キーエンス	電気機器	169,500	70,009.48	11,866,607,000	70,690.00	11,981,955,000	1.78
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,442,500	3,356.67	11,555,340,200	3,303.00	11,370,577,500	1.69
日本	株式	三井物産	卸売業	1,342,800	8,064.16	10,828,564,000	7,970.00	10,702,116,000	1.59
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,254,600	7,763.63	9,740,261,800	7,948.00	9,971,560,800	1.48
日本	株式	任天堂	その他製品	1,070,300	8,269.47	8,850,818,000	8,555.00	9,156,416,500	1.36
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,205,700	7,287.30	8,786,303,100	7,410.00	8,934,237,000	1.33
日本	株式	信越化学工業	化学	1,522,800	5,888.16	8,966,498,200	5,855.00	8,915,994,000	1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,630,200	5,360.83	8,739,229,400	5,429.00	8,850,355,800	1.32
日本	株式	第一三共	医薬品	1,481,200	5,451.71	8,075,083,700	5,578.00	8,262,133,600	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	50,576,200	152.00	7,687,636,900	154.30	7,803,907,660	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	838,700	8,962.89	7,517,179,800	9,042.00	7,583,525,400	1.13
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,253,700	3,132.06	7,058,733,600	3,214.00	7,243,391,800	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,016,800	1,739.94	6,989,026,800	1,769.50	7,107,727,600	1.06
日本	株式	HOYA	精密機器	333,700	18,635.18	6,218,562,500	19,060.00	6,360,322,000	0.95
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,504,800	4,112.90	6,189,104,700	4,173.00	6,279,530,400	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,313,900	4,276.13	5,618,413,900	4,337.00	5,698,384,300	0.85
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,905,800	2,698.02	5,141,889,750	2,730.00	5,202,834,000	0.77
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,714,800	1,874.47	5,088,837,650	1,887.50	5,124,185,000	0.76
日本	株式	ディスコ	機械	82,400	62,723.05	5,168,380,000	61,490.00	5,066,776,000	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	204,400	22,943.35	4,689,622,500	22,945.00	4,689,958,000	0.70
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,542,500	2,944.84	4,542,430,100	2,966.50	4,575,826,250	0.68
日本	株式	丸紅	卸売業	1,487,800	3,093.70	4,602,813,200	3,060.00	4,552,668,000	0.68
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,014,300	4,411.01	4,474,088,100	4,452.00	4,515,663,600	0.67

日本	株式	住友商事	卸売業	1,085,600	4,047.73	4,394,225,600	4,081.00	4,430,333,600	0.66
----	----	------	-----	-----------	----------	---------------	----------	---------------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.01
		食料品	3.07
		繊維製品	0.36
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.46
		医薬品	4.25
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.88
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.51
		機械	5.52
		電気機器	17.10
		輸送用機器	8.69
		精密機器	2.20
		その他製品	2.36
		電気・ガス業	1.55
		陸運業	2.26
		海運業	0.77
		空運業	0.37
		倉庫・運輸関連業	0.13
		情報・通信業	6.75
		卸売業	7.70
		小売業	3.97
		銀行業	7.94
		証券、商品先物取引業	0.94
		保険業	3.00
その他金融業	1.15		
不動産業	1.93		
サービス業	4.32		
	小計	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	361円		9,889,431,650	10,006,920,000	1.49

(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	560,068,108,770	84.59
地方債証券	日本	32,887,297,131	4.97
特殊債券	日本	36,302,538,086	5.48
	国際機関	298,002,000	0.05
	小計	36,600,540,086	5.53
社債券	日本	29,151,437,000	4.40
	フランス	1,492,426,000	0.23
	韓国	99,337,000	0.02
	小計	30,743,200,000	4.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,800,754,955	0.27
合計(純資産総額)		662,099,900,942	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.46	6,469,413,300	98.43	6,467,310,900	0.100	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,110,000,000	96.22	5,879,408,600	96.23	5,879,653,000	0.500	2033/3/20	0.89
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	99.31	5,859,467,000	99.29	5,858,346,000	0.100	2026/9/20	0.88
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,890,000,000	99.21	5,843,704,600	99.20	5,843,351,200	0.005	2026/6/20	0.88
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	99.08	5,697,387,500	99.06	5,696,007,500	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	99.09	5,628,652,800	99.07	5,627,573,600	0.005	2026/9/20	0.85
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,620,000,000	98.67	5,545,366,400	98.64	5,543,961,400	0.005	2027/6/20	0.84

日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	5,790,000,000	95.06	5,504,202,400	95.10	5,506,347,900	0.400	2033/6/20	0.83
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,760,000,000	95.10	5,477,875,200	95.07	5,476,262,400	0.200	2032/3/20	0.83
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	5,310,000,000	98.96	5,254,829,100	98.94	5,253,767,100	0.005	2026/12/20	0.79
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,430,000,000	96.34	5,231,533,500	96.26	5,227,135,200	0.100	2030/9/20	0.79
日本	国債証券	第368回利付国債（10年）	5,490,000,000	94.44	5,184,810,900	94.41	5,183,218,800	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	5,220,000,000	98.21	5,126,718,600	98.25	5,128,963,200	0.800	2033/9/20	0.77
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	98.65	5,090,494,800	98.62	5,088,895,200	0.100	2027/12/20	0.77
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,320,000,000	95.06	5,057,564,400	95.00	5,054,478,800	0.100	2031/9/20	0.76
日本	国債証券	第373回利付国債（10年）	5,240,000,000	96.09	5,035,116,000	96.13	5,037,526,400	0.600	2033/12/20	0.76
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,030,000,000	100.00	5,030,000,000	99.99	5,029,597,600	0.300	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	5,020,000,000	99.81	5,010,462,000	99.79	5,009,558,400	0.100	2025/9/20	0.76
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	5,040,000,000	99.38	5,009,205,600	99.38	5,008,953,600	0.005	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	5,280,000,000	94.77	5,004,172,800	94.74	5,002,641,600	0.200	2032/6/20	0.76
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	5,277,000,000	94.70	4,997,635,620	94.64	4,994,469,420	0.100	2031/12/20	0.75
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,220,000,000	95.41	4,980,871,800	95.36	4,977,896,400	0.100	2031/6/20	0.75
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,130,000,000	96.55	4,953,117,600	96.51	4,951,373,400	0.500	2032/12/20	0.75
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	4,990,000,000	98.81	4,930,619,000	98.78	4,929,221,800	0.100	2027/9/20	0.74
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	5,060,000,000	96.05	4,860,433,600	95.97	4,856,233,800	0.100	2030/12/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	99.20	4,841,057,600	99.18	4,839,984,000	0.100	2026/12/20	0.73
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	4,800,000,000	99.68	4,785,072,000	99.68	4,784,832,000	0.100	2025/12/20	0.72
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	98.27	4,751,451,200	98.23	4,749,807,300	0.100	2028/6/20	0.72
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	4,860,000,000	97.59	4,743,126,000	97.60	4,743,651,600	0.800	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	99.56	4,739,056,000	99.55	4,738,770,400	0.100	2026/3/20	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	84.59
地方債証券	4.97
特殊債券	5.53
社債券	4.64
合計	99.73

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

#### 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	524,913,508,139	69.15
	イギリス	28,844,104,588	3.80
	カナダ	24,061,514,448	3.17
	フランス	22,092,292,818	2.91
	スイス	21,964,585,369	2.89
	ドイツ	17,369,108,034	2.29
	オランダ	14,874,125,429	1.96
	オーストラリア	13,238,785,741	1.74
	アイルランド	12,983,867,370	1.71
	デンマーク	7,677,187,868	1.01
	スウェーデン	6,406,013,102	0.84
	スペイン	5,383,873,359	0.71
	イタリア	4,284,881,007	0.56
	香港	2,980,576,471	0.39
	シンガポール	2,204,037,012	0.29
	フィンランド	2,088,968,752	0.28
	ジャージー	1,878,905,623	0.25
	ベルギー	1,570,051,972	0.21
	イスラエル	1,445,952,264	0.19
	ノルウェー	1,270,951,048	0.17
	バミューダ	983,614,561	0.13
	ケイマン	953,110,086	0.13
	キュラソー	788,086,264	0.10
	ニュージーランド	530,737,819	0.07
	リベリア	426,033,930	0.06
	オーストリア	401,376,562	0.05
	ルクセンブルク	374,485,512	0.05
	ポルトガル	352,044,589	0.05
	パナマ	171,083,591	0.02
	マン島	66,196,197	0.01
	小計	722,580,059,525	95.19
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	71,816,211	0.01
	香港	58,104,900	0.01
	小計	129,921,111	0.02

投資証券	アメリカ	11,320,567,363	1.49
	オーストラリア	954,128,882	0.13
	フランス	310,826,878	0.04
	シンガポール	239,318,793	0.03
	イギリス	216,742,598	0.03
	香港	113,608,412	0.01
	ベルギー	58,891,595	0.01
	カナダ	54,714,786	0.01
	小計	13,268,799,307	1.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,075,503,006	3.04
合計(純資産総額)		759,054,282,949	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	16,961,117,532	2.23
	買建	カナダ	696,496,074	0.09
	買建	ドイツ	2,940,756,446	0.39
	買建	イギリス	1,283,634,023	0.17
	買建	オーストラリア	716,576,895	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		250,661,950	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。

#### 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	67,448.35	36,763,266,461	64,995.37	35,426,249,543	4.67
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	29,779.03	33,767,159,762	29,982.79	33,998,210,384	4.48
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	190,578	178,528.42	34,023,590,637	173,197.70	33,007,671,271	4.35

アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	717,541	28,550.19	20,485,932,600	28,106.61	20,167,649,925	2.66
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	171,346	75,222.66	12,889,102,037	73,205.41	12,543,455,381	1.65
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	456,849	27,648.93	12,631,388,763	26,976.52	12,324,196,825	1.62
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	397,755	27,902.85	11,098,500,011	27,203.79	10,820,445,242	1.43
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	126,623.97	7,879,050,308	127,752.50	7,949,271,834	1.05
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	221,387.41	7,608,421,223	213,805.89	7,347,867,338	0.97
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	222,518	31,269.62	6,958,055,528	31,242.98	6,952,126,358	0.92
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	101,297	63,307.28	6,412,838,150	64,045.53	6,487,620,194	0.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	350,257	18,003.15	6,305,731,552	17,866.79	6,257,969,176	0.82
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	27,703.79	6,128,495,011	28,023.54	6,199,228,419	0.82
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	71,401	78,946.80	5,636,880,695	75,493.82	5,390,334,313	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	20,841.33	5,273,461,395	20,868.64	5,280,372,123	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	122,188	42,473.40	5,189,740,435	42,523.56	5,195,868,994	0.68
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,092	152,122.88	4,729,804,585	149,576.18	4,650,622,589	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	181,466	25,565.86	4,639,334,605	25,482.78	4,624,259,825	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	69,761.83	4,525,450,509	69,294.75	4,495,150,692	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,237	127,456.26	4,363,720,172	127,796.39	4,375,365,059	0.58
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	22,630.12	4,194,334,553	22,771.18	4,220,480,149	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	51,520.43	3,970,525,596	51,595.67	3,976,323,747	0.52
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	19,763.34	3,866,066,335	19,518.83	3,818,234,917	0.50
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	347,772	10,194.36	3,545,316,305	10,170.85	3,537,139,837	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	138,024	24,927.92	3,440,652,555	24,805.67	3,423,778,127	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	33,607	101,724.26	3,418,647,206	101,514.22	3,411,588,674	0.45
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	205,438	15,908.70	3,268,252,332	16,342.70	3,357,412,424	0.44

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	24,347.99	3,318,485,167	24,500.02	3,339,207,007	0.44
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	549,785	6,163.01	3,388,334,192	6,054.86	3,328,874,614	0.44
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	124,711	26,898.15	3,354,495,359	26,136.39	3,259,495,957	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	4.47
		素材	3.75
		資本財	6.97
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	1.54
		自動車・自動車部品	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.38
		消費者サービス	1.85
		メディア・娯楽	6.45
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.66
		生活必需品流通・小売り	1.72
		食品・飲料・タバコ	3.12
		家庭用品・パーソナル用品	1.57
		ヘルスケア機器・サービス	3.97
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.64
		銀行	5.47
		金融サービス	6.41
		保険	2.99
		エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.03
		ソフトウェア・サービス	9.21
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.94		
電気通信サービス	1.07		
公益事業	2.59		
半導体・半導体製造装置	9.07		
不動産管理・開発	0.29		
		小計	95.19
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.75
合計			96.96

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	412	アメリカドル	109,680,673	17,191,348,686	108,211,800	16,961,117,532	2.23
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	23	カナダドル	6,118,000	700,816,900	6,080,280	696,496,074	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	48	スイスフラン	5,692,727	988,257,407	5,708,640	991,019,904	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	230	ユーロ	11,584,149.2	1,966,756,851	11,483,900	1,949,736,542	0.26
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	36	オーストラリアドル	7,012,800	729,401,328	6,889,500	716,576,895	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	78	イギリスポンド	6,451,492.5	1,287,782,418	6,430,710	1,283,634,023	0.17

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,600,000.00	251,768,000	250,661,950	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。

## 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	159,336,954,431	45.91
	中国	32,456,432,460	9.35
	フランス	26,845,265,429	7.74
	イタリア	24,567,006,196	7.08
	ドイツ	20,708,042,405	5.97
	イギリス	17,392,128,207	5.01
	スペイン	16,444,500,085	4.74
	カナダ	6,896,110,870	1.99
	ベルギー	5,948,606,637	1.71
	オランダ	5,020,992,840	1.45
	オーストラリア	4,411,444,671	1.27

	オーストリア	3,912,053,876	1.13
	メキシコ	2,876,555,724	0.83
	ポーランド	1,801,986,823	0.52
	フィンランド	1,762,167,826	0.51
	アイルランド	1,702,025,401	0.49
	マレーシア	1,687,253,400	0.49
	シンガポール	1,401,444,720	0.40
	イスラエル	1,135,983,718	0.33
	デンマーク	882,512,933	0.25
	ニュージーランド	821,178,409	0.24
	スウェーデン	662,476,338	0.19
	ノルウェー	554,071,847	0.16
	小計	339,227,195,246	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,808,731,987	2.25
合計(純資産総額)		347,035,927,233	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,473,596,026	0.42
	買建	ドイツ	1,368,995,563	0.39

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,428,795,238	0.99

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

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

#### 投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	15,500,000	14,565.18	2,257,603,971	14,575.59	2,259,217,310	1.500	2026/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	15,518.17	2,195,822,234	15,523.07	2,196,515,318	4.375	2028/8/31	0.63
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,205.92	2,128,829,213	15,198.26	2,127,757,751	4.125	2032/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,327.93	1,952,897,399	14,320.89	1,951,937,722	3.375	2033/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,746.89	1,773,349,316	13,745.05	1,773,112,364	2.750	2032/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,655.80	1,713,263,280	14,664.06	1,714,229,538	2.375	2027/5/15	0.49

アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	15,302.35	1,706,212,551	15,308.78	1,706,929,368	3.000	2025/7/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	13,570.56	1,632,538,537	13,577.60	1,633,385,580	1.125	2028/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,494.16	1,623,346,379	14,489.26	1,622,797,789	3.500	2033/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	14,706.00	1,583,837,070	14,715.80	1,584,892,126	1.625	2026/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,548.99	1,578,663,728	12,552.05	1,579,048,837	1.375	2031/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	15,300.51	1,560,652,840	15,306.33	1,561,246,120	3.125	2025/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	15,540.83	1,554,083,228	15,549.09	1,554,909,781	4.500	2026/7/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	14,305.58	1,545,003,317	14,316.91	1,546,226,631	0.625	2026/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	14,736.00	1,534,018,543	14,741.51	1,534,592,169	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,963.80	1,519,358,081	12,962.88	1,519,250,452	1.875	2032/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	15,591.03	1,484,266,816	15,597.77	1,484,907,984	4.625	2026/10/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,361.03	1,477,143,163	12,369.60	1,478,167,493	0.625	2030/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	14,674.78	1,476,283,120	14,679.37	1,476,745,075	2.875	2028/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	9,270,000	15,616.44	1,447,644,632	15,606.65	1,446,736,520	4.500	2033/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	15,289.49	1,406,633,741	15,292.25	1,406,887,216	4.125	2030/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,927.51	1,406,678,745	13,923.22	1,406,245,868	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,480.72	1,391,601,239	12,482.87	1,391,840,178	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	14,473.34	1,374,967,979	14,484.06	1,375,985,864	0.750	2026/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	15,174.39	1,365,695,212	15,181.73	1,366,356,459	2.875	2025/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	13,592.90	1,304,919,273	13,602.39	1,305,830,326	0.625	2027/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	13,611.88	1,293,129,490	13,619.84	1,293,885,634	1.250	2028/9/30	0.37
中国	国債証券	CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000	2,193.50	1,280,350,571	2,197.01	1,282,398,555	2.520	2033/8/25	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	9,550,000	13,075.54	1,248,714,517	13,030.84	1,244,446,110	3.625	2053/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	13,709.54	1,233,859,119	13,717.81	1,234,603,016	1.250	2028/6/30	0.36

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.75
合計	97.75

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

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	37	アメリカドル	3,908,419.57	612,605,683	3,908,125	612,559,512	0.18
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	24	アメリカドル	2,606,565.42	408,553,064	2,605,125.12	408,327,311	0.12
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	25	アメリカドル	2,896,565.3	454,007,645	2,888,281.25	452,709,203	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	14	ユーロ	1,470,162.1	249,604,121	1,469,510	249,493,408	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	19	ユーロ	2,208,572.1	374,971,372	2,201,720	373,808,022	0.11



ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	34	ユーロ	4,419,852.1	750,402,489	4,392,120	745,694,133	0.21
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-------------	-------------	-----------	-------------	------

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	10,710,000.00	1,681,390,216	1,675,097,550	0.48
	カナダドル	買建	1,130,000.00	129,938,565	129,198,550	0.04
	ユーロ	買建	6,450,000.00	1,099,411,329	1,093,371,750	0.32
	イギリスポンド	買建	920,000.00	184,257,090	183,259,400	0.05
	オフショア人民元	買建	16,120,000.00	348,779,636	347,867,988	0.10

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

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

## 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	34,921,989,719	16.91
	台湾	34,202,232,399	16.56
	ケイマン	30,012,474,377	14.53
	韓国	22,362,315,160	10.83
	中国	21,090,116,481	10.21
	ブラジル	8,667,848,535	4.20
	サウジアラビア	7,627,358,706	3.69
	南アフリカ	5,054,223,849	2.45
	メキシコ	4,488,433,602	2.17
	インドネシア	3,052,158,559	1.48
	タイ	2,777,107,818	1.34
	マレーシア	2,766,074,092	1.34
	アラブ首長国連邦	2,094,714,873	1.01
	香港	1,758,169,781	0.85
	ポーランド	1,710,102,517	0.83
	トルコ	1,567,976,630	0.76
	カタール	1,492,336,846	0.72
	クウェート	1,486,369,976	0.72
	フィリピン	1,034,745,585	0.50
	ギリシャ	990,292,092	0.48
	チリ	893,065,947	0.43
	バミューダ	772,982,203	0.37
	アメリカ	665,437,883	0.32

	ハンガリー	533,991,974	0.26
	チェコ	274,338,353	0.13
	ルクセンブルク	273,023,886	0.13
	イギリス	259,504,532	0.13
	エジプト	229,800,558	0.11
	コロンビア	195,537,448	0.09
	ペルー	104,538,652	0.05
	シンガポール	80,490,324	0.04
	オランダ	22,179,628	0.01
	ロシア	132	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	193,461,933,117	93.67
投資信託受益証券	ブラジル	350,857,470	0.17
	メキシコ	144,197,093	0.07
	小計	495,054,563	0.24
投資証券	メキシコ	214,744,232	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,361,083,055	5.99
合計(純資産総額)		206,532,814,967	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	12,342,158,227	5.98

(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		191,885,443	0.09
	売建		3,982,234	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	2,719.30	11,313,354,534	4,045.69	16,831,670,800	8.15
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,128,100	6,136.72	6,922,843,502	7,378.40	8,323,573,040	4.03
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	8,023.25	6,472,082,583	8,364.29	6,747,188,059	3.27
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	1,638.24	4,481,079,927	1,529.81	4,184,484,612	2.03
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	506,553	4,397.88	2,227,759,705	5,386.49	2,728,547,734	1.32
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	101,071	17,262.36	1,744,724,854	23,829.18	2,408,439,274	1.17
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	91,166	14,700.46	1,340,182,880	22,270.66	2,030,326,990	0.98
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	873,750	2,258.07	1,972,992,120	2,183.44	1,907,785,069	0.92
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	16,601,620	90.14	1,496,525,238	112.28	1,864,029,894	0.90
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	475.06	1,038,139,394	852.10	1,862,064,462	0.90
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	879,852	1,779.79	1,565,956,958	2,107.06	1,853,906,674	0.90
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	253,804	4,422.95	1,122,564,053	6,227.86	1,580,656,287	0.77
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	553,283	2,619.90	1,449,551,368	2,694.66	1,490,913,718	0.72
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	485,940	2,802.87	1,362,027,233	2,862.59	1,391,048,928	0.67
ブラジル	株式	VALE SA	素材	581,587	2,120.00	1,232,968,591	1,903.42	1,107,005,965	0.54
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	346,607	3,016.13	1,045,414,034	3,184.78	1,103,868,774	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	152,359	6,345.81	966,842,071	7,060.66	1,075,755,402	0.52
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	389,936	1,792.07	698,794,976	2,603.28	1,015,114,930	0.49
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	56.06	753,417,356	74.38	999,532,841	0.48
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	6,523.05	925,470,991	6,919.03	981,652,638	0.48
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	27,063.96	827,913,729	31,913.47	976,264,967	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	74.43	807,747,200	89.62	972,550,755	0.47
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,178,000	756.06	890,645,096	807.01	950,660,725	0.46
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	338,630	3,544.27	1,200,197,495	2,800.98	948,497,551	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	2,025.14	838,737,436	2,273.67	941,665,441	0.46
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,554,200	330.18	843,368,716	354.88	906,447,267	0.44
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	778,040	1,060.07	824,781,684	1,136.21	884,020,407	0.43

インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	391,573	1,938.86	759,206,986	2,213.85	866,884,473	0.42
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	187,000	4,831.05	903,406,838	4,398.97	822,607,390	0.40
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	87.28	817,854,875	87.30	817,957,350	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別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	4.93
		素材	6.69
		資本財	4.51
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	3.69
		耐久消費財・アパレル	1.13
		消費者サービス	2.41
		メディア・娯楽	6.11
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.03
		生活必需品流通・小売り	1.27
		食品・飲料・タバコ	3.06
		家庭用品・パーソナル用品	0.73
		ヘルスケア機器・サービス	0.86
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.12
		銀行	15.67
		金融サービス	2.40
		保険	2.48
		ソフトウェア・サービス	2.16
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.38
電気通信サービス	2.42		
公益事業	2.76		
半導体・半導体製造装置	11.50		
不動産管理・開発	1.34		
		小計	93.67
投資信託受益証券			0.24
投資証券			0.10
合計			94.01

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	1,475	アメリカドル	78,158,860	12,250,619,716	78,742,875	12,342,158,227	5.98

(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	255,397.08	40,059,923	40,007,103	0.02
	ユーロ	買建	400,000.00	68,030,000	67,889,280	0.03
	ポーランドズロチ	買建	400,000.00	16,057,600	15,844,560	0.01
	香港ドル	買建	3,400,000.00	68,550,800	68,144,500	0.03
	ブラジルリアル	売建	132,307.22	4,032,723	3,982,234	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	マレーシア	14,508,717,613	9.83
	インドネシア	14,467,782,018	9.80
	中国	14,237,159,249	9.64
	メキシコ	14,162,755,719	9.59
	ブラジル	14,117,299,543	9.56
	タイ	13,741,309,690	9.31
	南アフリカ	12,003,153,545	8.13
	ポーランド	11,330,411,973	7.67
	チェコ	9,288,900,496	6.29
	コロンビア	6,553,103,649	4.44
	ルーマニア	5,773,586,927	3.91
	ハンガリー	4,345,972,789	2.94
	ペルー	3,328,552,635	2.25
	チリ	2,629,466,023	1.78
	ウルグアイ	288,847,957	0.20
ドミニカ共和国	213,814,209	0.14	
	小計	140,990,834,035	95.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,644,793,302	4.50
	合計(純資産総額)	147,635,627,337	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		3,150,053,903	2.13

(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 (%)
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000	2,967.93	2,027,099,128	2,939.33	2,007,565,700	10.000	2027/1/1	1.36
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,419.84	1,851,180,752	2,553.80	1,953,657,851	0.000	2026/1/1	1.32
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,297.83	1,792,313,851	2,420.83	1,888,252,067	0.000	2026/7/1	1.28
コロンビア	国債証券	COLTES 6.25% 11/26/25	46,800,000,000	3.87	1,811,739,178	3.88	1,820,039,619	6.250	2025/11/26	1.23
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	206,700,000	871.89	1,802,204,257	861.79	1,781,338,946	10.500	2026/12/21	1.21
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	51,800,000	3,343.45	1,731,910,714	3,360.40	1,740,688,839	3.885	2029/8/15	1.18
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	220,100,000	751.18	1,653,354,688	749.57	1,649,803,680	8.000	2030/1/31	1.12
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	54,900,000	2,977.03	1,634,390,976	3,000.56	1,647,311,730	10.000	2025/1/1	1.12
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000	3.12	1,613,082,031	3.13	1,616,431,405	7.250	2034/10/18	1.09
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	59,000,000	2,582.84	1,523,879,368	2,698.91	1,592,358,967	0.000	2025/7/1	1.08
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	230,000,000	681.16	1,566,673,898	679.11	1,561,964,960	8.875	2035/2/28	1.06
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	836.30	1,466,039,684	851.68	1,493,000,581	5.750	2026/3/5	1.01
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	68,000,000	2,144.12	1,458,002,407	2,163.54	1,471,210,899	0.000	2027/7/1	1.00
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,886.03	1,483,419,885	2,853.85	1,466,879,567	10.000	2029/1/1	0.99
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000	3,323.45	1,429,087,212	3,339.25	1,435,880,922	3.733	2028/6/15	0.97
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000	2.70	1,465,664,743	2.60	1,412,034,879	7.250	2050/10/26	0.96
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000	3,476.56	1,352,382,384	3,445.45	1,340,280,879	2.750	2029/10/25	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	160,800,000	826.84	1,329,561,255	824.50	1,325,812,046	7.750	2031/5/29	0.90
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	160,000,000	811.09	1,297,745,471	821.26	1,314,025,627	5.500	2027/3/4	0.89
ポーランド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000	4,129.20	1,337,863,606	4,031.48	1,306,202,417	6.000	2033/10/25	0.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	180,500,000	707.01	1,276,170,461	704.17	1,271,029,377	8.250	2032/3/31	0.86
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	876.81	1,224,039,127	871.05	1,215,998,342	8.500	2029/5/31	0.82
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	855.07	1,188,559,514	859.47	1,194,669,866	7.500	2027/6/3	0.81
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000	3,362.31	1,139,823,095	3,354.93	1,137,323,431	3.955	2025/9/15	0.77

ポーランド	国債証券	POLGB 7.5% 07/25/28	25,900,000	4,303.40	1,114,581,527	4,237.86	1,097,607,008	7.500	2028/7/25	0.74
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	607.46	1,103,766,086	595.06	1,081,230,925	8.750	2048/2/28	0.73
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.94	1,029,804,956	0.95	1,037,158,435	5.500	2026/4/15	0.70
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	162,300,000	641.13	1,040,566,055	631.60	1,025,087,774	9.000	2040/1/31	0.69
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 11/07/47	130,700,000	784.33	1,025,128,314	764.97	999,823,515	8.000	2047/11/7	0.68
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 05/26/33	124,000,000	808.87	1,003,010,204	795.65	986,612,584	7.500	2033/5/26	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.50
合計	95.50

(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	52,560,000.00	487,348,323	481,812,264	0.33
	チェココルナ	買建	45,410,000.00	310,132,796	310,872,319	0.21
	ハンガリーフォリント	買建	338,530,000.00	147,994,940	147,108,885	0.10
	ポーランドズロチ	買建	9,620,000.00	380,462,063	380,205,488	0.26
	マレーシアリングギット	買建	14,610,000.00	484,397,413	486,001,650	0.33
	タイバーツ	買建	108,520,000.00	462,747,239	461,752,600	0.31
	南アフリカランド	買建	48,730,000.00	414,284,847	406,895,500	0.28
	オフショア人民元	買建	22,030,000.00	474,962,170	475,405,197	0.32

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

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

#### J - REITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	118,360,592,900	95.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,072,757,017	4.88
合計(純資産総額)		124,433,349,917	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	5,510,265,000	4.43

(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	13,864	606,617.35	8,410,142,940	587,000	8,138,168,000	6.54
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	12,207	560,883.86	6,846,709,279	518,000	6,323,226,000	5.08
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	38,430	165,037.42	6,342,388,050	147,700	5,676,111,000	4.56
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	20,702	273,663.08	5,665,373,082	259,200	5,365,958,400	4.31
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	56,963	97,595.56	5,559,335,884	92,500	5,269,077,500	4.23
日本	投資証券	G L P投資法人	39,918	135,636.3	5,414,329,823	130,500	5,209,299,000	4.19
日本	投資証券	K D X不動産投資法人	33,675	160,685.1	5,411,070,742	151,500	5,101,762,500	4.10
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	17,914	269,831.95	4,833,769,552	248,800	4,457,003,200	3.58
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	57,539	57,916.29	3,332,445,410	68,300	3,929,913,700	3.16
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	23,679	170,119.77	4,028,266,033	159,400	3,774,432,600	3.03
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	11,660	325,077.62	3,790,405,049	323,500	3,772,010,000	3.03
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	26,584	149,595.25	3,976,840,126	139,900	3,719,101,600	2.99
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,782	67,787.1	2,696,706,412	78,200	3,110,952,400	2.50
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	35,710	78,297.86	2,796,016,580	81,900	2,924,649,000	2.35
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	21,646	133,804.26	2,896,327,011	125,400	2,714,408,400	2.18
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	8,127	346,396.61	2,815,165,249	328,500	2,669,719,500	2.15
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	4,103	609,165.64	2,499,406,620	635,000	2,605,405,000	2.09
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	6,235	399,300.28	2,489,637,245	369,000	2,300,715,000	1.85
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	15,191	150,062.48	2,279,599,133	147,700	2,243,710,700	1.80
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,943	464,943.17	2,298,214,089	441,000	2,179,863,000	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	7,585	283,276.75	2,148,654,148	271,600	2,060,086,000	1.66
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	4,409	451,283.05	1,989,706,967	447,500	1,973,027,500	1.59
日本	投資証券	イオンリート投資法人	14,578	142,124.93	2,071,897,229	133,200	1,941,789,600	1.56
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,844	317,697.17	1,856,622,261	321,000	1,875,924,000	1.51
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	13,975	138,526.68	1,935,910,353	130,900	1,829,327,500	1.47
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	17,500	108,535.36	1,899,368,800	103,900	1,818,250,000	1.46
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	11,119	150,828.56	1,677,062,758	144,400	1,605,583,600	1.29
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	22,907	73,092.89	1,674,338,831	70,000	1,603,490,000	1.29
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	4,104	377,553.65	1,549,480,179	383,000	1,571,832,000	1.26
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	12,049	127,391.49	1,534,940,063	117,200	1,412,142,800	1.13

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	95.12
合計	95.12

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	3,165	円	5,450,750,630	5,510,265,000	4.43

(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	90,338,401,973	76.54
	オーストラリア	9,008,896,953	7.63
	イギリス	6,068,070,392	5.14
	シンガポール	3,801,785,777	3.22
	フランス	2,345,887,770	1.99
	カナダ	1,672,943,154	1.42
	ベルギー	1,306,633,672	1.11
	香港	1,099,190,455	0.93
	スペイン	557,420,624	0.47
	ニュージーランド	336,034,445	0.28
	ガンジー	282,352,303	0.24
	オランダ	224,398,287	0.19
	韓国	222,656,767	0.19
	イスラエル	131,623,913	0.11
	アイルランド	44,373,701	0.04
	ドイツ	41,900,006	0.04
イタリア	11,393,416	0.01	
	小計	117,493,963,608	99.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		532,574,409	0.45
合計(純資産総額)		118,026,538,017	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		133,610,272	0.11
	売建		225,045,138	0.19

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

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

## 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	528,280	16,290.21	8,605,794,823	16,860.52	8,907,076,457	7.55
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	53,722	118,818.46	6,383,165,588	119,221.14	6,404,798,416	5.43
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	316,798	13,315.90	4,218,452,680	16,010.99	5,072,249,927	4.30
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	186,640	18,048.53	3,368,578,631	23,266.48	4,342,456,872	3.68
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	184,946	20,251.83	3,745,496,722	22,576.82	4,175,494,327	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	476,388	7,894.46	3,760,826,097	8,111.29	3,864,123,602	3.27
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	90,452	38,837.03	3,512,887,689	42,043.93	3,802,958,244	3.22
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	990,556	2,383.50	2,360,996,448	3,551.94	3,518,396,964	2.98
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	121,186	18,708.74	2,267,237,780	22,206.92	2,691,168,195	2.28
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	593,334	4,418.59	2,621,702,952	4,398.12	2,609,556,743	2.21
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,963	26,192.82	2,120,649,399	29,777.46	2,410,872,915	2.04
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	166,732	9,332.89	1,556,092,712	12,482.77	2,081,277,808	1.76
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	197,133	8,467.93	1,669,309,403	10,015.68	1,974,422,228	1.67
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	230,413	6,607.86	1,522,537,654	7,680.25	1,769,631,747	1.50
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	328,936	4,909.77	1,615,001,199	5,333.86	1,754,499,297	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,101	15,032.21	1,354,417,602	18,228.86	1,642,438,695	1.39
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	36,819	32,788.90	1,207,254,851	40,062.74	1,475,070,171	1.25
イギリス	投資証券	SEGO PLC	763,335	1,574.92	1,202,193,772	1,825.63	1,393,569,612	1.18
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,945	18,847.05	1,261,715,862	20,354.25	1,362,615,695	1.15
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	71,463	17,987.33	1,285,428,795	18,474.94	1,320,274,909	1.12
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	406,848	2,505.74	1,019,455,727	3,042.32	1,237,763,191	1.05
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	405,640	2,571.90	1,043,269,551	2,791.53	1,132,360,042	0.96
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	379,605	2,779.00	1,054,922,371	2,954.54	1,121,561,573	0.95
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	124,616	8,523.52	1,062,167,118	8,789.97	1,095,372,048	0.93
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	152,126	7,043.89	1,071,559,662	6,940.44	1,055,822,471	0.89
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	106,209	10,169.29	1,080,070,249	9,811.92	1,042,114,636	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	172,399	5,042.32	869,291,925	5,935.74	1,023,316,295	0.87
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	181,189	5,410.66	980,352,945	5,587.78	1,012,444,452	0.86
香港	投資証券	LINK REIT	1,458,800	788.17	1,149,794,892	680.69	993,001,513	0.84
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	60,693	13,686.58	830,679,904	15,832.30	960,910,233	0.81

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.55
合計	99.55

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

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	700,000.00	110,264,000	109,667,740	0.09
	イギリスポンド	買建	120,000.00	23,994,720	23,942,532	0.02
	アメリカドル	売建	1,070,000.00	167,604,800	167,609,401	0.14
	カナダドル	売建	40,000.00	4,579,560	4,579,544	0.00
	ユーロ	売建	80,000.00	13,575,120	13,576,344	0.01
	イギリスポンド	売建	150,000.00	29,922,150	29,923,710	0.03
	オーストラリアドル	売建	90,000.00	9,355,230	9,356,139	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REITインデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	メキシコ	148,102,084	26.74
	南アフリカ	113,525,920	20.50
	インド	101,100,603	18.25
	トルコ	39,629,667	7.16
	タイ	38,647,550	6.98
	マレーシア	34,018,796	6.14
	サウジアラビア	29,218,098	5.28
	フィリピン	15,802,334	2.85
	香港	3,679,175	0.66
	小計	523,724,227	94.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		30,105,259	5.44
合計(純資産総額)		553,829,486	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	投資 比率 (%)
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	271,800	267.33	72,661,501	225.51	61,293,788	11.07
インド	投資証券	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	85,139	589.70	50,206,798	655.58	55,815,792	10.08
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	66,813	594.52	39,722,302	604.28	40,373,760	7.29
南アフリ カ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	331,563	81.35	26,975,272	92.26	30,591,262	5.52
メキシコ	投資証券	PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	73,400	277.30	20,354,071	351.85	25,826,468	4.66
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	71,741	264.88	19,002,777	287.25	20,608,068	3.72
南アフリ カ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	668,697	29.07	19,444,773	29.83	19,949,104	3.60
インド	投資証券	NEXUS SELECT TRUST	81,770	254.66	20,823,588	237.45	19,417,071	3.51
インド	投資証券	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	20,572	604.04	12,426,393	656.83	13,512,342	2.44
インド	投資証券	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	25,151	439.74	11,060,059	491.24	12,355,398	2.23
南アフリ カ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	84,295	106.92	9,013,563	124.94	10,532,306	1.90
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	232,600	42.64	9,919,039	43.02	10,007,847	1.81
南アフリ カ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	27,992	319.11	8,932,538	352.71	9,873,176	1.78
マレーシ ア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	191,200	49.30	9,427,572	51.30	9,809,771	1.77
マレーシ ア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	160,000	60.29	9,646,415	61.30	9,808,171	1.77
マレーシ ア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	156,700	57.30	8,979,407	60.30	9,449,260	1.71
タイ	投資証券	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	238,700	42.79	10,214,939	37.70	8,999,229	1.62
南アフリ カ	投資証券	EQUITES PROPERTY FUND LTD	77,297	104.23	8,056,674	107.93	8,343,005	1.51
南アフリ カ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	35,975	241.09	8,673,307	231.28	8,320,586	1.50
フィリピ ン	投資証券	AREIT INC	89,520	90.02	8,058,600	89.29	7,993,978	1.44
タイ	投資証券	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	147,600	49.84	7,356,679	53.25	7,859,700	1.42
サウジア ラビア	投資証券	AL RAJHI REIT	21,664	357.81	7,751,758	352.37	7,633,895	1.38
トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	162,152	34.98	5,672,204	44.37	7,194,785	1.30
南アフリ カ	投資証券	ATTACQ LTD	75,086	71.23	5,348,376	82.54	6,197,824	1.12
タイ	投資証券	NIHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,800	40.47	6,507,576	36.63	5,891,069	1.06
南アフリ カ	投資証券	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	250,024	16.17	4,043,738	21.20	5,300,859	0.96
マレーシ ア	投資証券	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	107,700	39.97	4,305,734	45.97	4,951,594	0.89
フィリピ ン	投資証券	RL COMMERCIAL REIT INC	362,700	12.83	4,654,631	13.36	4,848,574	0.88
南アフリ カ	投資証券	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	43,727	101.23	4,426,502	109.94	4,807,591	0.87
サウジア ラビア	投資証券	SEDCO CAPITAL REIT FUND	14,489	343.91	4,982,998	326.01	4,723,581	0.85

(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	94.56
合計	94.56

(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。

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2014年11月28日  
作成基準日：2024年5月31日



### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 16,866円  
純資産総額 31.10億円

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2022年4月	0円
2022年10月	0円
2023年4月	0円
2023年10月	0円
2024年4月	0円
設定来 分配金合計額	0円

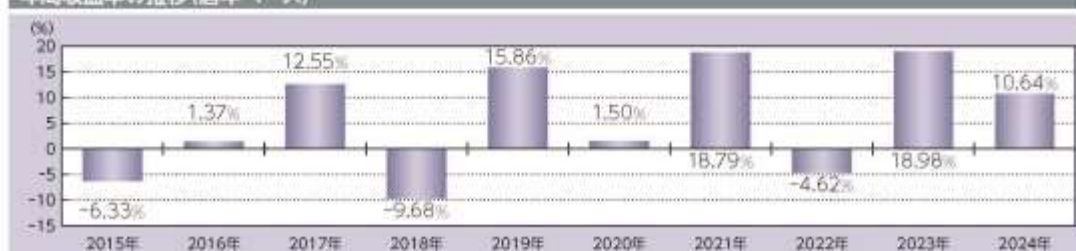
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	24.0%	MICROSOFT CORP APPLE INC	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス ソフトウェア・サービス/ハードウェア	-	-	1.1% 1.1%
外国債券インデックスマザーファンド	20.8%	T 1.5% 08/15/26 T 4.375% 08/31/28	アメリカ	国債	-	1.500% 4.375%	2026/08/15 2028/08/31	0.1% 0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	14.0%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC TENCENT HOLDINGS LTD	台湾 アジア圏	株式	半導体・半導体製造装置 メディア・娯楽	-	-	1.1% 0.6%
新興国債券インデックスマザーファンド	13.9%	BNTNF 10% 01/01/27 BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	国債	-	10.000% 0.000%	2027/01/01 2026/01/01	0.2% 0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	10.6%	PROLOGIS INC EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8% 0.6%
新興国REITインデックスマザーファンド	6.5%	FERRANO ADMINISTRACION SA EMBASSY OFFICE PARKS REIT	メキシコ インド	投資証券	-	-	-	0.7% 0.7%
国内株式インデックスマザーファンド	4.6%	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% 0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	3.1%	第350回利付国債(10年) 第370回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100% 0.500%	2028/03/20 2033/03/20	0.0% 0.0%
J-REITインデックスマザーファンド	1.6%	日本ビルファンド投資法人 ジャパンプラザリート投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1% 0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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、ベンチマークは有りません。

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。

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半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受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、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。

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半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。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、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ないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

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

#### < 一部解約の制限 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3 【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### < 基準価額の算出方法 >

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

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2014年11月28日設定）

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

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年4月21日から10月20日まで及び10月21日から翌年4月20日までとします。

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

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

#### （５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

## < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

## < 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 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19期計算期間(2023年10月21日から2024年4月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT インデックスバランス・オープン】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第18期 (2023年10月20日現在)	第19期 (2024年4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,136,445	30,392,987
親投資信託受益証券	2,655,724,348	2,831,229,614
未収入金	10,200,000	6,820,000
未収利息	-	55
流動資産合計	2,694,060,793	2,868,442,656
資産合計	2,694,060,793	2,868,442,656
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,790,227	750,854
未払受託者報酬	750,817	767,634
未払委託者報酬	6,757,314	6,908,630
未払利息	12	-
その他未払費用	75,016	76,701
流動負債合計	11,373,386	8,503,819
負債合計	11,373,386	8,503,819
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,861,663,164	1,766,633,466
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	821,024,243	1,093,305,371
(分配準備積立金)	737,384,869	932,815,986
元本等合計	2,682,687,407	2,859,938,837
純資産合計	2,682,687,407	2,859,938,837
負債純資産合計	2,694,060,793	2,868,442,656



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期		第19期	
	自	2023年 4月21日	自	2023年10月21日
	至	2023年10月20日	至	2024年 4月22日
<b>営業収益</b>				
受取利息		70		1,804
有価証券売買等損益		172,487,503		324,835,266
営業収益合計		172,487,573		324,837,070
<b>営業費用</b>				
支払利息		9,052		2,042
受託者報酬		750,817		767,634
委託者報酬		6,757,314		6,908,630
その他費用		75,016		76,701
営業費用合計		7,592,199		7,755,007
営業利益又は営業損失（ ）		164,895,374		317,082,063
経常利益又は経常損失（ ）		164,895,374		317,082,063
当期純利益又は当期純損失（ ）		164,895,374		317,082,063
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（ ）		9,687,083		22,881,368
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		685,372,836		821,024,243
剰余金増加額又は欠損金減少額		27,880,833		80,544,176
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		27,880,833		80,544,176
剰余金減少額又は欠損金増加額		47,437,717		102,463,743
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		47,437,717		102,463,743
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		821,024,243		1,093,305,371

## (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4月21日から10月20日まで、及び10月21日から翌年4月20日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第19期計算期間は2023年10月21日から2024年4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第18期 (2023年10月20日現在)	第19期 (2024年4月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,861,663,164口	1,766,633,466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) 1.4410円 (14,410円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6189円 (16,189円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2023年 4月21日 至 2023年10月20日			第19期 自 2023年10月21日 至 2024年 4月22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	40,992,656円	費用控除後の配当等収益額	A	40,536,843円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	245,090,035円
収益調整金額	C	285,179,970円	収益調整金額	C	323,791,126円
分配準備積立金額	D	696,392,213円	分配準備積立金額	D	647,189,108円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,022,564,839円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,256,607,112円
当ファンドの期末残存口数	F	1,861,663,164口	当ファンドの期末残存口数	F	1,766,633,466口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,492円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	7,113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19期 自 2023年10月21日 至 2024年 4月22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19期 (2024年 4月22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19期 (2024年 4月22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18期 自 2023年 4月21日 至 2023年10月20日	第19期 自 2023年10月21日 至 2024年 4月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,931,310,702円	1,861,663,164円
期中追加設定元本額	64,015,814円	137,192,336円
期中一部解約元本額	133,663,352円	232,222,034円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第18期 (2023年10月20日現在)	第19期 (2024年 4月22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	165,802,424	304,813,897
合計	165,802,424	304,813,897

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	23,028,447	48,663,714	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	107,058,644	296,113,503	
	新興国株式インデックス マザーファンド	91,477,552	389,685,223	
	国内株式インデックス マザーファンド	47,941,148	132,399,068	
	外国株式インデックス マザーファンド	110,578,220	679,326,236	
	国内債券インデックス マザーファンド	69,136,079	91,238,883	
	外国債券インデックス マザーファンド	170,004,646	602,615,468	
	新興国債券インデックス マザーファンド	176,629,559	400,295,569	
	新興国REITインデックス マザーファンド	219,164,122	190,891,950	
合計		1,015,018,417	2,831,229,614	

(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	2024年 4月22日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,286,422,747
株式	630,541,004,260
派生商品評価勘定	2,115,600
未収入金	2,833,527,322
未収配当金	6,406,379,582
未収利息	9,615
前払金	344,252,000
差入委託証拠金	658,068,419
流動資産合計	646,071,779,545
資産合計	
646,071,779,545	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	346,581,550
未払金	2,523,300
未払解約金	3,565,302,430
流動負債合計	3,914,407,280
負債合計	
3,914,407,280	
純資産の部	
元本等	
元本	232,518,945,423
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	409,638,426,842
元本等合計	642,157,372,265
純資産合計	
642,157,372,265	
負債純資産合計	
646,071,779,545	

##### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 4月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2024年 4月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	232,518,945,423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) 2,7617円 (27,617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

2024年 4月22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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</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

2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	242,540,893,459円
期中追加設定元本額	12,345,051,166円
期中一部解約元本額	22,366,999,202円
期末元本額	232,518,945,423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）	269,211,104円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,257,729,963円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,644,363円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,628,918,013円
世界経済インデックスファンド	5,844,624,950円
日本株式インデックス・オープン	2,836,040,889円
DCマイセレクション25	4,750,567,445円
DCマイセレクション50	15,573,552,203円
DCマイセレクション75	17,846,399,856円
DC日本株式インデックス・オープン	6,016,237,044円
DCマイセレクションS25	2,868,560,087円
DCマイセレクションS50	9,033,614,075円
DCマイセレクションS75	8,382,058,265円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,477,454,978円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	57,132,285円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	552,530,482円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	448,207,007円
DC世界経済インデックスファンド	3,931,022,860円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	720,012,452円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,269,905円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,318,124円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,243,691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）	135,928,509円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,797,454円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	62,015,718円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,686,156円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	39,888,720円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	424,263,770円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	288,862,890円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,961,549,269円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	26,054,951円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,703,073円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	293,169,744円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	165,461,392円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	218,405,189円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	16,037,940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）	364,341,677円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,407,483,902円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,896,227,259円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,366,846円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,674,382,755円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	649,883,771円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	414,552,916円
コア投資戦略ファンド（切替型）	577,662,435円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	184,988,882円

区分	2024年 4月22日現在
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,477,188円
SMT インデックスバランス・オープン	47,941,148円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	15,335,497,398円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	239,439,855円
SMT 世界経済インデックス・オープン	51,389,845円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	233,075,528円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	38,211,528円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,819,142円
グローバル経済コア	258,954,838円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	32,438,274円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	2,168,743,421円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,159,715円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	485,317,449円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	123,670,049円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	61,777,463円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	59,509,701円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	26,336,450円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	31,656,184円
10資産分散投資ファンド	114,036,459円
グローバル10資産バランスファンド	29,780,598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)	41,551,905,155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)	271,678,912円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	290,128,144円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,110,485円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	101,460,924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)	48,486,662,157円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	15,742,029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)	202,778,927円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		117,328,298,760
合計		117,328,298,760

(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

(2024年 4月22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	10,703,322,000	-	10,359,070,000	344,252,000
	合計	10,703,322,000	-	10,359,070,000	344,252,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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	9,300	3,590.00	33,387,000	
ニッスイ	235,200	957.60	225,227,520	
マルハニチロ	34,900	3,068.00	107,073,200	
雪国まいたけ	20,000	972.00	19,440,000	
カネコ種苗	6,600	1,405.00	9,273,000	
サカタのタネ	26,800	3,600.00	96,480,000	
ホクト	18,800	1,824.00	34,291,200	
ホクリヨウ	1,700	1,006.00	1,710,200	
住石ホールディングス	26,600	1,339.00	35,617,400	
日鉄鉱業	9,400	4,720.00	44,368,000	
三井松島ホールディングス	13,900	3,095.00	43,020,500	
I N P E X	789,900	2,389.50	1,887,466,050	
石油資源開発	27,300	6,750.00	184,275,000	
K & O エナジーグループ	10,700	3,410.00	36,487,000	
ショーボンドホールディングス	32,000	6,018.00	192,576,000	
ミライト・ワン	71,000	1,913.00	135,823,000	
タマホーム	14,800	4,215.00	62,382,000	
サンヨーホームズ	1,300	736.00	956,800	
日本アクア	4,400	961.00	4,228,400	
ファーストコーポレーション	3,000	857.00	2,571,000	
ベステラ	2,500	927.00	2,317,500	
キャンディル	1,900	592.00	1,124,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,100	899.00	1,887,900	
第一カッター興業	6,800	1,491.00	10,138,800	
安藤・間	136,300	1,162.00	158,380,600	
東急建設	73,700	797.00	58,738,900	
コムシスホールディングス	75,100	3,687.00	276,893,700	
ピーアールホールディングス	34,500	362.00	12,489,000	
高松コンストラクショングループ	17,500	2,564.00	44,870,000	
東建コーポレーション	5,900	10,580.00	62,422,000	
ソネック	1,100	921.00	1,013,100	
ヤマウラ	11,900	1,350.00	16,065,000	
オリエンタル白石	87,100	372.00	32,401,200	



大成建設	154,000	5,358.00	825,132,000
大林組	588,400	1,721.50	1,012,930,600
清水建設	466,500	925.70	431,839,050
飛島建設	17,000	1,355.00	23,035,000
長谷工コーポレーション	151,000	1,835.50	277,160,500
松井建設	15,300	851.00	13,020,300
銭高組	1,100	3,920.00	4,312,000
鹿島建設	364,800	2,873.50	1,048,252,800
不動テトラ	11,400	2,146.00	24,464,400
大末建設	2,900	1,541.00	4,468,900
鉄建建設	11,800	2,724.00	32,143,200
西松建設	31,400	4,357.00	136,809,800
三井住友建設	122,500	404.00	49,490,000
大豊建設	5,700	3,190.00	18,183,000
佐田建設	4,700	719.00	3,379,300
ナカノフドー建設	5,200	611.00	3,177,200
奥村組	26,700	4,790.00	127,893,000
東鉄工業	20,400	3,020.00	61,608,000
イチケン	1,800	2,348.00	4,226,400
富士ピー・エス	3,300	449.00	1,481,700
浅沼組	12,200	3,730.00	45,506,000
戸田建設	222,700	988.20	220,072,140
熊谷組	27,200	4,065.00	110,568,000
北野建設	1,400	3,315.00	4,641,000
植木組	2,100	1,561.00	3,278,100
矢作建設工業	22,400	1,427.00	31,964,800
ピーエス三菱	20,900	977.00	20,419,300
日本ハウスホールディングス	35,100	325.00	11,407,500
新日本建設	23,100	1,571.00	36,290,100
東亜道路工業	32,700	1,252.00	40,940,400
日本道路	19,300	1,813.00	34,990,900
東亜建設工業	50,800	1,071.00	54,406,800
日本国土開発	46,800	505.00	23,634,000
若築建設	5,700	3,345.00	19,066,500
東洋建設	41,400	1,245.00	51,543,000
五洋建設	233,300	774.60	180,714,180
世紀東急工業	21,100	1,786.00	37,684,600
福田組	6,200	5,250.00	32,550,000
住友林業	142,200	4,508.00	641,037,600
日本基礎技術	4,400	503.00	2,213,200
巴コーポレーション	9,200	705.00	6,486,000
大和ハウス工業	455,000	4,322.00	1,966,510,000

ライト工業	32,700	2,045.00	66,871,500
積水ハウス	499,000	3,435.00	1,714,065,000
日特建設	15,700	1,129.00	17,725,300
北陸電気工事	11,300	1,183.00	13,367,900
ユアテック	36,200	1,368.00	49,521,600
日本リーテック	12,900	1,269.00	16,370,100
四電工	6,900	3,810.00	26,289,000
中電工	25,500	3,160.00	80,580,000
関電工	103,000	1,839.00	189,417,000
きんでん	114,400	3,047.00	348,576,800
東京エネシス	15,400	1,326.00	20,420,400
トーエネック	5,500	5,410.00	29,755,000
住友電設	15,600	3,360.00	52,416,000
日本電設工業	30,900	2,111.00	65,229,900
エクシオグループ	160,800	1,681.50	270,385,200
新日本空調	10,700	3,925.00	41,997,500
九電工	35,600	6,927.00	246,601,200
三機工業	35,500	2,129.00	75,579,500
日揮ホールディングス	162,800	1,493.50	243,141,800
中外炉工業	5,400	2,756.00	14,882,400
ヤマト	6,100	993.00	6,057,300
太平電業	10,200	4,420.00	45,084,000
高砂熱学工業	44,100	5,320.00	234,612,000
三晃金属工業	1,000	4,705.00	4,705,000
朝日工業社	15,400	1,517.00	23,361,800
明星工業	31,800	1,227.00	39,018,600
大気社	19,000	4,640.00	88,160,000
ダイダン	21,600	2,653.00	57,304,800
日比谷総合設備	11,900	2,814.00	33,486,600
フィル・カンパニー	2,500	671.00	1,677,500
テスホールディングス	35,400	445.00	15,753,000
インフロニア・ホールディングス	189,700	1,384.50	262,639,650
東洋エンジニアリング	24,200	923.00	22,336,600
レイズネクスト	23,800	2,010.00	47,838,000
ニッポン	49,500	2,385.00	118,057,500
日清製粉グループ本社	152,800	2,041.00	311,864,800
日東富士製粉	2,900	5,210.00	15,109,000
昭和産業	16,000	3,465.00	55,440,000
鳥越製粉	6,500	685.00	4,452,500
中部飼料	22,900	1,173.00	26,861,700
フィード・ワン	24,100	996.00	24,003,600
東洋精糖	1,400	2,219.00	3,106,600

日本甜菜製糖	9,600	1,973.00	18,940,800
D M三井製糖ホールディングス	16,400	3,025.00	49,610,000
塩水港精糖	9,700	273.00	2,648,100
ウェルネオシュガー	8,200	2,168.00	17,777,600
森永製菓	70,700	2,530.50	178,906,350
中村屋	4,100	3,125.00	12,812,500
江崎グリコ	47,200	4,170.00	196,824,000
名糖産業	6,500	1,741.00	11,316,500
井村屋グループ	9,900	2,385.00	23,611,500
不二家	11,300	2,463.00	27,831,900
山崎製パン	110,600	3,715.00	410,879,000
第一屋製パン	1,400	720.00	1,008,000
モロゾフ	5,300	4,010.00	21,253,000
亀田製菓	9,500	4,070.00	38,665,000
寿スピリッツ	78,100	1,653.00	129,099,300
カルビー	75,600	3,397.00	256,813,200
森永乳業	57,700	3,059.00	176,504,300
六甲バター	12,100	1,453.00	17,581,300
ヤクルト本社	236,100	3,101.00	732,146,100
明治ホールディングス	202,500	3,511.00	710,977,500
雪印メグミルク	39,900	2,612.00	104,218,800
プリマハム	22,200	2,273.00	50,460,600
日本ハム	71,100	5,231.00	371,924,100
林兼産業	2,500	595.00	1,487,500
丸大食品	16,600	1,626.00	26,991,600
S Foods	18,200	3,065.00	55,783,000
柿安本店	6,400	3,180.00	20,352,000
伊藤ハム米久ホールディングス	25,200	4,100.00	103,320,000
サッポロホールディングス	54,400	5,772.00	313,996,800
アサヒグループホールディングス	381,700	5,473.00	2,089,044,100
キリンホールディングス	688,100	2,268.00	1,560,610,800
宝ホールディングス	111,400	1,015.00	113,071,000
オエノンホールディングス	49,400	347.00	17,141,800
養命酒製造	5,400	2,205.00	11,907,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,400	2,192.50	283,709,500
ライフドリンク カンパニー	2,500	4,725.00	11,812,500
サントリー食品インターナショナル	116,300	5,122.00	595,688,600
ダイドーグループホールディングス	18,700	2,679.00	50,097,300
伊藤園	56,000	3,751.00	210,056,000
キーコーヒー	18,500	2,013.00	37,240,500
ユニカフェ	2,400	912.00	2,188,800
ジャパンフーズ	1,200	1,399.00	1,678,800

日清オイリオグループ	23,300	5,070.00	118,131,000
不二製油グループ本社	38,500	2,329.50	89,685,750
かどや製油	900	3,600.00	3,240,000
J・オイルミルズ	18,900	1,966.00	37,157,400
キッコーマン	547,400	1,920.50	1,051,281,700
味の素	392,500	5,564.00	2,183,870,000
ブルドックソース	8,800	2,020.00	17,776,000
キューピー	88,800	3,122.00	277,233,600
ハウス食品グループ本社	56,900	3,087.00	175,650,300
カゴメ	71,000	3,686.00	261,706,000
アリアケジャパン	16,500	5,080.00	83,820,000
ピエトロ	1,000	1,793.00	1,793,000
エバラ食品工業	3,900	2,811.00	10,962,900
やまみ	900	3,610.00	3,249,000
ニチレイ	75,700	3,918.00	296,592,600
東洋水産	83,500	9,242.00	771,707,000
イトアンドホールディングス	7,800	1,971.00	15,373,800
大冷	1,100	1,903.00	2,093,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,500	1,477.00	11,077,500
日清食品ホールディングス	174,200	4,251.00	740,524,200
永谷園ホールディングス	8,100	2,264.00	18,338,400
一正蒲鉾	3,100	758.00	2,349,800
フジッコ	17,000	1,895.00	32,215,000
ロック・フィールド	20,200	1,604.00	32,400,800
日本たばこ産業	1,003,800	4,149.00	4,164,766,200
ケンコーマヨネーズ	11,400	2,233.00	25,456,200
わらべや日洋ホールディングス	11,100	2,414.00	26,795,400
なとり	10,400	2,101.00	21,850,400
イフジ産業	1,400	1,404.00	1,965,600
ファーマフーズ	23,700	833.00	19,742,100
ユーグレナ	102,800	505.00	51,914,000
紀文食品	14,300	1,143.00	16,344,900
ピクルスホールディングス	9,700	1,172.00	11,368,400
ミヨシ油脂	2,800	1,241.00	3,474,800
理研ビタミン	14,300	2,757.00	39,425,100
片倉工業	15,800	1,830.00	28,914,000
ゲンゼ	12,000	5,230.00	62,760,000
東洋紡	73,200	1,108.00	81,105,600
ユニチカ	57,200	218.00	12,469,600
富士紡ホールディングス	7,500	4,070.00	30,525,000
倉敷紡績	12,100	3,475.00	42,047,500
シキボウ	8,900	1,059.00	9,425,100

日本毛織	43,500	1,311.00	57,028,500
トーア紡コーポレーション	2,900	437.00	1,267,300
帝国繊維	19,200	2,221.00	42,643,200
帝人	161,800	1,512.50	244,722,500
東レ	1,126,700	724.50	816,294,150
住江織物	1,600	2,648.00	4,236,800
日本フェルト	5,400	429.00	2,316,600
イチカワ	1,200	1,816.00	2,179,200
日東製網	800	1,761.00	1,408,800
アツギ	5,400	598.00	3,229,200
ダイニック	2,300	740.00	1,702,000
セーレン	32,700	2,697.00	88,191,900
ソトー	2,500	694.00	1,735,000
東海染工	800	820.00	656,000
小松マテーレ	24,500	744.00	18,228,000
ワコールホールディングス	34,500	3,456.00	119,232,000
ホギメディカル	22,200	3,640.00	80,808,000
T S Iホールディングス	54,700	868.00	47,479,600
マツオカコーポレーション	2,300	1,432.00	3,293,600
ワールド	23,800	2,095.00	49,861,000
三陽商会	6,300	2,801.00	17,646,300
ナイガイ	2,800	256.00	716,800
オンワードホールディングス	99,200	623.00	61,801,600
ルックホールディングス	4,700	2,966.00	13,940,200
ゴールドウイン	29,800	9,355.00	278,779,000
デサント	29,000	3,350.00	97,150,000
キング	2,900	701.00	2,032,900
ヤマトインターナショナル	6,100	346.00	2,110,600
特種東海製紙	9,200	3,650.00	33,580,000
王子ホールディングス	700,000	639.80	447,860,000
日本製紙	94,800	1,120.00	106,176,000
三菱製紙	10,100	578.00	5,837,800
北越コーポレーション	82,600	1,408.00	116,300,800
中越パルプ工業	3,000	1,688.00	5,064,000
大王製紙	74,200	1,130.00	83,846,000
阿波製紙	2,000	478.00	956,000
レンゴー	153,000	1,156.50	176,944,500
トーモク	9,700	2,563.00	24,861,100
ザ・パック	12,500	3,625.00	45,312,500
北の達人コーポレーション	70,800	177.00	12,531,600
クラレ	244,900	1,693.00	414,615,700
旭化成	1,136,800	1,108.50	1,260,142,800

共和レザー	4,300	796.00	3,422,800
巴川コーポレーション	2,100	948.00	1,990,800
レゾナック・ホールディングス	162,400	3,735.00	606,564,000
住友化学	1,247,000	357.50	445,802,500
住友精化	7,900	4,965.00	39,223,500
日産化学	78,900	5,551.00	437,973,900
ラサ工業	6,500	2,643.00	17,179,500
クレハ	36,700	2,726.00	100,044,200
多木化学	6,500	3,775.00	24,537,500
テイカ	14,300	1,405.00	20,091,500
石原産業	27,900	1,790.00	49,941,000
片倉コープアグリ	1,800	1,099.00	1,978,200
日本曹達	19,800	5,740.00	113,652,000
東ソー	224,300	2,134.00	478,656,200
トクヤマ	54,300	2,829.50	153,641,850
セントラル硝子	17,900	2,759.00	49,386,100
東亜合成	80,800	1,602.50	129,482,000
大阪ソーダ	11,700	8,830.00	103,311,000
関東電化工業	32,500	988.00	32,110,000
デンカ	61,100	2,277.50	139,155,250
信越化学工業	1,506,900	6,116.00	9,216,200,400
日本カーバイド工業	7,100	1,789.00	12,701,900
堺化学工業	12,800	2,022.00	25,881,600
第一稀元素化学工業	18,400	938.00	17,259,200
エア・ウォーター	158,600	2,318.50	367,714,100
日本酸素ホールディングス	163,000	4,332.00	706,116,000
日本化学工業	6,200	2,409.00	14,935,800
東邦アセチレン	7,900	362.00	2,859,800
日本パーカライズン	74,900	1,194.00	89,430,600
高压ガス工業	24,400	856.00	20,886,400
チタン工業	1,000	1,050.00	1,050,000
四国化成ホールディングス	21,500	1,719.00	36,958,500
戸田工業	3,800	2,040.00	7,752,000
ステラ ケミファ	9,100	3,700.00	33,670,000
保土谷化学工業	5,300	4,160.00	22,048,000
日本触媒	97,900	1,487.50	145,626,250
大日精化工業	11,700	2,764.00	32,338,800
カネカ	42,700	3,969.00	169,476,300
三菱瓦斯化学	122,700	2,782.00	341,351,400
三井化学	138,600	4,433.00	614,413,800
東京応化工業	80,200	4,045.00	324,409,000
大阪有機化学工業	14,100	3,140.00	44,274,000

三菱ケミカルグループ	1,228,500	916.20	1,125,551,700
KHネオケム	25,600	2,349.00	60,134,400
ダイセル	216,000	1,424.50	307,692,000
住友ベークライト	47,100	4,293.00	202,200,300
積水化学工業	337,600	2,252.50	760,444,000
日本ゼオン	115,200	1,405.00	161,856,000
アイカ工業	42,400	3,670.00	155,608,000
UBE	80,000	2,780.00	222,400,000
積水樹脂	25,100	2,590.00	65,009,000
タキロンシーアイ	42,900	641.00	27,498,900
旭有機材	11,200	4,880.00	54,656,000
ニチバン	9,100	1,927.00	17,535,700
リケンテクノス	31,500	971.00	30,586,500
大倉工業	7,800	3,125.00	24,375,000
積水化成成品工業	23,600	474.00	11,186,400
群栄化学工業	4,000	3,485.00	13,940,000
タイガースポリマー	3,400	1,063.00	3,614,200
ミライアル	2,500	1,441.00	3,602,500
ダイキアクシス	3,100	726.00	2,250,600
ダイキョーニシカワ	37,100	726.00	26,934,600
竹本容器	2,800	802.00	2,245,600
森六ホールディングス	8,700	2,646.00	23,020,200
恵和	12,100	1,084.00	13,116,400
日本化薬	128,400	1,281.50	164,544,600
カーリットホールディングス	18,100	1,090.00	19,729,000
日本精化	11,100	2,366.00	26,262,600
扶桑化学工業	17,800	4,045.00	72,001,000
トリケミカル研究所	20,400	3,975.00	81,090,000
ADEKA	58,600	3,165.00	185,469,000
日油	152,100	2,080.50	316,444,050
新日本理化	10,300	174.00	1,792,200
ハリマ化成グループ	10,500	907.00	9,523,500
花王	380,000	6,451.00	2,451,380,000
第一工業製薬	6,700	3,305.00	22,143,500
石原ケミカル	7,500	1,743.00	13,072,500
日華化学	3,000	988.00	2,964,000
ニイタカ	1,500	1,913.00	2,869,500
三洋化成工業	10,300	4,140.00	42,642,000
有機合成薬品工業	6,100	292.00	1,781,200
大日本塗料	18,600	1,162.00	21,613,200
日本ペイントホールディングス	892,300	975.60	870,527,880
関西ペイント	164,700	2,061.00	339,446,700

神東塗料	6,200	126.00	781,200
中国塗料	34,500	1,993.00	68,758,500
日本特殊塗料	5,300	1,376.00	7,292,800
藤倉化成	19,400	458.00	8,885,200
太陽ホールディングス	29,300	3,050.00	89,365,000
D I C	65,700	2,900.00	190,530,000
サカタインクス	37,400	1,557.00	58,231,800
a r t i e n c e	36,600	2,915.00	106,689,000
富士フィルムホールディングス	936,400	3,347.00	3,134,130,800
資生堂	351,300	4,229.00	1,485,647,700
ライオン	214,100	1,388.00	297,170,800
高砂香料工業	12,600	3,365.00	42,399,000
マンダム	36,300	1,311.00	47,589,300
ミルボン	22,900	3,069.00	70,280,100
ファンケル	73,600	1,849.50	136,123,200
コーセー	34,200	7,970.00	272,574,000
コタ	17,000	1,424.00	24,208,000
シーボン	1,000	1,418.00	1,418,000
ポーラ・オルビスホールディングス	86,200	1,442.50	124,343,500
ノエビアホールディングス	15,000	5,220.00	78,300,000
アジュバンホールディングス	1,800	858.00	1,544,400
新日本製薬	9,600	1,684.00	16,166,400
I - n e	3,300	1,701.00	5,613,300
アクシージア	8,300	870.00	7,221,000
エステー	13,000	1,537.00	19,981,000
アグロ カネショウ	6,700	1,092.00	7,316,400
コニシ	48,600	1,399.00	67,991,400
長谷川香料	32,200	3,060.00	98,532,000
小林製薬	49,000	5,696.00	279,104,000
荒川化学工業	14,300	1,086.00	15,529,800
メック	13,900	3,760.00	52,264,000
日本高純度化学	3,800	3,110.00	11,818,000
タカラバイオ	45,300	989.00	44,801,700
J C U	18,600	3,655.00	67,983,000
新田ゼラチン	5,100	700.00	3,570,000
O A T アグリオ	5,600	2,011.00	11,261,600
デクセリアルズ	42,200	5,619.00	237,121,800
アース製薬	15,300	4,365.00	66,784,500
北興化学工業	16,900	1,454.00	24,572,600
大成ラミック	4,900	2,894.00	14,180,600
クミアイ化学工業	66,800	807.00	53,907,600
日本農薬	30,900	732.00	22,618,800



アキレス	10,600	1,525.00	16,165,000
有沢製作所	29,500	1,504.00	44,368,000
日東電工	108,100	13,855.00	1,497,725,500
レック	21,500	1,098.00	23,607,000
三光合成	21,200	654.00	13,864,800
きもと	12,400	208.00	2,579,200
藤森工業	13,300	4,240.00	56,392,000
前澤化成工業	10,900	1,700.00	18,530,000
未来工業	6,000	3,835.00	23,010,000
ウェーブロックホールディングス	2,800	672.00	1,881,600
J S P	11,800	2,316.00	27,328,800
エフピコ	31,800	2,647.00	84,174,600
天馬	12,200	2,187.00	26,681,400
信越ポリマー	36,300	1,473.00	53,469,900
東リ	16,600	372.00	6,175,200
ニフコ	50,300	3,769.00	189,580,700
バルカー	14,100	4,400.00	62,040,000
ユニ・チャーム	350,500	4,653.00	1,630,876,500
ショーエイコーポレーション	2,400	581.00	1,394,400
協和キリン	203,300	2,656.00	539,964,800
武田薬品工業	1,489,100	4,128.00	6,147,004,800
アステラス製薬	1,475,900	1,476.00	2,178,428,400
住友ファーマ	124,800	415.00	51,792,000
塩野義製薬	212,100	7,267.00	1,541,330,700
わかもと製薬	7,900	232.00	1,832,800
日本新薬	44,100	4,288.00	189,100,800
中外製薬	526,700	5,150.00	2,712,505,000
科研製薬	28,800	3,458.00	99,590,400
エーザイ	204,700	6,092.00	1,247,032,400
ロート製薬	163,000	2,975.00	484,925,000
小野薬品工業	357,100	2,292.50	818,651,750
久光製薬	37,400	3,774.00	141,147,600
持田製薬	19,300	3,150.00	60,795,000
参天製薬	306,600	1,471.00	451,008,600
扶桑薬品工業	5,900	2,208.00	13,027,200
日本ケミファ	900	1,601.00	1,440,900
ツムラ	53,000	3,794.00	201,082,000
キッセイ薬品工業	27,800	3,525.00	97,995,000
生化学工業	28,500	745.00	21,232,500
栄研化学	30,100	1,959.00	58,965,900
鳥居薬品	9,000	3,765.00	33,885,000
J C R ファーマ	57,000	811.00	46,227,000

東和薬品	25,900	2,792.00	72,312,800
富士製薬工業	12,400	1,537.00	19,058,800
ゼリア新薬工業	23,300	2,058.00	47,951,400
ネクセラファーマ	55,200	1,467.00	80,978,400
第一三共	1,465,800	4,633.00	6,791,051,400
杏林製薬	36,500	1,805.00	65,882,500
大幸薬品	34,900	333.00	11,621,700
ダイト	12,800	2,498.00	31,974,400
大塚ホールディングス	350,000	6,322.00	2,212,700,000
ペプチドリーム	81,600	1,517.50	123,828,000
セルソース	4,700	1,518.00	7,134,600
あすか製薬ホールディングス	17,300	2,222.00	38,440,600
サワイグループホールディングス	38,500	6,140.00	236,390,000
日本コークス工業	170,700	133.00	22,703,100
ニチレキ	21,900	2,396.00	52,472,400
ユシロ化学工業	8,700	1,929.00	16,782,300
ビーピー・カストロール	2,900	1,000.00	2,900,000
富士石油	49,000	467.00	22,883,000
MORESCO	2,700	1,292.00	3,488,400
出光興産	934,300	1,023.00	955,788,900
ENEOSホールディングス	2,663,700	719.70	1,917,064,890
コスモエネルギーホールディングス	49,900	7,411.00	369,808,900
横浜ゴム	85,100	4,084.00	347,548,400
TOYO TIRE	96,700	2,893.50	279,801,450
ブリヂストン	492,500	6,817.00	3,357,372,500
住友ゴム工業	165,000	1,903.50	314,077,500
藤倉コンポジット	12,900	1,430.00	18,447,000
オカモト	7,900	4,835.00	38,196,500
フコク	8,800	1,934.00	17,019,200
ニッタ	17,100	3,915.00	66,946,500
住友理工	26,100	1,342.00	35,026,200
三ツ星ベルト	19,500	4,815.00	93,892,500
バンドー化学	25,000	1,764.00	44,100,000
日東紡績	21,300	5,050.00	107,565,000
AGC	150,100	5,734.00	860,673,400
日本板硝子	80,300	513.00	41,193,900
石塚硝子	1,300	2,663.00	3,461,900
日本山村硝子	2,900	1,501.00	4,352,900
日本電気硝子	68,700	3,745.00	257,281,500
オハラ	8,100	1,282.00	10,384,200
住友大阪セメント	28,000	3,877.00	108,556,000
太平洋セメント	99,500	3,481.00	346,359,500

日本ヒューム	14,900	834.00	12,426,600
日本コンクリート工業	33,000	385.00	12,705,000
三谷セキサン	7,100	5,420.00	38,482,000
アジアパイルホールディングス	24,100	835.00	20,123,500
東海カーボン	155,400	1,037.00	161,149,800
日本カーボン	8,900	5,470.00	48,683,000
東洋炭素	11,900	7,410.00	88,179,000
ノリタケカンパニーリミテド	18,700	3,920.00	73,304,000
TOTO	111,100	4,360.00	484,396,000
日本碍子	195,800	2,053.00	401,977,400
日本特殊陶業	140,900	5,049.00	711,404,100
MARUWA	6,200	33,500.00	207,700,000
品川リフラクトリーズ	20,800	1,815.00	37,752,000
黒崎播磨	13,800	3,230.00	44,574,000
ヨータイ	10,500	1,440.00	15,120,000
東京窯業	8,300	470.00	3,901,000
ニッカトー	3,600	588.00	2,116,800
フジインコーポレーテッド	45,300	3,245.00	146,998,500
クニミネ工業	2,300	1,140.00	2,622,000
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,278.00	2,172,600
ニチアス	42,600	4,015.00	171,039,000
ニチハ	21,100	3,630.00	76,593,000
日本製鉄	775,100	3,480.00	2,697,348,000
神戸製鋼所	348,100	1,907.00	663,826,700
中山製鋼所	39,600	918.00	36,352,800
合同製鐵	9,700	5,420.00	52,574,000
JFEホールディングス	481,400	2,380.00	1,145,732,000
東京製鐵	48,700	1,653.00	80,501,100
共英製鋼	19,700	2,543.00	50,097,100
大和工業	32,600	8,157.00	265,918,200
東京鐵鋼	7,600	4,725.00	35,910,000
大阪製鐵	8,000	2,299.00	18,392,000
淀川製鋼所	19,700	4,540.00	89,438,000
中部鋼鈹	11,400	2,377.00	27,097,800
丸一鋼管	52,700	4,113.00	216,755,100
モリ工業	3,500	6,740.00	23,590,000
大同特殊鋼	109,100	1,725.50	188,252,050
日本高周波鋼業	3,000	483.00	1,449,000
日本冶金工業	12,600	4,545.00	57,267,000
山陽特殊製鋼	17,100	2,020.00	34,542,000
愛知製鋼	10,000	3,780.00	37,800,000
日本金属	2,000	818.00	1,636,000

大太平洋金属	14,800	1,294.00	19,151,200
新日本電工	86,200	313.00	26,980,600
栗本鐵工所	8,000	4,225.00	33,800,000
虹技	1,000	1,336.00	1,336,000
三菱製鋼	12,800	1,401.00	17,932,800
日亜鋼業	7,900	313.00	2,472,700
日本精線	13,800	1,180.00	16,284,000
エンビプロ・ホールディングス	13,700	510.00	6,987,000
シンニッタン	9,800	261.00	2,557,800
新家工業	1,700	3,720.00	6,324,000
大紀アルミニウム工業所	21,900	1,333.00	29,192,700
日本軽金属ホールディングス	50,600	1,879.00	95,077,400
三井金属鉱業	50,400	4,932.00	248,572,800
東邦亜鉛	11,100	1,044.00	11,588,400
三菱マテリアル	123,800	3,063.00	379,199,400
住友金属鉱山	200,700	5,216.00	1,046,851,200
DOWAホールディングス	42,800	5,717.00	244,687,600
古河機械金属	22,900	1,893.00	43,349,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,000	2,470.00	74,100,000
東邦チタニウム	35,800	1,391.00	49,797,800
UACJ	24,300	4,635.00	112,630,500
CKサンエツ	4,200	3,955.00	16,611,000
古河電気工業	57,600	3,316.00	191,001,600
住友電気工業	647,500	2,401.50	1,554,971,250
フジクラ	204,200	2,562.00	523,160,400
SWCC	19,400	3,995.00	77,503,000
タツタ電線	31,900	717.00	22,872,300
カナレ電気	1,400	1,686.00	2,360,400
平河ヒューテック	11,100	1,314.00	14,585,400
リョービ	18,400	2,724.00	50,121,600
アーレスティ	8,400	781.00	6,560,400
AREホールディングス	65,000	1,982.00	128,830,000
稲葉製作所	8,500	1,789.00	15,206,500
宮地エンジニアリンググループ	8,700	3,960.00	34,452,000
トーカロ	49,900	1,786.00	89,121,400
アルファC o	2,800	1,505.00	4,214,000
SUMCO	307,600	2,312.50	711,325,000
川田テクノロジーズ	12,300	2,929.00	36,026,700
RS Technologies	11,600	3,005.00	34,858,000
ジェイテックコーポレーション	1,300	1,994.00	2,592,200
信和	5,000	733.00	3,665,000
東洋製罐グループホールディングス	99,300	2,407.50	239,064,750

ホッカホールディングス	8,500	1,806.00	15,351,000
コロナ	9,700	959.00	9,302,300
横河ブリッジホールディングス	27,100	2,788.00	75,554,800
駒井ハルテック	1,400	1,937.00	2,711,800
高田機工	600	3,500.00	2,100,000
三和ホールディングス	173,900	2,455.50	427,011,450
文化シャッター	45,300	1,642.00	74,382,600
三協立山	21,800	826.00	18,006,800
アルインコ	13,200	1,126.00	14,863,200
東洋シャッター	1,800	663.00	1,193,400
L I X I L	270,300	1,786.00	482,755,800
日本フィルコン	5,000	541.00	2,705,000
ノーリツ	27,400	1,750.00	47,950,000
長府製作所	17,200	2,182.00	37,530,400
リンナイ	82,800	3,328.00	275,558,400
ダイニチ工業	3,800	700.00	2,660,000
日東精工	25,100	595.00	14,934,500
三洋工業	900	2,950.00	2,655,000
岡部	30,900	798.00	24,658,200
ジーテクト	22,000	2,125.00	46,750,000
東プレ	30,500	2,524.00	76,982,000
高周波熱錬	25,600	1,047.00	26,803,200
東京製綱	11,200	1,388.00	15,545,600
サンコール	15,400	452.00	6,960,800
モリテック スチール	6,800	236.00	1,604,800
パイオラックス	21,500	2,647.00	56,910,500
エイチワン	17,800	681.00	12,121,800
日本発條	153,100	1,504.00	230,262,400
中央発條	12,800	1,014.00	12,979,200
アドバネクス	900	1,377.00	1,239,300
立川ブラインド工業	7,800	1,407.00	10,974,600
三益半導体工業	15,600	2,751.00	42,915,600
日本ドライケミカル	1,800	2,597.00	4,674,600
日本製鋼所	46,700	3,761.00	175,638,700
三浦工業	70,800	2,477.50	175,407,000
タクマ	57,300	1,918.00	109,901,400
ツガミ	37,700	1,242.00	46,823,400
オークマ	14,800	6,877.00	101,779,600
芝浦機械	16,900	3,470.00	58,643,000
アマダ	270,400	1,672.50	452,244,000
アイダエンジニアリング	39,300	887.00	34,859,100
F U J I	79,800	2,496.00	199,180,800

牧野フライス製作所	18,800	6,110.00	114,868,000
オーエスジー	74,700	1,940.00	144,918,000
ダイジェット工業	800	834.00	667,200
旭ダイヤモンド工業	39,100	898.00	35,111,800
D M G 森精機	102,700	4,035.00	414,394,500
ソディック	41,300	713.00	29,446,900
ディスコ	81,600	47,620.00	3,885,792,000
日東工器	8,200	2,190.00	17,958,000
日進工具	15,800	900.00	14,220,000
パンチ工業	7,500	442.00	3,315,000
富士ダイス	10,100	673.00	6,797,300
豊和工業	4,200	791.00	3,322,200
リケンNPR	18,400	2,943.00	54,151,200
東洋機械金属	6,300	718.00	4,523,400
エンシュウ	1,900	698.00	1,326,200
島精機製作所	27,000	1,253.00	33,831,000
オプトラン	27,900	1,884.00	52,563,600
NCホールディングス	1,800	1,571.00	2,827,800
イワキポンプ	11,300	2,420.00	27,346,000
フリー	16,000	1,173.00	18,768,000
ヤマシンフィルタ	40,400	403.00	16,281,200
日阪製作所	18,500	1,035.00	19,147,500
やまびこ	27,700	2,029.00	56,203,300
野村マイクロ・サイエンス	22,900	4,700.00	107,630,000
平田機工	8,100	6,980.00	56,538,000
P E G A S U S	18,800	492.00	9,249,600
マルマエ	7,400	1,801.00	13,327,400
タツモ	10,200	3,725.00	37,995,000
ナプテスコ	106,400	2,578.00	274,299,200
三井海洋開発	21,500	3,090.00	66,435,000
レオン自動機	19,600	1,463.00	28,674,800
S M C	50,700	77,800.00	3,944,460,000
ホソカワミクロン	10,900	4,390.00	47,851,000
ユニオンツール	7,500	4,295.00	32,212,500
瑞光	12,200	1,005.00	12,261,000
オイレス工業	23,000	2,334.00	53,682,000
日精エー・エス・ビー機械	6,800	4,795.00	32,606,000
サトーホールディングス	24,100	2,171.00	52,321,100
技研製作所	15,900	1,913.00	30,416,700
日本エアテック	8,000	1,165.00	9,320,000
カワタ	2,400	982.00	2,356,800
日精樹脂工業	12,600	1,103.00	13,897,800

オカダアイヨン	2,500	2,847.00	7,117,500
ワイエイシイホールディングス	6,400	2,250.00	14,400,000
小松製作所	794,200	4,457.00	3,539,749,400
住友重機械工業	100,300	4,556.00	456,966,800
日立建機	67,500	4,520.00	305,100,000
日工	25,200	737.00	18,572,400
巴工業	6,600	4,445.00	29,337,000
井関農機	15,900	1,030.00	16,377,000
TOWA	18,900	9,250.00	174,825,000
丸山製作所	1,300	2,455.00	3,191,500
北川鉄工所	6,700	1,519.00	10,177,300
ローツェ	8,900	24,970.00	222,233,000
タカキタ	2,500	565.00	1,412,500
クボタ	885,900	2,417.50	2,141,663,250
荏原実業	8,900	3,345.00	29,770,500
三菱化工機	6,000	3,725.00	22,350,000
月島ホールディングス	23,000	1,384.00	31,832,000
帝国電機製作所	11,600	2,422.00	28,095,200
新東工業	34,300	1,224.00	41,983,200
澁谷工業	15,900	3,435.00	54,616,500
アイチ コーポレーション	23,700	1,086.00	25,738,200
小森コーポレーション	41,800	1,155.00	48,279,000
鶴見製作所	13,000	3,415.00	44,395,000
日本ギア工業	2,900	647.00	1,876,300
酒井重工業	2,700	6,160.00	16,632,000
荏原製作所	69,500	12,775.00	887,862,500
石井鐵工所	900	2,790.00	2,511,000
西島製作所	14,600	2,710.00	39,566,000
北越工業	17,100	1,924.00	32,900,400
ダイキン工業	202,300	19,680.00	3,981,264,000
オルガノ	20,400	7,030.00	143,412,000
トーヨーカネツ	5,800	4,250.00	24,650,000
栗田工業	94,800	5,895.00	558,846,000
椿本チエイン	24,000	5,210.00	125,040,000
大同工業	3,400	761.00	2,587,400
木村化工機	13,000	731.00	9,503,000
アネスト岩田	26,200	1,335.00	34,977,000
ダイフク	286,000	3,164.00	904,904,000
サムコ	4,600	4,260.00	19,596,000
加藤製作所	3,900	1,381.00	5,385,900
油研工業	1,300	2,205.00	2,866,500
タダノ	97,600	1,230.00	120,048,000

フジテック	39,600	3,725.00	147,510,000
C K D	46,900	2,851.00	133,711,900
平和	50,100	1,955.00	97,945,500
理想科学工業	13,600	2,937.00	39,943,200
S A N K Y O	163,100	1,642.00	267,810,200
日本金銭機械	20,500	1,315.00	26,957,500
マースグループホールディングス	8,600	3,220.00	27,692,000
フクシマガリレイ	11,100	6,260.00	69,486,000
オーイズミ	2,900	393.00	1,139,700
ダイコク電機	8,400	3,540.00	29,736,000
竹内製作所	30,700	5,750.00	176,525,000
アマノ	48,100	3,773.00	181,481,300
J U K I	26,300	541.00	14,228,300
ジャノメ	17,200	652.00	11,214,400
マックス	23,900	3,200.00	76,480,000
グローリー	40,700	2,806.00	114,204,200
新晃工業	17,100	3,790.00	64,809,000
大和冷機工業	26,000	1,498.00	38,948,000
セガサミーホールディングス	151,400	2,027.00	306,887,800
T P R	21,500	2,250.00	48,375,000
ツバキ・ナカシマ	34,000	842.00	28,628,000
ホシザキ	100,000	5,400.00	540,000,000
大豊工業	14,700	866.00	12,730,200
日本精工	313,700	867.90	272,260,230
N T N	367,600	312.80	114,985,280
ジェイテクト	150,800	1,398.50	210,893,800
不二越	12,500	3,305.00	41,312,500
日本トムソン	46,200	623.00	28,782,600
T H K	97,800	3,304.00	323,131,200
ユーシン精機	13,500	680.00	9,180,000
前澤給装工業	12,200	1,265.00	15,433,000
イーグル工業	18,800	1,766.00	33,200,800
前澤工業	4,800	1,255.00	6,024,000
日本ピラー工業	15,700	5,960.00	93,572,000
キッツ	56,700	1,302.00	73,823,400
マキタ	193,200	4,219.00	815,110,800
三井E & S	84,100	1,574.00	132,373,400
日立造船	149,600	1,233.00	184,456,800
三菱重工業	2,963,100	1,357.50	4,022,408,250
I H I	126,200	3,833.00	483,724,600
スター精密	31,200	1,789.00	55,816,800
日清紡ホールディングス	127,400	1,160.00	147,784,000



イビデン	88,400	5,968.00	527,571,200
コニカミノルタ	378,800	547.00	207,203,600
ブラザー工業	226,500	2,841.50	643,599,750
ミネベアミツミ	294,800	2,782.00	820,133,600
日立製作所	814,300	13,295.00	10,826,118,500
三菱電機	1,885,900	2,451.50	4,623,283,850
富士電機	103,000	9,625.00	991,375,000
東洋電機製造	2,700	1,106.00	2,986,200
安川電機	184,000	6,149.00	1,131,416,000
シンフォニアテクノロジー	18,700	3,215.00	60,120,500
明電舎	31,400	3,350.00	105,190,000
オリジン	1,700	1,205.00	2,048,500
山洋電気	7,400	7,030.00	52,022,000
デンヨー	12,900	2,249.00	29,012,100
PHCホールディングス	31,900	1,138.00	36,302,200
KOKUSAI ELECTRIC	65,700	3,840.00	252,288,000
ソシオネクスト	123,200	4,108.00	506,105,600
東芝テック	21,700	3,120.00	67,704,000
芝浦メカトロニクス	9,700	5,780.00	56,066,000
マブチモーター	83,400	2,655.50	221,468,700
ニデック	374,100	6,762.00	2,529,664,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,300	351.00	3,966,300
トレックス・セミコンダクター	8,800	1,656.00	14,572,800
東光高岳	10,300	2,529.00	26,048,700
ダブル・スコープ	48,500	503.00	24,395,500
ダイヘン	16,100	9,240.00	148,764,000
ヤーマン	33,200	989.00	32,834,800
JVCケンウッド	134,000	839.00	112,426,000
ミマキエンジニアリング	16,300	1,167.00	19,022,100
I - P E X	11,900	1,721.00	20,479,900
大崎電気工業	37,100	668.00	24,782,800
オムロン	129,400	5,252.00	679,608,800
日東工業	22,800	4,090.00	93,252,000
I D E C	25,000	2,648.00	66,200,000
正興電機製作所	2,700	1,312.00	3,542,400
不二電機工業	1,700	1,107.00	1,881,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	66,200	2,946.00	195,025,200
サクサホールディングス	1,700	2,833.00	4,816,100
メルコホールディングス	5,400	3,340.00	18,036,000
テクノメディカ	4,300	1,712.00	7,361,600
日本電気	222,500	10,740.00	2,389,650,000
富士通	1,559,200	2,463.50	3,841,089,200

沖電気工業	76,600	1,105.00	84,643,000
岩崎通信機	3,500	668.00	2,338,000
電気興業	6,800	2,076.00	14,116,800
サンケン電気	15,700	5,899.00	92,614,300
ナカヨ	1,200	1,097.00	1,316,400
アイホン	9,100	2,915.00	26,526,500
ルネサスエレクトロニクス	1,056,300	2,317.50	2,447,975,250
セイコーエプソン	217,400	2,754.00	598,719,600
ワコム	124,400	596.00	74,142,400
アルバック	37,200	9,190.00	341,868,000
アクセル	6,900	1,666.00	11,495,400
E I Z O	12,400	5,030.00	62,372,000
日本信号	38,600	1,010.00	38,986,000
京三製作所	35,500	494.00	17,537,000
能美防災	23,000	2,345.00	53,935,000
ホーチキ	12,800	2,182.00	27,929,600
星和電機	3,700	575.00	2,127,500
エレコム	40,700	1,502.00	61,131,400
パナソニック ホールディングス	2,001,600	1,379.00	2,760,206,400
シャープ	285,600	817.20	233,392,320
アンリツ	119,300	1,197.50	142,861,750
富士通ゼネラル	48,000	1,819.00	87,312,000
ソニーグループ	1,186,700	12,530.00	14,869,351,000
T D K	268,300	7,092.00	1,902,783,600
帝国通信工業	7,500	1,795.00	13,462,500
タムラ製作所	67,500	588.00	39,690,000
アルプスアルパイン	151,500	1,293.50	195,965,250
池上通信機	2,400	774.00	1,857,600
日本電波工業	20,500	1,202.00	24,641,000
鈴木	9,200	1,350.00	12,420,000
メイコー	16,900	4,845.00	81,880,500
日本トリム	3,900	3,500.00	13,650,000
ローランド ディー . ジー .	9,500	5,420.00	51,490,000
フォスター電機	12,500	1,227.00	15,337,500
S M K	4,500	2,412.00	10,854,000
ヨコオ	15,100	1,560.00	23,556,000
ホシデン	38,600	1,920.00	74,112,000
ヒロセ電機	25,000	16,270.00	406,750,000
日本航空電子工業	40,500	2,309.00	93,514,500
T O A	19,300	1,098.00	21,191,400
マクセル	37,600	1,501.00	56,437,600
古野電気	22,100	1,826.00	40,354,600

スミダコーポレーション	22,900	1,183.00	27,090,700
アイコム	6,500	3,185.00	20,702,500
リオン	7,000	2,960.00	20,720,000
横河電機	185,400	3,428.00	635,551,200
新電元工業	6,500	2,816.00	18,304,000
アズビル	115,400	4,347.00	501,643,800
東亜ディーケーケー	3,800	871.00	3,309,800
日本光電工業	72,000	4,185.00	301,320,000
チノー	7,000	2,715.00	19,005,000
共和電業	7,000	417.00	2,919,000
日本電子材料	10,300	2,383.00	24,544,900
堀場製作所	32,000	14,335.00	458,720,000
アドバンテスト	480,600	5,269.00	2,532,281,400
小野測器	3,400	679.00	2,308,600
エスベック	13,500	2,864.00	38,664,000
キーエンス	167,800	63,720.00	10,692,216,000
日置電機	8,000	6,380.00	51,040,000
シスメックス	434,400	2,450.50	1,064,497,200
日本マイクロニクス	30,200	6,500.00	196,300,000
メガチップス	13,300	3,440.00	45,752,000
O B A R A G R O U P	9,200	4,100.00	37,720,000
澤藤電機	1,100	1,185.00	1,303,500
原田工業	3,600	700.00	2,520,000
コーセル	18,100	1,439.00	26,045,900
イリソ電子工業	15,500	2,824.00	43,772,000
オブテックスグループ	30,900	1,817.00	56,145,300
千代田インテグレ	6,700	2,680.00	17,956,000
レーザーテック	76,900	34,520.00	2,654,588,000
スタンレー電気	107,500	2,775.50	298,366,250
ウシオ電機	85,300	1,988.00	169,576,400
岡谷電機産業	6,600	258.00	1,702,800
ヘリオス テクノ ホールディング	7,900	472.00	3,728,800
エノモト	2,200	1,570.00	3,454,000
日本セラミック	13,800	2,646.00	36,514,800
遠藤照明	3,500	1,419.00	4,966,500
古河電池	12,600	1,007.00	12,688,200
双信電機	3,500	479.00	1,676,500
山一電機	15,200	2,476.00	37,635,200
図研	14,700	4,085.00	60,049,500
日本電子	42,100	6,387.00	268,892,700
カシオ計算機	121,200	1,329.00	161,074,800
ファナック	818,100	4,426.00	3,620,910,600

日本シイエムケイ	37,400	579.00	21,654,600
エンプラス	4,900	7,700.00	37,730,000
大真空	25,300	754.00	19,076,200
ローム	310,300	2,142.50	664,817,750
浜松ホトニクス	134,700	5,570.00	750,279,000
三井ハイテック	14,900	6,729.00	100,262,100
新光電気工業	59,400	5,525.00	328,185,000
京セラ	1,042,500	1,933.00	2,015,152,500
太陽誘電	81,800	3,568.00	291,862,400
村田製作所	1,526,400	2,745.50	4,190,731,200
双葉電子工業	32,400	464.00	15,033,600
北陸電気工業	3,000	1,323.00	3,969,000
ニチコン	44,200	1,286.00	56,841,200
日本ケミコン	18,000	1,448.00	26,064,000
K O A	25,600	1,420.00	36,352,000
市光工業	30,700	515.00	15,810,500
小糸製作所	173,900	2,253.00	391,796,700
ミツバ	31,500	1,451.00	45,706,500
S C R E E Nホールディングス	57,400	16,025.00	919,835,000
キャノン電子	18,600	2,235.00	41,571,000
キャノン	836,700	4,432.00	3,708,254,400
リコー	420,600	1,373.00	577,483,800
象印マホービン	45,700	1,478.00	67,544,600
M U T O Hホールディングス	1,100	2,198.00	2,417,800
東京エレクトロン	355,100	32,450.00	11,522,995,000
イノテック	11,300	1,791.00	20,238,300
トヨタ紡織	70,700	2,438.50	172,401,950
芦森工業	1,600	2,432.00	3,891,200
ユニプレス	30,200	1,158.00	34,971,600
豊田自動織機	143,100	14,185.00	2,029,873,500
モリタホールディングス	29,500	1,752.00	51,684,000
三櫻工業	25,700	1,132.00	29,092,400
デンソー	1,384,100	2,850.00	3,944,685,000
東海理化電機製作所	47,300	2,321.00	109,783,300
川崎重工業	137,000	4,750.00	650,750,000
名村造船所	41,800	1,778.00	74,320,400
日本車輛製造	5,500	2,365.00	13,007,500
三菱ロジスネクスト	26,800	1,492.00	39,985,600
近畿車輛	1,000	2,234.00	2,234,000
日産自動車	2,264,000	550.40	1,246,105,600
いすゞ自動車	487,700	1,953.00	952,478,100
トヨタ自動車	9,211,800	3,517.00	32,397,900,600

日野自動車	252,300	490.40	123,727,920
三菱自動車工業	654,500	461.30	301,920,850
エフテック	5,300	736.00	3,900,800
レシップホールディングス	3,200	611.00	1,955,200
G M B	1,500	1,091.00	1,636,500
ファルテック	1,600	565.00	904,000
武蔵精密工業	41,100	1,642.00	67,486,200
日産車体	17,000	954.00	16,218,000
新明和工業	48,300	1,179.00	56,945,700
極東開発工業	27,700	2,529.00	70,053,300
トピー工業	13,600	2,650.00	36,040,000
ティラド	3,700	3,820.00	14,134,000
曙ブレーキ工業	102,400	136.00	13,926,400
タチエス	31,000	1,921.00	59,551,000
N O K	65,200	2,121.50	138,321,800
フタバ産業	45,000	1,051.00	47,295,000
カヤバ	15,800	5,330.00	84,214,000
大同メタル工業	32,900	632.00	20,792,800
プレス工業	67,100	762.00	51,130,200
ミクニ	9,600	431.00	4,137,600
太平洋工業	38,500	1,678.00	64,603,000
アイシン	129,400	6,202.00	802,538,800
マツダ	554,900	1,684.50	934,729,050
今仙電機製作所	4,900	612.00	2,998,800
本田技研工業	3,974,900	1,773.50	7,049,485,150
スズキ	1,232,500	1,762.00	2,171,665,000
S U B A R U	520,300	3,307.00	1,720,632,100
安永	3,400	661.00	2,247,400
ヤマハ発動機	725,000	1,417.00	1,027,325,000
T B K	8,400	360.00	3,024,000
エクセディ	27,500	3,010.00	82,775,000
豊田合成	48,100	3,217.00	154,737,700
愛三工業	27,800	1,613.00	44,841,400
盟和産業	1,100	995.00	1,094,500
日本プラスト	6,500	511.00	3,321,500
ヨロズ	15,800	955.00	15,089,000
エフ・シー・シー	29,800	2,220.00	66,156,000
シマノ	67,800	23,805.00	1,613,979,000
テイ・エス テック	59,800	1,936.50	115,802,700
ジャムコ	8,200	1,160.00	9,512,000
テルモ	938,100	2,602.50	2,441,405,250
クリエートメディック	2,400	1,000.00	2,400,000

日機装	39,100	1,263.00	49,383,300
日本エム・ディ・エム	13,300	673.00	8,950,900
島津製作所	222,900	4,155.00	926,149,500
JMS	15,500	520.00	8,060,000
長野計器	12,200	2,299.00	28,047,800
ブイ・テクノロジー	8,800	2,438.00	21,454,400
東京計器	12,900	2,533.00	32,675,700
愛知時計電機	7,300	2,314.00	16,892,200
インターアクション	10,100	1,530.00	15,453,000
オーバル	6,600	535.00	3,531,000
東京精密	34,300	10,220.00	350,546,000
マニー	67,100	1,862.50	124,973,750
ニコン	242,600	1,562.00	378,941,200
トプコン	81,600	1,766.50	144,146,400
オリンパス	991,000	2,171.00	2,151,461,000
理研計器	23,800	3,555.00	84,609,000
タムロン	10,300	6,280.00	64,684,000
HOYA	330,300	17,540.00	5,793,462,000
シード	3,900	586.00	2,285,400
ノーリツ鋼機	15,900	3,020.00	48,018,000
A & Dホロンホールディングス	24,500	2,610.00	63,945,000
朝日インテック	204,500	2,231.00	456,239,500
シチズン時計	154,300	1,027.00	158,466,100
リズム	1,700	2,817.00	4,788,900
大研医器	6,400	549.00	3,513,600
メニコン	57,700	1,503.00	86,723,100
シンシア	900	499.00	449,100
松風	7,600	2,947.00	22,397,200
セイコーグループ	23,400	4,060.00	95,004,000
ニプロ	139,800	1,258.00	175,868,400
KYORITSU	11,100	170.00	1,887,000
中本パックス	2,500	1,639.00	4,097,500
パラマウントベッドホールディングス	34,900	2,696.00	94,090,400
トランザクション	11,100	1,828.00	20,290,800
粧美堂	2,000	586.00	1,172,000
ニホンフラッシュ	15,700	900.00	14,130,000
前田工織	14,200	3,420.00	48,564,000
永大産業	8,800	275.00	2,420,000
アートネイチャー	15,100	762.00	11,506,200
フルヤ金属	4,000	11,240.00	44,960,000
バンダイナムコホールディングス	459,600	2,911.00	1,337,895,600
アイフィスジャパン	2,100	607.00	1,274,700

SHOEI	37,900	2,289.00	86,753,100
フランスベッドホールディングス	21,700	1,200.00	26,040,000
パイロットコーポレーション	23,600	4,169.00	98,388,400
萩原工業	11,200	1,598.00	17,897,600
フジシールインターナショナル	34,000	2,050.00	69,700,000
タカラトミー	76,400	2,494.50	190,579,800
広済堂ホールディングス	43,300	692.00	29,963,600
エステールホールディングス	1,700	643.00	1,093,100
タカノ	2,800	997.00	2,791,600
プロネクサス	17,400	1,125.00	19,575,000
ホクシン	5,700	122.00	695,400
ウッドワン	2,700	1,010.00	2,727,000
TOPPANホールディングス	206,200	3,622.00	746,856,400
大日本印刷	183,300	4,480.00	821,184,000
共同印刷	4,700	3,250.00	15,275,000
NISSHA	28,700	1,609.00	46,178,300
光村印刷	600	1,574.00	944,400
TAKARA & COMPANY	9,900	2,548.00	25,225,200
アシックス	142,900	6,596.00	942,568,400
ツツミ	3,900	2,115.00	8,248,500
ローランド	12,400	4,360.00	54,064,000
小松ウオール工業	6,800	3,125.00	21,250,000
ヤマハ	105,800	3,346.00	354,006,800
河合楽器製作所	5,100	3,620.00	18,462,000
クリナップ	16,400	748.00	12,267,200
ピジョン	106,800	1,417.50	151,389,000
キングジム	14,800	879.00	13,009,200
リンテック	33,700	3,050.00	102,785,000
イトーキ	34,400	1,894.00	65,153,600
任天堂	1,059,200	7,525.00	7,970,480,000
三菱鉛筆	23,800	2,477.00	58,952,600
タカラスタANDARD	35,300	1,821.00	64,281,300
コクヨ	68,600	2,559.00	175,547,400
ナカバヤシ	18,100	522.00	9,448,200
グローブライド	15,100	1,932.00	29,173,200
オカムラ	50,500	2,301.00	116,200,500
美津濃	16,700	7,200.00	120,240,000
東京電力ホールディングス	1,512,300	1,032.50	1,561,449,750
中部電力	618,200	2,023.00	1,250,618,600
関西電力	647,800	2,424.00	1,570,267,200
中国電力	291,500	1,174.00	342,221,000
北陸電力	171,500	955.40	163,851,100

東北電力	441,700	1,242.00	548,591,400
四国電力	156,200	1,250.00	195,250,000
九州電力	386,700	1,529.50	591,457,650
北海道電力	162,100	1,270.00	205,867,000
沖縄電力	42,900	1,253.00	53,753,700
電源開発	137,800	2,697.00	371,646,600
エフオン	12,200	428.00	5,221,600
イーレックス	29,900	823.00	24,607,700
レノバ	44,800	1,380.00	61,824,000
東京瓦斯	326,600	3,945.00	1,288,437,000
大阪瓦斯	339,800	3,348.00	1,137,650,400
東邦瓦斯	72,600	3,735.00	271,161,000
北海道瓦斯	10,000	2,964.00	29,640,000
広島ガス	35,400	383.00	13,558,200
西部ガスホールディングス	17,500	2,006.00	35,105,000
静岡ガス	33,500	971.00	32,528,500
メタウォーター	20,100	2,300.00	46,230,000
SBSホールディングス	15,000	2,744.00	41,160,000
東武鉄道	184,300	3,270.00	602,661,000
相鉄ホールディングス	60,000	2,647.00	158,820,000
東急	470,400	1,907.00	897,052,800
京浜急行電鉄	207,600	1,305.00	270,918,000
小田急電鉄	277,400	1,826.00	506,532,400
京王電鉄	80,600	3,980.00	320,788,000
京成電鉄	108,200	6,025.00	651,905,000
富士急行	20,700	3,585.00	74,209,500
東日本旅客鉄道	924,600	2,919.50	2,699,369,700
西日本旅客鉄道	398,000	3,053.00	1,215,094,000
東海旅客鉄道	646,200	3,658.00	2,363,799,600
西武ホールディングス	202,900	2,541.50	515,670,350
鴻池運輸	28,600	2,223.00	63,577,800
西日本鉄道	44,800	2,510.50	112,470,400
ハマキョウレックス	14,300	3,825.00	54,697,500
サカイ引越センター	18,600	2,708.00	50,368,800
近鉄グループホールディングス	167,500	4,238.00	709,865,000
阪急阪神ホールディングス	223,300	4,231.00	944,782,300
南海電気鉄道	74,700	3,065.00	228,955,500
京阪ホールディングス	92,300	3,393.00	313,173,900
神戸電鉄	4,600	2,741.00	12,608,600
名古屋鉄道	172,800	2,108.50	364,348,800
山陽電気鉄道	12,600	2,054.00	25,880,400
アルプス物流	13,400	3,150.00	42,210,000



ヤマトホールディングス	214,500	2,056.50	441,119,250
山九	42,600	5,402.00	230,125,200
丸運	4,400	281.00	1,236,400
丸全昭和運輸	10,300	4,570.00	47,071,000
センコーグループホールディングス	88,700	1,157.00	102,625,900
トナミホールディングス	3,700	4,615.00	17,075,500
ニッコンホールディングス	53,600	3,033.00	162,568,800
日本石油輸送	800	2,800.00	2,240,000
福山通運	19,100	3,740.00	71,434,000
セイノーホールディングス	94,200	2,119.50	199,656,900
エスライングループ本社	2,100	871.00	1,829,100
神奈川中央交通	4,700	3,075.00	14,452,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	42,800	1,221.00	52,258,800
C & F ロジホールディングス	16,100	3,170.00	51,037,000
九州旅客鉄道	118,400	3,549.00	420,201,600
S Gホールディングス	281,200	1,827.50	513,893,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	56,800	8,020.00	455,536,000
日本郵船	480,300	4,237.00	2,035,031,100
商船三井	363,900	4,729.00	1,720,883,100
川崎汽船	404,000	2,085.00	842,340,000
N S ユナイテッド海運	9,200	4,710.00	43,332,000
飯野海運	62,200	1,248.00	77,625,600
共栄タンカー	2,200	987.00	2,171,400
乾汽船	20,400	1,086.00	22,154,400
日本航空	411,400	2,862.50	1,177,632,500
A N Aホールディングス	455,700	3,054.00	1,391,707,800
パスコ	1,400	1,900.00	2,660,000
ランコム	4,900	5,860.00	28,714,000
日新	12,700	2,997.00	38,061,900
三菱倉庫	41,100	5,140.00	211,254,000
三井倉庫ホールディングス	15,700	4,625.00	72,612,500
住友倉庫	45,200	2,644.00	119,508,800
澁澤倉庫	7,600	2,959.00	22,488,400
東陽倉庫	2,000	1,516.00	3,032,000
日本トランスシティ	33,700	721.00	24,297,700
ケイヒン	1,300	1,973.00	2,564,900
中央倉庫	9,000	1,129.00	10,161,000
川西倉庫	1,400	1,122.00	1,570,800
安田倉庫	11,400	1,339.00	15,264,600
ファイズホールディングス	1,100	1,144.00	1,258,400
東洋埠頭	2,100	1,341.00	2,816,100
上組	77,300	3,344.00	258,491,200

サンリツ	1,800	909.00	1,636,200
キムラユニティー	3,500	1,667.00	5,834,500
キューソー流通システム	7,600	1,184.00	8,998,400
東海運	4,400	286.00	1,258,400
エーアイティー	10,500	1,744.00	18,312,000
内外トランスライン	6,700	2,507.00	16,796,900
日本コンセプト	6,100	1,779.00	10,851,900
NEC ネットエスアイ	65,600	2,511.00	164,721,600
クロスキャット	10,700	1,289.00	13,792,300
システナ	254,700	262.00	66,731,400
デジタルアーツ	10,600	4,115.00	43,619,000
日鉄ソリューションズ	28,700	5,180.00	148,666,000
キューブシステム	8,900	1,073.00	9,549,700
コア	7,500	1,844.00	13,830,000
手間いらず	2,900	3,265.00	9,468,500
ラクーンホールディングス	12,600	679.00	8,555,400
ソリトンシステムズ	8,700	1,310.00	11,397,000
ソフトクリエイトホールディングス	13,800	1,806.00	24,922,800
T I S	184,000	3,290.00	605,360,000
テクミラホールディングス	3,500	393.00	1,375,500
グリー	56,400	466.00	26,282,400
GMOペパボ	2,100	1,292.00	2,713,200
コーエーテクモホールディングス	105,400	1,464.00	154,305,600
三菱総合研究所	8,200	4,950.00	40,590,000
電算	900	1,491.00	1,341,900
A G S	3,100	1,180.00	3,658,000
ファインデックス	13,400	1,010.00	13,534,000
ブレインパッド	14,000	1,227.00	17,178,000
K L a b	30,900	256.00	7,910,400
ポルトゥウィンホールディングス	28,800	475.00	13,680,000
ネクソン	369,100	2,465.00	909,831,500
アイスタイル	55,500	490.00	27,195,000
エムアップホールディングス	20,600	1,036.00	21,341,600
エイチーム	10,000	628.00	6,280,000
エニグモ	21,500	340.00	7,310,000
テクノスジャパン	6,700	576.00	3,859,200
コロブラ	65,300	589.00	38,461,700
ブロードリーフ	79,900	580.00	46,342,000
クロス・マーケティンググループ	3,500	503.00	1,760,500
デジタルハーツホールディングス	10,500	915.00	9,607,500
メディアドゥ	7,600	1,357.00	10,313,200
じげん	49,100	528.00	25,924,800

ブイキューブ	20,300	237.00	4,811,100
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	595.00	1,071,000
サイバーリンクス	2,900	795.00	2,305,500
フィックスターズ	19,000	1,997.00	37,943,000
CARTA HOLDINGS	7,900	1,705.00	13,469,500
オブティム	17,300	888.00	15,362,400
セレス	6,800	1,633.00	11,104,400
SHIFT	11,200	16,595.00	185,864,000
ティーガイア	17,600	2,064.00	36,326,400
セック	2,100	4,540.00	9,534,000
テクマトリックス	30,700	1,651.00	50,685,700
プロシップ	8,100	1,381.00	11,186,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43,800	2,242.50	98,221,500
GMOペイメントゲートウェイ	33,600	7,612.00	255,763,200
ザッパラス	1,800	451.00	811,800
システムリサーチ	11,600	1,518.00	17,608,800
インターネットイニシアティブ	80,400	2,769.00	222,627,600
さくらインターネット	18,900	5,770.00	109,053,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,100	2,725.00	13,897,500
SRAホールディングス	8,600	3,905.00	33,583,000
システムインテグレータ	2,300	378.00	869,400
朝日ネット	18,100	638.00	11,547,800
eBASE	23,700	675.00	15,997,500
アバントグループ	21,300	1,229.00	26,177,700
アドソル日進	7,100	1,610.00	11,431,000
ODKソリューションズ	1,500	633.00	949,500
フリービット	7,400	1,384.00	10,241,600
コムチュア	24,300	1,801.00	43,764,300
アステリア	13,200	588.00	7,761,600
アイル	7,900	2,762.00	21,819,800
マークライنز	9,100	3,040.00	27,664,000
メディカル・データ・ビジョン	20,100	593.00	11,919,300
gumi	27,400	376.00	10,302,400
ショーケース	1,800	312.00	561,600
モバイルファクトリー	1,600	692.00	1,107,200
テラスカイ	7,300	2,115.00	15,439,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,800	1,682.00	14,801,600
PCIホールディングス	2,800	936.00	2,620,800
アイビーシー	1,200	406.00	487,200
ネオジャパン	5,600	1,499.00	8,394,400
PR TIMES	3,400	1,788.00	6,079,200
ラクス	79,600	1,634.00	130,066,400

ランドコンピュータ	3,600	786.00	2,829,600
ダブルスタンダード	5,100	1,726.00	8,802,600
オープンドア	9,800	729.00	7,144,200
アカツキ	8,000	2,276.00	18,208,000
ベネフィットジャパン	500	1,192.00	596,000
U b i c o mホールディングス	5,200	1,169.00	6,078,800
カナミックネットワーク	18,200	518.00	9,427,600
ノムラシステムコーポレーション	8,300	132.00	1,095,600
チェンジホールディングス	36,600	1,178.00	43,114,800
シンクロ・フード	4,800	544.00	2,611,200
オークネット	6,200	2,502.00	15,512,400
キャピタル・アセット・プランニング	1,500	815.00	1,222,500
セグエグループ	6,900	519.00	3,581,100
エイトレッド	1,100	1,375.00	1,512,500
マクロミル	33,000	731.00	24,123,000
ビーグリー	1,600	1,078.00	1,724,800
オロ	6,100	2,516.00	15,347,600
ユーザーローカル	7,100	2,048.00	14,540,800
テモナ	1,800	237.00	426,600
ニーズウェル	4,100	850.00	3,485,000
マネーフォワード	37,600	5,613.00	211,048,800
サインポスト	2,900	645.00	1,870,500
S u n A s t e r i s k	12,000	910.00	10,920,000
プラスアルファ・コンサルティング	10,000	2,083.00	20,830,000
電算システムホールディングス	7,500	2,716.00	20,370,000
A p p i e r G r o u p	57,600	1,372.00	79,027,200
ビジョナル	12,900	8,180.00	105,522,000
ソルクシーズ	6,100	322.00	1,964,200
フェイス	2,100	440.00	924,000
プロトコーポレーション	18,400	1,363.00	25,079,200
ハイマックス	5,300	1,373.00	7,276,900
野村総合研究所	372,800	3,973.00	1,481,134,400
C Eホールディングス	3,900	599.00	2,336,100
日本システム技術	12,500	1,727.00	21,587,500
インテージホールディングス	19,000	1,449.00	27,531,000
東邦システムサイエンス	6,300	1,265.00	7,969,500
ソースネクスト	77,100	181.00	13,955,100
インフォコム	21,700	2,751.00	59,696,700
シンプレクス・ホールディングス	25,500	2,702.00	68,901,000
H E R O Z	6,600	1,467.00	9,682,200
ラクスル	40,600	891.00	36,174,600
メルカリ	81,900	1,777.50	145,577,250

I P S	4,800	2,284.00	10,963,200
F I G	8,700	394.00	3,427,800
システムサポート	6,500	1,865.00	12,122,500
イーソル	12,100	759.00	9,183,900
東海ソフト	1,200	1,377.00	1,652,400
ウイングアーク1 s t	17,500	2,587.00	45,272,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,500	1,001.00	4,504,500
サーバーワークス	3,500	2,485.00	8,697,500
東名	600	2,071.00	1,242,600
ヴィッツ	800	792.00	633,600
トピラシステムズ	2,200	781.00	1,718,200
S a n s a n	55,300	1,405.00	77,696,500
L i n k - Uグループ	1,800	601.00	1,081,800
ギフトィ	14,800	1,252.00	18,529,600
メドレー	22,600	3,875.00	87,575,000
ベース	5,900	3,300.00	19,470,000
J M D C	28,700	3,116.00	89,429,200
フォーカスシステムズ	11,300	1,209.00	13,661,700
クレスコ	13,800	1,966.00	27,130,800
フジ・メディア・ホールディングス	161,600	1,877.50	303,404,000
オービック	56,200	21,355.00	1,200,151,000
ジャストシステム	24,200	2,607.00	63,089,400
T D Cソフト	31,500	1,097.00	34,555,500
L I N Eヤフー	2,395,600	355.20	850,917,120
トレンドマイクロ	79,600	7,867.00	626,213,200
I Dホールディングス	11,300	1,445.00	16,328,500
日本オラクル	32,200	11,435.00	368,207,000
アルファシステムズ	4,400	3,185.00	14,014,000
フューチャー	35,900	1,777.00	63,794,300
C A C H o l d i n g s	9,000	1,969.00	17,721,000
S Bテクノロジー	7,100	2,030.00	14,413,000
トーセ	2,200	691.00	1,520,200
オービックビジネスコンサルタント	23,700	6,728.00	159,453,600
アイティフォー	21,600	1,371.00	29,613,600
東計電算	4,700	3,890.00	18,283,000
エクスネット	1,100	1,216.00	1,337,600
大塚商会	166,900	3,152.00	526,068,800
サイボウズ	23,200	1,577.00	36,586,400
電通総研	20,500	5,050.00	103,525,000
A C C E S S	17,500	1,434.00	25,095,000
デジタルガレージ	26,900	2,605.00	70,074,500
E Mシステムズ	28,100	624.00	17,534,400

ウェザーニューズ	5,200	4,500.00	23,400,000
C I J	41,900	488.00	20,447,200
ビジネスエンジニアリング	3,200	3,510.00	11,232,000
日本エンタープライズ	7,900	140.00	1,106,000
WOWOW	12,700	1,092.00	13,868,400
スカラ	15,600	716.00	11,169,600
インテリジェント ウェイブ	4,000	1,109.00	4,436,000
ANYCOLOR	17,800	2,226.00	39,622,800
I M A G I C A G R O U P	16,900	614.00	10,376,600
ネットワンシステムズ	67,900	2,674.50	181,598,550
システムソフト	58,900	52.00	3,062,800
アルゴグラフィックス	15,400	3,990.00	61,446,000
マーベラス	27,400	676.00	18,522,400
エイベックス	28,700	1,305.00	37,453,500
B I P R O G Y	55,000	4,628.00	254,540,000
都築電気	8,900	2,184.00	19,437,600
T B S ホールディングス	84,600	4,265.00	360,819,000
日本テレビホールディングス	149,000	2,257.50	336,367,500
朝日放送グループホールディングス	15,800	642.00	10,143,600
テレビ朝日ホールディングス	40,900	2,053.00	83,967,700
スカパーJ S A Tホールディングス	130,700	932.00	121,812,400
テレビ東京ホールディングス	12,100	2,940.00	35,574,000
日本BS放送	2,700	912.00	2,462,400
ビジョン	25,400	1,019.00	25,882,600
スマートバリュー	2,200	386.00	849,200
U - N E X T H O L D I N G S	18,900	4,295.00	81,175,500
ワイヤレスゲート	3,400	215.00	731,000
日本通信	165,700	196.00	32,477,200
クロップス	1,000	1,026.00	1,026,000
日本電信電話	50,048,600	172.00	8,608,359,200
K D D I	1,300,200	4,359.00	5,667,571,800
ソフトバンク	2,709,600	1,837.00	4,977,535,200
光通信	17,000	24,630.00	418,710,000
エムティーアイ	11,600	689.00	7,992,400
G M O インターネットグループ	62,200	2,600.00	161,720,000
ファイバーゲート	9,100	1,079.00	9,818,900
アйдママーケティングコミュニケーション	2,100	225.00	472,500
K A D O K A W A	89,000	2,799.50	249,155,500
学研ホールディングス	28,000	933.00	26,124,000
ゼンリン	28,800	812.00	23,385,600
昭文社ホールディングス	3,200	378.00	1,209,600
インプレスホールディングス	7,600	163.00	1,238,800

アイネット	10,200	2,062.00	21,032,400
松竹	8,700	9,364.00	81,466,800
東宝	93,600	5,488.00	513,676,800
東映	27,800	3,745.00	104,111,000
N T Tデータグループ	439,900	2,363.50	1,039,703,650
ピー・シー・エー	9,700	1,755.00	17,023,500
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	1,942.00	12,817,200
D T S	35,500	4,000.00	142,000,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	76,900	5,651.00	434,561,900
シーイーシー	21,200	1,765.00	37,418,000
カブコン	301,000	2,509.50	755,359,500
アイ・エス・ピー	8,600	1,269.00	10,913,400
ジャステック	10,400	1,937.00	20,144,800
S C S K	117,700	2,742.50	322,792,250
N S W	7,500	2,894.00	21,705,000
アイネス	13,100	1,532.00	20,069,200
T K C	26,700	3,740.00	99,858,000
富士ソフト	33,800	6,140.00	207,532,000
N S D	60,000	3,015.00	180,900,000
コナミグループ	63,000	9,374.00	590,562,000
福井コンピュータホールディングス	10,400	2,419.00	25,157,600
J B C Cホールディングス	11,200	3,245.00	36,344,000
ミロク情報サービス	15,300	1,643.00	25,137,900
ソフトバンクグループ	830,000	7,511.00	6,234,130,000
リョーサン菱洋ホールディングス	33,400	2,771.00	92,551,400
高千穂交易	5,600	3,675.00	20,580,000
オルバヘルスケアホールディングス	1,300	1,985.00	2,580,500
伊藤忠食品	4,000	6,840.00	27,360,000
エレマテック	15,900	1,809.00	28,763,100
あらた	27,200	3,205.00	87,176,000
トーメンデバイス	2,600	6,180.00	16,068,000
東京エレクトロン デバイス	17,700	5,670.00	100,359,000
円谷フィールズホールディングス	30,500	1,675.00	51,087,500
双日	197,600	3,887.00	768,071,200
アルフレッサ ホールディングス	178,200	2,203.50	392,663,700
横浜冷凍	48,400	1,008.00	48,787,200
ラサ商事	7,200	1,890.00	13,608,000
アルコニックス	23,400	1,410.00	32,994,000
神戸物産	137,300	3,352.00	460,229,600
ハイパー	1,800	294.00	529,200
あい ホールディングス	28,400	2,400.00	68,160,000
ディービーエックス	2,200	997.00	2,193,400

ダイワボウホールディングス	78,600	2,629.00	206,639,400
マクニカホールディングス	42,000	6,699.00	281,358,000
ラクト・ジャパン	6,900	2,555.00	17,629,500
グリムス	7,500	1,954.00	14,655,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,900	1,206.00	32,441,400
八洲電機	14,400	1,539.00	22,161,600
メディアスホールディングス	10,300	752.00	7,745,600
レスター	15,100	2,900.00	43,790,000
ジオリーブグループ	1,800	1,253.00	2,255,400
大光	4,100	637.00	2,611,700
OCHIホールディングス	1,800	1,602.00	2,883,600
TOKAIホールディングス	96,400	961.00	92,640,400
黒谷	2,200	635.00	1,397,000
Cominix	1,600	865.00	1,384,000
三洋貿易	20,000	1,437.00	28,740,000
ビューティガレージ	5,600	1,943.00	10,880,800
ウイン・パートナーズ	11,500	1,180.00	13,570,000
ミタチ産業	2,200	1,123.00	2,470,600
シップヘルスケアホールディングス	63,800	2,224.00	141,891,200
明治電機工業	6,600	1,586.00	10,467,600
デリカフーズホールディングス	3,400	585.00	1,989,000
スターティアホールディングス	2,100	1,425.00	2,992,500
コメダホールディングス	43,500	2,576.00	112,056,000
ピーバンドットコム	1,100	380.00	418,000
アセンテック	6,800	526.00	3,576,800
富士興産	2,200	1,782.00	3,920,400
協栄産業	800	2,579.00	2,063,200
フルサト・マルカホールディングス	15,800	2,149.00	33,954,200
ヤマエグループホールディングス	11,700	2,700.00	31,590,000
小野建	17,400	1,795.00	31,233,000
南陽	3,200	1,208.00	3,865,600
佐島電機	9,900	2,216.00	21,938,400
エコートレーディング	1,500	1,193.00	1,789,500
伯東	10,200	5,380.00	54,876,000
コンドーテック	13,700	1,234.00	16,905,800
中山福	4,300	359.00	1,543,700
ナガイレーベン	22,400	2,341.00	52,438,400
三菱食品	16,400	5,360.00	87,904,000
松田産業	13,500	2,619.00	35,356,500
第一興商	68,700	1,853.00	127,301,100
メディバルホールディングス	180,500	2,432.00	438,976,000
SPK	7,900	1,962.00	15,499,800



萩原電気ホールディングス	7,600	4,020.00	30,552,000
アズワン	55,600	2,556.50	142,141,400
スズデン	6,200	2,081.00	12,902,200
尾家産業	1,900	1,623.00	3,083,700
シモジマ	11,900	1,246.00	14,827,400
ドウシシャ	16,400	2,110.00	34,604,000
小津産業	1,800	1,786.00	3,214,800
高速	10,500	2,117.00	22,228,500
たけびし	6,800	2,096.00	14,252,800
リックス	3,600	4,485.00	16,146,000
丸文	15,900	1,402.00	22,291,800
ハピネット	15,100	2,914.00	44,001,400
橋本総業ホールディングス	7,000	1,290.00	9,030,000
日本ライフライン	52,000	1,151.00	59,852,000
タカショー	15,500	507.00	7,858,500
I D O M	47,000	1,404.00	65,988,000
進和	10,900	2,661.00	29,004,900
エスケイジャパン	1,900	795.00	1,510,500
ダイトロン	7,000	3,280.00	22,960,000
シークス	25,300	1,548.00	39,164,400
田中商事	2,200	901.00	1,982,200
オーハシテクニカ	9,300	1,540.00	14,322,000
白銅	5,000	2,687.00	13,435,000
ダイコー通産	800	1,359.00	1,087,200
伊藤忠商事	1,193,100	6,577.00	7,847,018,700
丸紅	1,472,300	2,645.50	3,894,969,650
高島	5,400	1,166.00	6,296,400
長瀬産業	81,400	2,607.00	212,209,800
蝶理	11,100	3,240.00	35,964,000
豊田通商	155,500	9,398.00	1,461,389,000
三共生興	24,600	743.00	18,277,800
兼松	74,200	2,503.00	185,722,600
ツカモトコーポレーション	1,100	1,229.00	1,351,900
三井物産	1,329,400	7,273.00	9,668,726,200
日本紙パルプ商事	8,500	5,340.00	45,390,000
カメイ	18,900	2,005.00	37,894,500
東都水産	500	6,460.00	3,230,000
O U Gホールディングス	1,200	2,685.00	3,222,000
スターゼン	12,300	2,672.00	32,865,600
山善	53,800	1,338.00	71,984,400
椿本興業	11,000	2,111.00	23,221,000
住友商事	1,074,200	3,781.00	4,061,550,200

内田洋行	7,200	6,830.00	49,176,000
三菱商事	3,408,200	3,477.00	11,850,311,400
第一実業	16,700	1,897.00	31,679,900
キャノンマーケティングジャパン	41,100	4,271.00	175,538,100
西華産業	7,000	3,860.00	27,020,000
佐藤商事	12,300	1,680.00	20,664,000
東京産業	16,200	647.00	10,481,400
ユアサ商事	13,900	5,480.00	76,172,000
神鋼商事	4,500	6,810.00	30,645,000
トルク	4,300	250.00	1,075,000
阪和興業	31,900	5,850.00	186,615,000
正栄食品工業	11,800	4,390.00	51,802,000
カナデン	13,300	1,534.00	20,402,200
R Y O D E N	14,300	2,620.00	37,466,000
岩谷産業	40,400	8,914.00	360,125,600
ナイス	2,500	1,738.00	4,345,000
ニチモウ	2,500	2,204.00	5,510,000
極東貿易	10,600	1,931.00	20,468,600
アステナホールディングス	33,400	486.00	16,232,400
三愛オブリ	41,400	2,047.00	84,745,800
稲畑産業	35,100	3,135.00	110,038,500
G S I クレオス	9,500	2,258.00	21,451,000
明和産業	21,000	672.00	14,112,000
クワザワホールディングス	2,900	1,019.00	2,955,100
ワキタ	29,400	1,509.00	44,364,600
東邦ホールディングス	49,100	3,677.00	180,540,700
サンゲツ	40,900	3,340.00	136,606,000
ミツウロコグループホールディングス	22,700	1,339.00	30,395,300
シナネンホールディングス	4,900	4,720.00	23,128,000
伊藤忠エネクス	44,000	1,538.00	67,672,000
サンリオ	144,200	2,639.50	380,615,900
サンワテクノス	9,100	2,185.00	19,883,500
新光商事	23,900	964.00	23,039,600
トーヨー	6,900	3,085.00	21,286,500
三信電気	7,200	2,040.00	14,688,000
東陽テクニカ	18,000	1,479.00	26,622,000
モスフードサービス	26,100	3,430.00	89,523,000
加賀電子	16,200	5,830.00	94,446,000
ソーダニッカ	15,000	1,122.00	16,830,000
立花エレテック	11,800	2,901.00	34,231,800
フォーバル	7,000	1,159.00	8,113,000
P A L T A C	23,900	4,532.00	108,314,800

三谷産業	31,100	388.00	12,066,800
西本Wismettacホールディングス	4,500	5,640.00	25,380,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	2,540.00	1,778,000
コア商事ホールディングス	12,500	819.00	10,237,500
KPPグループホールディングス	46,000	726.00	33,396,000
ヤマタネ	7,800	2,559.00	19,960,200
丸紅建材リース	600	2,835.00	1,701,000
泉州電業	8,300	5,590.00	46,397,000
トラスコ中山	37,300	2,423.00	90,377,900
オートバックスセブン	61,800	1,585.00	97,953,000
モリト	12,700	1,486.00	18,872,200
加藤産業	22,000	4,545.00	99,990,000
北恵	2,000	864.00	1,728,000
イエローハット	28,200	2,068.00	58,317,600
JKホールディングス	13,700	1,034.00	14,165,800
日伝	12,000	2,436.00	29,232,000
北沢産業	4,900	341.00	1,670,900
杉本商事	8,600	2,148.00	18,472,800
因幡電機産業	46,000	3,445.00	158,470,000
東テク	17,800	3,150.00	56,070,000
ミスミグループ本社	268,100	2,283.50	612,206,350
アルテック	4,300	288.00	1,238,400
タキヒヨー	1,900	1,194.00	2,268,600
蔵王産業	1,400	2,491.00	3,487,400
スズケン	67,600	4,537.00	306,701,200
ジェコス	10,600	1,093.00	11,585,800
ローソン	37,900	10,355.00	392,454,500
サンエー	13,600	4,795.00	65,212,000
カワチ薬品	14,000	2,651.00	37,114,000
エービーシー・マート	77,800	3,125.00	243,125,000
ハードオフコーポレーション	6,500	1,729.00	11,238,500
アスクル	43,000	2,367.00	101,781,000
ゲオホールディングス	20,100	2,001.00	40,220,100
アダストリア	21,500	3,400.00	73,100,000
くら寿司	20,900	4,725.00	98,752,500
キャンドウ	6,500	2,779.00	18,063,500
IKホールディングス	3,700	378.00	1,398,600
パルグループホールディングス	35,000	1,886.00	66,010,000
エディオン	70,500	1,600.00	112,800,000
サーラコーポレーション	37,800	794.00	30,013,200
ワッツ	4,300	721.00	3,100,300
ハローズ	8,200	4,530.00	37,146,000

あみやき亭	4,400	6,190.00	27,236,000
大黒天物産	5,500	8,500.00	46,750,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,689.00	27,024,000
ファーマライズホールディングス	2,400	649.00	1,557,600
アルペン	14,800	2,043.00	30,236,400
ハブ	3,100	789.00	2,445,900
クオールホールディングス	24,600	1,775.00	43,665,000
ジーンズホールディングス	10,600	3,285.00	34,821,000
ビックカメラ	94,700	1,577.00	149,341,900
D C Mホールディングス	94,100	1,407.00	132,398,700
MonotaRO	251,800	1,915.00	482,197,000
東京一番フーズ	2,600	509.00	1,323,400
きちりホールディングス	2,200	924.00	2,032,800
J.フロント リテイリング	203,900	1,512.50	308,398,750
ドトール・日レスホールディングス	31,700	2,091.00	66,284,700
マツキヨココカラ&カンパニー	323,100	2,273.00	734,406,300
ブロンコビリー	10,500	3,860.00	40,530,000
Z O Z O	113,200	3,417.00	386,804,400
トレジャー・ファクトリー	10,000	1,654.00	16,540,000
物語コーポレーション	29,700	4,305.00	127,858,500
三越伊勢丹ホールディングス	299,200	2,330.00	697,136,000
Hamee	7,500	1,188.00	8,910,000
マーケットエンタープライズ	1,100	680.00	748,000
ウエルシアホールディングス	92,200	2,351.50	216,808,300
クリエイティブSDホールディングス	25,300	3,385.00	85,640,500
丸善C H Iホールディングス	10,500	335.00	3,517,500
ミサワ	2,200	621.00	1,366,200
ティーライフ	1,300	1,389.00	1,805,700
チムニー	2,400	1,294.00	3,105,600
シュッピン	16,400	1,180.00	19,352,000
オイシックス・ラ・大地	24,200	1,153.00	27,902,600
ネクステージ	40,700	2,757.00	112,209,900
ジョイフル本田	51,800	2,218.00	114,892,400
鳥貴族ホールディングス	6,700	4,060.00	27,202,000
ホットランド	13,800	2,165.00	29,877,000
すかいらーくホールディングス	242,800	2,239.00	543,629,200
S F Pホールディングス	8,600	1,992.00	17,131,200
綿半ホールディングス	14,000	1,521.00	21,294,000
ヨシックスホールディングス	3,800	2,748.00	10,442,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,000	884.00	44,200,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	582.00	5,063,400
B E E N O S	7,400	2,168.00	16,043,200

あさひ	16,700	1,434.00	23,947,800	
日本調剤	11,900	1,520.00	18,088,000	
コスモス薬品	15,100	14,200.00	214,420,000	
トーエル	4,000	808.00	3,232,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,817,200	2,031.00	3,690,733,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	120,200	1,085.00	130,417,000	
ツルハホールディングス	37,300	9,961.00	371,545,300	
サンマルクホールディングス	14,500	2,107.00	30,551,500	
フェリシモ	2,200	906.00	1,993,200	
トリドールホールディングス	49,900	3,775.00	188,372,500	
TOKYO BASE	21,500	276.00	5,934,000	
ウイルプラスホールディングス	1,900	1,010.00	1,919,000	
JMホールディングス	13,500	2,635.00	35,572,500	
サツドラホールディングス	3,600	940.00	3,384,000	
アレンザホールディングス	13,600	1,070.00	14,552,000	
串カツ田中ホールディングス	5,000	1,717.00	8,585,000	
パロックジャパンリミテッド	14,300	759.00	10,853,700	
クスリのアオキホールディングス	53,500	2,821.50	150,950,250	
力の源ホールディングス	9,100	1,750.00	15,925,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	94,800	3,024.00	286,675,200	
メディカルシステムネットワーク	19,800	637.00	12,612,600	
はるやまホールディングス	4,400	604.00	2,657,600	
ノジマ	51,700	1,811.00	93,628,700	
カッパ・クリエイト	27,900	1,596.00	44,528,400	
ライトオン	5,900	400.00	2,360,000	
良品計画	193,900	2,455.50	476,121,450	
パリミキホールディングス	10,800	397.00	4,287,600	
アドヴァングループ	16,900	1,035.00	17,491,500	
アルビス	6,000	2,625.00	15,750,000	
コナカ	8,600	395.00	3,397,000	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,597.00	1,916,400	
G - 7ホールディングス	19,600	1,375.00	26,950,000	
イオン北海道	52,600	914.00	48,076,400	
コジマ	29,800	837.00	24,942,600	
ヒマラヤ	2,900	915.00	2,653,500	
コーナン商事	21,800	4,410.00	96,138,000	
エコス	6,700	2,325.00	15,577,500	
ワタミ	18,700	926.00	17,316,200	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	358,500	3,757.00	1,346,884,500	
西松屋チェーン	35,100	2,134.00	74,903,400	

ゼンショーホールディングス	90,500	6,034.00	546,077,000
幸楽苑ホールディングス	13,100	1,262.00	16,532,200
ハークスレイ	2,800	912.00	2,553,600
サイゼリヤ	26,300	5,390.00	141,757,000
V Tホールディングス	68,200	519.00	35,395,800
魚力	6,400	2,390.00	15,296,000
フジ・コーポレーション	8,700	1,705.00	14,833,500
ユナイテッドアローズ	21,100	1,804.00	38,064,400
ハイデイ日高	26,500	2,765.00	73,272,500
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	6,700	152.00	1,018,400
コロワイド	76,300	2,152.50	164,235,750
巻番屋	70,500	1,109.00	78,184,500
P L A N T	2,000	1,810.00	3,620,000
スギホールディングス	107,400	2,388.00	256,471,200
薬王堂ホールディングス	8,800	2,826.00	24,868,800
スクロール	26,800	918.00	24,602,400
ヨンドシーホールディングス	17,000	1,855.00	31,535,000
木曽路	27,000	2,499.00	67,473,000
S R S ホールディングス	29,600	1,136.00	33,625,600
千趣会	32,700	310.00	10,137,000
リテールパートナーズ	26,600	1,688.00	44,900,800
上新電機	17,700	2,507.00	44,373,900
日本瓦斯	94,200	2,590.00	243,978,000
ロイヤルホールディングス	31,300	2,465.00	77,154,500
いなげや	17,300	1,238.00	21,417,400
チヨダ	17,400	869.00	15,120,600
ライフコーポレーション	18,600	3,960.00	73,656,000
リンガーハット	22,900	2,336.00	53,494,400
M r M a x H D	23,000	651.00	14,973,000
A O K I ホールディングス	38,400	1,110.00	42,624,000
オークワ	25,700	994.00	25,545,800
コメリ	27,400	3,400.00	93,160,000
青山商事	38,200	1,597.00	61,005,400
しまむら	41,700	7,429.00	309,789,300
はせがわ	4,900	348.00	1,705,200
高島屋	122,700	2,262.00	277,547,400
松屋	30,200	923.00	27,874,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	78,600	1,835.00	144,231,000
近鉄百貨店	7,800	2,201.00	17,167,800
丸井グループ	117,900	2,407.00	283,785,300
アクシアル リテイリング	48,800	1,064.00	51,923,200
イオン	601,700	3,322.00	1,998,847,400

イズミ	31,500	3,663.00	115,384,500
平和堂	29,700	2,430.00	72,171,000
フジ	27,300	1,939.00	52,934,700
ヤオコー	20,900	8,398.00	175,518,200
ゼビオホールディングス	24,400	1,009.00	24,619,600
ケーズホールディングス	119,500	1,490.50	178,114,750
Olympicグループ	4,300	511.00	2,197,300
日産東京販売ホールディングス	12,400	544.00	6,745,600
シルバーライフ	3,800	922.00	3,503,600
Genky DrugStores	7,800	6,040.00	47,112,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,344.00	2,150,400
ブックオフグループホールディングス	10,500	1,716.00	18,018,000
ギフトホールディングス	7,600	3,055.00	23,218,000
アインホールディングス	24,500	5,925.00	145,162,500
元気寿司	10,200	2,976.00	30,355,200
ヤマダホールディングス	546,800	449.20	245,622,560
アークランズ	53,000	1,923.00	101,919,000
ニトリホールディングス	64,600	21,480.00	1,387,608,000
グルメ杵屋	14,700	1,067.00	15,684,900
愛眼	5,800	187.00	1,084,600
ケーユーホールディングス	8,700	1,118.00	9,726,600
吉野家ホールディングス	65,500	2,891.00	189,360,500
松屋フーズホールディングス	8,400	5,590.00	46,956,000
サガミホールディングス	26,900	1,471.00	39,569,900
関西フードマーケット	12,200	1,894.00	23,106,800
王将フードサービス	13,200	7,630.00	100,716,000
ミニストップ	13,000	1,531.00	19,903,000
アークス	32,700	3,210.00	104,967,000
パローホールディングス	34,000	2,443.00	83,062,000
ベルク	8,900	7,660.00	68,174,000
大庄	8,800	1,231.00	10,832,800
ファーストリテイリング	79,900	41,450.00	3,311,855,000
サンドラッグ	60,000	4,414.00	264,840,000
サクスパー ホールディングス	15,400	863.00	13,290,200
ヤマザワ	2,000	1,233.00	2,466,000
やまや	1,800	3,045.00	5,481,000
ベルーナ	43,300	622.00	26,932,600
いよぎんホールディングス	196,600	1,180.00	231,988,000
しずおかフィナンシャルグループ	367,100	1,460.00	535,966,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	139,100	1,314.50	182,846,950
楽天銀行	57,500	3,275.00	188,312,500
京都フィナンシャルグループ	209,300	2,768.50	579,447,050

島根銀行	2,100	570.00	1,197,000
じもとホールディングス	6,500	548.00	3,562,000
めぶきフィナンシャルグループ	765,700	545.50	417,689,350
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,200	4,645.00	98,474,000
九州フィナンシャルグループ	319,800	1,050.00	335,790,000
ゆうちょ銀行	1,815,600	1,562.50	2,836,875,000
富山第一銀行	52,400	913.00	47,841,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	886,500	833.10	738,543,150
西日本フィナンシャルホールディングス	93,200	1,939.00	180,714,800
三十三フィナンシャルグループ	14,800	2,029.00	30,029,200
第四北越フィナンシャルグループ	25,900	4,435.00	114,866,500
ひろぎんホールディングス	235,200	1,101.00	258,955,200
おきなわフィナンシャルグループ	14,100	2,598.00	36,631,800
十六フィナンシャルグループ	21,400	4,625.00	98,975,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,400	5,450.00	94,830,000
プロクレアホールディングス	18,900	1,831.00	34,605,900
あいちフィナンシャルグループ	25,400	3,175.00	80,645,000
あおぞら銀行	118,700	2,463.00	292,358,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,062,200	1,546.00	15,556,161,200
りそなホールディングス	1,910,900	996.10	1,903,447,490
三井住友トラスト・ホールディングス	592,700	3,243.00	1,922,126,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,174,700	8,699.00	10,218,715,300
千葉銀行	460,500	1,323.00	609,241,500
群馬銀行	320,600	917.40	294,118,440
武蔵野銀行	23,100	2,990.00	69,069,000
千葉興業銀行	31,200	1,113.00	34,725,600
筑波銀行	72,500	298.00	21,605,000
七十七銀行	48,100	4,265.00	205,146,500
秋田銀行	11,100	1,964.00	21,800,400
山形銀行	18,400	1,147.00	21,104,800
岩手銀行	10,400	2,413.00	25,095,200
東邦銀行	130,700	336.00	43,915,200
東北銀行	3,600	1,174.00	4,226,400
ふくおかフィナンシャルグループ	143,900	4,188.00	602,653,200
スルガ銀行	145,600	954.00	138,902,400
八十二銀行	354,500	1,033.50	366,375,750
山梨中央銀行	18,500	1,753.00	32,430,500
大垣共立銀行	31,500	2,224.00	70,056,000
福井銀行	14,800	1,852.00	27,409,600
清水銀行	6,600	1,574.00	10,388,400
富山銀行	1,200	1,862.00	2,234,400
滋賀銀行	27,500	4,075.00	112,062,500



南都銀行	24,900	3,015.00	75,073,500
百五銀行	155,400	642.00	99,766,800
紀陽銀行	59,100	1,780.00	105,198,000
ほくほくフィナンシャルグループ	102,200	1,897.00	193,873,400
山陰合同銀行	103,400	1,171.00	121,081,400
鳥取銀行	2,500	1,381.00	3,452,500
百十四銀行	16,300	2,879.00	46,927,700
四国銀行	24,200	1,125.00	27,225,000
阿波銀行	23,200	2,486.00	57,675,200
大分銀行	9,900	2,893.00	28,640,700
宮崎銀行	10,000	2,789.00	27,890,000
佐賀銀行	9,700	2,070.00	20,079,000
琉球銀行	35,200	1,153.00	40,585,600
セブン銀行	517,900	279.70	144,856,630
みずほフィナンシャルグループ	2,230,200	3,019.00	6,732,973,800
高知銀行	2,500	938.00	2,345,000
山口フィナンシャルグループ	162,000	1,580.50	256,041,000
名古屋銀行	10,500	6,630.00	69,615,000
北洋銀行	250,400	453.00	113,431,200
大光銀行	2,400	1,452.00	3,484,800
愛媛銀行	22,300	1,141.00	25,444,300
トマト銀行	2,600	1,212.00	3,151,200
京葉銀行	68,000	752.00	51,136,000
栃木銀行	82,500	351.00	28,957,500
北日本銀行	5,400	2,387.00	12,889,800
東和銀行	30,300	659.00	19,967,700
福島銀行	7,700	316.00	2,433,200
大東銀行	3,200	723.00	2,313,600
トモニホールディングス	156,400	418.00	65,375,200
フィデアホールディングス	17,100	1,534.00	26,231,400
池田泉州ホールディングス	229,200	388.00	88,929,600
F P G	55,900	2,204.00	123,203,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	26,900	1,053.00	28,325,700
マーキュリアホールディングス	3,900	1,000.00	3,900,000
S B I ホールディングス	243,600	3,750.00	913,500,000
ジャフコ グループ	49,300	1,718.50	84,722,050
大和証券グループ本社	1,280,000	1,110.00	1,420,800,000
野村ホールディングス	2,778,700	897.30	2,493,327,510
岡三証券グループ	145,200	753.00	109,335,600
丸三証券	55,100	1,028.00	56,642,800
東洋証券	44,100	364.00	16,052,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	196,400	569.00	111,751,600

光世証券	1,800	695.00	1,251,000
水戸証券	49,000	485.00	23,765,000
いちよし証券	31,100	813.00	25,284,300
松井証券	81,500	815.00	66,422,500
マネックスグループ	162,000	826.00	133,812,000
極東証券	22,700	1,544.00	35,048,800
岩井コスモホールディングス	18,900	2,210.00	41,769,000
アイザワ証券グループ	23,900	1,310.00	31,309,000
マネーパートナーズグループ	8,000	281.00	2,248,000
スパークス・グループ	18,500	1,775.00	32,837,500
かんぽ生命保険	168,300	2,925.50	492,361,650
F P パートナー	3,300	5,430.00	17,919,000
S O M P O ホールディングス	745,700	3,039.00	2,266,182,300
アニコム ホールディングス	56,100	563.00	31,584,300
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,109,800	2,730.00	3,029,754,000
第一生命ホールディングス	807,300	3,489.00	2,816,669,700
東京海上ホールディングス	1,633,200	4,740.00	7,741,368,000
T & D ホールディングス	443,700	2,528.50	1,121,895,450
アドバンスクリエイト	9,600	1,050.00	10,080,000
N E X Y Z . G r o u p	2,800	637.00	1,783,600
全国保証	43,300	5,500.00	238,150,000
あんしん保証	5,100	227.00	1,157,700
イントラスト	3,300	848.00	2,798,400
日本モーゲージサービス	5,000	493.00	2,465,000
C a s a	3,400	826.00	2,808,400
S B I アルヒ	16,300	844.00	13,757,200
プレミアグループ	28,200	1,958.00	55,215,600
ネットプロテクションズホールディングス	57,200	204.00	11,668,800
クレディセゾン	104,900	2,947.00	309,140,300
芙蓉総合リース	15,200	13,525.00	205,580,000
みずほリース	138,800	1,092.00	151,569,600
東京センチュリー	123,800	1,548.00	191,642,400
日本証券金融	61,000	1,557.00	94,977,000
アイフル	244,200	489.00	119,413,800
リコーリース	15,800	5,170.00	81,686,000
イオンフィナンシャルサービス	95,200	1,307.00	124,426,400
アコム	296,000	394.20	116,683,200
ジャックス	17,700	5,530.00	97,881,000
オリエントコーポレーション	54,400	1,036.00	56,358,400
オリックス	991,000	3,183.00	3,154,353,000
三菱HCキャピタル	736,700	1,018.00	749,960,600
九州リースサービス	3,300	1,296.00	4,276,800

日本取引所グループ	426,100	3,794.00	1,616,623,400
イー・ギャランティ	27,200	1,730.00	47,056,000
アサックス	3,900	749.00	2,921,100
NECキャピタルソリューション	8,200	3,680.00	30,176,000
robot home	49,800	154.00	7,669,200
大東建託	60,600	16,995.00	1,029,897,000
いちご	191,700	438.00	83,964,600
日本駐車場開発	178,000	201.00	35,778,000
スター・マイカ・ホールディングス	20,200	606.00	12,241,200
SREホールディングス	7,300	3,585.00	26,170,500
ADワークスグループ	18,600	236.00	4,389,600
ヒューリック	385,800	1,489.00	574,456,200
野村不動産ホールディングス	92,100	4,168.00	383,872,800
三重交通グループホールディングス	36,400	600.00	21,840,000
サムティ	26,500	2,646.00	70,119,000
ディア・ライフ	28,800	1,017.00	29,289,600
地主	12,900	2,488.00	32,095,200
プレサンスコーポレーション	26,600	1,755.00	46,683,000
ハウスコム	1,800	921.00	1,657,800
JPMC	10,000	1,290.00	12,900,000
サンセイランディック	2,700	1,040.00	2,808,000
フージャースホールディングス	25,500	1,072.00	27,336,000
オープンハウスグループ	60,700	4,592.00	278,734,400
東急不動産ホールディングス	497,300	1,137.00	565,430,100
飯田グループホールディングス	158,600	2,008.00	318,468,800
イーランド	1,500	1,518.00	2,277,000
ムゲンエステート	5,300	1,395.00	7,393,500
And Doホールディングス	10,000	1,242.00	12,420,000
シーアールイー	9,700	1,354.00	13,133,800
ケイアイスター不動産	8,100	3,745.00	30,334,500
グッドコムアセット	16,100	809.00	13,024,900
ジェイ・エス・ビー	8,400	2,636.00	22,142,400
ロードスターキャピタル	11,000	3,025.00	33,275,000
テンポイノベーション	2,900	914.00	2,650,600
フェイスネットワーク	2,400	1,445.00	3,468,000
霞ヶ関キャピタル	4,500	15,960.00	71,820,000
パーク24	107,700	1,772.50	190,898,250
バラカ	6,200	1,951.00	12,096,200
三井不動産	2,292,600	1,585.00	3,633,771,000
三菱地所	1,080,300	2,793.50	3,017,818,050
平和不動産	27,000	4,120.00	111,240,000
東京建物	144,600	2,590.50	374,586,300

京阪神ビルディング	31,300	1,535.00	48,045,500
住友不動産	239,100	5,467.00	1,307,159,700
テオオーシー	30,200	799.00	24,129,800
レオパレス21	165,300	495.00	81,823,500
スターツコーポレーション	23,900	3,530.00	84,367,000
フジ住宅	21,700	735.00	15,949,500
空港施設	24,300	614.00	14,920,200
明和地所	10,100	976.00	9,857,600
ゴールドクレスト	13,700	2,408.00	32,989,600
エスリード	8,000	3,310.00	26,480,000
日神グループホールディングス	27,700	534.00	14,791,800
日本エスコン	30,900	1,002.00	30,961,800
MIRARTHホールディングス	75,900	483.00	36,659,700
AVANTIA	4,900	815.00	3,993,500
イオンモール	86,000	1,792.00	154,112,000
毎日コムネット	3,500	798.00	2,793,000
ファースト住建	3,500	1,124.00	3,934,000
カチタス	44,700	1,824.00	81,532,800
トーセイ	27,700	2,396.00	66,369,200
穴吹興産	2,000	2,144.00	4,288,000
サンフロンティア不動産	24,800	1,914.00	47,467,200
FJネクストホールディングス	17,900	1,329.00	23,789,100
インテリックス	1,800	581.00	1,045,800
ランドビジネス	2,700	265.00	715,500
サンネクスタグループ	3,000	1,029.00	3,087,000
グランディハウス	13,400	597.00	7,999,800
日本空港ビルデング	58,500	5,560.00	325,260,000
明豊ファシリティワークス	4,200	857.00	3,599,400
LIFULL	60,600	161.00	9,756,600
MIXI	37,100	2,494.00	92,527,400
ジェイエイシーリクルートメント	62,700	760.00	47,652,000
日本M&Aセンターホールディングス	275,100	860.40	236,696,040
メンバーズ	6,200	880.00	5,456,000
中広	1,900	418.00	794,200
UTグループ	22,300	3,370.00	75,151,000
アイティメディア	6,700	1,778.00	11,912,600
ケアネット	26,900	581.00	15,628,900
E・Jホールディングス	10,200	1,788.00	18,237,600
オープンアップグループ	52,000	2,037.00	105,924,000
コシダカホールディングス	51,900	926.00	48,059,400
アルトナー	3,300	2,100.00	6,930,000
パソナグループ	21,100	2,141.00	45,175,100

C D S	2,100	1,777.00	3,731,700
リンクアンドモチベーション	49,700	494.00	24,551,800
エス・エム・エス	60,500	2,283.50	138,151,750
サニーサイドアップグループ	3,100	697.00	2,160,700
パーソルホールディングス	1,756,900	214.90	377,557,810
リニカル	5,600	396.00	2,217,600
クックパッド	48,700	177.00	8,619,900
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,100	801.00	3,284,100
学情	8,900	1,744.00	15,521,600
スタジオアリス	8,800	2,002.00	17,617,600
エプコ	2,400	819.00	1,965,600
N J S	3,900	3,070.00	11,973,000
総合警備保障	288,400	854.20	246,351,280
カカクコム	112,100	1,779.00	199,425,900
アイロムグループ	7,100	1,796.00	12,751,600
セントケア・ホールディング	12,900	852.00	10,990,800
サイネックス	1,600	755.00	1,208,000
ルネサンス	13,700	1,002.00	13,727,400
ディップ	26,500	2,756.00	73,034,000
デジタルホールディングス	9,200	1,113.00	10,239,600
新日本科学	15,900	1,433.00	22,784,700
キャリアデザインセンター	1,700	1,830.00	3,111,000
エムスリー	341,000	1,861.00	634,601,000
ツカダ・グローバルホールディング	4,900	442.00	2,165,800
ウェルネット	7,300	549.00	4,007,700
ワールドホールディングス	7,900	2,348.00	18,549,200
ディー・エヌ・エー	61,500	1,538.00	94,587,000
博報堂D Yホールディングス	220,100	1,445.00	318,044,500
ぐるなび	33,000	327.00	10,791,000
タカミヤ	23,900	526.00	12,571,400
ファンコミュニケーションズ	24,800	402.00	9,969,600
ライク	6,600	1,706.00	11,259,600
A o b a - B B T	3,600	379.00	1,364,400
エスプール	50,400	305.00	15,372,000
W D Bホールディングス	8,900	2,154.00	19,170,600
ティア	5,100	458.00	2,335,800
C D G	1,000	1,280.00	1,280,000
アドウェイズ	24,300	436.00	10,594,800
バリューコマース	15,400	1,028.00	15,831,200
インフォマート	179,800	377.00	67,784,600
J Pホールディングス	44,600	488.00	21,764,800
エコナックホールディングス	8,700	128.00	1,113,600

C Lホールディングス	4,300	1,341.00	5,766,300
プレステージ・インターナショナル	81,100	669.00	54,255,900
アミューズ	10,700	1,586.00	16,970,200
ドリームインキュベータ	6,000	2,361.00	14,166,000
クイック	12,100	2,379.00	28,785,900
T A C	5,200	180.00	936,000
電通グループ	169,600	4,212.00	714,355,200
イオンファンタジー	6,300	2,269.00	14,294,700
シーティーエス	22,100	734.00	16,221,400
H . U . グループホールディングス	50,600	2,389.50	120,908,700
アルプス技研	16,500	2,681.00	44,236,500
日本空調サービス	18,800	889.00	16,713,200
オリエンタルランド	912,700	4,645.00	4,239,491,500
ダスキン	38,500	3,258.00	125,433,000
明光ネットワークジャパン	21,300	707.00	15,059,100
ファルコホールディングス	7,800	2,203.00	17,183,400
ラウンドワン	162,800	713.00	116,076,400
リゾートトラスト	75,000	2,616.50	196,237,500
ビー・エム・エル	21,300	2,954.00	62,920,200
リソー教育	89,500	271.00	24,254,500
早稲田アカデミー	9,700	1,517.00	14,714,900
ユー・エス・エス	387,200	1,234.50	477,998,400
東京個別指導学院	21,100	404.00	8,524,400
サイバーエージェント	381,400	1,032.00	393,604,800
楽天グループ	1,479,400	760.80	1,125,527,520
クリーク・アンド・リバー社	8,800	1,631.00	14,352,800
S B I グローバルアセットマネジメント	34,100	687.00	23,426,700
テー・オー・ダブリュー	34,500	362.00	12,489,000
山田コンサルティンググループ	7,600	1,895.00	14,402,000
セントラルスポーツ	6,600	2,430.00	16,038,000
フルキャストホールディングス	16,600	1,465.00	24,319,000
エン・ジャパン	28,200	2,740.00	77,268,000
リソルホールディングス	800	5,110.00	4,088,000
テクノプロ・ホールディングス	101,100	2,850.00	288,135,000
アトラグループ	2,300	164.00	377,200
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	1,175.00	10,810,000
K e e P e r 技研	10,700	4,420.00	47,294,000
ファーストロジック	2,300	505.00	1,161,500
三機サービス	1,500	1,348.00	2,022,000
G u n o s y	14,000	759.00	10,626,000
デザインワン・ジャパン	3,800	132.00	501,600
イー・ガーディアン	6,700	1,363.00	9,132,100

リブセンス	4,800	222.00	1,065,600
ジャパンマテリアル	52,900	2,186.00	115,639,400
ベクトル	21,400	1,244.00	26,621,600
ウチヤマホールディングス	4,000	348.00	1,392,000
チャーム・ケア・コーポレーション	14,500	1,472.00	21,344,000
キャリアリンク	6,400	2,422.00	15,500,800
I B J	13,700	525.00	7,192,500
アサンテ	8,700	1,627.00	14,154,900
バリューHR	15,300	1,306.00	19,981,800
M & A キャピタルパートナーズ	14,100	2,088.00	29,440,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	1,017.00	7,220,700
E R I ホールディングス	2,300	2,209.00	5,080,700
アビスト	1,300	3,125.00	4,062,500
シグマクシス・ホールディングス	22,800	1,564.00	35,659,200
ウィルグループ	14,700	1,060.00	15,582,000
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	11,100	140.00	1,554,000
メドピア	15,500	694.00	10,757,000
レアジョブ	1,800	681.00	1,225,800
リクルートホールディングス	1,276,800	6,308.00	8,054,054,400
エラン	23,100	903.00	20,859,300
土木管理総合試験所	4,400	324.00	1,425,600
日本郵政	2,026,700	1,454.50	2,947,835,150
ベルシステム24ホールディングス	18,700	1,509.00	28,218,300
鎌倉新書	15,200	516.00	7,843,200
S M N	2,200	358.00	787,600
グローバルキッズCOMPANY	1,800	644.00	1,159,200
エアトリ	12,800	1,460.00	18,688,000
アトラエ	10,300	418.00	4,305,400
ストライク	7,300	4,655.00	33,981,500
ソラスト	48,100	491.00	23,617,100
セラク	5,500	1,022.00	5,621,000
インソース	37,800	739.00	27,934,200
ベイカレント・コンサルティング	126,800	3,284.00	416,411,200
Orchestra Holdings	4,000	960.00	3,840,000
アイモバイル	22,600	381.00	8,610,600
キャリアインデックス	4,000	174.00	696,000
MS - Japan	6,500	1,206.00	7,839,000
船場	1,800	1,271.00	2,287,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	56,000	2,441.00	136,696,000
フルテック	1,300	1,112.00	1,445,600
GameWith	3,900	249.00	971,100
MS & Consulting	1,500	594.00	891,000

エル・ティー・エス	2,100	2,347.00	4,928,700
ミダックホールディングス	10,600	1,427.00	15,126,200
キュービーネットホールディングス	10,100	1,139.00	11,503,900
R P Aホールディングス	24,400	249.00	6,075,600
スプリックス	2,600	790.00	2,054,000
マネジメントソリューションズ	7,500	1,650.00	12,375,000
プロレド・パートナーズ	4,800	479.00	2,299,200
テノ・ホールディングス	1,500	439.00	658,500
フロンティア・マネジメント	4,500	1,497.00	6,736,500
コプロ・ホールディングス	2,700	1,530.00	4,131,000
ギークス	1,600	520.00	832,000
アンビスホールディングス	18,600	2,352.00	43,747,200
カーブスホールディングス	47,500	759.00	36,052,500
フォーラムエンジニアリング	23,800	922.00	21,943,600
Fast Fitness Japan	6,100	1,066.00	6,502,600
ダイレクトマーケティングミックス	18,800	250.00	4,700,000
ポピンズ	2,800	1,272.00	3,561,600
L I T A L I C O	13,600	1,875.00	25,500,000
コンフィデンス・インターワークス	800	1,524.00	1,219,200
アドバンテッジリスクマネジメント	4,600	393.00	1,807,800
リログループ	86,600	1,319.00	114,225,400
東祥	12,400	697.00	8,642,800
I D & Eホールディングス	10,500	4,380.00	45,990,000
ビーウィズ	3,700	1,920.00	7,104,000
T R Eホールディングス	33,200	1,240.00	41,168,000
人・夢・技術グループ	6,700	1,665.00	11,155,500
N I S S Oホールディングス	15,300	816.00	12,484,800
大栄環境	31,400	2,630.00	82,582,000
日本管財ホールディングス	18,200	2,547.00	46,355,400
M & A総研ホールディングス	8,300	5,140.00	42,662,000
エイチ・アイ・エス	50,300	1,767.00	88,880,100
ラックランド	8,000	1,844.00	14,752,000
共立メンテナンス	54,200	3,372.00	182,762,400
イチネンホールディングス	18,400	1,660.00	30,544,000
建設技術研究所	8,900	4,640.00	41,296,000
スペース	11,500	1,028.00	11,822,000
燦ホールディングス	16,400	1,068.00	17,515,200
スバル興業	5,400	2,758.00	14,893,200
東京テアトル	2,800	1,117.00	3,127,600
タナベコンサルティンググループ	6,200	980.00	6,076,000
ナガワ	5,400	7,020.00	37,908,000
東京都競馬	14,500	4,320.00	62,640,000



カナモト	26,800	2,676.00	71,716,800
ニシオホールディングス	16,100	3,755.00	60,455,500
トランス・コスモス	21,500	3,215.00	69,122,500
乃村工藝社	75,500	855.00	64,552,500
藤田観光	6,900	6,800.00	46,920,000
KNT-CTホールディングス	10,300	1,244.00	12,813,200
トーカイ	15,400	2,104.00	32,401,600
セコム	175,700	11,010.00	1,934,457,000
セントラル警備保障	9,400	2,701.00	25,389,400
丹青社	33,700	874.00	29,453,800
メイテックグループホールディングス	62,200	2,865.50	178,234,100
応用地質	16,200	2,364.00	38,296,800
船井総研ホールディングス	34,600	2,352.00	81,379,200
進学会ホールディングス	3,100	244.00	756,400
オオバ	5,400	1,086.00	5,864,400
いであ	2,200	2,247.00	4,943,400
学究社	7,000	2,151.00	15,057,000
イオンディライト	18,600	3,705.00	68,913,000
ナック	15,100	522.00	7,882,200
ダイセキ	35,300	2,977.00	105,088,100
ステップ	6,400	1,940.00	12,416,000
合計	269,710,300		630,541,004,260

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2024年 4月22日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	408,873,006
国債証券	559,811,473,490
地方債証券	33,127,358,429
特殊債券	37,231,003,717
社債券	31,230,573,000
未収入金	957,561,500
未収利息	972,598,691
前払費用	32,177,110
流動資産合計	663,771,618,943
資産合計	663,771,618,943

2024年 4月22日現在	
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
未払金	800,000,000
未払解約金	309,206,217
流動負債合計	1,109,206,217
負債合計	1,109,206,217
純資産の部	
元本等	
元本	502,149,062,095
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	160,513,350,631
元本等合計	662,662,412,726
純資産合計	662,662,412,726
負債純資産合計	663,771,618,943

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 4月22日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	502,149,062,095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。
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	有価証券 98,903,000円 1口当たり純資産額 1.3197円 (1万口当たり純資産額) (13,197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

2024年 4月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。

	2024年 4月22日現在
--	---------------

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	482,957,007,939円
期中追加設定元本額	35,483,738,714円
期中一部解約元本額	16,291,684,558円
期末元本額	502,149,062,095円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,124,784,595円
S B I 資産設計オープン（分配型）	18,413,093円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,845,415,047円
世界経済インデックスファンド	7,364,891,264円
D C マイセレクション 2 5	29,708,664,627円
D C マイセレクション 5 0	38,550,233,252円
D C マイセレクション 7 5	13,065,346,613円
D C 日本債券インデックス・オープン	402,764,896円
D C 日本債券インデックス・オープン S	87,640,090,562円
D C 日本債券インデックス・オープン P	62,407,304,253円
D C マイセレクション S 2 5	17,560,690,330円
D C マイセレクション S 5 0	21,213,642,325円
D C マイセレクション S 7 5	5,830,163,010円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	351,844,989円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,048,750,159円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,249,658,484円
D C 世界経済インデックスファンド	4,767,028,433円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,254,689円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	22,675,574円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	8,968,360円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,321,333円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	53,204,780円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	106,003,813円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	28,020,431円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	23,821,904円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,040,996,870円

区分	2024年 4月22日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	744,394,804円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,280,645,992円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	66,682,184円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	45,520,836円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	911,601,947円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,019,219,378円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,343,116,000円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	94,673,158円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,000,089,106円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,621,051,518円
分散投資コア戦略ファンドA	18,842,053,099円
分散投資コア戦略ファンドS	26,751,434,550円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	322,498,861円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,999,707,882円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	88,757,406円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	45,191,176円
SMT インデックスバランス・オープン	69,136,079円
SMT 世界経済インデックス・オープン	60,275,314円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	146,187,836円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	221,428,574円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	19,311,309円
グローバル経済コア	381,844,318円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	49,018,828円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	41,495,848円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	157,453,912円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	88,655,457円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	26,978,325円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	19,210,031円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	999,099,717円
10資産分散投資ファンド	454,023,110円
グローバル10資産バランスファンド	428,445,355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)	101,789,618,872円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	67,189,160円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	18,402,627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)	494,355,141円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	23,908,004,760
地方債証券	697,462,653
特殊債券	902,736,598
社債券	455,053,000
合計	25,963,257,011

(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448回利付国債(2年)	1,060,000,000	1,058,971,800	
	第449回利付国債(2年)	1,140,000,000	1,138,734,600	
	第450回利付国債(2年)	1,140,000,000	1,138,575,000	
	第451回利付国債(2年)	1,180,000,000	1,178,194,600	
	第452回利付国債(2年)	3,140,000,000	3,133,814,200	
	第453回利付国債(2年)	1,360,000,000	1,356,668,000	
	第454回利付国債(2年)	2,890,000,000	2,885,809,500	
	第455回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,046,377,500	
	第456回利付国債(2年)	1,100,000,000	1,097,393,000	
	第457回利付国債(2年)	2,720,000,000	2,712,520,000	
	第458回利付国債(2年)	1,490,000,000	1,488,212,000	
	第459回利付国債(2年)	30,000,000	29,953,500	
	第144回利付国債(5年)	6,580,000,000	6,579,210,400	
	第145回利付国債(5年)	5,020,000,000	5,015,733,000	
	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,790,448,000	
	第147回利付国債(5年)	5,040,000,000	5,015,102,400	
	第148回利付国債(5年)	5,970,000,000	5,934,717,300	
	第149回利付国債(5年)	5,680,000,000	5,641,887,200	
	第150回利付国債(5年)	5,310,000,000	5,269,325,400	
	第151回利付国債(5年)	3,880,000,000	3,846,438,000	
	第152回利付国債(5年)	690,000,000	685,922,100	
	第153回利付国債(5年)	5,980,000,000	5,921,037,200	
	第154回利付国債(5年)	5,090,000,000	5,048,771,000	
	第155回利付国債(5年)	2,720,000,000	2,714,097,600	
	第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,628,866,500	
	第157回利付国債(5年)	2,460,000,000	2,442,460,200	
	第158回利付国債(5年)	3,270,000,000	3,234,128,100	
	第159回利付国債(5年)	950,000,000	938,144,000	
	第160回利付国債(5年)	2,950,000,000	2,925,249,500	
	第161回利付国債(5年)	1,410,000,000	1,403,937,000	
	第162回利付国債(5年)	1,630,000,000	1,620,464,500	
	第163回利付国債(5年)	3,440,000,000	3,434,771,200	
	第164回利付国債(5年)	1,750,000,000	1,728,440,000	
第165回利付国債(5年)	2,510,000,000	2,490,522,400		
第166回利付国債(5年)	1,640,000,000	1,635,129,200		
第167回利付国債(5年)	50,000,000	49,784,000		

第1回利付国債(40年)	740,000,000	830,872,000	
第2回利付国債(40年)	1,030,000,000	1,113,296,100	
第3回利付国債(40年)	730,000,000	786,450,900	
第4回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,234,502,000	
第5回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,181,740,000	
第6回利付国債(40年)	1,630,000,000	1,634,564,000	
第7回利付国債(40年)	1,460,000,000	1,392,358,200	
第8回利付国債(40年)	1,310,000,000	1,153,258,500	
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,441,925,200	
第10回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,529,388,000	
第11回利付国債(40年)	1,525,000,000	1,094,431,500	
第12回利付国債(40年)	1,490,000,000	942,425,000	
第13回利付国債(40年)	2,330,000,000	1,452,358,900	
第14回利付国債(40年)	2,310,000,000	1,535,410,800	
第15回利付国債(40年)	2,950,000,000	2,160,226,000	
第16回利付国債(40年)	2,840,000,000	2,277,907,200	
第339回利付国債(10年)	5,860,000,000	5,879,631,000	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,444,929,100	
第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	5,026,626,400	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,745,053,600	
第343回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,655,797,100	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,873,863,000	
第345回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,854,868,000	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,716,017,500	
第347回利付国債(10年)	3,840,000,000	3,813,542,400	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,225,494,000	
第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,111,496,000	
第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	6,497,927,100	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,774,659,200	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,168,665,000	
第353回利付国債(10年)	4,415,000,000	4,341,490,250	
第354回利付国債(10年)	4,420,000,000	4,337,390,200	
第355回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,478,051,600	
第356回利付国債(10年)	4,580,000,000	4,482,262,800	
第357回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,693,702,600	
第358回利付国債(10年)	4,110,000,000	4,007,619,900	
第359回利付国債(10年)	4,645,000,000	4,519,120,500	
第360回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,268,891,900	
第361回利付国債(10年)	5,630,000,000	5,447,925,800	
第362回利付国債(10年)	4,450,000,000	4,293,894,000	
第363回利付国債(10年)	5,120,000,000	4,925,644,800	
第364回利付国債(10年)	5,560,000,000	5,332,429,200	

第365回利付国債(10年)	5,077,000,000	4,853,713,540	
第366回利付国債(10年)	5,760,000,000	5,533,804,800	
第367回利付国債(10年)	5,280,000,000	5,058,662,400	
第368回利付国債(10年)	5,550,000,000	5,302,192,500	
第369回利付国債(10年)	5,220,000,000	5,101,401,600	
第370回利付国債(10年)	6,160,000,000	6,006,308,000	
第371回利付国債(10年)	5,100,000,000	4,915,380,000	
第372回利付国債(10年)	5,320,000,000	5,303,720,800	
第373回利付国債(10年)	5,700,000,000	5,565,309,000	
第374回利付国債(10年)	30,000,000	29,781,300	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	123,491,500	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	177,220,800	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	132,576,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	126,409,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,409,500	
第6回利付国債(30年)	560,000,000	631,002,400	
第7回利付国債(30年)	380,000,000	426,952,800	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	923,083,000	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	252,684,000	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	164,264,000	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	280,326,800	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	211,709,400	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	442,248,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	858,180,000	
第15回利付国債(30年)	340,000,000	392,642,200	
第16回利付国債(30年)	200,000,000	231,230,000	
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,296,132,600	
第18回利付国債(30年)	315,000,000	358,441,650	
第19回利付国債(30年)	530,000,000	603,405,000	
第20回利付国債(30年)	480,000,000	557,164,800	
第21回利付国債(30年)	780,000,000	889,137,600	
第22回利付国債(30年)	540,000,000	627,852,600	
第23回利付国債(30年)	430,000,000	500,464,100	
第24回利付国債(30年)	680,000,000	791,302,400	
第25回利付国債(30年)	600,000,000	684,192,000	
第26回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,739,716,300	
第27回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,945,499,900	
第28回利付国債(30年)	1,850,000,000	2,153,307,500	
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,920,934,200	
第30回利付国債(30年)	1,970,000,000	2,236,935,000	
第31回利付国債(30年)	1,380,000,000	1,544,413,200	
第32回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,922,802,000	

第33回利付国債(30年)	2,290,000,000	2,484,947,700
第34回利付国債(30年)	2,165,000,000	2,408,346,000
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,675,176,000
第36回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,603,653,800
第37回利付国債(30年)	2,715,000,000	2,869,592,100
第38回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,618,203,600
第39回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,893,060,000
第40回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,227,972,900
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,326,610,800
第42回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,547,258,400
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,402,635,100
第44回利付国債(30年)	1,330,000,000	1,340,147,900
第45回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,515,758,400
第46回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,784,597,600
第47回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,577,552,000
第48回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,773,582,800
第49回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,637,462,300
第50回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,561,468,700
第51回利付国債(30年)	1,900,000,000	1,407,292,000
第52回利付国債(30年)	1,880,000,000	1,454,856,800
第53回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,207,277,100
第54回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,466,310,600
第55回利付国債(30年)	1,590,000,000	1,305,564,900
第56回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,440,454,400
第57回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,207,369,200
第58回利付国債(30年)	2,130,000,000	1,730,582,400
第59回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,129,027,900
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,345,825,800
第61回利付国債(30年)	1,250,000,000	979,200,000
第62回利付国債(30年)	1,285,000,000	951,876,600
第63回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,004,080,000
第64回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,084,656,800
第65回利付国債(30年)	1,385,000,000	984,181,000
第66回利付国債(30年)	1,495,000,000	1,057,039,750
第67回利付国債(30年)	1,665,000,000	1,240,175,250
第68回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,171,396,200
第69回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,222,666,200
第70回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,467,998,000
第71回利付国債(30年)	1,460,000,000	1,100,767,000
第72回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,254,520,700
第73回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,362,251,800
第74回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,557,964,800
第75回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,408,250,900



第76回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,601,226,600	
第77回利付国債(30年)	2,030,000,000	1,902,861,100	
第78回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,337,595,000	
第79回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,143,706,500	
第80回利付国債(30年)	2,070,000,000	2,025,205,200	
第81回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,174,912,200	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	173,520,700	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	275,904,900	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	225,066,600	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	400,101,000	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	616,386,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	299,016,100	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	483,836,800	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	300,123,900	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	529,737,000	
第87回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,855,889,900	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	438,249,000	
第89回利付国債(20年)	350,000,000	364,458,500	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	658,967,400	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	471,766,500	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	922,046,400	
第93回利付国債(20年)	410,000,000	430,081,800	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	641,640,700	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	881,667,500	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,679,024,100	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	956,763,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	466,268,000	
第99回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,605,492,400	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	513,825,600	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	770,891,550	
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,277,055,000	
第103回利付国債(20年)	400,000,000	431,264,000	
第104回利付国債(20年)	160,000,000	171,196,800	
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,265,845,000	
第106回利付国債(20年)	680,000,000	732,414,400	
第107回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,182,566,000	
第108回利付国債(20年)	840,000,000	895,389,600	
第109回利付国債(20年)	920,000,000	982,854,400	
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,185,712,000	
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,053,982,600	
第112回利付国債(20年)	990,000,000	1,070,734,500	
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,192,003,000	

第114回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,395,074,000	
第115回利付国債(20年)	700,000,000	765,919,000	
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,820,854,000	
第117回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,614,931,600	
第118回利付国債(20年)	660,000,000	717,862,200	
第119回利付国債(20年)	530,000,000	570,142,200	
第120回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,456,981,300	
第121回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,592,392,200	
第122回利付国債(20年)	900,000,000	969,363,000	
第123回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,976,706,000	
第124回利付国債(20年)	760,000,000	829,730,000	
第125回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,372,481,600	
第126回利付国債(20年)	930,000,000	1,016,685,300	
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,108,301,400	
第128回利付国債(20年)	1,270,000,000	1,381,417,100	
第129回利付国債(20年)	740,000,000	799,851,200	
第130回利付国債(20年)	1,685,000,000	1,822,647,650	
第131回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,386,246,900	
第132回利付国債(20年)	790,000,000	849,597,600	
第133回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,959,723,200	
第134回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,603,772,400	
第135回利付国債(20年)	130,000,000	139,896,900	
第136回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,228,453,000	
第137回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,292,112,000	
第138回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,411,023,600	
第139回利付国債(20年)	480,000,000	512,942,400	
第140回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,682,452,100	
第141回利付国債(20年)	1,650,000,000	1,778,188,500	
第142回利付国債(20年)	1,265,000,000	1,374,131,550	
第143回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,775,569,200	
第144回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,135,098,800	
第145回利付国債(20年)	2,275,000,000	2,452,859,500	
第146回利付国債(20年)	2,670,000,000	2,879,034,300	
第147回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,928,676,400	
第148回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,393,114,000	
第149回利付国債(20年)	2,980,000,000	3,153,734,000	
第150回利付国債(20年)	2,970,000,000	3,109,857,300	
第151回利付国債(20年)	2,515,000,000	2,579,585,200	
第152回利付国債(20年)	2,680,000,000	2,744,856,000	
第153回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,428,067,000	
第154回利付国債(20年)	2,845,000,000	2,904,745,000	
第155回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,633,109,600	
第156回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,543,405,000	

第157回利付国債(20年)	3,090,000,000	2,787,241,800	
第158回利付国債(20年)	2,860,000,000	2,666,778,400	
第159回利付国債(20年)	2,310,000,000	2,171,977,500	
第160回利付国債(20年)	2,080,000,000	1,973,691,200	
第161回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,230,826,000	
第162回利付国債(20年)	1,650,000,000	1,533,856,500	
第163回利付国債(20年)	2,610,000,000	2,416,259,700	
第164回利付国債(20年)	2,370,000,000	2,154,306,300	
第165回利付国債(20年)	2,410,000,000	2,180,736,700	
第166回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,659,634,300	
第167回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,178,543,600	
第168回利付国債(20年)	1,630,000,000	1,432,492,900	
第169回利付国債(20年)	2,040,000,000	1,754,991,600	
第170回利付国債(20年)	2,550,000,000	2,181,984,000	
第171回利付国債(20年)	1,960,000,000	1,668,077,600	
第172回利付国債(20年)	2,000,000,000	1,721,880,000	
第173回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,055,288,000	
第174回利付国債(20年)	2,620,000,000	2,231,637,400	
第175回利付国債(20年)	2,270,000,000	1,956,989,700	
第176回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,025,304,800	
第177回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,012,256,000	
第178回利付国債(20年)	2,480,000,000	2,107,057,600	
第179回利付国債(20年)	2,685,000,000	2,270,489,700	
第180回利付国債(20年)	2,200,000,000	1,955,008,000	
第181回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,189,114,100	
第182回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,193,738,000	
第183回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,427,152,400	
第184回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,160,756,000	
第185回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,244,629,200	
第186回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,278,866,400	
第187回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,712,133,300	
国債証券合計	576,677,000,000	559,811,473,490	
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	99,236,000	
第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	74,131,000	
第6回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	99,515,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	112,881,000	
第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	109,546,000	
第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	104,714,000	
第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	101,230,000	
第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	213,436,000	

第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,082,000	
第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,831,000	
第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	74,931,000	
第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	214,266,000	
第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	213,514,000	
第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	198,992,000	
第751回東京都公募公債	100,000,000	100,090,000	
第765回東京都公募公債	100,000,000	99,453,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	99,267,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	295,848,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	194,248,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	287,049,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,744,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,420,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,535,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	196,710,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	194,736,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	98,856,000	
第31回1号宮城県公募公債(10年)	200,000,000	200,744,000	
第39回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	97,270,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	232,878,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	107,670,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	216,018,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,595,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	106,872,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	103,603,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,334,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	99,801,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,410,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,267,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,194,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	206,028,160	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	216,358,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	300,000,000	322,956,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	107,033,000	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,390,000	
第400回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	301,185,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,315,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	155,142,000	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	198,298,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,784,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	98,339,000	

第458回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	96,641,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	153,736,000	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	174,439,720	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	191,456,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	108,461,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	107,315,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,402,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	90,283,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	92,236,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,322,575	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	106,496,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	103,495,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,625,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,499,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	436,020,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	90,370,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	292,224,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	102,713,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	95,760,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	79,841,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,883,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,424,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,298,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,360,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,261,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	300,216,400	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	162,711,450	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	108,584,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,084,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,776,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,329,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,696,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	274,521,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,818,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	78,653,000	

令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	194,044,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	96,911,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	147,942,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,894,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	107,884,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	216,270,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	125,589,410	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,282,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	376,896,000	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,329,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	98,335,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	106,281,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	107,538,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	83,818,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	551,718,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	217,286,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	182,524,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	216,018,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	181,200,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,256,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,286,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,588,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,295,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,572,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,314,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	142,920,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,442,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,900,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,167,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,739,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,834,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	107,375,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	101,836,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,248,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	78,653,000	
	100,000,000	90,754,000	

平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）			
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	291,264,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,019,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	90,097,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	98,121,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	97,862,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	215,076,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,243,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	106,883,000	
第20回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	91,872,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,290,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,310,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	290,856,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,791,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	126,685,000	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,079,000	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,272,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,236,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	288,147,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,022,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	214,706,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	97,817,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,184,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	125,927,934	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,356,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,318,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,503,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,433,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,664,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,526,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,028,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,138,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,425,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,577,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,554,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	588,475,860	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,221,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,400,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,880,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,752,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,594,000	

第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,026,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,145,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,737,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,401,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	97,593,270	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,287,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,203,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,090,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	193,100,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	217,244,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	73,671,000	
第19回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,567,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	600,000,000	545,022,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	92,977,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	192,196,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,913,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,520,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,991,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	100,288,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,493,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	291,195,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,848,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	193,552,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	99,581,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	125,566,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	215,222,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	109,153,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	107,002,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	74,220,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	73,823,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	324,219,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,383,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,413,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,436,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,865,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	98,942,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	206,644,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	291,225,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,095,000	
	100,000,000	103,053,000	



平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）			
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	101,925,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	99,793,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	194,770,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,346,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	187,272,000	
第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	105,396,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,394,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,522,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,286,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,439,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	108,190,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	105,053,000	
2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	98,697,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,373,150	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,454,700	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	534,325,000	
令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	298,851,000	
令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	193,904,000	
令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	286,353,000	
令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	95,862,000	
令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	97,324,000	
平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,333,000	
平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	97,961,000	
第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	106,394,000	
地方債証券合計	33,402,430,000	33,127,358,429	
特殊債券			
第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	96,522,000	
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,278,000	
第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,295,000	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	58,198,000	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	133,924,700	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,361,000	
第21回道路債券	100,000,000	115,506,000	
第28回道路債券	200,000,000	232,628,000	
第33回道路債券	200,000,000	234,512,000	

第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,091,000	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,895,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,681,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,708,000	
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	110,338,000	
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	216,382,000	
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	217,916,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,846,000	
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	110,324,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,342,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,233,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,643,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,913,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,532,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,894,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,590,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,741,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	546,396,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,774,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	78,018,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,744,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,263,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,776,000	
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	101,217,000	
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	203,458,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	166,468,000	
	112,000,000	112,408,800	

第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,062,000	
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	99,679,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	74,733,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	247,000,000	244,762,180	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,549,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	111,180,160	
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	203,591,650	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,326,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,078,000	
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	99,345,000	
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	198,594,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	287,313,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,805,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,250,000	
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	99,190,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	118,861,200	
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	197,422,000	
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	272,397,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	211,335,700	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,227,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,951,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	281,996,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	115,879,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	337,419,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	102,662,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	347,283,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	230,934,000	

第8回公営企業債券(30年)	100,000,000	113,823,000	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	216,320,000	
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	200,000,000	212,892,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	200,000,000	145,532,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,613,000	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	536,935,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,183,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,394,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	527,585,000	
第43回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,151,000	
第45回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,771,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	219,000,000	219,794,970	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,436,500	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,554,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,378,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,945,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,169,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,695,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,427,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,680,000	
第86回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	251,937,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,131,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,278,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	249,293,200	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	356,206,980	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,276,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,221,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	108,985,800	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,191,960	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,766,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,885,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,545,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,162,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	707,014,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,029,000	

F 1 4 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,870,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,428,000	
第 1 6 9 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	194,804,000	
第 1 7 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,183,000	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,156,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,034,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,834,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,443,000	
F 2 2 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,301,000	
F 2 4 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,592,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,074,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,093,000	
第 3 3 回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	199,034,000	
第 2 7 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,397,000	
第 2 8 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,681,000	
第 3 0 回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	298,611,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	108,229,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,218,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,278,020	
第 4 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	116,220,780	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,257,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,761,400	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,733,560	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	200,644,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	117,480,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	65,059,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	136,916,000	
第 1 9 1 回都市再生債券	100,000,000	93,025,000	
第 1 7 回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	299,040,000	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,812,000	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	87,429,000	86,408,703	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,194,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	61,058,000	60,449,862	
第 4 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	105,162,000	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	105,852,000	104,403,944	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	120,048,000	117,907,544	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	42,603,000	41,945,209	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	151,284,000	148,628,965	
	104,270,000	102,533,904	

第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券			
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,383,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,158,000	13,536,292	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,858,000	13,254,154	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,431,000	14,971,585	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,665,000	17,293,103	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,612,000	18,312,781	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,984,000	18,672,427	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,378,000	38,768,087	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,935,000	17,507,741	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,302,000	17,896,150	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,916,000	17,508,229	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,086,000	16,637,428	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,062,000	35,073,641	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,928,000	18,469,425	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,027,000	24,661,072	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,818,000	23,421,992	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,950,000	23,574,928	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,292,000	50,461,206	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,662,000	62,317,467	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,042,000	32,313,075	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,216,000	100,832,228	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,464,000	34,039,580	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,980,000	29,487,439	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,930,000	28,210,696	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,852,000	33,459,762	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	162,969,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,908,000	86,770,516	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	116,548,000	117,582,946	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,134,000	34,260,978	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,463,000	35,585,347	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,308,000	36,292,024	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,341,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,282,000	114,064,864	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,147,000	38,887,455	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,328,000	81,994,752	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,920,000	46,229,806	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,076,000	49,055,451	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	309,708,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,222,000	48,472,348	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,458,000	152,484,026	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,942,000	102,383,909	

第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,789,000	49,917,968	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,682,000	53,639,214	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,871,000	57,639,967	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,393,000	63,061,399	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,737,000	62,242,421	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,292,000	62,970,770	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,799,000	63,712,218	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,056,000	63,793,725	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,296,000	65,677,362	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,453,000	65,861,585	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,031,000	65,259,146	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,825,000	65,057,519	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,702,000	65,873,966	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,050,000	133,853,715	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,338,000	131,618,674	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,808,000	135,053,525	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,341,000	67,302,385	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,320,000	133,897,502	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,867,000	67,707,338	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,806,000	135,964,145	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,492,000	136,566,065	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,841,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,821,000	69,662,663	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,194,000	69,249,575	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,354,000	68,732,698	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,844,000	141,445,722	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,280,000	70,920,567	

第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,260,000	70,098,669	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,358,000	142,457,313	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,076,000	71,924,391	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	235,728,000	215,818,413	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,910,000	145,388,348	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,232,000	75,320,747	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,863,000	75,656,965	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,898,000	155,779,122	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,114,000	78,821,521	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,842,000	158,090,353	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,786,000	159,500,484	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,734,000	79,380,253	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	172,536,000	160,406,719	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,848,000	159,473,225	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,438,000	81,010,432	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,618,000	81,587,047	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	264,225,000	243,216,470	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,568,000	81,574,670	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,058,000	83,196,480	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,157,000	84,123,693	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,257,000	85,244,076	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,207,000	86,213,545	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,864,000	173,297,734	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,166,000	90,006,687	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,076,000	183,801,032	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,388,000	93,270,386	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,834,000	



第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,309,000	94,162,272	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,509,000	94,196,644	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,350,000	192,011,468	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,873,000	96,649,587	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,522,000	97,566,336	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	74,397,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	282,144,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	96,586,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,304,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,391,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,356,000	
い第876号商工債	400,000,000	395,788,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,771,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,234,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,074,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,712,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	395,344,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,734,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	99,975,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,248,000	
第20回アングス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	298,623,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,467,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,899,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,396,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	483,425,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,870,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,095,000	
第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,721,000	
第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,164,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,726,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,225,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,308,000	
第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	399,344,000	
第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,448,000	
第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,210,000	
第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,708,000	
第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,500,000	
第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,330,000	
第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,774,000	

	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,484,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,052,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,489,000	
	第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,750,000	
	第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,322,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,113,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	185,070,000	
	特殊債券合計	37,827,039,000	37,231,003,717	
社債券	第27回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	99,844,000	
	第41回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	200,000,000	200,206,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,043,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,152,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,925,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	397,668,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債(2023)	100,000,000	99,474,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債(2023)	400,000,000	397,896,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,348,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,816,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,318,000	
	第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,399,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,159,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,100,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,770,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,673,000	
	第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,637,000	
	第16回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,586,000	
	第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,314,000	
	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	299,583,000	
	第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,869,000	
	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,804,000	
	第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	199,154,000	
	第8回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,187,000	

第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,266,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,411,000	
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	98,659,000	
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	97,652,000	
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	99,532,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,819,000	
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	199,098,000	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,637,000	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,812,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,763,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,443,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,554,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,338,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,586,000	
第13回JSR株式会社無担保社債	100,000,000	94,464,000	
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	98,515,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,636,000	
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	199,516,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	79,633,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,429,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,113,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,808,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	194,940,000	
第2回株式会社ADEKA無担保社債	100,000,000	99,443,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	283,248,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,705,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	199,024,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	299,826,000	
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	99,489,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,225,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,494,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,048,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,368,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,880,000	

第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,110,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,258,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,397,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	98,949,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,689,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,004,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,341,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	97,723,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,627,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,836,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,640,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,701,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,031,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,258,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,396,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,750,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,384,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,432,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,685,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,857,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,983,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,276,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,803,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,265,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,644,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	191,016,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,524,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,141,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	199,522,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	83,741,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,274,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	107,150,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	194,594,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,026,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,682,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,238,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,223,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,502,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,827,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,776,000	

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	96,223,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,980,000	
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	108,612,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,995,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,882,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,578,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,902,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	387,712,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,758,000	
第30回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	301,581,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,641,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,215,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,506,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,681,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,582,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,672,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,113,000	
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	99,622,000	
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	98,953,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,050,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,808,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,782,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,150,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,432,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,685,000	
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	198,524,000	
第42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	199,828,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,734,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,829,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,331,000	

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	98,486,000	
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	99,449,000	
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	98,654,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,529,000	
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	198,014,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,166,000	
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	197,702,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,098,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,730,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	190,532,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,712,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	83,982,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,778,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,186,000	
第17回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	87,317,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,133,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	78,984,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,815,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,752,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,812,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	73,057,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,959,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,497,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,652,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	215,178,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,872,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,992,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,444,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	74,325,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,796,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	73,839,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	83,294,000	

第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	66,084,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,181,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,885,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	70,598,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	81,610,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,010,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	83,046,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,779,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,588,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,129,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,995,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	62,378,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	53,633,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	67,117,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	77,302,000	
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	147,234,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,076,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,650,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,496,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	169,794,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,682,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,528,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	92,027,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	83,339,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,001,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,410,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,776,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,051,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,667,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,229,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,710,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,181,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,887,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,276,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,910,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,214,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,611,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	292,632,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,173,000	

第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,972,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	179,758,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,927,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,150,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,238,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,333,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,641,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,915,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	94,952,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,730,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,343,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,513,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,878,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,358,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,978,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	94,895,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,928,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,483,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	88,377,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	98,204,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,841,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	90,115,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,207,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,298,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,204,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,156,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,580,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,626,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,329,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,694,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,833,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	268,656,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,629,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	95,135,000	
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,720,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	94,750,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	199,008,000	
	100,000,000	99,906,000	



第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債			
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	98,706,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	73,516,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,248,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	190,198,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	82,726,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	197,646,000	
社債券合計	32,300,000,000	31,230,573,000	
合計		661,400,408,636	

(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

	2024年 4月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,401,881,970
コール・ローン	317,858,120
株式	678,183,235,533
投資信託受益証券	123,282,843
投資証券	12,499,123,639
派生商品評価勘定	19,943,622
未収入金	1
未収配当金	667,411,828
未収利息	578
前払金	489,862,134
差入委託証拠金	5,630,106,439
流動資産合計	708,332,706,707
資産合計	708,332,706,707
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	509,685,216
未払解約金	231,355,438
流動負債合計	741,040,654
負債合計	741,040,654
純資産の部	
元本等	
元本	115,178,385,575
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	592,413,280,478
元本等合計	707,591,666,053
純資産合計	707,591,666,053
負債純資産合計	708,332,706,707

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

		2024年 4月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>	
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 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		115,178,385,575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)	6.1434円 (61,434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

	2024年 4月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	115,198,793,434円
期中追加設定元本額	5,475,133,301円
期中一部解約元本額	5,495,541,160円
期末元本額	115,178,385,575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）	1,479,977,756円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,721,623円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,251,103,000円
世界経済インデックスファンド	13,674,177,118円

区分	2024年 4月22日現在
外国株式インデックス・オープン	888,745,635円
DCマイセレクション25	544,573,837円
DCマイセレクション50	3,044,673,888円
DCマイセレクション75	4,085,418,685円
DC外国株式インデックス・オープン	13,138,304,725円
DCマイセレクションS25	323,554,570円
DCマイセレクションS50	1,782,235,531円
DCマイセレクションS75	1,928,903,125円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	12,926,750円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	125,024,996円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	101,429,272円
DC世界経済インデックスファンド	9,257,181,739円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	892,248,625円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,773,850円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,805,608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）	19,977,599円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	5,782,091円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	28,620,264円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	6,168,293円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	17,980,323円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	132,833,226円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	115,606,268円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	893,313,297円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	59,196,524円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	13,214,592円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	100,064,807円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	31,998,730円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	726,534,023円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	760,395,417円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,159,872,166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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,509,250,995円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,005,435,944円
コア投資戦略ファンド（切替型）	126,172,035円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	428,715,696円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,015,792円
SMT インデックスバランス・オープン	110,578,220円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	70,909,215円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	4,808,995,117円
SMT 世界経済インデックス・オープン	249,336,368円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,131,115,963円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	185,447,658円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,376,473円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,081,794,638円
グローバル経済コア	647,239,516円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,561,447円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,826,070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）	30,839,009円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	167,862,453円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	160,722,163円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	71,959,428円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	86,016,714円
10資産分散投資ファンド	63,416,678円
グローバル10資産バランスファンド	13,486,308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・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	23,675円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	25,847円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	27,150円

区分	2024年 4月22日現在
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	23,756円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	15,277円
DCターゲット・イヤーファンド（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）	48,111,958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）	194,510,196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）	600,559,434円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,406,960,286円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	126,537,170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）	60,868,495円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	76,341,387円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	79,807,557円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	161,828,459円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	167,216,074円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	166,490,866円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	157,998,954円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	156,432,494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）	78,612,474円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	106,537,618円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	92,404,999,482
投資信託受益証券	22,606,407
投資証券	16,093,510
合計	92,398,486,585

(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

（2024年 4月22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	16,947,801,291	-	16,457,939,157	489,862,134
合計		16,947,801,291	-	16,457,939,157	489,862,134

## (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 4月22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)
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	29,745,900	-	29,870,490	124,590
	オーストラリアドル	29,745,900	-	29,870,490	124,590
	売建	232,125,000	-	232,129,050	4,050
	アメリカドル	232,125,000	-	232,129,050	4,050
合計		261,870,900	-	261,999,540	120,540

## (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	32.36	756,965.12	
	BAKER HUGHES CO	77,332	32.60	2,521,023.20	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	161.97	2,931,495.03	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	87.51	742,259.82	
	CHEVRON CORP	138,024	160.00	22,083,840.00	
	CONOCOPHILLIPS	92,757	129.38	12,000,900.66	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.75	1,513,651.50	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	51.83	2,604,768.48	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	200.74	2,663,217.58	
	EOG RESOURCES INC	45,763	133.17	6,094,258.71	
	EQT CORPORATION	27,026	36.65	990,502.90	
	EXXON MOBIL	307,151	119.88	36,821,261.88	
	HALLIBURTON CO	70,302	39.08	2,747,402.16	
	HESS CORP	21,602	154.35	3,334,268.70	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	56.85	763,438.65	
	KINDER MORGAN INC	160,038	18.84	3,015,115.92	
	MARATHON OIL CORP	50,360	27.50	1,384,900.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	29,195	196.38	5,733,314.10	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	66.63	3,291,921.78	
	ONEOK INC	43,535	79.63	3,466,692.05	
OVINTIV INC	20,398	51.98	1,060,288.04		
PHILLIPS 66	34,260	154.71	5,300,364.60		
PIONEER NATURAL RESOURCES	18,553	270.31	5,015,061.43		
SCHLUMBERGER	110,287	49.85	5,497,806.95		
TARGA RESOURCES CORP	17,298	112.92	1,953,290.16		

TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	582.60	931,577.40
VALERO ENERGY CORP	26,282	163.89	4,307,356.98
WILLIAMS COS	90,577	38.51	3,488,120.27
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	231.64	4,048,835.56
ALBEMARLE CORP	8,403	112.15	942,396.45
AMCOR PLC	110,292	8.97	989,319.24
AVERY DENNISON CORP	6,638	211.57	1,404,401.66
BALL CORP	25,896	64.95	1,681,945.20
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	154.45	1,325,489.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,499	79.47	1,311,175.53
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	20.81	894,830.00
CORTEVA INC	56,865	54.80	3,116,202.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	77.67	772,039.80
DOW INC	51,980	56.66	2,945,186.80
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	73.89	2,521,052.91
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	96.42	851,581.44
ECOLAB INC	20,345	218.16	4,438,465.20
FMC CORP	8,264	57.82	477,824.48
FREEMONT-MCMORAN INC	110,698	49.61	5,491,727.78
INT'L PAPER CO	25,191	35.37	891,005.67
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	83.97	1,621,208.79
LINDE PLC	37,432	446.30	16,705,901.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	100.74	1,989,111.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	575.89	2,889,240.13
MOSAIC CO/THE	27,732	31.00	859,692.00
NEWMONT CORPORATION	86,194	39.02	3,363,289.88
NUCOR CORP	18,727	191.36	3,583,598.72
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,221	179.89	1,119,095.69
PPG INDUSTRIES INC	17,495	130.90	2,290,095.50
RELIANCE INC	4,126	319.49	1,318,215.74
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	106.57	1,114,295.92
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,426	305.96	5,637,618.96
STEEL DYNAMICS INC	11,618	136.90	1,590,504.20
VULCAN MATERIALS CO	10,153	252.06	2,559,165.18
WESTLAKE CORP	2,222	150.76	334,988.72
WESTROCK CO	21,356	47.99	1,024,874.44
3 M COMPANY	43,663	92.27	4,028,785.01
AECOM	10,456	93.35	976,067.60
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	83.21	1,221,439.59
ALLEGION PLC	7,721	125.21	966,746.41
AMETEK INC	17,753	177.70	3,154,708.10
AXON ENTERPRISE INC	5,367	293.60	1,575,778.03

BOEING CO	43,809	169.82	7,439,644.38
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	177.03	1,685,679.66
CARLISLE COS INC	3,456	367.41	1,269,768.96
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	53.53	3,322,232.39
CATERPILLAR	39,504	354.66	14,010,488.64
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.31	997,430.06
CUMMINS INC	11,452	287.56	3,293,137.12
DEERE&CO	20,534	400.32	8,220,170.88
DOVER CORP	10,657	169.84	1,809,984.88
EATON CORP	30,932	303.02	9,373,014.64
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	108.58	4,778,605.80
FASTENAL CO	44,011	67.57	2,973,823.27
FERGUSON PLC	16,260	208.80	3,395,088.00
FORTIVE CORP	25,894	79.49	2,058,314.06
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	73.51	757,888.10
GE VERNOVA INC	20,868	135.10	2,819,266.80
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	288.62	5,241,050.58
GENERAL ELECTRIC CO	83,474	148.06	12,359,160.44
GRACO INC	13,378	88.38	1,182,347.64
GRAINGER (WW) INC	3,363	942.65	3,170,131.95
HEICO CORP	3,640	197.10	717,444.00
HEICO CORP-CLASS A	5,700	159.77	910,689.00
HONEYWELL INTL INC	51,027	194.26	9,912,505.02
HOWMET AEROSPACE INC	28,204	63.41	1,788,415.64
HUBBELL INC	4,458	388.03	1,729,837.74
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	271.66	932,608.78
IDEX CORP	5,916	227.04	1,343,168.64
ILLINOIS TOOL WORKS	22,812	250.46	5,713,493.52
INGERSOLL-RAND INC	31,562	88.40	2,790,080.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	36.79	467,233.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	63.66	3,199,933.56
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	205.45	3,016,416.90
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	457.15	1,154,760.90
LOCKHEED MARTIN CORP	17,553	463.87	8,142,310.11
MASCO CORP	18,934	71.91	1,361,543.94
NORDSON CORP	4,121	259.59	1,069,770.39
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,303	462.58	5,228,541.74
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	95.11	2,921,493.87
OWENS CORNING	6,460	160.11	1,034,310.60
PACCAR INC	40,380	111.19	4,489,852.20
PARKER HANNIFIN CORP	9,881	534.65	5,282,876.65
PENTAIR PLC	14,383	78.53	1,129,496.99



QUANTA SERVICES INC	11,573	243.26	2,815,247.98
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	269.96	2,285,481.36
RTX CORP	112,196	101.56	11,394,625.76
SMITH (A.O.) CORP	9,016	86.07	776,007.12
SNAP-ON INC	4,000	268.80	1,075,200.00
SOLVENTUM CORP	10,915	62.20	678,913.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	89.32	1,125,253.36
TEXTRON	13,876	93.30	1,294,630.80
TORO CO	8,812	85.11	749,989.32
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	288.27	5,188,860.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,240	1,187.70	5,035,848.00
UNITED RENTALS INC	5,364	628.34	3,370,415.76
VERTIV HOLDINGS CO-A	26,201	75.01	1,965,337.01
WABTEC CORP	13,304	144.17	1,918,037.68
WATSCO INC	2,656	396.92	1,054,219.52
XYLEM INC	17,693	127.84	2,261,873.12
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	243.31	7,766,211.89
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	142.14	1,313,373.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,232	193.38	1,591,904.16
CINTAS CORP	7,043	661.29	4,657,465.47
COPART INC	69,100	52.88	3,654,008.00
DAYFORCE INC	10,668	58.75	626,745.00
EQUIFAX INC	9,160	216.20	1,980,392.00
JACOBS SOLUTIONS INC	8,836	143.83	1,270,881.88
LEIDOS HOLDINGS	9,314	124.91	1,163,411.74
PAYCHEX INC	24,118	119.52	2,882,583.36
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	183.25	776,063.75
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	157.22	538,164.06
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	189.76	3,122,500.80
ROBERT HALF INC	7,185	70.23	504,602.55
ROLLINS INC	25,466	42.51	1,082,559.66
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	60.82	936,749.64
TRANSUNION	15,741	66.70	1,049,924.70
VERALTO CORP	17,691	88.89	1,572,552.99
VERISK ANALYTICS INC	10,738	222.52	2,389,419.76
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	165.02	3,263,270.50
WASTE MANAGEMENT INC	30,660	207.07	6,348,766.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	71.22	595,897.74
CSX CORP	152,551	34.34	5,238,601.34
DELTA AIR LINES INC	9,648	47.57	458,955.36
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.61	1,407,410.80
FEDEX CORP	18,863	266.99	5,036,232.37

GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.37	380,847.07
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	167.30	961,640.40
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	48.14	655,811.22
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	241.28	4,338,696.96
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,712	211.82	3,116,295.84
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	29.38	397,599.54
U-HAUL HOLDING CO	6,606	62.31	411,619.86
UBER TECHNOLOGIES INC	144,319	69.20	9,986,874.80
UNION PACIFIC CORP	46,736	232.08	10,846,490.88
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	142.77	7,933,300.59
APTIV PLC	21,896	69.63	1,524,618.48
BORGWARNER INC	19,781	32.80	648,816.80
FORD MOTOR COMPANY	314,432	12.14	3,817,204.48
GENERAL MOTORS CO	103,664	42.37	4,392,243.68
LEAR CORP	3,688	132.86	489,987.68
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	8.63	443,029.68
TESLA INC	221,215	147.05	32,529,665.75
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	800.38	1,683,199.14
DR HORTON INC	22,973	142.19	3,266,530.87
GARMIN LTD	11,170	139.52	1,558,438.40
HASBRO INC	10,572	55.27	584,314.44
LENNAR CORP-CL A	18,864	150.19	2,833,184.16
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	352.47	3,037,938.93
NIKE B	94,445	94.53	8,927,885.85
NVR INC	247	7,685.00	1,898,195.00
PULTE GROUP INC	16,747	105.43	1,765,636.21
AIRBNB INC-CLASS A	32,814	155.01	5,086,498.14
BOOKING HOLDINGS INC	2,694	3,414.82	9,199,525.08
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	38.20	670,792.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	14.12	1,013,957.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,089	2,869.11	5,993,570.79
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	152.50	1,404,067.50
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	473.55	1,348,670.40
DOORDASH INC - A	19,212	127.18	2,443,382.16
DRAFTKINGS INC	32,654	40.68	1,328,364.72
EXPEDIA GROUP INC	9,628	129.00	1,242,012.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	194.47	3,818,418.45
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	146.37	554,303.19
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	45.46	1,389,484.90
MARRIOTT INTL A	19,516	236.00	4,605,776.00
MCDONALD'S CORP	55,965	271.99	15,221,920.35
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	42.42	965,224.68

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,429	129.21	2,381,211.09
STARBUCKS CORP	88,273	87.61	7,733,597.53
VAIL RESORTS INC	3,014	202.94	611,661.16
WYNN RESORTS LTD	6,702	94.99	636,622.98
YUM BRANDS INC	22,162	138.50	3,069,437.00
ALPHABET INC-CL A	456,849	154.09	70,395,862.41
ALPHABET INC-CL C	397,755	155.72	61,938,408.60
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	265.21	1,907,390.32
COMCAST CORP-CL A	309,993	40.24	12,474,118.32
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	127.27	2,511,418.91
FOX CORP - CLASS A	21,544	31.39	676,266.16
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.87	298,660.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	30.72	875,857.92
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	49.88	456,551.64
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	68.10	1,047,309.90
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	24.34	330,634.56
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	89.96	1,044,705.48
MATCH GROUP INC	22,730	32.18	731,451.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	171,346	481.07	82,429,420.22
NETFLIX INC	33,607	555.04	18,653,229.28
NEWS CORP-CLASS A	33,479	24.02	804,165.58
OMNICOM GROUP	14,048	92.62	1,301,125.76
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	12.44	404,399.52
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	32.40	1,482,850.80
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	35.34	1,240,893.42
ROKU INC	9,122	56.90	519,041.80
SEA LTD-ADR	28,338	55.06	1,560,290.28
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	3.09	186,846.12
SNAP INC - A	91,303	11.16	1,018,941.48
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	140.60	1,809,100.20
THE WALT DISNEY CO	142,615	112.61	16,059,875.15
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	77.30	2,595,965.90
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	8.40	1,490,269.20
AMAZON.COM	717,541	174.63	125,304,184.83
AUTOZONE INC	1,368	2,985.54	4,084,218.72
BATH & BODY WORKS INC	19,328	43.99	850,238.72
BEST BUY COMPANY INC	15,285	76.15	1,163,952.75
BURLINGTON STORES INC	5,108	178.57	912,135.56
CARMAX INC	10,695	68.34	730,896.30
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	195.08	965,646.00
EBAY	41,952	50.39	2,113,961.28
ETSY INC	10,294	66.76	687,227.44

GENUINE PARTS CO	9,903	162.39	1,608,148.17
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	33.00	231,000.00
HOME DEPOT	77,067	335.36	25,845,189.12
LKQ CORP	19,286	49.12	947,328.32
LOWES COMPANIES	44,328	230.24	10,206,078.72
MERCADOLIBRE INC	3,573	1,356.43	4,846,524.39
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,090.94	4,993,232.38
POOL CORP	2,664	361.13	962,050.32
ROSS STORES INC	25,425	133.34	3,390,169.50
TJX COMPANIES INC	88,680	93.36	8,279,164.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	252.79	1,983,390.34
ULTA BEAUTY INC	3,920	413.50	1,620,920.00
WILLIAMS-SONOMA INC	4,460	279.20	1,245,232.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	20.35	508,750.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,237	709.51	24,291,493.87
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	144.82	2,358,683.34
DOLLAR TREE INC	16,318	122.03	1,991,285.54
KROGER CO	50,664	56.57	2,866,062.48
SYSCO CORP	40,090	76.73	3,076,105.70
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,264	168.30	5,934,931.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	18.24	940,582.08
WALMART INC	347,772	59.53	20,702,867.16
ALTRIA GROUP INC	139,093	42.09	5,854,424.37
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	62.60	2,542,686.80
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	49.06	1,177,734.36
BUNGE GLOBAL SA	11,604	109.52	1,270,870.08
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	44.20	701,409.80
CELSIUS HOLDINGS INC	9,973	68.84	686,541.32
COCA-COLA CO	316,878	60.17	19,066,549.26
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	67.58	1,040,326.52
CONAGRA BRANDS INC	33,324	30.62	1,020,380.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	260.70	3,421,948.20
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	42.61	564,241.62
GENERAL MILLS INC	43,531	70.42	3,065,453.02
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	185.02	2,024,488.84
HORMEL FOODS CORP	23,338	34.74	810,762.12
JM SMUCKER CO	7,850	114.76	900,866.00
KELLANOVA	18,819	57.38	1,079,834.22
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	31.50	2,556,319.50
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	37.78	2,605,459.92
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	81.00	961,956.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	73.92	1,337,360.64

MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	64.23	942,189.87
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	68.11	7,180,905.41
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	53.14	3,100,612.72
PEPSICO INC	105,521	174.13	18,374,371.73
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	93.77	11,157,035.91
TYSON FOODS INC	23,306	59.95	1,397,194.70
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	104.35	2,018,755.10
CLOROX COMPANY	9,570	143.55	1,373,773.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	87.13	5,396,657.94
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	144.41	2,714,908.00
KENVUE INC	133,461	19.58	2,613,166.38
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	126.83	3,408,809.91
PROCTER & GAMBLE CO	181,466	158.14	28,697,033.24
ABBOTT LABORATORIES	133,298	107.28	14,300,209.44
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	298.98	1,570,541.94
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	39.47	1,641,004.72
BECTON DICKINSON & CO	22,142	234.12	5,183,885.04
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	67.33	7,549,106.93
CARDINAL HEALTH	19,151	108.19	2,071,946.69
CENCORA INC	13,171	239.13	3,149,581.23
CENTENE CORP	40,934	75.15	3,076,190.10
COOPER COS INC/THE	16,848	90.42	1,523,396.16
CVS HEALTH CORP	99,034	69.75	6,907,621.50
DAVITA INC	4,627	127.82	591,423.14
DEXCOM INC	28,772	130.71	3,760,788.12
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,175	85.94	4,140,159.50
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	531.42	9,688,849.44
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	84.49	2,788,001.02
HCA HEALTHCARE INC	15,457	305.11	4,716,085.27
HENRY SCHEIN INC	8,755	70.86	620,379.30
HOLOGIC INC	18,875	75.38	1,422,797.50
HUMANA INC	9,818	328.33	3,223,543.94
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	476.35	3,164,869.40
INSULET CORP	5,246	166.25	872,147.50
INTUITIVE SURGICAL INC	27,005	366.34	9,893,011.70
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	201.48	1,319,291.04
MCKESSON CORP	10,179	524.83	5,342,244.57
MEDTRONIC PLC	102,632	79.48	8,157,191.36
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	367.52	1,670,378.40
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	128.44	1,114,730.76
RESMED INC	10,920	178.85	1,953,042.00
STERIS PLC	8,172	199.51	1,630,395.72

STRYKER CORP	26,379	325.43	8,584,517.97
TELEFLEX INC	3,934	206.56	812,607.04
THE CIGNA GROUP	22,963	352.39	8,091,931.57
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,401	501.13	35,781,183.13
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	157.47	735,699.84
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	198.38	2,477,964.58
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	119.43	1,821,785.22
ABBVIE INC	136,294	166.41	22,680,684.54
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	132.73	2,892,319.43
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	144.41	1,392,545.63
AMGEN	40,959	268.93	11,015,103.87
AVANTOR INC	49,647	24.10	1,196,492.70
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	279.73	518,339.69
BIO-TECHNE CORP	12,980	62.12	806,317.60
BIOGEN INC	10,740	194.38	2,087,641.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	88.63	1,310,217.29
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	155,274	48.93	7,597,556.82
CATALENT INC	13,739	55.48	762,239.72
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	226.78	953,383.12
DANAHER CORP	54,787	235.51	12,902,886.37
ELI LILLY & CO	62,224	726.31	45,193,913.44
EXACT SCIENCES CORP	12,208	60.96	744,199.68
GILEAD SCIENCES INC	96,270	66.76	6,426,985.20
ILLUMINA INC	11,423	117.43	1,341,402.89
INCYTE CORP	15,212	52.35	796,348.20
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	228.09	3,155,853.24
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	109.94	546,511.74
JOHNSON & JOHNSON	185,343	147.91	27,414,083.13
MERCK & CO	195,618	125.78	24,604,832.04
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,188.54	1,933,754.58
MODERNA INC	24,153	101.41	2,449,355.73
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	132.00	889,944.00
PFIZER	432,739	26.00	11,251,214.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	896.82	7,467,820.14
REPLIGEN CORP	4,353	157.14	684,030.42
REVVITY INC	8,524	100.86	859,730.64
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	28.16	847,137.28
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	12.86	1,184,933.26
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,059	544.78	16,375,542.02
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	237.93	860,830.74
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	394.28	7,836,709.28
VIATRIS INC	89,720	11.25	1,009,350.00

WATERS CORP	4,749	296.10	1,406,178.90
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	372.04	2,145,554.68
ZOETIS INC	35,994	146.50	5,273,121.00
BANK OF AMERICA CORP	549,785	36.97	20,325,551.45
CITIGROUP	146,698	59.14	8,675,719.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	33.99	1,343,352.78
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	36.25	1,972,725.00
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,567.36	1,200,597.76
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.28	1,515,407.36
JPMORGAN CHASE & CO	222,518	185.80	41,343,844.40
KEY CORP	71,223	14.63	1,041,992.49
M & T BANK CORP	13,791	143.38	1,977,353.58
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	152.30	4,802,475.90
REGIONS FINL CORP	70,810	18.90	1,338,309.00
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	36.80	3,913,385.60
US BANCORP	117,317	40.45	4,745,472.65
WELLS FARGO & CO	281,146	60.35	16,967,161.10
ALLY FINANCIAL INC	21,529	39.05	840,707.45
AMERICAN EXPRESS	45,006	231.04	10,398,186.24
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	417.01	3,259,350.16
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	29,517	107.63	3,176,914.71
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	129.53	1,655,393.40
BANK NEW YORK CO	56,329	56.29	3,170,759.41
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	405.08	41,033,388.76
BLACKROCK INC	11,583	749.98	8,687,018.34
BLACKSTONE INC	55,334	118.40	6,551,545.60
BLOCK INC	42,352	70.42	2,982,427.84
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	142.91	4,301,162.27
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	44.08	690,689.52
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	180.85	1,592,022.55
CME GROUP INC	27,997	213.04	5,964,480.88
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	211.01	2,657,670.95
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	26.98	519,338.02
CORPAY INC	6,039	294.29	1,777,217.31
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	125.35	2,380,020.45
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	36.56	1,023,058.48
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	434.02	1,366,294.96
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	70.73	3,216,093.10
FISERV INC	46,319	148.62	6,883,929.78
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.15	655,660.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	54.77	236,387.32
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	122.10	2,533,452.90

GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,012	404.00	10,104,848.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	131.21	5,789,247.62
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	165.60	863,272.80
KKR & CO INC	44,805	92.62	4,149,839.10
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	262.59	1,441,619.10
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	204.01	654,260.07
MASTERCARD INC-CLASS A	64,870	455.39	29,541,149.30
MOODY'S CORP	12,577	374.67	4,712,224.59
MORGAN STANLEY	93,827	90.66	8,506,355.82
MSCI INC	5,952	510.07	3,035,936.64
NASDAQ INC	29,020	60.35	1,751,357.00
NORTHERN TRUST CORP	15,902	81.45	1,295,217.90
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	62.31	4,940,310.66
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	108.73	1,987,040.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	123.60	1,914,069.60
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	16.63	530,713.19
S&P GLOBAL INC	25,151	412.56	10,376,296.56
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	73.42	8,597,114.90
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	66.13	631,541.50
STATE STREET CORP	22,335	73.37	1,638,718.95
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	41.57	1,213,677.72
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.62	439,772.42
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	101.05	915,614.05
VISA INC-CLASS A SHARES	122,188	269.78	32,963,878.64
AFLAC	43,196	83.23	3,595,203.08
ALLSTATE CORP	20,722	172.96	3,584,077.12
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	127.86	807,947.34
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	74.23	4,048,058.82
AON PLC	15,249	310.19	4,730,087.31
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	92.93	2,763,459.41
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,294	236.57	3,854,671.58
ASSURANT INC	4,726	173.83	821,520.58
BROWN & BROWN INC	20,155	82.17	1,656,136.35
CHUBB LTD	30,987	250.21	7,753,257.27
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	119.95	1,332,644.50
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	381.56	826,458.96
EVEREST GROUP LTD	3,288	370.26	1,217,414.88
FNF GROUP	20,461	48.77	997,882.97
GLOBE LIFE INC	6,909	66.74	461,106.66
HARTFORD FINANCIAL SVCS	21,873	98.95	2,164,333.35
LOEWS CORP	16,402	75.64	1,240,647.28
MARKEL GROUP INC	1,007	1,456.69	1,466,886.83



MARSH & MCLENNAN COS	38,224	202.41	7,736,919.84
METLIFE INC	48,925	71.11	3,479,056.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	80.44	1,491,035.84
PROGRESSIVE CORP	45,236	214.69	9,711,716.84
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,057	110.61	3,213,994.77
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	214.07	3,670,658.29
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	264.52	2,046,591.24
WR BERKLEY CORP	14,360	82.40	1,183,264.00
WEYERHAEUSER CO	52,615	31.47	1,655,794.05
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	316.88	15,322,098.64
ADOBE INC	34,893	465.02	16,225,942.86
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	101.50	1,165,626.00
ANSYS INC	6,794	322.11	2,188,415.34
APPLOVIN CORP-CLASS A	12,260	66.80	818,968.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	198.47	475,137.18
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	191.55	2,190,565.80
AUTODESK INC	17,030	216.50	3,686,995.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	52.46	777,089.98
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	59.61	443,677.23
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,540	280.25	5,756,335.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	157.95	1,114,811.10
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	84.10	1,939,934.70
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,006	67.44	2,495,684.64
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	26.89	330,747.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,478	282.64	4,939,981.92
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	233.71	724,501.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	120.09	2,495,470.20
DOCUSIGN INC	14,969	55.70	833,773.30
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	22.98	530,102.64
DYNATRACE INC	22,028	45.40	1,000,071.20
EPAM SYSTEMS INC	4,768	245.96	1,172,737.28
FAIR ISAAC CORP	1,816	1,130.06	2,052,188.96
FORTINET INC	49,270	63.40	3,123,718.00
GARTNER INC	5,859	440.38	2,580,186.42
GEN DIGITAL INC	43,555	20.50	892,877.50
GODADDY INC - CLASS A	11,388	120.12	1,367,926.56
HUBSPOT INC	3,646	631.24	2,301,501.04
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,082	181.58	12,907,069.56
INTUIT INC	21,468	605.17	12,991,789.56
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	226.34	1,062,439.96
MICROSOFT CORP	545,058	399.12	217,543,548.96
MONDAY.COM LTD	1,631	178.07	290,432.17

MONGODB INC	5,325	327.47	1,743,777.75
OKTA INC	11,505	92.03	1,058,805.15
ORACLE CORP	126,564	114.88	14,539,672.32
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	20.47	3,007,431.93
PALO ALTO NETWORKS INC	24,532	277.71	6,812,781.72
PTC INC	9,741	176.37	1,718,020.17
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	534.38	4,518,717.28
SALESFORCE INC	74,662	270.37	20,186,364.94
SAMSARA INC-CL A	13,283	30.15	400,482.45
SERVICENOW INC	15,986	713.91	11,412,565.26
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,702	145.45	3,156,555.90
SYNOPSYS INC	11,896	510.71	6,075,406.16
TWILIO INC - A	12,842	57.55	739,057.10
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	403.35	1,346,785.65
UIPATH INC - CLASS A	28,419	18.75	532,856.25
UNITY SOFTWARE INC	16,437	22.89	376,242.93
VERISIGN INC	6,723	184.12	1,237,838.76
WIX.COM LTD	5,010	121.41	608,264.10
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	252.22	4,144,479.04
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	59.45	1,240,662.05
ZSCALER INC	7,204	169.21	1,218,988.84
AMPHENOL CORPORATION	45,860	110.17	5,052,396.20
APPLE INC	1,133,924	165.00	187,097,460.00
ARISTA NETWORKS INC	20,702	246.09	5,094,555.18
CDW CORP/DE	9,823	235.78	2,316,066.94
CISCO SYSTEMS	312,372	48.32	15,093,815.04
CORNING	66,604	31.27	2,082,707.08
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	114.87	2,081,903.88
F5 INC	4,851	177.33	860,227.83
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.79	1,635,883.28
HP INC	68,329	27.81	1,900,229.49
JABIL INC	9,340	118.75	1,109,125.00
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	36.06	913,075.26
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	145.12	2,008,170.56
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	339.65	4,469,454.35
NETAPP INC	15,191	97.95	1,487,958.45
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	82.46	1,199,628.08
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,881	713.65	2,769,675.65
TE CONNECTIVITY LTD	23,161	140.55	3,255,278.55
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	401.36	1,332,515.20
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	57.97	1,027,112.46
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	66.05	1,703,429.50

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	268.07	1,115,707.34
AT&T INC	548,004	16.51	9,047,546.04
LIBERTY GLOBAL LTD-C	18,869	17.39	328,131.91
T-MOBILE US INC	40,175	162.33	6,521,607.75
VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	40.49	13,048,104.95
AES CORP	54,375	16.40	891,750.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	49.82	1,035,159.96
AMEREN CORPORATION	20,898	73.88	1,543,944.24
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	84.20	3,428,624.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	118.52	1,714,747.36
ATMOS ENERGY CORP	11,302	117.20	1,324,594.40
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.53	1,354,204.98
CMS ENERGY CORP	23,697	59.55	1,411,156.35
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	91.77	2,539,734.75
CONSTELLATION ENERGY	25,114	180.90	4,543,122.60
DOMINION ENERGY INC	62,863	49.84	3,133,091.92
DTE ENERGY COMPANY	15,851	108.57	1,720,943.07
DUKE ENERGY CORP	60,351	98.24	5,928,882.24
EDISON INTL	30,900	69.93	2,160,837.00
ENERGY CORP	16,181	106.77	1,727,645.37
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	35.44	722,940.56
EVERGY INC	18,475	51.76	956,266.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	59.69	1,638,490.50
EXELON CORP	73,907	37.55	2,775,207.85
FIRSTENERGY CORP	39,425	38.17	1,504,852.25
NEXTERA ENERGY INC	156,893	64.30	10,088,219.90
NISOURCE INC	32,351	27.58	892,240.58
NRG ENERGY INC	19,068	69.97	1,334,187.96
PG&E CORP	148,742	16.85	2,506,302.70
PPL CORPORATION	58,459	27.02	1,579,562.18
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	65.74	2,647,086.84
SEMPRA	49,744	70.08	3,486,059.52
SOUTHERN CO	82,430	72.15	5,947,324.50
VISTRA CORP	28,652	65.66	1,881,290.32
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	81.56	1,912,337.32
XCEL ENERGY INC	41,562	54.72	2,274,272.64
ADVANCED MICRO DEVICES	124,711	146.64	18,287,621.04
ANALOG DEVICES	37,792	183.36	6,929,541.12
APPLIED MATERIALS	64,814	189.77	12,299,752.78
BROADCOM INC	34,367	1,204.71	41,402,268.57
ENPHASE ENERGY INC	9,617	106.48	1,024,018.16
ENTEGRIS INC	12,389	122.20	1,513,935.80

	FIRST SOLAR INC	7,921	175.04	1,386,491.84
	INTEL CORP	328,277	34.20	11,227,073.40
	KLA CORP	10,294	628.16	6,466,279.04
	LAM RESEARCH CORP	10,237	870.25	8,908,749.25
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	66.51	730,146.78
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	62.13	4,209,245.37
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	81.68	3,325,846.24
	MICRON TECHNOLOGY	85,302	106.77	9,107,694.54
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	591.52	2,088,657.12
	NVIDIA CORP	190,578	762.00	145,220,436.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	215.12	4,153,967.20
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	60.71	1,943,387.81
	QORVO INC	8,678	104.88	910,148.64
	QUALCOMM	87,162	157.63	13,739,346.06
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	96.11	1,080,468.62
	TERADYNE INC	12,318	95.97	1,182,158.46
	TEXAS INSTRUMENTS	69,576	159.68	11,109,895.68
	CBRE GROUP INC-A	22,995	84.90	1,952,275.50
	COSTAR GROUP INC	33,027	84.26	2,782,855.02
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	2.83	279,321.00
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	41.82	493,852.38
	アメリカドル 小計	26,339,362		3,296,971,229.14 (510,371,146,270)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	38,058	24.97	950,308.26
	CAMECO CORP	31,793	66.18	2,104,060.74
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,602	105.31	8,698,816.62
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	28.69	3,192,996.17
	ENBRIDGE	166,986	47.97	8,010,318.42
	IMPERIAL OIL	12,043	95.63	1,151,672.09
	KEYERA CORP	18,607	35.00	651,245.00
	MEG ENERGY CORP	27,250	31.16	849,110.00
	PARKLAND CORP	7,149	42.19	301,616.31
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	47.98	1,829,525.38
	SUNCOR ENERGY	98,973	52.99	5,244,579.27
	TC ENERGY CORP	82,559	49.05	4,049,518.95
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	65.12	1,628,586.08
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	87.82	3,170,302.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	23.53	3,146,596.31
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	70.58	657,946.76
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	15.96	692,025.60
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	167.00	2,612,047.00
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	19.21	995,980.87

KINROSS GOLD CORP	108,451	9.31	1,009,678.81
LUNDIN MINING CORP	65,800	15.84	1,042,272.00
NUTRIEN LTD	37,152	72.56	2,695,749.12
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	26.24	588,195.84
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	64.81	2,293,366.66
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	106.42	373,002.10
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	72.38	2,309,356.28
CAE INC	25,999	25.58	665,054.42
STANTEC INC	9,001	108.50	976,608.50
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	129.28	673,936.64
WSP GLOBAL INC	9,951	209.64	2,086,127.64
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	21.50	700,448.50
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	21,664	45.56	987,011.84
RB GLOBAL INC	14,445	99.87	1,442,622.15
THOMSON REUTERS CORP	11,495	206.67	2,375,671.65
AIR CANADA	13,805	19.58	270,301.90
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	175.47	7,411,326.39
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	116.41	8,512,481.25
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	196.65	1,147,846.05
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	66.45	1,345,878.30
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	95.38	292,816.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	48.42	475,484.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	98.20	2,265,768.60
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	132.26	596,889.38
DOLLARAMA INC	22,000	112.80	2,481,600.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,865	76.06	4,401,211.90
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	31.69	219,611.70
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	148.27	1,914,610.51
METRO INC	18,840	69.70	1,313,148.00
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	177.84	929,391.84
SAPUTO INC	20,898	25.68	536,660.64
BANK MONTREAL	56,278	126.75	7,133,236.50
BANK NOVA SCOTIA	91,232	64.28	5,864,392.96
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,075	65.43	4,650,437.25
NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	110.12	3,044,377.52
ROYAL BANK OF CANADA	109,143	134.57	14,687,373.51
TORONTO-DOMINION BANK	136,393	79.88	10,895,072.84
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	52.68	1,527,772.68
BROOKFIELD CORP	104,769	53.62	5,617,713.78
IGM FINANCIAL INC	7,685	33.60	258,216.00
ONEX CORP	6,603	97.30	642,471.90
TMX GROUP LTD	23,425	36.10	845,642.50

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,513.79	2,655,187.66
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	40.26	957,704.88
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	82.28	574,067.56
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	221.95	2,941,947.25
	MANULIFE FINANCIAL CORP	135,007	31.72	4,282,422.04
	POWER CORP OF CANADA	43,577	36.84	1,605,376.68
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	70.30	3,066,064.20
	CGI INC - CL A	16,084	142.99	2,299,851.16
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	3,661.67	5,686,573.51
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	124.03	866,225.52
	OPEN TEXT CORP	20,463	48.18	985,907.34
	SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	95.82	9,019,536.60
	BCE INC	6,203	44.80	277,894.40
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.55	433,960.00
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	53.01	1,477,971.81
	TELUS CORP	32,908	21.87	719,697.96
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	29.89	729,166.55
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	30.72	346,982.40
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	30.20	311,784.80
	EMERA INC	25,484	46.71	1,190,357.64
	FORTIS INC	35,547	52.89	1,880,080.83
	HYDRO ONE LTD	29,579	37.80	1,118,086.20
	NORTHLAND POWER INC	17,854	20.74	370,291.96
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	205.50	552,795.00
	カナダドル 小計	3,115,615		203,788,022.83 (22,960,796,532)
ユーロ	ENI	174,687	15.25	2,665,374.24
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	16.04	636,178.48
	NESTE OIL OYJ	32,766	25.72	842,741.52
	OMV AG	12,549	43.58	546,885.42
	REPSOL SA	89,536	14.94	1,338,115.52
	TENARIS SA	40,648	17.70	719,469.60
	TOTALENERGIES SE	167,596	67.28	11,275,858.88
	AIR LIQUIDE	40,571	187.76	7,617,610.96
	AKZO NOBEL	12,357	66.28	819,021.96
	ARCELORMITTAL	42,704	23.83	1,017,636.32
	ARKEMA	4,369	95.60	417,676.40
	BASF SE	70,406	50.44	3,551,278.64
	COVESTRO AG	14,454	48.50	701,019.00
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	104.10	1,426,898.70
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.29	309,353.73
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	93.14	1,002,652.10

OCI NV	7,248	24.78	179,605.44
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	40.90	797,713.60
STORA ENSO OYJ R	42,169	12.77	538,708.97
SYENSQO SA	5,356	86.67	464,204.52
SYMRISE AG	10,018	105.40	1,055,897.20
UMICORE	17,605	21.08	371,113.40
UPM KYMMENE OYJ	42,324	32.00	1,354,368.00
VOESTALPINE AG	7,152	25.00	178,800.00
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,593	38.22	634,184.46
AIRBUS SE	46,092	160.04	7,376,563.68
ALSTOM	24,388	15.10	368,258.80
BOUYGUES ORD	16,606	36.12	599,808.72
BRENTAG SE	9,500	74.54	708,130.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	43.55	1,710,556.90
DASSAULT AVIATION SA	2,130	205.20	437,076.00
EIFFAGE	5,924	98.82	585,409.68
FERROVIAL SE	37,026	33.22	1,230,003.72
GEA GROUP AG	13,382	37.12	496,739.84
IMCD NV	4,641	151.25	701,951.25
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	81.35	1,008,577.30
KNORR-BREMSE AG	5,022	68.10	341,998.20
KONE OYJ-B	26,369	42.90	1,131,230.10
LEGRAND SA	19,340	95.48	1,846,583.20
LEONARDO SPA	31,340	21.68	679,451.20
METSO CORPORATION	51,970	11.23	583,882.95
MTU AERO ENGINES AG	3,962	211.90	839,547.80
PRYSMIAN SPA	21,155	50.40	1,066,212.00
RATIONAL AG	483	785.50	379,396.50
REXEL SA	17,411	23.96	417,167.56
RHEINMETALL AG	3,203	504.00	1,614,312.00
SAFRAN SA	26,619	205.90	5,480,852.10
SAINT-GOBAIN	36,177	70.26	2,541,796.02
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	208.40	8,784,060.00
SIEMENS	58,485	172.96	10,115,565.60
SIEMENS ENERGY AG	36,841	17.62	649,138.42
THALES SA	6,657	155.25	1,033,499.25
VINCI S.A.	39,327	113.35	4,457,715.45
WARTSILA OYJ	41,917	15.22	638,186.32
BUREAU VERITAS SA	25,073	27.38	686,498.74
RANDSTAD NV	10,680	48.17	514,455.60
TELEPERFORMANCE	4,734	87.52	414,319.68
WOLTERS KLUWER	19,155	140.55	2,692,235.25

ADP	2,382	118.20	281,552.40
AENA SME SA	5,508	173.20	953,985.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.71	304,523.58
DHL GROUP	74,810	38.34	2,868,215.40
GETLINK	21,115	15.55	328,338.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	105.85	2,605,709.45
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	98.20	490,116.20
CONTINENTAL AG	8,168	62.36	509,356.48
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	89.92	922,039.68
FERRARI NV	10,026	387.20	3,882,067.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,436	74.14	4,703,145.04
MICHELIN	49,034	35.32	1,731,880.88
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	48.97	575,152.65
RENAULT SA	11,597	47.73	553,524.81
STELLANTIS NV	166,407	24.23	4,032,041.61
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	121.20	1,857,753.60
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	141.30	351,271.80
ADIDAS AG	12,783	224.60	2,871,061.80
HERMES INTERNATIONAL	2,420	2,320.00	5,614,400.00
KERING	5,534	339.10	1,876,579.40
LVMH	21,429	796.60	17,070,341.40
MONCLER SPA	14,605	65.44	955,751.20
PUMA SE	9,220	42.56	392,403.20
SEB SA	2,282	111.40	254,214.80
ACCOR	14,436	39.78	574,264.08
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	57.42	2,111,448.24
DELIVERY HERO SE	13,414	28.09	376,799.26
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	35.18	285,239.44
SODEXO	6,173	78.55	484,889.15
BOLLORE SE	31,761	6.15	195,330.15
PUBLICIS GROUPE	17,217	99.70	1,716,534.90
SCOUT24 SE	7,536	66.90	504,158.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	26.78	1,762,820.28
VIVENDI SE	61,243	9.89	606,060.72
D' IETEREN GROUP	2,217	203.80	451,824.60
INDITEX	87,257	43.74	3,816,621.18
PROSUS	112,590	28.54	3,213,318.60
ZALANDO SE	17,664	26.92	475,514.88
CARREFOUR	39,746	15.76	626,396.96
JERONIMO MARTINS	21,861	17.78	388,688.58
KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.53	332,072.40
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	27.38	1,941,242.00



ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,097	54.96	3,577,731.12
DANONE (GROUPE)	51,810	59.44	3,079,586.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	9.47	320,885.78
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	74.60	709,595.20
HEINEKEN NV	23,160	89.64	2,076,062.40
JDE PEET'S BV	7,000	19.92	139,440.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	79.40	866,492.20
LOTUS BAKERIES	38	9,040.00	343,520.00
PERNOD-RICARD	15,339	145.00	2,224,155.00
REMY COINTREAU	1,032	93.80	96,801.60
BEIERSDORF AG	7,430	135.80	1,008,994.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	65.90	578,602.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,018	72.22	1,084,599.96
LOREAL	18,546	444.95	8,252,042.70
AMPLIFON SPA	11,650	31.34	365,111.00
BIOMERIEUX	3,044	99.55	303,030.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	97.70	335,111.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	91.18	188,742.60
ESSILORLUXOTTICA	22,901	203.30	4,655,773.30
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	36.62	621,990.70
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	26.90	906,234.10
KONINKLIJKE PHILIPS	54,179	18.85	1,021,274.15
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	50.80	1,095,603.60
ARGENX SE	4,935	337.30	1,664,575.50
BAYER	78,462	26.32	2,065,512.15
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	59.52	608,294.40
GRIFOLS SA	27,685	8.34	231,059.01
IPSEN	3,532	108.40	382,868.80
MERCK KGAA	9,152	146.00	1,336,192.00
ORION OYJ-CLASS B	10,139	32.40	328,503.60
QIAGEN N.V.	16,526	37.47	619,229.22
RECORDATI SPA	6,099	49.86	304,096.14
SANOFI	87,091	86.89	7,567,336.99
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	271.60	495,398.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	200.60	517,949.20
UCB (GROUPE)	9,389	121.20	1,137,946.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	44,853	15.62	700,828.12
AIB GROUP PLC	145,826	5.03	734,233.91
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	10.20	4,581,014.29
BANCO BPM SPA	77,744	6.39	496,784.16
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.51	5,517,704.35
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	10.05	888,640.79

BNP PARIBAS	77,707	65.43	5,084,369.01
CAIXABANK	275,085	4.80	1,322,058.51
COMMERZBANK AG	81,889	13.37	1,095,265.37
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	14.03	1,223,318.67
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	43.00	1,091,168.00
FINECOBANK SPA	41,585	14.14	588,011.90
ING GROEP NV-CVA	256,546	15.23	3,907,195.58
INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.37	3,866,992.56
KBC GROEP NV	18,057	69.60	1,256,767.20
MEDIOBANCA	33,860	13.49	456,940.70
NORDEA BANK ABP	236,636	10.89	2,576,966.04
SOCIETE GENERALE	53,019	24.75	1,312,220.25
UNICREDIT SPA	116,219	35.27	4,099,625.22
ADYEN NV	1,609	1,399.20	2,251,312.80
AMUNDI SA	4,626	63.80	295,138.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	14.95	2,104,625.96
DEUTSCHE BOERSE	14,123	186.30	2,631,114.90
EDENRED	20,131	43.71	879,926.01
EURAZEO SA	3,357	81.00	271,917.00
EURONEXT NV	6,480	84.65	548,532.00
EXOR NV	7,825	100.70	787,977.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	69.70	593,495.50
NEXI SPA	48,458	5.40	262,060.86
SOFINA	1,238	211.80	262,208.40
WORLDLINE SA	20,332	9.49	193,032.00
AEGON LTD	101,846	5.52	562,393.61
AGEAS	11,086	43.06	477,363.16
ALLIANZ SE-REG	30,116	263.20	7,926,531.20
ASR NEDERLAND NV	11,959	45.65	545,928.35
ASSICURAZIONI GENERALI	84,111	22.67	1,906,796.37
AXA SA	144,204	33.90	4,888,515.60
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	230.00	1,024,650.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	415.00	4,321,810.00
NN GROUP NV	22,941	42.76	980,957.16
POSTE ITALIANE SPA	46,035	11.65	536,307.75
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	39.87	1,320,972.84
TALANX AG	5,053	68.20	344,614.60
BECHTLE AG	7,659	45.52	348,637.68
CAPGEMINI SA	12,235	200.10	2,448,223.50
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	38.10	1,887,740.70
NEMETSCHEK SE	5,455	79.55	433,945.25
SAP SE	81,129	165.80	13,451,188.20

	NOKIA OYJ	396,129	3.31	1,311,186.99
	CELLNEX TELECOM SA	34,475	30.70	1,058,382.50
	DEUTSCHE TELEKOM	253,485	21.16	5,363,742.60
	ELISA A	10,227	42.74	437,101.98
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.94	302,079.37
	KPN (KON.)	290,883	3.32	966,022.44
	ORANGE	153,281	10.85	1,663,865.25
	TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.22	189,096.03
	TELEFONICA	373,259	4.00	1,495,648.81
	ACCIONA SA	2,181	107.20	233,803.20
	E.ON SE	166,881	12.38	2,065,986.78
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	12.83	279,078.16
	ELIA GROUP SA/NV	987	92.35	91,149.45
	ENAGAS	21,663	13.68	296,349.84
	ENDESA	25,972	17.42	452,432.24
	ENEL	640,374	5.95	3,813,427.17
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.60	850,014.79
	ENGIE	146,393	15.93	2,332,040.49
	FORTUM OYJ	32,550	12.24	398,574.75
	IBERDROLA SA	476,876	11.34	5,407,773.84
	REDEIA CORP SA	30,678	15.94	489,007.32
	RWE STAMM	44,929	32.45	1,457,946.05
	SNAM SPA	147,559	4.28	632,142.75
	TERNA SPA	95,819	7.42	711,551.89
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.80	1,433,692.80
	VERBUND AG	6,430	70.35	452,350.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	523.00	2,016,688.00
	ASML HOLDING NV	31,092	821.00	25,526,532.00
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	133.50	848,659.50
	INFINEON TECHNOLOGIES	104,721	30.13	3,155,767.33
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	36.71	1,845,999.06
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	74.28	391,827.00
	VONOVIA SE	52,580	25.19	1,324,490.20
	ユーロ 小計	13,836,326		394,134,971.77 (65,028,328,992)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	5.14	6,772,278.88
	SHELL PLC-NEW	502,076	28.51	14,314,186.76
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	21.79	2,033,595.33
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	22.50	671,760.00
	CRH PLC	52,103	62.52	3,257,479.56
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	48.76	532,654.24
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	17.67	311,062.68

GLENCORE PLC	793,369	4.74	3,762,949.16
MONDI PLC	37,918	15.04	570,476.31
RIO TINTO PLC REG	88,047	53.80	4,736,928.60
ASHTED GROUP PLC	33,317	55.58	1,851,758.86
BAE SYSTEMS PLC	240,047	12.96	3,111,009.12
BUNZL PLC	29,337	29.94	878,349.78
DCC PLC	6,622	54.55	361,230.10
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	6.22	629,750.44
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	3.95	2,515,020.09
SMITHS GROUP PLC	26,476	15.86	419,909.36
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	92.15	508,115.10
EXPERIAN PLC	74,157	31.98	2,371,540.86
INTERTEK GROUP PLC	13,890	49.06	681,443.40
RELX PLC	145,542	33.02	4,805,796.84
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.22	768,612.31
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.41	323,186.83
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	45.42	315,759.84
BURBERRY GROUP PLC	29,776	11.32	337,064.32
PERSIMMON PLC	25,686	12.86	330,321.96
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.30	345,315.98
COMPASS GROUP PLC	129,701	22.03	2,857,313.03
ENTAIN PLC	49,630	8.37	415,601.62
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	148.40	1,935,432.80
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	78.16	1,081,187.28
PEARSON	55,305	9.93	549,289.26
WHITBREAD PLC	17,434	30.59	533,306.06
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.68	484,480.93
INFORMA PLC	110,598	7.83	866,645.92
WPP PLC	85,821	7.74	664,426.18
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.16	241,881.83
KINGFISHER PLC	153,717	2.45	377,528.95
NEXT PLC	8,464	87.74	742,631.36
OCADO GROUP PLC	54,753	3.47	190,102.41
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.58	383,890.98
TESCO PLC	525,585	2.81	1,478,996.19
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	24.47	629,857.80
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	23.10	3,649,338.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	24.56	441,097.60
DIAGEO	174,682	28.36	4,954,854.93
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.74	1,214,799.72
HALEON PLC	530,525	3.25	1,728,450.45
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	41.67	2,359,397.07

	UNILEVER PLC	193,307	38.11	7,366,929.77
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	9.61	659,746.71
	ASTRAZENECA	118,805	109.46	13,004,395.30
	GSK PLC	319,416	15.99	5,107,461.84
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	17.99	322,200.90
	BARCLAYS	1,129,529	1.85	2,099,116.69
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,478,895	6.46	9,556,619.49
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.50	2,458,659.97
	NATWEST GROUP PLC	426,244	2.76	1,179,417.14
	STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.66	1,267,980.21
	3I GROUP PLC	74,757	28.35	2,119,360.95
	ABRDN PLC	153,430	1.36	208,971.66
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.18	237,573.37
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,529	89.84	2,922,405.36
	M&G PLC	131,539	1.99	262,880.69
	SCHRODERS PLC	39,932	3.66	146,390.71
	ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	4.23	173,150.82
	WISE PLC - A	49,048	8.08	396,307.84
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	27.35	444,574.25
	AVIVA PLC	193,334	4.59	888,756.39
	LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.44	1,218,597.20
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	4.81	245,416.81
	PRUDENTIAL	212,226	7.22	1,532,271.72
	SAGE GROUP PLC	76,660	11.40	874,307.30
	HALMA PLC	31,069	21.83	678,236.27
	BT GROUP PLC	464,863	1.05	489,965.60
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.67	1,102,630.39
	CENTRICA PLC	453,631	1.31	597,432.02
	NATIONAL GRID PLC	285,439	10.40	2,968,565.60
	SEVERN TRENT PLC	17,468	24.54	428,664.72
	SSE PLC	81,692	16.60	1,356,495.66
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.34	522,997.20
	イギリスポンド 小計	20,916,176		148,136,547.63 (28,375,555,698)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	13.16	228,957.68
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	688.00	394,912.00
	GIVAUDAN-REG	742	3,951.00	2,931,642.00
	HOLCIM LTD	38,804	77.54	3,008,862.16
	SIG GROUP AG	26,203	19.21	503,359.63
	SIKA AG-BR	12,257	255.90	3,136,566.30
	ABB LTD	124,889	44.64	5,575,044.96
	GEBERIT AG-REG	2,530	485.50	1,228,315.00

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	219.50	449,536.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	225.80	698,173.60	
	VAT GROUP AG	1,956	459.10	897,999.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	31.26	464,398.56	
	SGS SA	12,959	82.00	1,062,638.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	248.70	940,334.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	127.45	5,222,263.75	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	191.00	474,253.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	37.85	149,053.30	
	AVOLTA AG	7,820	34.56	270,259.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,411.00	395,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	104,200.00	833,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,420.00	854,440.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	205,438	95.24	19,565,915.12	
	ALCON INC	38,399	72.48	2,783,159.52	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	248.00	963,976.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	133.10	1,136,674.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	78.65	145,502.50	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	502.80	2,783,500.80	
	NOVARTIS	158,232	85.53	13,533,582.96	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	238.00	527,170.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,075	222.10	12,010,057.50	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	29.51	898,815.58	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	100.60	250,192.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	48.44	740,599.16	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,189.00	2,169,925.00	
	UBS GROUP AG	249,657	25.70	6,416,184.90	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	139.20	593,548.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	117.90	348,394.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	611.20	1,295,132.80	
	SWISS RE LTD	24,330	98.12	2,387,259.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	448.40	5,129,696.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	66.00	339,900.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	70.98	852,185.88	
	SWISSCOM	1,856	518.50	962,336.00	
	BKW AG	1,744	141.40	246,601.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	84.90	482,147.10	
	スイスフラン 小計	1,167,106		106,282,146.96 (18,056,273,947)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	346.20	7,703,642.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	416.20	2,240,404.60	
	SCA SV CELLULOSA B	55,976	152.95	8,561,529.20	

ALFA LAVAL AB	18,955	420.50	7,970,577.50	
ASSA ABLOY AB-B	75,977	305.40	23,203,375.80	
ATLAS COPCO A	207,097	179.45	37,163,556.65	
ATLAS COPCO B	114,624	155.60	17,835,494.40	
BEIJER REF AB	26,868	140.60	3,777,640.80	
EPIROC AB-A	53,479	212.40	11,358,939.60	
EPIROC AB-B	28,804	188.00	5,415,152.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	81.08	3,138,768.96	
INDUTRADE AB	22,644	271.80	6,154,639.20	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	275.10	3,851,950.20	
LIFCO AB-B SHS	17,970	273.20	4,909,404.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	48.83	5,998,667.84	
SAAB AB-B	6,388	896.60	5,727,480.80	
SANDVIK AB	87,594	237.10	20,768,537.40	
SKANSKA B	25,507	189.25	4,827,199.75	
SKF AB-B	21,050	219.50	4,620,475.00	
VOLVO AB-A SHS	13,514	288.40	3,897,437.60	
VOLVO B	114,238	280.20	32,009,487.60	
SECURITAS B	28,375	109.65	3,111,318.75	
VOLVO CAR AB -RED SHS	49,839	2.30	115,003.49	
VOLVO CAR AB-B	49,839	40.86	2,036,421.54	
EVOLUTION AB	13,186	1,281.00	16,891,266.00	
HENNES & MAURITZ B	40,961	171.10	7,008,427.10	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	254.50	12,591,133.00	
GETINGE AB-B SHS	17,796	212.80	3,786,988.80	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	261.00	3,741,435.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	145.25	16,590,164.50	
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	109.00	13,160,224.00	
SWEDBANK AB-A	71,421	214.80	15,341,230.80	
EQT AB	31,471	288.10	9,066,795.10	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	353.40	4,176,481.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	352.50	3,936,720.00	
INVESTOR AB-B SHS	128,538	261.05	33,554,844.90	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	539.50	3,927,560.00	
ERICSSON (LM) B	214,689	56.30	12,086,990.70	
HEXAGON AB-B SHS	172,099	120.40	20,720,719.60	
TELE2 AB-B SHS	46,762	100.85	4,715,947.70	
TELIA CO AB	123,760	26.52	3,282,115.20	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	66.78	3,786,426.00	
SAGAX AB-B	17,402	265.60	4,621,971.20	
スウェーデンクローナ 小計	2,485,749		419,384,545.88 (5,946,872,860)	

ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	283.30	8,306,356.00	
	EQUINOR ASA	66,436	299.00	19,864,364.00	
	NORSK HYDRO	100,517	70.72	7,108,562.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	337.30	4,215,575.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	747.00	6,457,815.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	113.50	2,169,779.50	
	MOWI ASA	31,968	185.90	5,942,851.20	
	ORKLA	39,191	71.90	2,817,832.90	
	SALMAR ASA	5,423	652.50	3,538,507.50	
	DNB BANK ASA	71,795	211.50	15,184,642.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	164.10	3,047,993.40	
	TELENOR ASA	51,193	124.10	6,353,051.30	
ノルウェークローネ 小計		454,677		85,007,330.94	(1,196,053,146)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	387.00	11,653,344.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,228.00	1,682,140.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	83,415	176.75	14,743,601.25	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	9,385.00	2,055,315.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	9,568.00	2,927,808.00	
	DSV A/S	14,203	1,070.00	15,197,210.00	
	PANDORA A/S	6,512	1,082.00	7,045,984.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	927.60	6,316,956.00	
	COLOPLAST-B	9,737	906.00	8,821,722.00	
	DEMANT A/S	8,512	315.60	2,686,387.20	
	GENMAB A/S	4,878	2,006.00	9,785,268.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	866.20	219,173,719.80	
	DANSKE BANK A/S	48,617	202.90	9,864,389.30	
	TRYG A/S	29,772	135.90	4,046,014.80	
ORSTED A/S	12,910	385.10	4,971,641.00		
デンマーククローネ 小計		509,787		320,971,500.35	(7,096,679,872)
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	38.81	800,611.49	
	SANTOS	224,634	7.83	1,758,884.22	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	29.40	4,149,369.00	
	BHP GROUP LTD	388,318	44.63	17,330,632.34	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	22.96	798,319.20	
	FORTESCUE LTD	137,312	24.60	3,377,875.20	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	30,758	53.33	1,640,324.14	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	68.24	983,270.16	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	15.50	1,142,071.00	
	ORICA LTD	38,288	17.96	687,652.48	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.83	802,327.55	



RIO TINTO LTD	28,272	129.52	3,661,789.44	
SOUTH32 LTD	346,773	3.19	1,106,205.87	
REECE LTD	16,814	26.27	441,703.78	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	37.66	475,645.80	
BRAMBLES LTD	108,007	15.53	1,677,348.71	
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	27.92	1,238,977.92	
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.88	464,013.08	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.62	477,700.00	
TRANSURBAN GROUP	224,973	12.75	2,868,405.75	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	40.32	1,863,187.20	
IDP EDUCATION LTD	17,793	16.44	292,516.92	
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.94	899,144.22	
CAR GROUP LTD	29,334	33.25	975,355.50	
REA GROUP LTD	3,586	175.97	631,028.42	
SEEK LTD	28,001	23.73	664,463.73	
WESFARMERS LTD	90,757	65.25	5,921,894.25	
COLES GROUP LTD	108,486	16.05	1,741,200.30	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.32	584,673.32	
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	31.40	2,891,029.40	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.84	757,286.40	
COCHLEAR LIMITED	4,783	315.65	1,509,753.95	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	50.09	606,439.63	
SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	26.27	1,098,847.83	
CSL LIMITED	37,640	269.49	10,143,603.60	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	28.25	6,735,449.75	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	111.86	14,599,184.18	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	33.06	7,961,277.78	
WESTPAC BANKING	276,117	25.50	7,040,983.50	
ASX LTD	14,549	62.51	909,457.99	
MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	183.33	5,177,422.53	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.50	448,890.00	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	6.35	1,058,303.70	
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.59	833,536.97	
QBE INSURANCE GROUP	104,083	17.34	1,804,799.22	
SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	15.95	1,513,080.80	
WISETECH GLOBAL LTD	13,801	88.46	1,220,836.46	
XERO LTD	11,340	116.81	1,324,625.40	
TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.65	1,125,904.55	
ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	9.76	1,518,021.60	
オーストラリアドル 小計	5,197,730		129,735,326.23 (12,919,043,785)	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.85	647,318.85	

ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	14,283	34.69	495,477.27
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	26.60	1,063,468.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	4.65	618,250.05
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.44	416,107.72
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.89	651,104.16
ニュージーランドドル 小計		444,838		3,891,726.05 (355,742,678)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,996	35.85	8,209,506.60
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	101.50	10,860,500.00
	MTR CORP	125,000	23.45	2,931,250.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	15.70	1,884,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	33.65	5,855,100.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	18.00	3,564,000.00
	WH GROUP LTD	658,301	5.39	3,548,242.39
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	22.65	6,375,975.00
	HANG SENG BANK	59,400	96.05	5,705,370.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	214.60	18,949,180.00
	AIA GROUP LTD	864,200	47.20	40,790,240.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	42.60	1,597,500.00
	CLP HOLDINGS	136,500	59.70	8,149,050.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.66	5,120,358.62
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	43.30	4,849,600.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	31.10	3,794,075.60
	ESR GROUP LTD	157,000	8.00	1,256,000.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	8.21	1,420,330.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	22.15	2,773,800.20
	SINO LAND CO	315,400	7.83	2,469,582.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	70.00	7,350,000.00
SWIRE PACIFIC A	44,500	60.80	2,705,600.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	14.98	1,441,076.00	
WHARF HOLDINGS	84,000	24.25	2,037,000.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	22.40	2,755,200.00	
香港ドル 小計		5,440,678		156,392,536.41 (3,090,316,519)
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	26.50	212,000.00
	KEPPEL LTD	112,800	6.97	786,216.00
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.07	165,764.90
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.95	582,230.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.25	677,075.00
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.92	269,376.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.40	607,240.00
	DBS GROUP	141,600	36.41	5,155,656.00

	OCBC BANK	257,100	13.69	3,519,699.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	29.93	2,813,420.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.06	597,960.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	2.35	1,462,036.05	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.32	447,412.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.46	639,846.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	5.74	245,672.00	
	シンガポールドル 小計	4,568,566		18,181,602.95 (2,064,702,831)	
イスラエルシ ケル	ICL LTD	59,427	18.05	1,072,657.35	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	773.80	1,660,574.80	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	33.88	3,330,742.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	29.25	3,290,976.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.19	1,909,405.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	136.10	1,701,658.30	
	NICE LTD	4,991	843.00	4,207,413.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	247.00	379,639.00	
	イスラエルシケル 小計	390,926		17,553,066.25 (721,722,403)	
	合 計	84,867,536		678,183,235,533 (678,183,235,533)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権 証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	
		カナダドル 小計	1,490.00	- ( - )	
		新株予約権証券合計		- ( - )	
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	83,290	695,471.50	
		オーストラリアドル 小計	83,290	695,471.50 (69,255,051)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,734,200.00	
		香港ドル 小計	315,000	2,734,200.00 (54,027,792)	
		投資信託受益証券合計	398,290	123,282,843 (123,282,843)	
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,446,472.07	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	880,832.98	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	6,216,477.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	681,838.46	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,149,349.49	

BOSTON PROPERTIES		11,259	677,791.80	
CAMDEN PROPERTY TRUST		7,749	746,151.21	
CROWN CASTLE INC		32,235	3,068,772.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC		23,348	3,194,706.84	
EQUINIX INC		7,333	5,485,084.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		14,090	883,865.70	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		25,885	1,592,962.90	
ESSEX PROPERTY TRUST		5,205	1,224,059.85	
EXTRA SPACE STORAGE INC		15,693	2,078,694.78	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		18,095	774,466.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		54,765	984,674.70	
HOST HOTELS AND RESORTS INC		56,773	1,062,222.83	
INVITATION HOMES INC		45,008	1,510,918.56	
IRON MOUNTAIN INC		23,326	1,751,782.60	
KIMCO REALTY CORP		47,897	871,725.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		9,195	1,159,305.60	
PROLOGIS INC		71,288	7,377,595.12	
PUBLIC STORAGE		11,847	3,084,721.86	
REALTY INCOME CORP		64,068	3,398,166.72	
REGENCY CENTERS CORP		12,511	730,267.07	
SBA COMMUNICATIONS CORP		8,933	1,751,403.98	
SIMON PROPERTY GROUP		25,979	3,648,490.76	
SUN COMMUNITIES INC		10,890	1,281,644.10	
UDR INC		23,815	866,866.00	
VENTAS INC		31,565	1,361,398.45	
VICI PROPERTIES INC		83,762	2,336,122.18	
WELLTOWER INC		43,994	4,017,532.08	
WP CAREY INC		16,024	900,709.04	
アメリカドル 小計		925,374	69,197,072.13	(10,711,706,765)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	208,528.29	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	273,398.50	
カナダドル 小計		20,377	481,926.79	(54,298,691)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	215,648.52	
	GECINA SA	3,139	292,240.90	
	KLEPIERRE	17,225	423,735.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	785,170.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	332,664.64	
ユーロ 小計		48,695	2,049,459.56	(338,140,332)
イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	357,153.70	
	SEGRO PLC	78,133	663,036.63	

イギリスポンド 小計		134,422	1,020,190.33 (195,417,457)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	664,275.40
	GOODMAN GROUP	135,303	4,125,388.47
	GPT GROUP	167,884	696,718.60
	MIRVAC GROUP	266,683	565,367.96
	SCENTRE GROUP	381,283	1,201,041.45
	STOCKLAND	207,412	908,464.56
	VICINITY CENTERS	305,149	581,308.84
オーストラリアドル 小計		1,557,804	8,742,565.28 (870,584,650)
香港ドル	LINK REIT	166,900	5,148,865.00
香港ドル 小計		166,900	5,148,865.00 (101,741,572)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	727,393.28
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	636,434.52
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	370,977.59
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	266,200.00
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,001,005.39 (227,234,172)
投資証券合計		3,979,428	12,499,123,639 (12,499,123,639)
合計			12,622,406,482 (12,622,406,482)

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 592銘柄	97.9%				73.9%
	投資証券 33銘柄				2.1%	1.6%
カナダドル	株式 85銘柄	99.8%				3.3%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 2銘柄				0.2%	0.0%
ユーロ	株式 217銘柄	99.5%				9.4%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.3%				4.1%
	投資証券 2銘柄				0.7%	0.0%

スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%				2.6%
スウェーデンクローナ	株式	43銘柄	100.0%				0.9%
ノルウェークローネ	株式	12銘柄	100.0%				0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%				1.0%
オーストラリアドル	株式	50銘柄	93.2%				1.9%
	投資信託受益証券	1銘柄			0.5%		0.0%
	投資証券	7銘柄				6.3%	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	25銘柄	95.2%				0.4%
	投資信託受益証券	1銘柄			1.7%		0.0%
	投資証券	1銘柄				3.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	15銘柄	90.1%				0.3%
	投資証券	4銘柄				9.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%				0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 4月22日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	570,133,109
コール・ローン	3,066,645,832
国債証券	328,063,611,857
派生商品評価勘定	24,758,247
未収利息	2,802,596,496
前払金	38,714,066
前払費用	255,476,123
差入委託証拠金	199,395,602
流動資産合計	335,021,331,332
資産合計	335,021,331,332
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,820,623
未払解約金	60,681,572
流動負債合計	99,502,195
負債合計	99,502,195

2024年 4月22日現在	
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	94,484,093,956
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	240,437,735,181
元本等合計	334,921,829,137
純資産合計	334,921,829,137
負債純資産合計	335,021,331,332

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 4月22日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	94,484,093,956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 3,5447円 (1万口当たり純資産額) (35,447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

2024年 4月22日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2024年 4月22日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	88,613,779,823円
期中追加設定元本額	9,179,458,610円
期中一部解約元本額	3,309,144,477円
期末元本額	94,484,093,956円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,101,270,052円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	491,727,378円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,365,111,217円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,189,143円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,743,114,680円
世界経済インデックスファンド	21,848,603,777円
DCマイセレクション25	1,895,896,877円
DCマイセレクション50	1,814,284,509円
DCマイセレクション75	1,451,394,643円



区分	2024年 4月22日現在
DC外国債券インデックス・オープン	2,246,600,145円
DCマイセクションS25	1,116,579,746円
DCマイセクションS50	983,643,873円
DCマイセクションS75	565,040,575円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,238,611円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,100,012円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	55,981,038円
DC世界経済インデックスファンド	14,419,796,494円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	758,636,583円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,044,653円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	997,055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）	13,654,071円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	23,130,124円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	47,888,494円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,821,859円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	51,321,780円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	752,831,605円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	357,798,192円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,503,958,975円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,380,051円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	27,305,183円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	335,937,407円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	128,336,498円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	165,869,012円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	633,617,682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）	1,483,780,621円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	624,198,319円
外国債券ファンド・シリーズ1	764,169,682円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	771,225,714円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,489,463,838円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	219,389,061円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,385,876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）	1,273,954,841円
SMT インデックスバランス・オープン	170,004,646円
SMT 世界経済インデックス・オープン	418,546,417円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	608,739,142円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	922,326,985円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,110,129円
グローバル経済コア	1,080,153,768円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,556,420円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,861,917円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	63,559,081円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	86,332,374円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	43,789,961円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	57,361,341円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	677,211,540円
10資産分散投資ファンド	35,846,396円
グローバル10資産バランスファンド	22,582,559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）	13,096,868,365円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	278,201,713円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	143,005,107円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	127,877,310円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,768,551,637	
合計	1,768,551,637	

(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

(2024年 4月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	2,408,641,362	-	2,369,927,296	38,714,066
	合計	2,408,641,362	-	2,369,927,296	38,714,066

(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 4月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,774,914,409	-	2,799,566,099	24,651,690
	アメリカドル	1,365,200,871	-	1,377,291,760	12,090,889
	カナダドル	106,615,030	-	107,802,240	1,187,210
	ユーロ	876,737,654	-	885,192,920	8,455,266
	イギリスポンド	148,528,748	-	148,884,840	356,092
	オフショア人民元	277,832,106	-	280,394,339	2,562,233
	合計	2,774,914,409	-	2,799,566,099	24,651,690

(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	3,696,011.70	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,587,808.60	
		T 0.25% 07/31/25	7,640,000.00	7,186,076.57	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,918,388.68	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,800,429.68	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,348,000.00	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,372,968.72	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,621,941.76	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,772,109.37	
		T 0.375% 09/30/27	6,580,000.00	5,670,366.38	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,785,078.14	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,700,703.12	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,144,482.40	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,913,959.93	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,587,027.74	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,069,541.02	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,085,106.28	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,046,918.75	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,470,214.82	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,648,925.80	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,183,490.22	
		T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,269,687.52	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,345,273.43	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,160,498.05	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,271,749.95	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,336,064.48	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,536,992.18	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,737,959.02	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,667,734.36	
		T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,662,369.14	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,335,937.52	
		T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,636,054.70	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,808,717.75	
		T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,261,768.72	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	6,988,124.96	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,014,009.95	
		T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,053,273.44	
		T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,373,902.52	

T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,426,128.15	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	6,987,968.72	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,653,593.75	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,228,554.68	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,824,375.00	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,315,856.66	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,198,388.66	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,387,500.00	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,491,363.68	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,815,933.60	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,048,100.00	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	9,991,271.87	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,662,812.50	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,480,057.77	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,484,609.36	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,441,371.06	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,944,531.25	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,518,408.17	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,272,968.73	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,073,315.62	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,893,835.14	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,804,472.69	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,586,500.00	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,651,070.27	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,405,535.56	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,253,164.04	
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	2,994,651.55	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,585,859.36	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,621,158.60	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,231,281.25	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,726,937.50	
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	5,992,441.39	
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,448,637.08	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,854,271.87	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,851,351.54	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,003,183.62	
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,098,147.55	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,398,343.76	
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,177,326.15	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,651,386.70	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,127,636.70	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,532,850.79	

T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,949,072.24
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,061,387.50
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,454,042.95
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,214,890.63
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,023,208.03
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,885,556.62
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,405,980.48
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,471,828.11
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,886,312.50
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,393,270.68
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,198,967.80
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,645,781.25
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,946,364.06
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,677,962.88
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,656,527.32
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	990,191.39
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,500,018.37
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,058,668.38
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	7,081,675.15
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,250,000.00
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,593,792.95
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,096,233.42
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,136,625.00
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,206,482.42
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,349,609.37
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,238,873.06
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,298,513.66
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,868,618.15
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,686,800.76
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,475,964.03
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,155,849.61
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,909,372.96
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,036,128.89
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,377,216.83
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	8,915,617.23
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	3,811,960.93
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,369,525.03
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,681,078.15
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,726,738.29
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,309,743.36
T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,636,733.21
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,697,283.20
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	686,273.43

T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,698,710.96	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,619,814.46	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,314,830.06	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,559,132.81	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	3,000,134.37	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,126,632.82	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	836,431.63	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	2,991,757.82	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,618,422.66	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,944,203.17	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,430,312.50	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	5,836,734.37	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,631,625.00	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	7,861,546.89	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,358,744.15	
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,804,882.82	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,379,607.23	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,439,746.10	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,890,941.41	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,193,210.96	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,766,406.24	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,294,156.20	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	675,013.27	
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,288,837.89	
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,837,808.60	
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,123,931.80	
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	7,892,739.21	
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	1,901,947.25	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	3,976,181.62	
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,420,635.12	
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,854,511.73	
T 3.75% 11/15/43	4,730,000.00	4,069,647.63	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,375,332.01	
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,201,171.87	
T 3.875% 08/15/33	8,170,000.00	7,709,799.25	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,304,886.72	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,405,936.34	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,816,550.37	
T 3% 02/15/47	6,600,000.00	4,920,738.30	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	740,429.69	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	737,226.56	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,908,224.61	

T 3% 05/15/45	700,000.00	529,210.93
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,388,879.49
T 3% 07/15/25	11,150,000.00	10,869,943.33
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,400,302.74
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,796,000.00
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,079,085.94
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,848,437.50
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,126,359.36
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,732,097.66
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	3,894,859.37
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	8,931,906.29
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,034,548.83
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,504,257.76
T 4.25% 02/15/54	3,250,000.00	3,012,089.85
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	857,355.47
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,818,197.25
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	696,293.75
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	976,699.22
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,822,478.51
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	618,947.26
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,928,984.36
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	13,964,557.59
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	924,074.99
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,428,720.72
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,091,447.65
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	542,899.41
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	9,909,765.60
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,662,746.09
T 4.5% 11/15/33	4,770,000.00	4,725,653.87
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,364,771.47
T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,463,103.14
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	749,091.79
T 4.75% 11/15/53	1,380,000.00	1,389,056.25
T 4.875% 10/31/30	2,500,000.00	2,530,566.40
T 4% 01/15/27	3,200,000.00	3,130,687.48
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,387,138.68
T 4% 02/28/30	6,200,000.00	5,990,750.00
T 4% 07/31/30	3,980,000.00	3,838,445.68
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,339,171.87
T 4% 11/15/52	7,400,000.00	6,557,238.27
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	417,328.12
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,329,199.22
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,043,805.66

	T 5% 08/31/25	4,250,000.00	4,242,695.31
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,732,937.50
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,514,683.60
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,136,460.93
	アメリカドル 小計	1,146,220,000.00	998,257,026.62 (154,530,187,720)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,119,496.59
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,854,911.76
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,888,863.67
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,741,855.43
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,138,491.41
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,417,940.59
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	861,427.46
	CAN 1.5% 06/01/31	3,770,000.00	3,253,627.77
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,091,723.69
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	1,924,300.19
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	742,803.55
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,424,026.09
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,248,479.51
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	224,387.52
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,094,091.21
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,110,488.40
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,542,612.01
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	895,057.98
	CAN 2.75% 12/01/55	1,280,000.00	1,069,915.86
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	509,934.27
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	382,867.35
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,338,155.84
	CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,600,962.07
	CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	2,024,883.93
	CAN 3.25% 12/01/33	1,310,000.00	1,259,762.60
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,146,100.74
	CAN 3.5% 08/01/25	640,000.00	631,518.90
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	933,256.87
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,309,169.50
	CAN 3% 06/01/34	1,200,000.00	1,126,779.40
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,222,045.14
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	766,855.19
	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	300,780.14
	CAN 4.5% 11/01/25	1,330,000.00	1,330,596.31
	CAN 4% 03/01/29	2,400,000.00	2,423,898.59
	CAN 4% 05/01/26	1,030,000.00	1,025,307.10



	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,632,487.94
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,870,841.99
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	712,346.89
	カナダドル 小計	64,790,000.00	59,193,051.45 (6,669,281,106)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,603,266.50
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	29,419,467.80
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,033,690.82
	MBONO 7.5% 05/26/33	24,150,000.00	20,677,471.50
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,260,816.20
	MBONO 7.75% 05/29/31	39,030,000.00	34,650,053.40
	MBONO 7.75% 11/13/42	29,910,000.00	24,238,166.70
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,250,000.00	8,800,855.00
	MBONO 7% 09/03/26	7,460,000.00	6,927,878.20
	MBONO 8.5% 03/01/29	14,540,000.00	13,706,421.80
	MBONO 8.5% 05/31/29	30,830,000.00	29,014,113.00
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,038,840.60
	MBONO 8% 07/31/53	21,820,000.00	17,778,936.00
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,242,110.00
		メキシコペソ 小計	344,190,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,202,651.96
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	993,085.85
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	421,967.04
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	182,359.65
	BGB 0.8% 06/22/25	2,000,000.00	1,942,024.00
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,416,059.88
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,475,140.80
	BGB 0.9% 06/22/29	1,670,000.00	1,518,452.51
	BGB 0% 10/22/27	900,000.00	815,456.15
	BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,179,088.70
	BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,138,028.44
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	660,534.00
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	651,979.20
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	771,568.20
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	775,777.20
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	551,723.12
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,399,309.26
	BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,372,728.24
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	653,268.00
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	514,113.78
BGB 2.75% 04/22/39	560,000.00	526,654.24	
BGB 2.85% 10/22/34	680,000.00	666,890.13	

BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	985,473.00
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	444,165.92
BGB 3.5% 06/22/55	460,000.00	459,449.84
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	980,605.95
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,451,387.65
BGB 3% 06/22/34	1,050,000.00	1,047,427.50
BGB 4.25% 03/28/41	1,750,000.00	1,958,605.25
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,170,585.28
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,162,026.00
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,239,338.60
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,127,068.56
BKO 2.8% 06/12/25	1,490,000.00	1,481,601.84
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,358,115.04
BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,819,808.90
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,490,677.44
BTPS 0.45% 02/15/29	1,880,000.00	1,635,387.56
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,814,299.45
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,154,331.15
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,557,893.60
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,188,854.72
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,442,848.64
BTPS 0.95% 03/01/37	1,320,000.00	918,396.60
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,882,109.28
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,907,996.92
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,376,649.74
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,762,176.58
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,097,659.20
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,992,804.95
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,202,459.95
BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	824,925.00
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,583,662.67
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	1,992,937.50
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	901,121.16
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,251,836.25
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	786,250.00
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,357,796.99
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,041,012.00
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,652,020.12
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,254,758.00
BTPS 1.7% 09/01/51	1,350,000.00	816,010.20
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	685,248.00
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,648,708.10
BTPS 2.05% 08/01/27	2,320,000.00	2,227,464.48

BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,400,921.28	
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	420,592.60	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	673,281.60	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,203,819.72	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,371,656.55	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,600,000.00	2,331,641.00	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	991,957.80	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,637,028.48	
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,297,083.32	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,718,474.56	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	863,950.74	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	606,169.27	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,531,131.02	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,385,221.36	
BTPS 2.95% 02/15/27	330,000.00	326,191.14	
BTPS 2.95% 09/01/38	880,000.00	771,094.72	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,152,778.82	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,148,878.82	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,245,340.00	
BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,693,351.44	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,948,341.00	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	1,794,311.19	
BTPS 3.4% 04/01/28	2,000,000.00	2,001,210.40	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,602,994.12	
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	910,642.46	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,362,893.36	
BTPS 3.7% 06/15/30	630,000.00	635,138.91	
BTPS 3.8% 04/15/26	1,440,000.00	1,450,195.20	
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,787,322.24	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,372,735.98	
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	868,966.36	
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,910,936.60	
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,125,783.30	
BTPS 4.15% 10/01/39	460,000.00	457,262.54	
BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	1,973,329.92	
BTPS 4.35% 11/01/33	1,800,000.00	1,874,593.80	
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,110,901.20	
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,593,474.48	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,119,166.40	
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,547,412.51	
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,772,766.92	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,600,000.00	1,705,040.00	

BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,074,915.07
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	887,923.52
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,281,535.00
BTPS 4% 11/15/30	1,800,000.00	1,843,547.40
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,929,219.09
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,954,528.72
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,614,633.32
BTPS 5% 08/01/34	3,170,000.00	3,470,395.54
BTPS 5% 09/01/40	2,260,000.00	2,469,411.60
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,981,532.78
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,312,440.50
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,530,338.18
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,812,185.04
DBR 0.25% 02/15/29	1,370,000.00	1,232,521.87
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,898,165.17
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,870,775.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,259,051.28
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	326,637.85
DBR 0% 02/15/30	970,000.00	842,561.40
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,408,795.52
DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,567,366.67
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,803,659.20
DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,788,795.90
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,738,174.52
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,591,415.70
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,018,370.35
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,272,385.60
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,347,211.00
DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,234,360.64
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,467,206.60
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,208,240.32
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,777,203.33
DBR 1.25% 08/15/48	3,540,000.00	2,672,438.04
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,982,679.76
DBR 1.8% 08/15/53	3,050,000.00	2,541,409.45
DBR 1% 05/15/38	2,080,000.00	1,684,107.06
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,362,339.08
DBR 2.1% 11/15/29	4,180,000.00	4,093,081.08
DBR 2.2% 02/15/34	1,320,000.00	1,285,029.24
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,568,608.05
DBR 2.4% 11/15/30	1,150,000.00	1,144,121.20
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,851,865.10
DBR 2.5% 08/15/46	2,920,000.00	2,846,007.20

DBR 2.5% 08/15/54	1,330,000.00	1,294,975.78
DBR 2.6% 08/15/33	1,790,000.00	1,806,310.48
DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	1,980,727.95
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	2,953,572.50
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,168,756.48
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,552,420.29
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,552,168.13
DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,520,102.42
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,667,814.60
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,104,521.72
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,494,952.50
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	2,997,461.62
FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	4,003,256.40
FRTR 0.5% 05/25/25	3,950,000.00	3,829,011.50
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,271,193.00
FRTR 0.5% 05/25/29	4,550,000.00	4,049,550.05
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,765,759.04
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	486,987.71
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,199,084.46
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,803,157.84
FRTR 0.75% 05/25/28	5,410,000.00	4,976,015.21
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,556,506.56
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,572,242.40
FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,954,991.36
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,799,836.66
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,683,500.00
FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,599,449.20
FRTR 0% 11/25/29	1,970,000.00	1,684,265.29
FRTR 0% 11/25/30	5,810,000.00	4,825,205.00
FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	3,937,682.28
FRTR 1.25% 05/25/34	4,460,000.00	3,775,439.06
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,613,119.65
FRTR 1.25% 05/25/38	2,740,000.00	2,129,637.60
FRTR 1.5% 05/25/31	6,080,000.00	5,552,797.12
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,064,328.45
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,104,482.40
FRTR 1.75% 06/25/39	3,050,000.00	2,517,851.25
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,692,341.01
FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,513,302.82
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,461,136.17
FRTR 2.5% 05/25/43	1,440,000.00	1,267,489.44
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,102,119.19

FRTR 2.75% 02/25/29	4,370,000.00	4,346,752.03
FRTR 2.75% 10/25/27	4,730,000.00	4,706,406.76
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,217,855.64
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,693,776.65
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,819,330.80
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,770,434.40
FRTR 3.5% 11/25/33	2,820,000.00	2,931,931.44
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,216,483.40
FRTR 3% 05/25/54	2,380,000.00	2,183,733.30
FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	721,938.14
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,981,416.09
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,815,028.00
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,810,789.40
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,988,313.40
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,330,781.00
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,630,494.72
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,270,472.14
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,975,992.40
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	618,995.31
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	664,014.82
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	384,153.09
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	526,261.62
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	239,724.00
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	716,364.11
IRISH 0% 10/18/31	1,070,000.00	871,202.56
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	904,258.34
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	377,818.85
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	429,159.35
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	568,885.60
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	634,591.44
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	961,381.20
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	910,989.87
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	194,330.39
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	813,841.00
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	364,679.77
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,841,604.42
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	838,119.45
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,032,351.60
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,659,864.50
NETHER 0.5% 07/15/32	1,150,000.00	963,611.20
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	844,812.90
NETHER 0.75% 07/15/28	1,610,000.00	1,485,497.89
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,129,813.37

NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,705,903.56	
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,418,163.67	
NETHER 0% 01/15/38	1,170,000.00	790,440.30	
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	822,846.49	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,144,316.70	
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,131,331.26	
NETHER 2.5% 01/15/30	1,000,000.00	988,451.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,521,252.15	
NETHER 2.5% 07/15/33	1,150,000.00	1,125,900.60	
NETHER 2.5% 07/15/34	500,000.00	486,654.50	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,815,575.84	
NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	603,043.20	
NETHER 3.25% 01/15/44	680,000.00	717,740.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,901,013.10	
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,858,553.09	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,675,946.70	
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,901,199.12	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,210,612.50	
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,356,220.40	
OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,410,617.66	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,826,008.00	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,396,302.75	
OBL 2.2% 04/13/28	2,950,000.00	2,907,437.40	
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,240,043.81	
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	509,320.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,262,860.86	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,136,936.30	
RAGB 0.7% 04/20/71	350,000.00	154,659.05	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	814,004.40	
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	447,564.78	
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,403,999.04	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	101,670.35	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,057,304.31	
RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,256,542.20	
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,374,702.25	
RAGB 0% 04/20/25	990,000.00	957,999.24	
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	776,419.60	
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	347,235.56	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,155,983.85	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	789,415.20	
RAGB 1.5% 11/02/86	310,000.00	182,622.24	
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	510,544.32	

RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	481,413.44
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	882,413.76
RAGB 2.9% 02/20/33	1,500,000.00	1,492,152.00
RAGB 2.9% 02/20/34	550,000.00	544,889.95
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	221,016.84
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	696,357.20
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	435,934.66
RAGB 3.45% 10/20/30	230,000.00	237,828.97
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	475,083.00
RAGB 4.15% 03/15/37	1,460,000.00	1,619,515.95
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,208,421.16
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,300,171.79
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	310,941.18
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	211,212.22
RFGB 0.125% 09/15/31	630,000.00	515,128.32
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	189,733.35
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	542,469.00
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	306,227.01
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	498,889.26
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	659,800.28
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	468,676.35
RFGB 0.75% 04/15/31	700,000.00	606,965.52
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	426,523.24
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	428,596.37
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	601,150.32
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	311,207.00
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	334,801.25
RFGB 1.375% 04/15/47	610,000.00	437,692.20
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	509,636.18
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	435,760.50
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	381,621.54
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	548,460.45
RFGB 2.875% 04/15/29	240,000.00	240,198.72
RFGB 2.95% 04/15/55	230,000.00	221,648.70
RFGB 3% 09/15/33	580,000.00	581,474.94
RFGB 4% 07/04/25	640,000.00	645,304.96
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,794,463.00
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,772,419.22
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,128,219.57
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,732,721.38
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,825,208.00
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,273,133.28
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,458,238.75



SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,051,529.96	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,515,389.10	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,675,462.73	
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,729,011.90	
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,947,691.88	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,473,645.10	
SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,781,067.91	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	1,981,459.89	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,041,394.95	
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,922,766.75	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,501,318.02	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,280,000.00	2,163,460.81	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	324,264.60	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,434,225.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,424,494.50	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,880,355.90	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,810,000.00	1,213,303.81	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,245,181.80	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,898,460.64	
SPGB 1% 07/30/42	1,180,000.00	766,421.80	
SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,086,504.00	
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,545,343.15	
SPGB 2.35% 07/30/33	2,190,000.00	2,037,404.07	
SPGB 2.55% 10/31/32	2,530,000.00	2,413,063.40	
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,422,066.78	
SPGB 2.8% 05/31/26	1,270,000.00	1,260,006.37	
SPGB 2.9% 10/31/46	1,850,000.00	1,617,749.15	
SPGB 3.15% 04/30/33	1,990,000.00	1,978,659.63	
SPGB 3.25% 04/30/34	1,660,000.00	1,651,087.46	
SPGB 3.45% 07/30/43	1,140,000.00	1,095,093.12	
SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,255,041.00	
SPGB 3.5% 05/31/29	660,000.00	675,253.26	
SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,321,006.90	
SPGB 3.9% 07/30/39	1,230,000.00	1,268,609.70	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,100,000.00	2,259,100.20	
SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,885,911.44	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,131,747.04	
SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,991,392.62	
SPGB 4% 10/31/54	650,000.00	661,264.50	
SPGB 5.15% 10/31/28	4,600,000.00	5,019,124.40	
SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,708,416.20	
SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,673,551.25	

	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,445,700.95
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,031,940.00
	ユーロ 小計	679,180,000.00	629,374,789.52 (103,840,546,522)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,169,424.90
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,298,539.60
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	2,058,131.18
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,702,025.60
	UKT 0.375% 10/22/30	1,930,000.00	1,525,292.51
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,839,351.02
	UKT 0.5% 10/22/61	2,040,000.00	590,464.94
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,338,631.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,515,600.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	567,242.31
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	741,897.00
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,535,482.00
	UKT 0.875% 10/22/29	1,410,000.00	1,189,305.39
	UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,303,718.00
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	372,287.16
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,138,325.00
	UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,151,986.79
	UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,218,243.60
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,503,712.00
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	937,711.16
	UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	566,440.00
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	962,753.90
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	682,780.38
	UKT 1.625% 10/22/71	1,550,000.00	694,028.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	618,895.72
	UKT 1.75% 07/22/57	1,740,000.00	901,208.64
	UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,382,535.00
	UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	2,931,894.80
	UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	880,860.08
	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,296,771.40
	UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,559,757.18
	UKT 3.25% 01/31/33	3,460,000.00	3,222,313.91
	UKT 3.5% 01/22/45	1,820,000.00	1,533,592.42
	UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,179,494.77
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,307,817.50	
UKT 3.75% 01/29/38	1,930,000.00	1,786,794.00	
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	980,605.00	
UKT 3.75% 10/22/53	2,910,000.00	2,468,145.60	
UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,313,948.00	

	UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,872,449.55	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,332,146.64	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,229,527.64	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,802,385.90	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,393,133.90	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,659,729.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,501,812.50	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,578,776.40	
	UKT 4.375% 07/31/54	430,000.00	406,479.00	
	UKT 4.5% 06/07/28	2,540,000.00	2,564,752.30	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,415,854.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,440,000.00	2,398,693.72	
	UKT 4.625% 01/31/34	1,620,000.00	1,668,195.00	
	UKT 4.75% 10/22/43	860,000.00	868,288.68	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,710,000.00	1,774,381.50	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,437,800.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,113,897.00	
	UKT 4% 10/22/63	1,190,000.00	1,056,800.92	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,168,488.50	
	イギリスポンド 小計	105,450,000.00	86,211,599.61 (16,513,831,905)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,801,091.58	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,311,052.13	
	SGB 0.75% 11/12/29	6,440,000.00	5,878,300.68	
	SGB 1.75% 11/11/33	4,080,000.00	3,832,942.93	
	SGB 1% 11/12/26	7,580,000.00	7,245,945.38	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,419,162.36	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,560,000.00	7,500,318.94	
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,399,752.50	
	スウェーデンクローナ 小計	46,390,000.00	44,388,566.50 (629,429,872)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,002,360.92	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,504,208.80	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,905,692.33	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,360,071.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,692,911.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,620,000.00	3,196,021.98	
	NGB 2% 04/26/28	4,650,000.00	4,325,946.15	
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,842,549.48	
	NGB 3.625% 04/13/34	2,470,000.00	2,430,208.57	
	NGB 3% 08/15/33	4,630,000.00	4,334,943.05	
	ノルウェークローネ 小計	40,030,000.00	36,594,913.28	

			(514,890,429)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,570,000.00	2,961,134.59	
	DGB 0.5% 11/15/27	4,430,000.00	4,120,174.66	
	DGB 0.5% 11/15/29	5,900,000.00	5,303,515.31	
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,443,797.90	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,439,528.88	
	DGB 2.25% 11/15/33	3,680,000.00	3,593,682.65	
	DGB 4.5% 11/15/39	9,560,000.00	11,750,913.95	
デンマーククローネ 小計		42,240,000.00	39,612,747.94	(875,837,856)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,997,586.88	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,620,000.00	3,466,229.64	
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	2,974,136.10	
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,410,000.00	2,540,797.82	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,613,732.20	
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,065,955.58	
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,270,000.00	2,955,851.10	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,202,816.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,480,000.00	4,372,282.88	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,015,393.93	
	POLGB 5.75% 04/25/29	3,920,000.00	3,937,559.24	
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,395,792.45	
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,610,000.00	3,869,833.36	
	ポーランドズロチ 小計		51,360,000.00	47,407,967.18
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,981,182.65	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,090,000.00	1,930,393.97	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,220,992.58	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	2,017,640.88	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,040,301.39	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,650,144.37	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,219,437.88	
	ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,408,848.59	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,392,016.22	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,153,513.48	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,050,429.51	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,470,000.00	1,269,765.71	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,475,275.96	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,583,407.93	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,674,498.01	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,054,045.97	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,810,000.00	1,757,351.04	
ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	815,788.35		

	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,578,515.20	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,220,000.00	1,145,582.63	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,800,000.00	1,726,203.49	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,043,478.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,661,996.98	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,782,676.38	
	ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,074,882.95	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,010,000.00	2,062,114.47	
	ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	738,062.71	
	オーストラリアドル 小計	49,530,000.00	44,508,547.30 (4,432,161,140)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	990,000.00	829,739.60	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	613,125.90	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	807,766.72	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	284,982.48	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	828,947.44	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	495,374.84	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	393,837.00	
	NZGB 2% 05/15/32	700,000.00	571,003.81	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,195,036.68	
	NZGB 3% 04/20/29	830,000.00	769,162.41	
	NZGB 4.25% 05/15/34	450,000.00	428,253.70	
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	834,795.14	
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	485,128.96	
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	372,262.77	
	ニュージーランドドル 小計	10,210,000.00	8,909,417.45 (814,409,849)	
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	755,305.18	
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	824,733.86	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	498,008.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	556,260.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	320,802.30	
	SIGB 2.125% 06/01/26	830,000.00	808,208.35	
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	679,820.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	888,135.56	
	SIGB 2.375% 07/01/39	380,000.00	339,315.30	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	700,560.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	435,804.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	840,000.00	772,766.40	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	585,585.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	635,895.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	413,910.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	710,000.00	690,830.00	

	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	831,962.95	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	743,174.45	
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	468,342.00	
	シンガポールドル 小計	12,730,000.00	11,949,418.35 (1,356,975,947)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,523,211.67	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,505,214.23	
	MGS 3.519% 04/20/28	450,000.00	447,510.02	
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,276,167.39	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,932,773.24	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,247,879.25	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,750,962.80	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,859,823.87	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,172,807.07	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,140,091.12	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,988,449.24	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,491,146.65	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	604,687.56	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,702,894.70	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,989,549.08	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,540,085.85	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,789,926.77	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,565,153.36	
	MGS 4.457% 03/31/53	1,090,000.00	1,127,347.76	
	MGS 4.498% 04/15/30	3,070,000.00	3,174,700.81	
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	362,348.70	
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	916,398.92	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,750,000.00	1,864,275.17	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,055,640.22	
MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,971,739.10		
MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	1,993,707.89		
MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,857,255.45		
MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,132,466.66		
	マレーシアリンギット 小計	49,150,000.00	49,984,214.55 (1,616,354,541)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,415,585.74	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,342,704.23	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,510,000.00	1,976,336.08	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,330,000.00	1,562,525.02	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,333,330.99	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,876,940.46	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,472,663.78	

	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,420,000.00	917,750.81
	ILGOV 2% 03/31/27	2,030,000.00	1,897,835.83
	ILGOV 3.75% 02/28/29	1,220,000.00	1,183,954.85
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,094,009.52
	ILGOV 4% 03/30/35	760,000.00	709,907.64
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	1,974,740.34
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,398,632.37
	イスラエルシェケル 小計	29,670,000.00	26,156,917.66 (1,075,483,520)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	52,570,000.00	52,698,412.73
	CGB 2.18% 08/15/26	28,600,000.00	28,717,646.10
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,168,121.27
	CGB 2.22% 09/25/25	21,100,000.00	21,205,099.10
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,414,535.20
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,455,223.49
	CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,511,318.82
	CGB 2.37% 01/15/29	19,460,000.00	19,686,319.80
	CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,314,464.65
	CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,170,540.30
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,086,443.71
	CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	17,917,400.25
	CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,582,844.62
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,279,596.00
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,883,847.20
	CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,143,585.86
	CGB 2.52% 08/25/33	41,200,000.00	41,889,786.88
	CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,056,808.00
	CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	27,764,932.35
	CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	32,735,107.21
	CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,141,009.35
	CGB 2.62% 04/15/28	23,550,000.00	24,012,008.61
	CGB 2.62% 06/25/30	21,400,000.00	21,869,537.40
	CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,405,471.07
	CGB 2.64% 01/15/28	13,020,000.00	13,273,003.33
	CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,265,567.14
	CGB 2.67% 11/25/33	13,600,000.00	14,063,470.32
	CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	34,374,168.04
	CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,432,766.15
	CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	19,966,117.58
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,972,053.30
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,211,127.39
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	11,056,878.17	
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,221,901.74	

CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,793,875.94	
CGB 2.8% 03/25/30	42,000,000.00	43,366,923.60	
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,771,332.06	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,845,490.12	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,806,317.97	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,241,367.78	
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	30,212,647.24	
CGB 2% 06/15/25	43,900,000.00	43,986,531.29	
CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,053,862.18	
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,798,881.72	
CGB 3.02% 10/22/25	4,270,000.00	4,348,134.16	
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,224,746.52	
CGB 3.12% 10/25/52	8,970,000.00	9,981,719.12	
CGB 3.19% 04/15/53	18,160,000.00	20,815,694.79	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,310,136.42	
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,770,556.82	
CGB 3.32% 04/15/52	13,750,000.00	15,830,292.50	
CGB 3.39% 03/16/50	18,830,000.00	21,704,339.24	
CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,908,217.71	
CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	16,528,853.45	
CGB 3.81% 09/14/50	19,620,000.00	24,227,407.76	
CGB 3.86% 07/22/49	17,280,000.00	21,366,215.42	
CGB 3% 10/15/53	6,000,000.00	6,682,380.00	
CGB 4.08% 10/22/48	15,720,000.00	20,050,561.32	
オフショア人民元 小計	1,383,880,000.00	1,434,573,598.26 (30,609,640,323)	
合計		328,063,611,857 (328,063,611,857)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 212銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 39銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 364銘柄	100.0%	31.7%
イギリスポンド	国債証券 58銘柄	100.0%	5.0%
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 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%



ポーランドズロチ	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	58銘柄	100.0%	9.3%

(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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 4月22日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	6,630,716,089
コール・ローン	68,508,340
株式	181,130,335,132
投資信託受益証券	497,405,118
投資証券	222,778,876
派生商品評価勘定	19,358
未収入金	3,180,254
未収配当金	307,731,111
未収利息	124
前払金	362,029,212
差入委託証拠金	1,368,508,609
流動資産合計	190,591,212,223
資産合計	190,591,212,223
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	362,049,279
未払解約金	50,411,888
流動負債合計	412,461,167
負債合計	412,461,167
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	44,643,487,967
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	145,535,263,089
元本等合計	190,178,751,056
純資産合計	190,178,751,056
負債純資産合計	190,591,212,223

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 4月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

2024年 4月22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、それに準じる日)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、それに準じる日)又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、それに準じる日)又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 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	44,643,487,967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) 4.2599円 (42,599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

2024年 4月22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。

2024年 4月22日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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

2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	41,563,685,998円
期中追加設定元本額	4,270,950,285円
期中一部解約元本額	1,191,148,316円
期末元本額	44,643,487,967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	7,383,349,102円
世界経済インデックスファンド	11,598,239,824円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,122,318,227円
DC世界経済インデックスファンド	7,620,157,191円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	81,137,980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)	1,290,457,005円

区分	2024年 4月22日現在
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	799,892,923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）	361,231,899円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,155,479円
S M T インデックスバランス・オープン	91,477,552円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式S M T Bセレクション（S M A専用）	2,287,415,109円
S M T 世界経済インデックス・オープン	275,477,978円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,249,598,096円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	204,903,372円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	7,071,796円
グローバル経済コア	600,786,055円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	378,941,894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
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	113,919,332円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	109,105,942円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	48,908,502円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	58,548,439円
10資産分散投資ファンド	17,983,650円
グローバル10資産バランスファンド	19,289,152円
D C世界経済インデックスファンド（株式特化型）	43,544円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,554,620,116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）	138,552,527円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,368,902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）	12,535,058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）	22,737,185円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	11,125,824,931	
投資信託受益証券	12,731,058	
投資証券	24,706,235	
合計	11,113,849,754	

(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

（2024年 4月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引	8,581,862,772	-	362,029,212
	買建			
合計		8,581,862,772	-	362,029,212

## (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 4月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,091,380	-	2,110,738	19,358
	アメリカドル	2,091,380	-	2,110,738	19,358
	売建	2,091,380	-	2,111,447	20,067
	ブラジルリアル	2,091,380	-	2,111,447	20,067
合計		4,182,760	-	4,222,185	709

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	1.94	270,575.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	15.92	587,925.60	
	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	113.43	1,786,409.07	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	19.94	1,452,250.14	
	NIO INC - ADR	231,271	3.80	878,829.80	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	36.89	1,506,071.14	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	11.43	906,033.24	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	37.10	2,465,369.20	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	24.28	298,231.24	
	IQIYI INC-ADR	59,454	4.09	243,166.86	
	KANZHUN LTD	38,815	17.84	692,459.60	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	11.36	1,801,093.92	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	101,071	113.49	11,470,547.79	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	15.16	828,888.16	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	46.19	683,057.72	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	903,900	1.61	1,457,086.80		

	CREDICORP LTD	10,882	165.02	1,795,747.64	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	18.02	373,969.06	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.00	282,223.80	
	KE HOLDINGS INC	114,048	12.58	1,434,723.84	
	アメリカドル 小計	2,392,587		31,214,660.02 (4,832,029,371)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	13.68	36,447,090.48	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	102.51	50,116,318.92	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	295.88	10,355,800.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	32.29	5,765,444.08	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	12.07	3,783,945.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	138.19	14,095,380.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	526.54	17,678,580.50	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	160.32	8,512,992.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	266.15	15,963,677.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	174.84	7,463,045.40	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	64.36	53,243,740.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	168.87	13,826,231.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	205.50	64,350,270.00	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	328.27	8,521,889.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	69.08	19,314,768.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	36.25	6,590,250.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	60.74	8,667,598.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	451,600	173.36	78,289,376.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	49.25	13,381,225.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	15.61	54,968,117.40	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	19.26	4,258,386.00	
	メキシコペソ 小計	10,289,640		495,594,125.03 (4,494,642,238)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	14.42	2,337,482.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	42.72	27,088,752.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	778,040	40.53	31,533,961.20	
	PRIO SA	130,000	48.80	6,344,000.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	26.57	4,035,983.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	14.68	1,459,192.00	
	GERDAU SA-PREF	186,708	19.22	3,588,527.76	
	SUZANO SA	121,779	61.21	7,454,092.59	
	VALE SA	581,587	63.36	36,849,352.32	
	WEG SA	314,144	38.55	12,110,251.20	
	CCR SA	248,600	12.65	3,144,790.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	50.27	6,904,081.80	

	RUMO SA	244,300	21.25	5,191,375.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	15.65	3,387,395.55	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	1.54	470,470.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	23.30	4,030,900.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.35	1,505,010.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	25.45	4,817,176.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	13.38	4,009,986.00	
	AMBEV SA	756,200	11.95	9,036,590.00	
	JBS SA	110,000	22.12	2,433,200.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	16.09	1,613,955.72	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	3.60	3,762,554.40	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	24.45	2,339,865.00	
	HYPERA SA	54,500	28.35	1,545,075.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	12.07	3,935,097.61	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	13.64	11,296,402.48	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	27.71	8,673,230.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	31.55	26,548,725.55	
	ITAUSA SA	824,701	9.53	7,859,400.53	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	11.18	11,803,944.62	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	32.96	3,589,344.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	15.55	2,208,100.00	
	TOTVS SA	124,500	28.10	3,498,450.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	48.71	4,354,674.00	
	TIM SA	96,100	17.29	1,661,569.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	42.73	1,581,010.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	37.80	8,002,260.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	13.11	2,777,051.97	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	84.49	4,266,745.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	9.31	1,904,826.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	34.93	950,096.00	
	ENEVA SA	102,200	12.27	1,253,994.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	39.90	1,845,375.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	31.15	5,142,865.00	
	ブラジルリアル 小計	13,074,860		300,147,179.30 (8,928,027,921)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,984.90	631,595,612.70	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,875.00	254,934,375.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	42,925.00	912,199,175.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	69.90	172,037,041.20	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	12.40	525,346,236.80	
	FALABELLA SA	70,837	2,481.00	175,746,597.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,621.00	496,726,272.00	

	BANCO DE CHILE	7,583,203	104.65	793,582,193.95	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	26,800.00	187,305,200.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	43.10	497,812,283.90	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	89.98	314,148,523.70	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	55.65	142,535,120.70	
	チリペソ 小計	70,645,682		5,103,968,631.95 (825,725,149)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	33,700.00	1,708,522,600.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	31,820.00	1,958,998,300.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,000.00	909,198,000.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,576,718,900.00 (181,361,639)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	25.80	134,185.80	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	37.04	751,726.80	
	OPAP SA	44,643	16.43	733,484.49	
	JUMBO SA	19,341	27.26	527,235.66	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.56	413,431.42	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.83	784,330.27	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	7.09	950,106.51	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.78	427,363.02	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.81	361,918.67	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.05	617,606.60	
	ユーロ 小計	1,109,898		5,701,389.24 (940,672,210)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	189.90	27,077,841.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	41.22	10,670,538.96	
	SASA POLYESTER SANAYI	368,879	39.62	14,614,985.98	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	58.70	11,689,048.40	
	KOC HOLDING AS	89,884	219.90	19,765,491.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	47.20	14,100,905.60	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	885.00	6,355,185.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	302.50	26,201,037.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	1,120.00	18,334,400.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	262.50	8,295,787.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	371.50	30,176,202.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	20,274	655.00	13,279,470.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	62.50	36,636,437.50	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	88.30	18,664,147.60	
	TURKIYE IS BANKASI-C	961,147	12.86	12,360,350.42	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	32.04	11,890,909.08	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	76.55	10,953,616.05	
		3,874,292		291,066,354.19	



トルコリラ 小計				(1,388,881,322)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	861.50	11,460,534.50
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	101.80	6,180,278.00
	CEZ AS	25,283	872.00	22,046,776.00
チェココルナ 小計		99,296		39,687,588.50 (259,425,859)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	2,960.00	284,213,280.00
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,855.00	254,501,555.00
	OTP BANK NYRT	40,021	16,940.00	677,955,740.00
ハンガリーフォリント 小計		164,780		1,216,670,575.00 (509,129,185)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	67.65	6,966,529.35
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	142.40	2,874,486.40
	BUDIMEX	2,656	674.50	1,791,472.00
	LPP SA	230	15,320.00	3,523,600.00
	CD PROJEKT SA	6,704	113.20	758,892.80
	ALLEGRO.EU SA	83,795	32.66	2,737,163.67
	PEPCO GROUP NV	22,887	19.14	438,171.61
	DINO POLSKA SA	9,471	368.00	3,485,328.00
	BANK PEKAO SA	27,684	184.60	5,110,466.40
	M BANK SA	1,423	679.20	966,501.60
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	59.12	9,454,470.40
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	558.60	4,101,799.80
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	50.68	4,385,289.72
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	6.20	618,760.00
ポーランドズロチ 小計		631,607		47,212,931.75 (1,807,452,666)
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	722,000	0.00	0.07
	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	-
			761,240,136	

	ロシアグループ 小計			(126)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	8.41	2,766,890.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	9.19	2,223,980.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.65	17,992,710.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	32.85	18,905,175.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	8.88	195,360.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	7.49	28,462,000.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	18.32	7,859,280.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	5.05	5,656,000.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	17.34	4,118,250.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	9.75	5,416,125.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.73	1,987,440.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	7.59	6,147,900.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	22.20	1,199,688.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	16.14	3,776,760.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	18.18	4,454,100.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	12.96	2,345,760.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	17.74	16,054,700.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.24	891,000.00
	BOC AVIATION LTD	68,800	61.90	4,258,720.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	3.61	1,971,060.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.12	2,908,720.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.67	3,832,140.00
	CITIC LTD	1,038,000	6.93	7,193,340.00
	CRRG CORP LTD-H	936,000	4.59	4,296,240.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.25	1,224,000.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	25.60	1,996,800.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	5.43	868,800.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	22.25	3,704,625.00
	WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	17.14	7,006,832.00
	ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	29.60	1,844,080.00
	AIR CHINA LIMITED-H	630,000	3.73	2,349,900.00
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	10.02	3,863,180.94
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	8.90	4,610,645.00
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.53	1,136,006.22
	JD LOGISTICS INC	326,200	7.58	2,472,596.00
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.90	2,543,800.00
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	102.10	1,786,750.00
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.06	1,568,600.00
	BYD CO LTD-H	187,000	201.20	37,624,400.00
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	2.82	750,120.00
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	41.60	5,990,400.00

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	8.81	8,351,880.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	11.02	5,441,125.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	3.11	1,114,449.84
LI AUTO INC-CLASS A	190,542	106.30	20,254,614.60
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	27.00	4,513,374.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	13.22	3,093,480.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	22.55	1,955,085.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	83.80	20,128,760.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.32	1,892,160.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	26.05	8,091,130.00
LI NING CO LTD	380,000	16.74	6,361,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	73.25	11,632,100.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	16.38	720,720.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	15.96	3,734,640.00
MEITUAN-CLASS B	873,750	95.30	83,268,375.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	66.70	16,308,150.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	21.65	3,611,220.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	9.10	718,900.00
TRIP.COM GROUP LTD	96,607	379.40	36,652,695.80
BAIDU INC-CLASS A	379,500	92.50	35,103,750.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	85.25	3,546,400.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	24.35	1,256,460.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.67	2,117,560.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	23.50	4,023,200.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	44.35	20,063,940.00
NETEASE INC	338,630	142.80	48,356,364.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,128,100	303.80	342,716,780.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	66.70	182,443,709.60
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	63.25	569,250.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	10.40	2,620,800.00
JD.COM INC - CL A	414,161	97.30	40,297,865.30
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	40.35	1,731,176.40
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	31.50	2,034,900.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	5.17	2,119,700.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	13.00	1,196,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	2.61	2,046,240.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	22.85	4,420,332.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	105.32	1,600,864.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.11	2,318,040.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	15.20	8,770,400.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	32.30	7,945,800.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-

NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	42.70	14,885,220.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	6.60	1,287,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	8.30	3,452,800.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	51.45	5,968,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.42	4,313,920.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	47.10	4,267,260.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	24.50	2,143,750.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	28.30	2,133,820.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	4.76	1,900,192.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	10.96	1,407,264.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	19.88	3,801,056.00
AKESO INC	61,000	43.90	2,677,900.00
BEIGENE LTD	110,905	77.00	8,539,685.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	7.00	1,729,000.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	5.77	8,009,683.20
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	4.79	1,623,810.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	10.44	2,317,680.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	15.38	1,876,360.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	33.20	6,739,600.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	11.44	835,120.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.34	4,612,140.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	32.95	2,098,519.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	12.62	7,925,360.00
ZAI LAB LTD	128,250	10.78	1,382,535.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	3.48	13,693,800.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.36	45,148,992.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	5.33	7,309,961.75
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.39	6,871,228.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	4.87	80,849,889.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.30	862,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	32.55	23,612,518.65
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	2.78	5,103,802.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	10,851,515	4.11	44,599,726.65
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.05	7,492,500.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.65	540,800.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.84	1,854,720.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	8.52	2,992,224.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	11.16	3,189,249.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.56	1,334,400.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	7.29	645,894.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.54	1,264,488.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	8.72	2,319,520.00

CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	9.00	11,880,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	15.56	6,015,496.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	6.39	1,175,913.36
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	13.58	1,431,332.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.55	4,788,900.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	10.14	12,140,500.32
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	31.15	36,694,700.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	11.16	1,295,676.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	7.28	3,589,040.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	23.75	5,260,625.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	23.60	3,787,800.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	14.72	986,240.00
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	8.20	13,021,600.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	35.65	4,260,175.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,554,200	15.80	40,356,360.00
ZTE CORP-H	82,908	15.64	1,296,681.12
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.88	6,232,160.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	23.75	1,413,125.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.89	1,152,900.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	2.70	3,855,600.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	6.89	3,213,496.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	5.70	2,576,400.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.22	2,144,520.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	23.65	4,654,320.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	19.70	5,070,780.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	61.40	7,183,800.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	3.48	1,552,080.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.97	3,498,880.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	7.30	4,000,400.00
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	16.56	1,059,840.00
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.09	3,432,410.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	14.50	1,305,000.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	5.28	4,730,811.36
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	13.44	1,229,141.76
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	11.52	6,733,900.80
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	4.10	922,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	23.50	12,716,108.50
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	25.15	2,992,850.00
CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	3.69	1,164,195.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	4.44	1,514,040.00
LONGFOR PROPERTIES	343,500	9.10	3,125,850.00

	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	3.86	1,237,516.00	
	香港ドル 小計	135,728,622		1,773,706,215.67 (35,048,434,821)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.66	1,914,744.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.83	2,844,012.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	5.44	4,121,344.00	
	GAMUDA BHD	164,102	5.15	845,125.30	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.78	935,041.88	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	9.87	1,058,863.47	
	MISC BHD	217,540	8.01	1,742,495.40	
	GENTING BHD	271,600	4.45	1,208,620.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.58	953,826.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.46	443,037.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.99	1,078,656.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	22.86	2,664,607.32	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	124.00	2,256,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	15.74	2,573,175.20	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.36	793,728.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.46	1,101,825.16	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.12	2,884,968.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.15	1,247,905.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	6.56	8,089,805.12	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.50	2,365,194.00	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.65	8,506,523.25	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.15	10,558,015.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.48	1,202,021.56	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.55	1,379,776.95	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.04	2,011,920.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.50	937,650.00	
TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.07	1,648,320.64		
PETRONAS GAS BHD	148,400	18.10	2,686,040.00		
TENAGA NATIONAL BHD	441,775	11.60	5,124,590.00		
YTL CORPORATION BERHAD	812,700	2.60	2,113,020.00		
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	4.02	2,007,588.00		
INARI AMERTRON BHD	274,700	3.05	837,835.00		
	マレーシアリンギット 小計	13,499,909		80,137,073.85 (2,591,416,598)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	160.00	32,128,000.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	33.50	56,434,100.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	57.25	16,808,886.25	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	23.90	4,932,960.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	38.75	18,837,692.50	

	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	31.25	6,334,375.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	242.00	31,556,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	63.00	41,258,700.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.05	6,576,850.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	5.85	4,735,575.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.26	3,451,878.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	31.50	26,741,547.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	33.50	6,103,700.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	10.20	8,569,377.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	17.80	14,104,720.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	54.75	52,362,900.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	30.50	7,256,255.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	17.60	9,792,640.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	27.75	52,394,775.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	224.00	18,524,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	124.00	16,516,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	16.00	7,018,400.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	103.00	15,573,600.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.78	15,534,416.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	42.75	4,339,125.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	41.75	3,749,150.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	69.25	34,348,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	195.50	39,842,900.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	65.75	8,011,637.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	7.80	15,721,820.40	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	30.25	6,651,975.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	46.25	3,154,250.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	39.50	27,416,950.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	61.75	23,366,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.30	6,365,600.00	
	タイパーツ 小計	27,392,940		646,517,354.65 (2,708,907,715)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	38.95	9,267,763.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	590.00	32,101,900.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	28.80	16,880,342.40	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	948.50	34,416,322.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	328.40	50,287,892.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	220.20	13,434,402.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	90.00	8,600,400.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	124.00	29,115,448.00	
	BDO UNIBANK INC	394,773	145.50	57,439,471.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	67.10	36,574,666.70	

	PLDT INC	10,460	1,300.00	13,598,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	350.00	18,613,000.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	27.00	34,584,300.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	27.30	42,406,455.00	
	フィリピンペソ 小計	5,297,000		397,320,363.10 (1,067,719,011)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,760.00	5,967,948,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	25,350.00	5,092,815,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	8,875.00	9,794,450,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,760.00	1,735,008,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	950.00	2,747,598,550.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	9,650.00	7,276,100,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,800.00	4,545,231,600.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	5,075.00	2,004,137,800.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	4,900.00	16,058,770,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	59.00	7,943,754,336.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,800.00	8,788,360,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	4,950.00	4,718,835,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	9,725.00	5,829,165,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	6,100.00	8,563,180,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	2,380.00	2,754,612,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,400.00	5,863,900,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	9,475.00	88,776,012,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	6,725.00	41,034,551,200.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	5,225.00	13,504,535,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	5,275.00	63,460,898,050.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	800.00	2,272,480,000.00		
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	3,150.00	28,030,275,000.00		
	インドネシアルピア 小計	201,300,808		336,762,617,036.00 (3,232,921,123)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	60,500.00	313,390,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	76,800.00	490,521,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	103,800.00	1,042,567,200.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	24,900.00	455,072,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	31,500.00	352,453,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	472,000.00	568,288,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	94,400.00	508,721,600.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	117,100.00	222,255,800.00	
	LG CHEM LTD	9,272	370,500.00	3,435,276,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	243,500.00	213,549,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	97,300.00	225,346,800.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	386,500.00	4,554,902,500.00	



SKC CO LTD	1,432	109,300.00	156,517,600.00
DOOSAN BOBCAT INC	12,098	51,600.00	624,256,800.00
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	14,690.00	1,204,624,070.00
ECOPRO BM CO LTD	8,232	227,500.00	1,872,780,000.00
ECOPRO CO LTD	3,133	517,000.00	1,619,761,000.00
ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	108,300.00	299,882,700.00
GS HOLDINGS CORP	6,593	43,250.00	285,147,250.00
HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	234,000.00	1,363,284,000.00
HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	32,700.00	485,562,300.00
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	123,400.00	260,991,000.00
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	119,300.00	747,891,700.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	33,250.00	324,786,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	49,200.00	660,067,200.00
L&F CO LTD	4,327	150,600.00	651,646,200.00
LG CORP	16,658	75,500.00	1,257,679,000.00
LG ENERGY SOLUTION	8,760	367,000.00	3,214,920,000.00
POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	253,500.00	1,206,153,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	42,650.00	368,794,550.00
SAMSUNG C&T CORP	15,406	138,200.00	2,129,109,200.00
SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	24,750.00	749,925,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	9,630.00	916,477,470.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	60,000.00	140,280,000.00
SK INC	6,394	155,500.00	994,267,000.00
SK SQUARE CO LTD	19,731	76,100.00	1,501,529,100.00
HANJIN KAL CORP	7,812	55,700.00	435,128,400.00
HMM CO LTD	35,545	15,500.00	550,947,500.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	171,200.00	478,161,600.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	20,250.00	543,145,500.00
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	18,150	58,800.00	1,067,220,000.00
HANON SYSTEMS	19,000	4,880.00	92,720,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	234,500.00	2,379,706,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	235,000.00	5,510,280,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	146,700.00	886,361,400.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	145,600.00	502,174,400.00
KIA CORP	45,204	110,400.00	4,990,521,600.00
COWAY CO LTD	9,036	54,000.00	487,944,000.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	91,200.00	1,573,564,800.00
KANGWON LAND INC	28,528	14,710.00	419,646,880.00
HYBE CO LTD	4,975	230,500.00	1,146,737,500.00
KAKAO CORP	52,020	48,600.00	2,528,172,000.00
KRAFTON INC	3,793	254,000.00	963,422,000.00
NAVER CORP	21,578	182,400.00	3,935,827,200.00

NCSOFT CORPORATION	2,709	164,900.00	446,714,100.00
NETMARBLE CORP	2,465	57,000.00	140,505,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	335,000.00	616,065,000.00
KT&G CORP	19,456	89,600.00	1,743,257,600.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	90,300.00	283,722,600.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	142,800.00	537,213,600.00
LG H&H CO LTD	1,321	371,000.00	490,091,000.00
HLB INC	23,903	100,000.00	2,390,300,000.00
CELLTRION INC	24,444	172,900.00	4,226,367,600.00
CELLTRION PHARM INC	2,169	89,700.00	194,559,300.00
HANMI PHARM CO LTD	1,202	308,500.00	370,817,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	781,000.00	2,625,722,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	82,700.00	264,391,900.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	57,400.00	120,540,000.00
YUHAN CORPORATION	13,854	69,300.00	960,082,200.00
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	52,400.00	2,685,447,600.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,350.00	378,205,500.00
KAKAObANK CORP	35,459	23,750.00	842,151,250.00
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	63,700.00	4,114,956,300.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	41,750.00	2,829,731,500.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	13,540.00	1,541,041,560.00
KAKAOPAY CORP	3,065	33,200.00	101,758,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	60,900.00	280,261,800.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	75,000.00	1,273,125,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,150.00	221,757,250.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	11,160.00	135,114,120.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	35,900.00	572,497,300.00
DB INSURANCE CO LTD	10,074	87,500.00	881,475,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	277,500.00	1,704,960,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	77,300.00	937,726,300.00
POSCO DX CO LTD	9,010	38,750.00	349,137,500.00
SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	147,400.00	1,073,661,600.00
COSMOAM&T CO LTD	3,978	149,200.00	593,517,600.00
LG DISPLAY CO LTD	51,846	9,930.00	514,830,780.00
LG INNOTEK CO LTD	2,696	181,300.00	488,784,800.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	142,900.00	1,319,395,700.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	806,665	77,600.00	62,597,204,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	65,200.00	9,250,380,400.00
SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	401,000.00	4,115,463,000.00
KT CORP	10,500	33,300.00	349,650,000.00
LG UPLUS CORP	22,125	9,690.00	214,391,250.00
SK TELECOM	9,563	50,100.00	479,106,300.00

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	20,150.00	891,436,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	136,400.00	987,263,200.00	
	SK HYNIX INC	91,166	173,300.00	15,799,067,800.00	
	韓国ウォン 小計	2,610,303		196,844,205,130.00 (22,066,235,395)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	69.30	16,510,032.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	42.00	19,075,392.00	
	CHINA STEEL	1,779,261	24.45	43,502,931.45	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	52.40	28,403,996.40	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	67.10	40,113,990.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	55.00	42,391,360.00	
	TAIWAN CEMENT	1,268,419	32.00	40,589,408.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	1,055.00	33,292,635.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	31.15	11,277,172.20	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,515.00	13,635,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	38.85	19,510,975.05	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	19.45	9,044,250.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	31.10	12,004,600.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	172.50	31,604,587.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.30	13,829,600.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	43.25	3,227,963.75	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	45.15	9,797,550.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	46.90	21,717,560.90	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	487.00	19,449,319.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	153.50	12,111,303.50	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	365.00	11,315,000.00	
	POU CHEN	273,780	35.30	9,664,434.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	601.00	32,490,060.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	270.00	23,906,880.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	76.00	59,006,020.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,000	285.50	7,137,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	17.85	10,859,547.30	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	31.00	95,797,347.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,474,537	26.55	65,698,957.35	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	26.65	44,061,990.70	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	22.20	33,707,614.20	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,066,087	38.70	79,957,566.90	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	21.20	37,978,612.80	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	17.35	34,711,294.85	
	TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	16.15	12,899,328.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	25.60	38,782,105.60	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	45.00	31,049,325.00	

CHAILEASE HOLDING CO LTD	287,702	168.00	48,333,936.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,919,822	29.90	57,402,677.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	47.45	72,648,654.65
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	13.20	34,006,183.20
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	65.00	87,974,315.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.07	15,590,158.62
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	401.00	34,486,000.00
ACER INC	617,803	43.80	27,059,771.40
ADVANTECH CO LTD	76,261	365.00	27,835,265.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	413.50	52,552,542.00
AUO CORP	1,268,072	17.15	21,747,434.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	207.00	24,570,900.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	35.30	28,443,328.00
DELTA ELECTRONICS INC	347,903	298.50	103,849,045.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	215.00	30,960,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	292.50	21,937,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,185,248	143.00	312,490,464.00
INNOLUX CORP	1,320,576	13.55	17,893,804.80
INVENTEC CO LTD	455,511	53.00	24,142,083.00
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,120.00	31,884,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	96.10	33,966,737.20
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	154.00	15,400,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	171.50	3,601,500.00
PEGATRON CORP	340,474	94.80	32,276,935.20
QUANTA COMPUTER INC	463,270	241.50	111,879,705.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	77.30	15,622,330.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	170.00	35,870,000.00
WISTRON CORP	427,000	115.00	49,105,000.00
WIWYNN CORP	16,000	2,315.00	37,040,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	88.70	23,123,380.40
YAGEO CORPORATION	64,588	588.00	37,977,744.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	112.00	15,447,264.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	123.00	71,870,745.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	80.20	17,323,200.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	102.00	25,010,400.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	2,860.00	34,320,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	146.00	75,089,990.00
EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,190.00	26,280,000.00
GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,155.00	15,015,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	520.00	21,840,000.00
MEDIATEK INC	253,804	993.00	252,027,372.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	62.00	16,058,000.00

	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	588.00	56,474,460.00
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	20,000	800.00	16,000,000.00
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	22.20	12,787,200.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	552.00	47,441,088.00
	SILERGY CORP	53,000	336.00	17,808,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,160,389	750.00	3,120,291,750.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	49.10	97,021,600.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	81.20	15,265,600.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	363,030	25.40	9,220,962.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	36.15	10,088,633.55
	新台湾ドル 小計	58,180,450		6,514,466,670.97 (30,986,712,167)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	149,952	585.90	87,856,876.80
	COAL INDIA LTD	295,479	435.25	128,607,234.75
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	125,486	478.45	60,038,776.70
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	166.65	99,496,049.40
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	275.15	148,514,413.70
	PETRONET LNG LTD	83,779	300.15	25,146,266.85
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	506,553	2,941.60	1,490,076,304.80
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	609.45	44,814,686.85
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,555.00	41,100,205.00
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	2,808.45	188,736,265.35
	BERGER PAINTS INDIA LTD	35,338	504.85	17,840,389.30
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,274.35	106,537,377.05
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	614.50	151,713,905.00
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	927.45	64,711,896.30
	JSW STEEL LTD	99,332	865.25	85,947,013.00
	NMDC LTD	146,261	235.65	34,466,404.65
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,709.35	47,468,551.95
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,827.40	82,446,984.00
	SHREE CEMENT LTD	1,387	24,360.25	33,787,666.75
	SRF LTD	33,773	2,527.10	85,347,748.30
	SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	4,067.80	40,726,813.60
	TATA STEEL LTD	1,137,948	162.10	184,461,370.80
	ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	9,367.40	185,961,624.80
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	487.00	33,920,037.00
	VEDANTA LTD	107,173	385.85	41,352,702.05
	ABB LTD INDIA	11,720	6,291.20	73,732,864.00
	ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,025.70	101,814,805.00
	ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	169.35	40,978,127.55
	ASTRAL LTD	19,918	1,944.05	38,721,587.90
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	233.15	118,301,475.75

BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	254.45	38,626,273.35
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	532.25	37,473,593.50
CUMMINS INDIA LTD	20,968	3,040.15	63,745,865.20
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,501.35	53,547,149.10
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	3,752.00	136,257,632.00
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	3,519.25	378,636,107.50
POLYCAB INDIA LTD	7,354	5,292.45	38,920,677.30
SIEMENS INDIA LTD	11,025	5,588.25	61,610,456.25
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	39.41	59,115,000.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	992.00	22,809,056.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,310.55	137,059,940.10
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	923.30	24,425,901.50
GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	80.55	31,776,813.90
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	3,558.80	94,133,818.80
BAJAJ AUTO LTD	9,644	8,795.45	84,823,319.80
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,341.95	20,681,760.45
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,193.10	36,177,178.20
EICHER MOTORS LTD	26,253	4,340.80	113,959,022.40
HERO MOTOCORP LTD	21,431	4,215.15	90,334,879.65
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	2,082.90	312,668,284.80
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,710.65	309,504,327.50
MRF LTD	432	129,243.85	55,833,343.20
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	127.10	66,248,968.50
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	681.40	40,399,524.60
TATA MOTORS LTD	277,381	963.20	267,173,379.20
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	637.35	47,801,250.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,494.40	73,913,548.80
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,898.90	78,337,220.60
PAGE INDUSTRIES LTD	886	35,355.85	31,325,283.10
TITAN CO LTD	56,531	3,562.85	201,411,473.35
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	596.65	98,147,135.05
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	435.65	19,138,104.50
ZOMATO LTD	1,054,701	189.20	199,549,429.20
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	5,708.55	81,951,943.80
TRENT LTD	37,950	4,152.55	157,589,272.50
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	4,701.90	134,436,724.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	4,668.10	103,426,423.60
ITC LTD	480,447	424.80	204,093,885.60
MARICO LTD	81,711	505.05	41,268,140.55
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,437.10	125,413,166.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,137.50	106,059,362.50
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,122.70	65,767,766.00

VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,395.60	112,147,624.80
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,650.65	68,916,900.00
DABUR INDIA LTD	144,837	504.35	73,048,540.95
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,169.05	74,113,093.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,232.25	321,577,935.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,170.05	89,848,268.10
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	771.95	92,781,442.45
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,087.10	38,499,646.50
CIPLA LTD	88,546	1,345.35	119,125,361.10
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,669.30	80,475,087.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,942.65	108,875,290.65
LUPIN LTD	48,134	1,547.05	74,465,704.70
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,522.55	254,996,674.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	2,536.85	31,000,307.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	614.95	18,530,903.30
AXIS BANK LTD	391,573	1,029.50	403,124,403.50
BANDHAN BANK LTD	74,811	173.55	12,983,449.05
BANK OF BARODA	248,313	256.95	63,804,025.35
HDFC BANK LTD	485,940	1,531.30	744,119,922.00
ICICI BANK LTD	879,852	1,066.40	938,274,172.80
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	81.83	43,454,021.24
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,483.15	71,732,549.75
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,793.20	334,153,854.00
PUNJAB NATIONAL BANK	272,403	128.25	34,935,684.75
STATE BANK OF INDIA	314,786	750.80	236,341,328.80
UNION BANK OF INDIA	238,889	140.85	33,647,515.65
YES BANK LTD	2,352,478	23.94	56,318,323.32
BAJAJ FINANCE LTD	49,376	7,122.30	351,670,684.80
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,618.70	123,929,290.70
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	7,830.70	23,452,946.50
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,128.35	94,779,143.30
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	3,707.15	52,541,436.95
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	370.00	174,337,340.00
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,652.60	20,530,249.80
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	37,520	377.90	14,178,808.00
POWER FINANCE CORPORATION	205,755	398.50	81,993,367.50
REC LTD	186,584	425.75	79,438,138.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	732.05	44,431,774.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	2,366.10	129,413,839.50
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	601.65	84,309,214.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,689.30	56,812,848.30
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	588.55	26,670,731.80

	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,447.05	105,252,628.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,447.90	236,476,819.60	
	INFOSYS LTD	553,283	1,411.60	781,014,282.80	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	4,659.60	73,151,060.40	
	MPHASIS LTD	19,317	2,279.35	44,030,203.95	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	15,982	3,887.60	62,131,623.20	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	3,827.45	583,146,454.55	
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,444.50	31,110,565.50	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,193.75	113,163,918.75	
	WIPRO LTD	247,008	452.85	111,857,572.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	389,936	1,288.90	502,588,510.40	
	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,754.95	34,790,128.80	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,770.75	107,488,066.50	
	ADANI POWER LTD	167,705	594.50	99,700,622.50	
	GAIL INDIA LTD	504,548	202.00	101,918,696.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	435.70	11,643,646.80	
	NTPC LTD	664,141	350.90	233,047,076.90	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	281.70	225,636,066.00	
	TATA POWER CO LTD	199,512	428.00	85,391,136.00	
	DLF LTD	126,742	855.85	108,472,140.70	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,500.20	74,410,952.40	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,172.95	49,195,868.90	
	インドルピー 小計	24,204,501		17,895,598,714.51 (33,464,769,596)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	14.78	885,528.92	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.97	1,867,176.75	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.88	2,459,004.96	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	12.10	3,423,319.90	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.21	2,237,687.50	
	DUKHAN BANK	319,751	3.90	1,247,028.90	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.51	2,878,328.31	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.43	2,237,579.19	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	18.03	6,045,477.03	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	14.03	10,400,467.06	
	OOREDOO QSC	72,800	10.23	744,744.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	16.16	1,559,633.92	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.93	607,945.70	
	カタールリアル 小計	5,782,030		36,593,922.14 (1,555,973,569)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	186.88	6,394,472.96	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	780.35	7,796,476.85	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	451.30	30,437,025.90	



	GOLD FIELDS LTD	144,200	341.35	49,222,670.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	176.15	17,590,515.15
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	96.76	14,595,955.72
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	478.56	8,460,462.24
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	139.45	6,703,222.05
	SASOL LTD	88,115	157.02	13,835,817.30
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	24.70	19,746,785.50
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	231.73	11,656,714.19
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,257.39	99,646,817.49
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	17.10	8,132,383.80
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	55.70	9,820,801.20
	BID CORP LTD	58,066	415.50	24,126,423.00
	CLICKS GROUP LTD	35,422	284.07	10,062,327.54
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	231.53	19,731,912.72
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	217.01	12,192,055.82
	ABSA GROUP LTD	140,135	140.01	19,620,301.35
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,000.00	29,200,000.00
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	215.06	13,572,651.66
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	167.55	40,706,104.95
	FIRSTSTRAND LTD	816,636	59.93	48,940,995.48
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	432.89	7,440,080.43
	REMGRO LTD	74,679	119.04	8,889,788.16
	DISCOVERY LIMITED	98,779	108.85	10,752,094.15
	OLD MUTUAL LTD	974,656	10.13	9,873,265.28
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	39.27	9,340,919.28
	SANLAM LTD	307,490	64.61	19,866,928.90
	MTN GROUP LTD	255,377	82.09	20,963,897.93
	VODACOM GROUP	79,334	88.12	6,990,912.08
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	125.21	8,431,140.56
	南アフリカランド 小計	5,817,702		624,741,919.64 (5,054,162,129)
アラブ首長国連 邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.43	1,262,739.78
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.27	1,410,828.42
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.48	1,545,196.56
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.24	3,884,583.20
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	11.00	2,043,591.00
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.68	2,982,817.92
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	16.55	5,919,918.45
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	12.80	9,267,443.20
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	17.56	11,275,943.28
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.35	3,883,195.85
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	8.29	9,190,857.72

アラブ首長国連邦ディルハム 小計		6,135,824		52,667,115.38 (2,224,132,282)
クウェートディ ナール	BOUBAYAN BANK K.S.C	162,047	0.62	101,765.51
	GULF BANK	162,936	0.26	42,363.36
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,585,286	0.73	1,163,599.92
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.85	1,199,423.35
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.49	146,040.36
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.78	118,463.19
クウェートディナール 小計		3,761,910		2,771,655.69 (1,393,921,079)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	8.87	1,301,229.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	41.89	3,728,210.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	16.94	1,084,160.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.96	712,420.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	10.92	1,092,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	27.23	2,619,526.00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	10.15	2,413,588.80
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	11.31	900,276.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	23.82	235,818.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	25.26	784,323.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	34.22	958,160.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	7.30	1,199,390.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	23.23	683,891.20
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	7.36	2,719,520.00
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	19.12	400,181.60
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	18.48	380,688.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	12.05	1,111,010.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	19.99	415,792.00
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	51.29	528,287.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	36.90	413,280.00
	GEM CO LTD-A	289,800	6.20	1,796,760.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	21.33	529,538.58
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	16.09	596,939.00
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.95	1,025,125.00
	HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.25	1,872,225.00
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	47.64	1,067,136.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.62	746,820.00
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.03	241,800.00
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	10.38	231,474.00
	JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	60.11	609,515.40
LB GROUP CO LTD-A	15,300	20.37	311,661.00	
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	11.68	550,128.00	

NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	16.99	1,345,608.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.17	61,815.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	17.41	828,716.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.32	548,454.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	19.60	1,087,310.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	31.43	227,930.36
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	28.67	514,339.80
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.60	1,031,760.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	18.36	298,166.40
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	6.27	687,681.06
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.90	535,860.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	30.87	333,396.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	17.28	862,272.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	30.69	305,058.60
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	47.04	536,256.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	14.37	140,826.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	4.23	1,402,668.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	86.55	3,487,965.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	29.34	432,823.68
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	38.95	642,090.75
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	48.58	88,415.60
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	41.40	169,740.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	30.78	1,151,172.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	29.65	219,706.50
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	23.28	3,012,432.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	18.63	5,013,333.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	32.87	374,718.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	42.79	663,245.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	30.88	259,392.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	10.30	659,200.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	39.10	2,158,906.50
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.25	1,356,975.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	7.13	1,640,613.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.36	3,014,464.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	190.80	10,452,024.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	7.80	1,449,240.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	18.25	788,400.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	35.00	1,381,555.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	4.91	111,948.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	53.80	129,120.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	7.44	149,625.84
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	94.53	356,378.10

GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	18.55	107,590.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	27.94	735,380.80
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	53.50	612,896.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	12.63	519,093.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	19.20	923,520.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.47	1,148,223.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	8.84	320,008.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	25.51	2,142,329.80
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	82.00	487,080.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	39.99	501,234.66
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.24	855,168.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.75	659,925.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.51	2,195,017.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	61.00	1,731,973.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	7.86	196,971.60
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	95.16	951,600.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	13.71	557,997.00
TBEA CO LTD-A	29,274	14.29	418,325.46
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	18.49	798,768.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	7.35	1,465,590.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	19.49	615,884.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	70.10	579,026.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	20.82	151,986.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	9.21	737,721.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	35.30	388,300.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.09	1,601,631.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.16	2,049,036.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.49	139,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.98	2,014,830.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.61	1,221,405.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	34.40	1,826,640.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	36.30	193,079.70
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.80	257,520.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	16.09	896,213.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	7.10	155,064.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	52.31	564,948.00
BYD CO LTD -A	17,000	210.13	3,572,210.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	132.50	1,192,500.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	17.03	738,284.56
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	46.00	851,000.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.05	619,115.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	118.01	991,284.00

NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.74	490,482.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	45,700	52.70	2,408,390.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	15.23	648,798.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	24.29	953,479.66
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	38.84	108,752.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	39.94	1,737,390.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	24.69	685,394.40
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	32.00	253,824.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	70.00	3,556,000.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	57.09	439,593.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	28.74	2,905,614.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	60.55	484,400.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	27.36	716,832.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	9.93	332,456.40
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	16.50	404,250.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.90	530,640.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.95	968,830.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	23.54	383,702.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	9.76	222,528.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.19	257,685.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	72.35	1,499,092.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.14	678,470.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	22.32	497,535.12
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	42.68	605,885.28
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	30.06	321,642.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	251.78	402,848.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	38.11	83,842.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	61.10	1,118,130.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	83.23	249,690.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	4.49	267,155.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	64.17	506,943.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	37.19	2,010,379.83
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	15.50	424,700.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	48.06	817,020.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	27.58	2,167,236.40
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	27.66	948,793.32
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	55.65	962,745.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	95.45	868,595.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	48.70	272,720.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	26.20	301,300.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,646.64	21,406,320.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	175.68	3,232,512.00

MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	43.48	1,459,101.84
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	8.98	240,664.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	18.70	938,740.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	238.88	2,240,694.40
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	43.17	492,138.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.29	697,946.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	142.90	5,930,350.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	29.92	302,192.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	16.38	486,486.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	12.14	1,113,832.86
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.54	504,640.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	44.41	126,035.58
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	31.50	306,180.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,694	8.54	185,266.76
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	13.31	196,988.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.57	113,518.80
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	271.39	4,043,711.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	53.10	106,200.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	76.60	1,438,548.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	83,180	28.69	2,386,434.20
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	42.20	1,198,480.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	66.72	699,692.64
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	53.57	485,719.19
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	117.88	259,336.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	59.25	604,350.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	40.49	601,276.50
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	69.47	1,541,747.71
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	49.64	397,120.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	19.03	358,715.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	279.50	581,360.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	41.68	4,964,171.36
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	12.18	337,166.76
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	24.62	469,700.36
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.01	449,341.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	19.94	216,947.20
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	28.13	196,910.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	9,440	19.31	182,286.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	29.29	328,985.28
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	13.99	237,830.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	42.20	694,780.80
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	56.71	563,697.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	226.03	881,517.00

ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	15.20	137,104.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	17.65	615,067.20
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.54	4,685,734.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.80	336,400.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	14.20	2,235,080.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	6.90	3,532,110.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	12.05	1,358,035.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	8.17	1,876,975.80
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	9.33	1,376,175.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	22.27	1,298,341.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.04	320,320.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.35	918,015.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.16	2,639,548.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	33.62	6,253,320.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.03	1,102,608.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.99	1,199,528.20
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.85	817,890.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	5.55	3,211,230.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	16.18	3,324,990.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	10.69	1,276,386.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.88	690,520.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.34	3,209,782.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.97	363,825.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	9.88	784,472.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.32	419,655.60
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.41	107,659.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	7.31	341,377.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.29	409,551.40
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	18.13	2,557,780.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	21.38	515,258.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	12.33	1,447,874.91
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.68	56,448.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.24	315,448.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	12.91	782,346.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	5.57	956,252.03
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.95	2,014,645.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	13.41	969,543.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.44	979,202.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	110.70	597,780.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.52	425,880.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.47	625,056.90
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.03	325,825.28

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.56	944,832.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.27	1,928,652.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.76	428,640.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.04	438,748.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.36	2,002,128.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	24.26	2,430,852.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	39.42	4,131,216.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.98	214,662.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	276.24	1,332,305.52
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	28.28	912,482.48
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	20.31	336,374.22
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	44.60	481,680.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	53.42	160,260.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	37.50	357,412.50
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	45.10	248,050.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	10.87	143,157.90
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	21.93	831,147.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	4.24	2,605,904.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	25.00	700,000.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	8.98	312,504.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	50.80	462,280.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	22.05	3,640,455.00
GOERTEK INC -A	26,900	14.82	398,658.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.13	256,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	32.09	224,630.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	35.85	706,675.20
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	13.61	228,648.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	26.39	1,225,815.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	87.25	150,768.00
NINESTAR CORP-A	18,543	21.60	400,528.80
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.34	397,062.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	85.60	407,456.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	171.50	1,103,602.50
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	14.20	404,700.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.98	558,756.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	7.74	363,780.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	19.67	360,747.80
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	34.33	144,186.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	6.62	355,560.20
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	95.88	450,636.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	34.26	539,595.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.30	524,190.00



ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	170.70	1,485,090.00
ZTE CORP-A	76,400	28.03	2,141,492.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.84	2,046,352.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	9.43	1,638,934.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.77	1,151,001.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	26.00	8,576,880.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	19.10	1,061,960.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.98	1,572,186.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	15.84	2,802,096.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	17.06	1,574,638.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	133.85	949,933.45
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	53.00	537,314.00
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	141.41	1,615,185.02
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	38.40	807,628.80
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	74.09	464,692.48
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	24.06	509,302.08
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	18.22	136,650.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	75.50	3,104,937.50
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	61.70	462,750.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	14.78	505,505.56
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	24.54	731,292.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	7.63	175,383.18
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	18.45	1,851,273.00
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	45.90	966,424.50
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	298.48	925,288.00
SG MICRO CORP-A	4,095	62.18	254,627.10
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	56.67	447,693.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	135.64	379,792.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	113.33	464,199.68
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	10.38	382,762.50
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	7.37	241,367.50
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	19.79	444,602.14
TONGWEI CO LTD-A	66,600	23.03	1,533,798.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	20.94	532,252.92
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	59.78	410,031.02
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	93.31	680,229.90
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	34.58	491,036.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	31.09	529,213.98
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	8.24	450,728.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	6.70	359,790.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.34	1,746,152.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	8.10	662,580.00

	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	8.08	103,424.00	
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	2.40	190,320.00	
	オフショア人民元 小計	26,271,841		359,307,898.35 (7,666,588,557)	
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	80,157	20.50	1,643,218.50	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	465,520	30.05	13,988,876.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	43.00	506,325.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	114.80	4,295,012.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	32.55	1,537,694.55	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	54.00	11,385,576.00	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	153.00	1,430,397.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	79.70	13,059,402.90	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	22.64	1,931,712.72	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	9.35	967,079.85	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	37.90	1,935,894.10	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	240.00	1,009,680.00	
	JARIR MARKETING CO	125,000	14.16	1,770,000.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	141.80	911,915.80	
	ALMARAI CO	56,483	58.50	3,304,255.50	
	SAVOLA	36,289	51.90	1,883,399.10	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	169.60	1,158,876.80	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	316.00	5,182,084.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	142.40	2,267,577.60	
	AL RAJHI BANK	324,926	79.10	25,701,646.60	
	ALINMA BANK	161,322	42.05	6,783,590.10	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	29.05	2,499,200.55	
	BANK AL-JAZIRA	97,894	21.08	2,063,605.52	
	BANK ALBILAD	89,702	45.55	4,085,926.10	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	36.50	3,461,477.50	
	RIYAD BANK	234,479	27.65	6,483,344.35	
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	39.00	5,767,905.00	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	16.70	1,179,688.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	37.75	18,526,718.50	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	265.00	2,903,605.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	232.60	3,308,269.80	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	152.60	2,541,553.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	357.00	1,576,869.00		
ELM CO	4,094	934.40	3,825,433.60		
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	52.20	2,549,656.80		
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	12.40	1,122,299.20		
SAUDI TELECOM CO	339,167	39.30	13,329,263.10		
ACWA POWER CO	16,922	447.60	7,574,287.20		

	POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	65.40	1,051,697.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	19.90	3,225,969.10	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	13.80	1,393,675.80	
	サウジアラビアリアル 小計	4,157,021		191,124,659.04 (7,901,093,404)	
	合 計	1,383,826,413		181,130,335,132 (181,130,335,132)	

## (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	15,569,811.20	
		メキシコペソ 小計	97,360	15,569,811.20 (141,205,731)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,533,786.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,251,234.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,727,880.00	
ブラジルリアル 小計	100,000	2,462,000.00			
		ブラジルリアル 小計	383,600	11,974,900.00 (356,199,387)	
		投資信託受益証券合計	480,960	497,405,118 (497,405,118)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	16,035,981.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	126,346	8,528,355.00	
	メキシコペソ 小計	740,046	24,564,336.00 (222,778,876)		
		投資証券合計	740,046	222,778,876 (222,778,876)	
		合計		720,183,994 (720,183,994)	

(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 26銘柄	100.0%			2.7%
メキシコペソ	株式 21銘柄	92.5%			2.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.9%		0.1%
	投資証券 2銘柄			4.6%	0.1%
ブラジルリアル	株式 45銘柄	96.2%			4.9%

	投資信託受 4銘柄 益証券		3.8%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
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%			1.0%
ロシアルーブル	株式 14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 168銘柄	100.0%			19.3%
マレーシアリンギット	株式 32銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 35銘柄	100.0%			1.5%
フィリピンペソ	株式 14銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			1.8%
韓国ウォン	株式 99銘柄	100.0%			12.1%
新台湾ドル	株式 89銘柄	100.0%			17.0%
インドルピー	株式 136銘柄	100.0%			18.4%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式 32銘柄	100.0%			2.8%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 11銘柄	100.0%			1.2%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%			0.8%
オフショア人民元	株式 328銘柄	100.0%			4.2%
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

	2024年 4月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	773,721,741
コール・ローン	1,637,370,647
国債証券	135,308,460,012
派生商品評価勘定	7,096,934
未収利息	2,247,508,922

	2024年 4月22日現在
項目	金額（円）
前払費用	205,488,236
流動資産合計	140,179,646,492
資産合計	140,179,646,492
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,616,887
未払解約金	35,380,834
流動負債合計	39,997,721
負債合計	39,997,721
純資産の部	
元本等	
元本	61,835,203,451
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	78,304,445,320
元本等合計	140,139,648,771
純資産合計	140,139,648,771
負債純資産合計	140,179,646,492

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 4月22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 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,835,203,451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) 2.2663円 (22,663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

	2024年 4月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2024年 4月22日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	56,033,592,704円
期中追加設定元本額	6,886,817,322円
期中一部解約元本額	1,085,206,575円
期末元本額	61,835,203,451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	5,034,797,474円
世界経済インデックスファンド	22,411,818,754円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,887,472,558円
DC 世界経済インデックスファンド	14,894,675,486円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	8,499,732円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
DC 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	793,107,311円
DC 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,635,915,842円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	228,236,344円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	106,147,583円

区分	2024年 4月22日現在
SMT インデックスバランス・オープン	176,629,559円
SMT 世界経済インデックス・オープン	493,655,495円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	717,974,157円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,087,843,391円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,742,108円
グローバル経済コア	1,073,549,753円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	111,223,185円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	95,401,667円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	40,524,198円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	46,361,721円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	262,737,498円
10資産分散投資ファンド	57,805,602円
グローバル10資産バランスファンド	35,128,305円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	326,420,611円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	150,819,366円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	223,114,107円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	221,322,125円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	220,369,822円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	217,835,361円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	215,675,366円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	140,951,853円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		187,528,535
合計		187,528,535

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2024年 4月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,467,852,310	-	1,470,332,357	2,480,047
	メキシコペソ	219,987,606	-	216,291,270	3,696,336
	チェココルナ	142,015,916	-	143,821,363	1,805,447
	ハンガリーフォリント	66,031,493	-	66,321,364	289,871
	ポーランドズロチ	176,368,011	-	177,271,020	903,009
	マレーシアリング	226,508,805	-	227,787,370	1,278,565
	タイバーツ	220,776,294	-	221,436,900	660,606
	南アフリカランド	186,592,347	-	185,689,780	902,567
	オフショア人民元	229,571,838	-	231,713,290	2,141,452
合計	1,467,852,310	-	1,470,332,357	2,480,047	

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	38,800,000.00	39,041,724.00	
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,571,666.17	
		MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000.00	106,143,600.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	161,020,405.58	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	54,730,225.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	124,000,000.00	106,170,040.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	129,078,180.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	160,800,000.00	142,755,024.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000.00	100,080,695.00	
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	24,127,222.00	
		MBONO 7% 09/03/26	85,600,000.00	79,494,152.00	
		MBONO 8.5% 03/01/29	52,000,000.00	49,018,840.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000.00	131,377,560.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	87,331,686.00	
		MBONO 8% 07/31/53	72,500,000.00	59,073,000.00	
		MBONO 8% 11/07/47	130,700,000.00	107,546,495.00	
			メキシコペソ 小計		1,631,950,000.00
ブラジルレアル	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	64,412,117.95	
		BLTN 0% 01/01/30	12,200,000.00	6,649,671.00	
		BLTN 0% 07/01/25	50,000,000.00	44,450,181.49	
		BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00	62,329,227.48	
		BLTN 0% 07/01/27	68,000,000.00	48,774,923.04	
		BNTNF 10% 01/01/25	54,900,000.00	54,725,895.08	
		BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000.00	67,101,864.32	
		BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000.00	49,341,003.38	
		BNTNF 10% 01/01/31	21,850,000.00	20,499,028.26	
		BNTNF 10% 01/01/33	28,900,000.00	26,745,261.08	
		BNTNF 10% 01/01/35	8,000,000.00	7,307,933.60	
	ブラジルレアル 小計		518,050,000.00	452,337,106.68 (13,454,993,406)	
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	1,025,000,000.00	880,707,379.80		



	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,906,161,242.66	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	2,160,000,000.00	2,114,940,328.56	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,320,000,000.00	2,151,693,535.20	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,360,000,000.00	2,147,639,534.72	
	BTPCL 5% 10/01/28	840,000,000.00	805,309,770.72	
	BTPCL 6% 01/01/43	2,000,000,000.00	2,004,878,082.00	
	BTPCL 6% 04/01/33	1,650,000,000.00	1,634,988,902.25	
	BTPCL 7% 05/01/34	620,000,000.00	660,156,040.96	
	チリペソ 小計	15,960,000,000.00	15,306,474,816.87	(2,476,296,802)
コロンビア ペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	62,300,000,000.00	59,689,205,737.00	
	COLTES 13.25% 02/09/33	10,000,000,000.00	11,369,475,600.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	15,800,000,000.00	15,168,267,652.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000.00	40,409,896,548.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	47,110,000,000.00	31,727,273,457.60	
	COLTES 7% 03/26/31	700,000,000.00	586,093,676.00	
	コロンビアペソ 小計	187,510,000,000.00	158,950,212,670.60	(6,298,720,077)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	3,896,892.30	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	9,250,000.00	7,842,323.71	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	10,400,000.00	10,216,282.44	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	11,300,000.00	10,466,808.51	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,650,000.00	6,735,124.72	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	10,324,779.66	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,600,000.00	11,474,562.24	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,400,000.00	9,292,709.71	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	4,450,000.00	4,708,948.12	
	ペルーソル 小計	79,050,000.00	74,958,431.41	(3,149,835,742)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	24,101,850.75	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,766,164.83	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	30,000,000.00	31,605,000.00	
	ウルグアイペソ 小計	72,000,000.00	72,473,015.58	(291,269,049)
ドミニカペ ソ	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	43,484,176.40	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	39,020,599.68	
	ドミニカペソ 小計	72,000,000.00	82,504,776.08	(216,443,029)
チェココル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29	41,100,000.00	32,808,075.00	
	CZGB 0.25% 02/10/27	95,200,000.00	85,743,212.80	
	CZGB 0.95% 05/15/30	98,900,000.00	82,087,593.40	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	23,293,584.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	80,703,000.00	

	CZGB 1.25% 02/14/25	75,500,000.00	73,669,729.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	23,492,767.50	
	CZGB 1.75% 06/23/32	86,500,000.00	71,795,000.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	29,000,000.00	22,098,000.00	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	64,467,526.40	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	73,973,283.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28	98,700,000.00	92,450,710.80	
	CZGB 2.75% 07/23/29	100,500,000.00	93,950,616.00	
	CZGB 2% 10/13/33	102,500,000.00	84,810,550.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	57,000,000.00	52,899,306.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	45,000,000.00	44,561,160.00	
	CZGB 4.5% 11/11/32	25,000,000.00	25,376,750.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	49,858,375.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	72,933,000.00	
	CZGB 5.75% 03/29/29	18,000,000.00	19,242,000.00	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	83,580,000.00	
	CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	30,321,000.00	
	CZGB 6% 02/26/26	73,000,000.00	75,423,600.00	
	チェココロナ 小計	1,470,600,000.00	1,359,538,838.90 (8,886,897,528)	
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	548,072,223.60	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	453,027,469.60	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	760,395,171.50	
	HGB 2.25% 04/20/33	872,000,000.00	595,898,291.20	
	HGB 2.25% 06/22/34	291,000,000.00	190,802,705.40	
	HGB 2.75% 12/22/26	685,500,000.00	613,175,431.35	
	HGB 2% 05/23/29	733,000,000.00	575,503,515.20	
	HGB 3.25% 10/22/31	1,042,000,000.00	810,109,360.40	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	223,130,678.40	
	HGB 3% 08/21/30	715,000,000.00	566,277,855.00	
	HGB 3% 10/27/27	932,000,000.00	813,544,011.60	
	HGB 3% 10/27/38	530,000,000.00	336,376,690.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	603,000,000.00	549,326,970.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	840,000,000.00	712,074,048.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	883,596,150.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	753,302,223.70	
HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	241,245,965.00		
	ハンガリーフォロント 小計	11,471,000,000.00	9,625,858,759.95 (4,028,046,482)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	25,200,000.00	22,273,977.60	
	POLGB 0.75% 04/25/25	17,300,000.00	16,565,130.60	
	POLGB 0% 10/25/25	15,200,000.00	14,072,568.71	

	POLGB 1.25% 10/25/30	22,800,000.00	17,387,257.20	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	16,913,815.40	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	20,055,611.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	21,711,238.20	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,982,530.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000.00	33,731,590.40	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,495,785.80	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	20,153,939.30	
	POLGB 6% 10/25/33	29,300,000.00	29,608,441.10	
	POLGB 7.5% 07/25/28	25,900,000.00	27,764,178.40	
	ポーランドズロチ 小計	307,450,000.00	281,716,064.11 (10,784,936,082)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,653,764.57	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	11,100,000.00	10,494,439.50	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,591,693.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	10,109,008.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,315,589.60	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	9,200,000.00	9,096,263.10	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,399,250.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,497,643.03	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,238,816.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,511,033.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	10,200,000.00	8,666,079.63	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,601,018.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,301,841.45	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	6,500,000.00	6,427,223.98	
	ROMGB 5% 02/12/29	11,200,000.00	10,592,950.24	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	9,600,000.00	9,603,168.00	
	ROMGB 7.2% 05/31/27	1,000,000.00	1,027,283.50	
	ROMGB 7.2% 10/28/26	5,300,000.00	5,418,199.54	
	ROMGB 7.2% 10/30/33	5,300,000.00	5,466,925.09	
	ROMGB 7.35% 04/28/31	8,200,000.00	8,577,318.90	
ROMGB 7.9% 02/24/38	6,100,000.00	6,665,073.50		
ROMGB 8.25% 09/29/32	6,800,000.00	7,413,088.00		
ROMGB 8.75% 10/30/28	7,500,000.00	8,185,555.50		
ROMGB 8% 04/29/30	7,500,000.00	8,000,025.00		
	ルーマニアレイ 小計	182,100,000.00	175,853,250.13 (5,829,271,461)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	16,200,000.00	14,955,169.15	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,594,060.44	
	MGS 3.582% 07/15/32	21,500,000.00	20,944,732.18	
	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000.00	43,040,699.50	
	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	26,050,634.59	

	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,111,805.06
	MGS 3.882% 03/14/25	6,200,000.00	6,227,528.00
	MGS 3.885% 08/15/29	51,800,000.00	52,107,132.56
	MGS 3.899% 11/16/27	25,500,000.00	25,738,810.05
	MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,625,080.63
	MGS 3.906% 07/15/26	24,600,000.00	24,792,189.96
	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000.00	34,158,657.00
	MGS 4.065% 06/15/50	18,250,000.00	17,771,749.44
	MGS 4.254% 05/31/35	13,650,000.00	13,961,428.84
	MGS 4.457% 03/31/53	7,500,000.00	7,756,980.00
	MGS 4.504% 04/30/29	7,000,000.00	7,246,974.00
	MGS 4.642% 11/07/33	9,500,000.00	10,006,654.95
	MGS 4.696% 10/15/42	26,800,000.00	28,550,042.68
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,424,225.67
	MGS 4.893% 06/08/38	18,600,000.00	20,153,786.34
	MGS 4.921% 07/06/48	11,400,000.00	12,602,804.88
	マレーシアリングット 小計	425,350,000.00	429,821,145.92 (13,899,255,341)
タイパーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	172,200,000.00	169,513,473.36
	THAIGB 1.45% 12/17/24	84,000,000.00	83,522,380.20
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,810,264.44
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,863,005.51
	THAIGB 1.6% 12/17/29	138,100,000.00	131,425,998.48
	THAIGB 1% 06/17/27	203,000,000.00	194,568,805.06
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	201,906,657.51
	THAIGB 2.25% 03/17/27	83,000,000.00	82,723,214.92
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,040,967.00
	THAIGB 2.4% 03/17/29	118,000,000.00	117,650,053.30
	THAIGB 2.65% 06/17/28	164,000,000.00	165,409,793.20
	THAIGB 2.8% 06/17/34	60,000,000.00	60,553,644.00
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	95,631,926.20
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	102,892,406.70
	THAIGB 2% 06/17/42	93,600,000.00	79,358,738.47
	THAIGB 2% 12/17/31	113,000,000.00	108,166,597.89
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	153,737,182.76
	THAIGB 3.35% 06/17/33	157,000,000.00	165,232,656.10
	THAIGB 3.39% 06/17/37	131,000,000.00	138,403,936.60
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	165,850,071.48
	THAIGB 3.45% 06/17/43	114,000,000.00	118,580,485.80
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,500,000.00	145,922,758.80
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	194,526,468.00
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	107,950,753.78
	THAIGB 4.875% 06/22/29	169,500,000.00	188,931,157.95

	タイパーツ 小計	3,201,300,000.00	3,225,173,397.51 (13,513,476,535)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,624,950,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	7,981,050,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	60,103,869,840.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000.00	106,623,800,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,607,680,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	37,800,000,000.00	36,156,078,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	63,000,000,000.00	60,866,820,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,442,476,000.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	82,500,000,000.00	81,027,375,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	73,854,855,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	52,867,500,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	46,000,000,000.00	44,939,470,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,650,600,000.00	
	INDOGB 6.875% 04/15/29	16,000,000,000.00	15,960,960,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	24,000,000,000.00	24,194,160,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	62,800,000,000.00	63,520,316,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	28,500,000,000.00	28,531,207,500.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	51,000,000,000.00	52,665,150,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	36,331,594,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	36,700,000,000.00	38,147,081,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,070,312,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000.00	90,460,800,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	38,735,872,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	85,000,000,000.00	85,386,750,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	57,360,402,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,003,274,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,736,516,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	71,000,000,000.00	78,271,110,000.00	
INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,274,368,000.00		
INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,440,944,000.00		
INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	42,673,716,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,281,000,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,253,439,000.00		
	インドネシアルピア 小計	1,397,800,000,000.00	1,420,045,495,340.00 (13,632,436,755)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	209,200,000.00	214,492,760.00	
	SAGB 11.625% 03/31/53	35,000,000.00	31,640,000.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	44,731,510.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	64,557,480.00	
	SAGB 7% 02/28/31	122,700,000.00	98,006,625.00	

	SAGB 8.25% 03/31/32	180,500,000.00	149,219,350.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	107,278,910.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	78,069,600.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	125,690,975.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	230,000,000.00	182,551,000.00	
	SAGB 8% 01/31/30	220,100,000.00	194,727,972.50	
	SAGB 9% 01/31/40	162,300,000.00	119,501,490.00	
	南アフリカランド 小計	1,784,500,000.00	1,410,467,672.50 (11,410,683,470)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,633,220.72	
	CGB 2.04% 02/25/27	26,000,000.00	26,029,120.00	
	CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,413,985.90	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,240,633.74	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,013,588.20	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,105,586.60	
	CGB 2.39% 11/15/26	2,000,000.00	2,019,674.40	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,111,815.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	16,600,000.00	16,803,889.50	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,154,454.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,475,490.92	
	CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,072,424.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,086,005.80	
	CGB 2.52% 08/25/33	15,700,000.00	15,962,855.68	
	CGB 2.54% 12/25/30	17,800,000.00	18,124,956.80	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	17,261,257.78	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	18,149,203.96	
	CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,620,675.50	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	5,111,144.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	23,200,000.00	23,650,820.08	
	CGB 2.67% 05/25/33	16,700,000.00	17,180,133.35	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,987,318.45	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,161,935.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,281,214.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,950,676.58	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,208,367.54	
	CGB 2.76% 05/15/32	13,000,000.00	13,433,590.30	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,365,109.60	
	CGB 2.8% 03/24/29	19,000,000.00	19,587,679.50	
	CGB 2.8% 03/25/30	9,000,000.00	9,292,912.20	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,268,736.39	
CGB 2.85% 06/04/27	9,400,000.00	9,647,038.58		
CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,970,678.68		
CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,340,807.20		

	CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,346,797.00	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,161,068.26	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,934,554.85	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,433,578.32	
	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,940,561.55	
	CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	5,118,830.32	
	CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,478,210.50	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,735,730.08	
	CGB 3.19% 04/15/53	6,200,000.00	7,106,679.94	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,108,494.24	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,671,591.80	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,838,429.41	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,477,810.40	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,154,103.56	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	15,021,093.70	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,605,176.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	10,442,193.52	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	10,376,311.25	
	CGB 3.81% 09/14/50	15,800,000.00	19,510,348.76	
	オフショア人民元 小計	639,300,000.00	664,178,563.81 (14,171,644,433)	
	合計		135,308,460,012 (135,308,460,012)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.8%
ブラジルレアル	国債証券 11銘柄	100.0%	9.9%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	1.8%
コロンビアペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	4.7%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.3%
ウルグアイペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 23銘柄	100.0%	6.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 17銘柄	100.0%	3.0%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	8.0%
ルーマニアレイ	国債証券 24銘柄	100.0%	4.3%
マレーシアリンギット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券 25銘柄	100.0%	10.0%

インドネシアルピア	国債証券	33銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	8.4%
オフショア人民元	国債証券	53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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 4月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,566,127,823
投資証券	121,990,816,300
派生商品評価勘定	204,209,260
未収配当金	1,176,549,816
未収利息	6,486
差入委託証拠金	361,206,703
流動資産合計	127,298,916,388
資産合計	127,298,916,388
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,135,080
前受金	203,686,220
未払解約金	77,372,275
流動負債合計	282,193,575
負債合計	282,193,575
純資産の部	
元本等	
元本	60,105,680,753
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	66,911,042,060
元本等合計	127,016,722,813
純資産合計	127,016,722,813
負債純資産合計	127,298,916,388

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 4月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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> <p>先物取引</p>



2024年 4月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	60,105,680,753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) 2.1132円 (21,132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

2024年 4月22日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	59,721,905,089円
期中追加設定元本額	8,581,519,477円
期中一部解約元本額	8,197,743,813円
期末元本額	60,105,680,753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）	1,835,126,522円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,937,507円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,968,270,849円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	30,375,404,288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	2,029,781,182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	23,028,447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	13,876,322円
グローバル経済コア	409,595,134円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	17,775,502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）	1,011,064,639円
10資産分散投資ファンド	33,263,148円
グローバル10資産バランスファンド	37,525,378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）	346,515,154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）	15,002,215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）	878,474,914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）	73,380,560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）	497,457,775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）	274,242,558円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	576,898,458
合計	576,898,458

(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

(2024年 4月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				

	買建	4,776,093,780	-	4,979,780,000	203,686,220
	合計	4,776,093,780	-	4,979,780,000	203,686,220

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	2,409	306,183,900	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,796	343,917,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	5,911	725,279,700	
	東海道リート投資法人	2,024	256,845,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,091	2,626,422,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,933	1,878,168,400	
	産業ファンド投資法人	21,580	2,824,822,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,624	3,870,792,000	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	6,216	2,436,672,000	
	G L P 投資法人	39,795	5,169,370,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,826	1,925,493,000	
	日本プロロジスリート投資法人	20,639	5,572,530,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,186	1,213,230,000	
	O n e リート投資法人	2,066	546,043,800	
	イオンリート投資法人	14,532	1,987,977,600	
	ヒューリックリート投資法人	11,085	1,668,292,500	
	日本リート投資法人	3,848	1,346,800,000	
	積水ハウス・リート投資法人	35,600	2,908,520,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,494	360,383,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,921	382,651,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	3,228	347,978,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	38,312	5,785,112,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,962	225,237,600	
	ラサールロジポート投資法人	15,145	2,411,084,000	
	スターアジア不動産投資法人	18,260	1,115,686,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,826	239,206,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,927	2,199,905,500	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,811	144,698,900	
	投資法人みらい	16,258	749,493,800	

三菱地所物流リート投資法人	4,090	1,607,370,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,101	757,498,500	
ザイマックス・リート投資法人	1,922	231,601,000	
タカラレーベン不動産投資法人	6,311	647,508,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,192	620,444,000	
日本ビルファンド投資法人	13,821	8,264,958,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,170	6,523,120,000	
日本都市ファンド投資法人	56,789	5,451,744,000	
オリックス不動産投資法人	23,606	3,963,447,400	
日本プライムリアルティ投資法人	8,102	2,758,731,000	
N T T 都市開発リート投資法人	12,012	1,473,872,400	
東急リアル・エステート投資法人	7,944	1,286,133,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,748	933,411,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,503	4,015,204,500	
森トラストリート投資法人	22,836	1,676,162,400	
インヴィンシブル投資法人	57,363	3,946,574,400	
フロンティア不動産投資法人	4,396	2,011,170,000	
平和不動産リート投資法人	8,852	1,249,017,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,562	2,093,161,600	
福岡リート投資法人	6,127	1,026,885,200	
K D X 不動産投資法人	34,094	5,434,583,600	
いちごオフィスリート投資法人	9,708	788,289,600	
大和証券オフィス投資法人	2,455	1,391,985,000	
阪急阪神リート投資法人	5,649	786,905,700	
スターツプロシード投資法人	2,053	432,977,700	
大和ハウスリート投資法人	17,859	4,698,702,900	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,660	3,172,800,000	
大和証券リビング投資法人	17,446	1,859,743,600	
ジャパンエクセレント投資法人	10,297	1,318,016,000	
合計	752,973	121,990,816,300	

(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

	2024年 4月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2024年 4月22日現在
項目	金額（円）
預金	469,731,390
コール・ローン	17,250,763
投資証券	110,099,072,449
派生商品評価勘定	2,325
未収配当金	138,525,008
未収利息	31
流動資産合計	110,724,581,966
資産合計	110,724,581,966
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,754
未払解約金	11,520,200
流動負債合計	11,522,954
負債合計	11,522,954
純資産の部	
元本等	
元本	40,027,161,619
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,685,897,393
元本等合計	110,713,059,012
純資産合計	110,713,059,012
負債純資産合計	110,724,581,966

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 4月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,027,161,619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 2.7659円 (1万口当たり純資産額) (27,659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

	2024年 4月22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

	2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	41,957,336,605円
期中追加設定元本額	3,333,719,158円
期中一部解約元本額	5,263,894,144円
期末元本額	40,027,161,619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	52,519,744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）	1,511,573,024円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,815,181円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,133,817,454円

区分	2024年 4月22日現在
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,084,244,967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	942,204,271円
分散投資コア戦略ファンドS	1,481,866,335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	107,058,644円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,521,455円
グローバル経済コア	307,440,176円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,121,144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）	268,626,759円
10資産分散投資ファンド	17,641,378円
グローバル10資産バランスファンド	28,168,377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）	1,063,627,569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）	209,994,274円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	116,245,579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）	57,468,175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）	46,665,921円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	89,136,147円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	88,786,125円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	88,402,125円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	87,023,198円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	86,160,305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）	74,224,050円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	56,559,092円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年 4月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		6,438,541,487
合計		6,438,541,487

(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

(2024年 4月22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	182,736,500	-	182,736,929	429
	アメリカドル	157,845,000	-	157,847,754	2,754
	オーストラリアドル	24,891,500	-	24,889,175	2,325
合計		182,736,500	-	182,736,929	429

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	56,433	962,182.65	
		AGREE REALTY CORP	57,588	3,257,177.28	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,332	697,211.88	
		ALEXANDER'S INC	1,336	281,268.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	89,300	10,331,117.00	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	84,759.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	605,477.54	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	180,734	6,374,488.18	
		AMERICOLD REALTY TRUST	152,253	3,477,458.52	
		APARTMENT INCOME REIT CO	81,449	3,126,012.62	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	70,959	555,608.97	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	118,612	1,795,785.68	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	35,039	367,909.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	22,270.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,377	14,799,817.01	
		BOSTON PROPERTIES	82,170	4,946,634.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	66,010.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	107,226	469,649.88	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	171,636	3,685,024.92	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	104,379	1,513,495.50	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	86,850.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	60,693	5,844,128.97	
		CARETRUST REIT INC	75,746	1,794,422.74	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	14,237	310,651.34	
		CENTERSPACE	8,999	583,945.11	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	237,470.98	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	69,911.86	
		CLIPPER REALTY INC	7,300	29,492.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	382,139.80	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	62,548	1,424,217.96	
		COUSINS PROPERTIES INC	84,601	1,875,604.17	
		CTO REALTY GROWTH INC	12,400	210,552.00	
CUBESMART	127,882	5,377,438.10			



DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	123,244	1,088,244.52	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	368,800	213,904.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	171,461	23,461,008.63	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	281,488.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,870	1,222,789.70	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,918	671,269.62	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	27,065	4,310,642.55	
ELME COMMUNITIES	50,407	749,048.02	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	75,879	694,292.85	
EPR PROPERTIES	41,990	1,696,815.90	
EQUINIX INC	53,238	39,822,024.00	
EQUITY COMMONWEALTH	59,311	1,107,929.48	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	105,934	6,645,239.82	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	195,668	12,041,408.72	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	86,970	2,215,995.60	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,434	8,568,183.78	
EXTRA SPACE STORAGE INC	119,684	15,853,342.64	
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	301,000.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	41,832	4,173,578.64	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,446	3,442,600.98	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	49,703	1,144,660.09	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	86,429.24	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	151,727	6,493,915.60	
GETTY REALTY CORP	27,420	740,065.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	26,116	343,425.40	
GLADSTONE LAND CORP	16,220	205,831.80	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	309,508.29	
GLOBAL NET LEASE INC	105,265	710,538.75	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	218,544	3,050,874.24	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	402,007	7,228,085.86	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,249	1,408,460.82	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	400,479	7,492,962.09	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,572	394,771.96	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	125,256	1,956,498.72	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	121,387.56	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,563	1,466,501.49	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,939	992,883.54	
INVITATION HOMES INC	326,177	10,949,761.89	
IRON MOUNTAIN INC	165,522	12,430,702.20	
JBG SMITH PROPERTIES	47,755	708,684.20	

KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	45,579.10
KILROY REALTY CORPORATION	59,470	1,967,862.30
KIMCO REALTY CORP	378,461	6,887,990.20
KITE REALTY GROUP TRUST	122,289	2,554,617.21
LTC PROPERTIES INC	22,450	713,910.00
LXP INDUSTRIAL TRUST	162,604	1,395,142.32
MACERICH CO/THE	120,093	1,836,221.97
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	55,120.82
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	333,202	1,472,752.84
MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,237	8,351,160.96
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,694	1,586,637.00
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,315	1,557,378.80
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	196,524.96
NETSTREIT CORP	41,151	702,036.06
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,156	103,559.96
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	444,916.16
NNN REIT INC	103,860	4,154,400.00
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	43,582.20
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	139,420	4,241,156.40
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	190,381.86
ORION OFFICE REIT INC	34,844	110,107.04
PARAMOUNT GROUP INC	100,128	457,584.96
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	119,531	1,930,425.65
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	244,720.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	1,041,217.10
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	69,768	2,303,739.36
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	454,889.50
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	441,404.96
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	182,732.80
PRIME US REIT	324,500	36,019.50
PROLOGIS INC	523,739	54,201,749.11
PUBLIC STORAGE	89,593	23,328,225.34
REALTY INCOME CORP	470,832	24,972,929.28
REGENCY CENTERS CORP	93,444	5,454,326.28
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,747	917,893.16
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	119,841	5,122,004.34
RLJ LODGING TRUST	86,118	950,742.72
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	34,031	3,553,857.33
SABRA HEALTH CARE REIT INC	128,885	1,760,569.10
SAFEHOLD INC	23,595	447,361.20
SAUL CENTERS INC	6,846	248,920.56

	SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	538,134.22	
	SIMON PROPERTY GROUP	184,493	25,910,196.92	
	SITE CENTERS CORP	99,154	1,353,452.10	
	SL GREEN REALTY CORP	35,863	1,778,087.54	
	STAG INDUSTRIAL INC	103,605	3,618,922.65	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	417,904.80	
	SUN COMMUNITIES INC	70,625	8,311,856.25	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	114,627	1,170,341.67	
	TANGER INC	61,543	1,641,351.81	
	TERRENO REALTY CORP	53,330	2,929,950.20	
	UDR INC	171,978	6,259,999.20	
	UMH PROPERTIES INC	33,009	507,348.33	
	UNITI GROUP INC	142,514	756,749.34	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	261,277.95	
	URBAN EDGE PROPERTIES	64,372	1,053,769.64	
	VENTAS INC	228,277	9,845,587.01	
	VERIS RESIDENTIAL INC	47,792	689,638.56	
	VICI PROPERTIES INC	586,082	16,345,826.98	
	VORNADO REALTY TRUST	90,043	2,349,221.87	
	WELLTOWER INC	313,289	28,609,551.48	
	WHITESTONE REIT	25,954	291,203.88	
	WP CAREY INC	124,225	6,982,687.25	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	62,425	873,950.00	
	アメリカドル 小計	14,752,460	551,602,300.31 (85,388,036,087)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	643,557.32	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	197,448.30	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,593	975,433.68	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	141,455.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	63,400.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,706	1,992,945.02	
	CHOICE PROPERTIES REIT	90,496	1,176,448.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	342,045.99	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	367,422.50	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	73,332	907,116.84	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	50,630.93	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,799	861,205.10	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,182,315.00	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	702,326.74	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	515,389.26
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	603,046.72
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	164,724.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	108,444.04
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	112,105.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	286,706.64
	PRIMARIS REIT	30,375	409,151.25
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	81,280.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	87,939	1,552,123.35
	SLATE GROCERY REIT	16,578	180,700.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	37,957	847,200.24
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,486	39,656.24
	カナダドル 小計	895,064	14,504,277.36 (1,634,196,930)
ユーロ	AEDIFICA	26,505	1,550,542.50
	ALTAREA	2,275	173,582.50
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	303,023.88
	CARMILA	32,392	524,750.40
	COFINIMMO	21,600	1,347,840.00
	COVIVIO(FP)	27,273	1,185,284.58
	CROMWELL REIT EUR	170,400	245,376.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	528,917.50
	GECINA SA	29,616	2,757,249.60
	HAMBORNER REIT AG	37,000	249,380.00
	ICADE	17,487	425,633.58
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	51,563.54
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,544	832,976.20
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	270,000	272,700.00
	KLEPIERRE	108,732	2,674,807.20
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,400	258,774.00
	MERCIALYS	53,414	581,678.46
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	190,427	1,944,259.67
	MONTEA NV	9,926	788,124.40
	NSI NV	7,359	129,665.58
	RETAIL ESTATES	6,645	436,576.50
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	700,005.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	57,448	4,314,344.80
	VASTNED RETAIL	10,650	236,962.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	96,620	2,488,931.20
	WERELDHAVE NV	24,249	341,910.90
	XIOR STUDENT HOUSING NV	18,383	454,979.25

	ユーロ 小計	1,507,507	25,799,840.24 (4,256,715,641)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	113,767.05	
	AEW UK REIT PLC	68,000	55,964.00	
	ASSURA PLC	1,624,807	666,170.87	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	298,936.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	111,609	1,191,984.12	
	BRITISH LAND CO PLC	542,437	2,062,345.47	
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	62,475.33	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	175,707.00	
	DERWENT LONDON PLC	64,392	1,308,445.44	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	287,435.55	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	143,805	562,277.55	
	HAMMERSON PLC	2,065,550	551,088.74	
	HELICAL PLC	65,400	127,660.80	
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	201,830.06	
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	431,966	2,740,824.27	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	67,236.44	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,142,035	2,221,258.07	
	NEWRIVER REIT PL	196,000	143,080.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	219,240.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730,219	670,706.15	
	PRS REIT PLC/THE	260,002	200,461.54	
	REGIONAL REIT LTD	222,000	48,285.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,385	917,670.60	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	91,590.00	
	SEGREO PLC	761,753	6,464,235.95	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,088,715	1,450,168.38	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	668,157	480,404.88	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347,000	268,578.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	123,801.17	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,069,790	1,567,242.35		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	453,930	295,054.50		
UNITE GROUP PLC	228,857	2,102,051.54		
URBAN LOGISTICS REIT PLC	261,651	286,769.49		
WAREHOUSE REIT PLC	237,876	184,353.90		
WORKSPACE GROUP PLC	70,057	344,680.44		
	イギリスポンド 小計	16,298,174	28,705,447.44 (5,498,528,457)	

オーストラリアドル	ABACUS GROUP	224,474	254,777.99
	ABACUS STORAGE KING	347,779	387,773.58
	ARENA REIT	192,648	680,047.44
	BWP TRUST	265,950	906,889.50
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	843,702.82
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	1,016,995.41
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	241,655.86
	CHARTER HALL GROUP	263,653	3,116,378.46
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,694	1,295,827.36
	CHARTER HALL RETAIL REIT	307,930	1,016,169.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	527,436.34
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	264,428.80
	DEXUS	599,530	4,232,681.80
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	323,180.00
	GDI PROPERTY GROUP	315,597	189,358.20
	GOODMAN GROUP	979,424	29,862,637.76
	GPT GROUP	1,097,901	4,556,289.15
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	323,427.30
	HEALTHCO REIT	300,321	330,353.10
	HMC CAPITAL LTD	128,494	781,243.52
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	947,280	1,150,945.20
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	322,496.84
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	231,523	1,088,158.10
	MIRVAC GROUP	2,199,457	4,662,848.84
	NATIONAL STORAGE REIT	750,136	1,650,299.20
	REGION RE GROUP	676,974	1,469,033.58
	RURAL FUNDS GROUP	222,079	433,054.05
	SCENTRE GROUP	2,955,904	9,311,097.60
	STOCKLAND	1,360,265	5,957,960.70
VICINITY CENTERS	2,179,714	4,152,355.17	
WAYPOINT REIT LTD	398,821	917,288.30	
オーストラリアドル 小計		19,569,343	82,266,790.97 (8,192,127,044)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	507,278	575,760.53
	GOODMAN PROPERTY TRUST	585,524	1,296,935.66
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	923,753	766,714.99
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	877,392	1,030,935.60
ニュージーランドドル 小計		2,893,947	3,670,346.78 (335,506,399)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	1,762,170.00
	FORTUNE REIT	875,000	2,966,250.00
	LINK REIT	1,458,800	45,003,980.00
	PROSPERITY REIT	752,000	834,720.00

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	830,280.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,058,394.60	
	香港ドル 小計	6,120,460	52,455,794.60 (1,036,526,501)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	471,076.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,039,418	5,220,910.08	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,358,877	1,182,222.99	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	437,390.28	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,899,144	5,450,390.72	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	374,026.00	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-LOGOS REIT	3,505,364	1,016,555.56	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	324,000.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	628,862	1,320,610.20	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,611,896	1,563,539.12	
	KEPPEL DC REIT	799,503	1,311,184.92	
	KEPPEL REIT	1,231,400	1,034,376.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	909,950	482,273.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,153,263	2,525,645.97	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,855,485	2,430,685.35	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,283,473	1,553,002.33	
	PARAGON REIT	761,500	635,852.50	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	233,000	801,520.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	196,707.00	
STARHILL GLOBAL REIT	863,000	401,295.00		
SUNTEC REIT	1,320,500	1,399,730.00		
	シンガポールドル 小計	24,891,456	30,179,698.12 (3,427,206,518)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	95,592,400.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	86,720	373,763,200.00	
	JR REIT XXVII	95,683	386,559,320.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	121,696,905.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	223,963,200.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	50,602,365.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	46,380	279,207,600.00	
	SK REITS CO LTD	75,914	305,174,280.00	
	韓国ウォン 小計	445,799	1,836,559,270.00 (205,878,294)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	586,800.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,579,410.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	115,000	858,130.00	

	イスラエルシェケル 小計	578,500	3,024,340.00 (124,350,578)	
	合計	87,952,710	110,099,072,449 (110,099,072,449)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 138銘柄	100.0%	77.6%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.5%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	3.9%
イギリスポンド	投資証券 37銘柄	100.0%	5.0%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.4%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.1%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 新興国REITインデックス マザーファンド

##### 貸借対照表

	2024年 4月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	16,609,822
コール・ローン	1,102,884
投資証券	522,101,194
未収配当金	478,892
未収利息	2
流動資産合計	540,292,794
資産合計	540,292,794
負債の部	
流動負債	
未払解約金	563,276
流動負債合計	563,276
負債合計	563,276
純資産の部	



	2024年 4月22日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	619,682,840
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	79,953,322
元本等合計	539,729,518
純資産合計	539,729,518
負債純資産合計	540,292,794

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 4月22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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	619,682,840口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 79,953,322円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8710円 (1万口当たり純資産額) (8,710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

	2024年 4月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

	2024年 4月22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

	2024年 4月22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	2024年 4月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年10月21日
期首元本額	644,804,803円
期中追加設定元本額	41,578,367円
期中一部解約元本額	66,700,330円
期末元本額	619,682,840円
期末元本額の内訳	
S M T インデックスバランス・オープン	219,164,122円
S M T 新興国REITインデックス・オープン	400,518,718円

## ( 有価証券に関する注記 )

## 売買目的有価証券

	2024年 4月22日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	23,483,878
合計	23,483,878

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

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

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	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	271,800	7,102,134.00		
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	71,741	2,155,099.64		
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	73,400	3,081,332.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	66,813	4,509,877.50		
	メキシコペソ 小計			483,754	16,848,443.14 (152,801,900)	
	トルコリラ	AKFEN GAYRIMENKUL YATIRIM OR	179,000	392,010.00		
		AKIS GAYRIMENKUL YATIRIMI AS	39,000	629,850.00		
		ASCE GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	19,000	270,180.00		
		EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	162,152	1,452,881.92		
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	45,871	689,899.84		
		KIZILBUK GAYRIMENKUL YATIRIM	12,000	259,200.00		
		OZAK GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	43,000	355,610.00		
		PASIFIK GAYRIMENKUL YATIRIM	44,000	296,560.00		
		PEKER GAYRIMENKUL YATIRIM OR	33,830	266,242.10		
		REYSAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	13,000	413,920.00		
		SERVET GAYRIMENKUL YATIRIM O	920	286,120.00		
		SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	76,700	332,111.00		
		TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	13,720	649,779.20		
		YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	19,198	829,737.56		
	ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	86,420	585,927.60			
	トルコリラ 小計			787,811	7,710,029.22 (36,789,946)	
	香港ドル	CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	50,000	48,500.00		
		SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	50,000	111,500.00		
	香港ドル 小計			100,000	160,000.00 (3,161,600)	
	マレーシア リンギット	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	160,000	297,600.00		
		IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	156,700	286,761.00		
		PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	107,700	137,856.00		
SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT		191,200	290,624.00			
マレーシアリンギット 小計			615,600	1,012,841.00 (32,752,543)		
タイバーツ	BA AIRPORT LEASEHOLD REIT	78,300	779,085.00			
	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	165,600	1,771,920.00			
	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	238,700	2,387,000.00			
	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	60,200	728,420.00			
	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	147,600	1,948,320.00			
	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,800	1,511,520.00			

	タイパーツ 小計	851,200	9,126,265.00 (38,239,050)
フィリピン ペソ	AREIT INC	89,520	2,994,444.00
	MREIT INC	88,000	1,152,800.00
	RL COMMERCIAL REIT INC	362,700	1,817,127.00
	フィリピンペソ 小計	540,220	5,964,371.00 (16,028,054)
インドル ピー	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	25,151	6,414,259.53
	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	85,139	31,095,316.97
	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	20,572	7,037,475.48
	NEXUS SELECT TRUST	81,770	10,729,041.70
	インドルピー 小計	212,632	55,276,093.68 (103,366,295)
南アフリカ ランド	ATTACQ LTD	75,086	783,146.98
	BURSTONE GROUP LIMITED	58,843	402,486.12
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	23,614	224,333.00
	EQUITES PROPERTY FUND LTD	77,297	929,109.94
	FAIRVEST LTD-B	129,040	449,059.20
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	331,563	3,438,308.31
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	35,975	989,312.50
	REDEFINE PROPERTIES LTD	668,697	2,500,926.78
	RESILIENT REIT LTD	27,992	1,187,700.56
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	250,024	622,559.76
	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	43,727	572,823.70
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	84,295	1,229,864.05
		南アフリカランド 小計	1,806,153
サウジアラ ビアリアル	AL MAATHER REIT FUND	5,245	47,100.10
	AL RAJHI REIT	21,664	187,393.60
	ALAHLI REIT FUND 1	4,800	40,368.00
	ALINMA RETAIL REIT FUND	7,174	37,017.84
	ALKHABEER REIT	8,225	53,956.00
	BONYAN REIT	6,340	63,146.40
	DERAYAH REIT	10,061	72,338.59
	MUSHARAKA REIT FUND	6,364	34,620.16
	RIYAD REIT FUND	11,566	90,330.46
	SEDCO CAPITAL REIT FUND	14,489	126,633.86
		サウジアラビアリアル 小計	95,928
	合計	5,493,298	522,101,194 (522,101,194)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	投資証券 4銘柄	100.0%	29.3%
トルコリラ	投資証券 15銘柄	100.0%	7.0%
香港ドル	投資証券 2銘柄	100.0%	0.6%
マレーシアリングット	投資証券 4銘柄	100.0%	6.3%
タイバーツ	投資証券 6銘柄	100.0%	7.3%
フィリピンペソ	投資証券 3銘柄	100.0%	3.1%
インドルピー	投資証券 4銘柄	100.0%	19.8%
南アフリカランド	投資証券 12銘柄	100.0%	20.7%
サウジアラビアリアル	投資証券 10銘柄	100.0%	6.0%

(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

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT インデックスバランス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2024年 5月31日現在)

資産総額	3,113,720,350円
負債総額	3,582,943円
純資産総額( - )	3,110,137,407円
発行済口数	1,844,019,927口
1口当たり純資産額( / )	1.6866円
(1万口当たり純資産額)	(16,866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 5月31日現在)

資産総額	676,292,331,653円
負債総額	3,562,165,374円
純資産総額( - )	672,730,166,279円
発行済口数	233,711,588,157口
1口当たり純資産額( / )	2.8785円
(1万口当たり純資産額)	(28,785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 5月31日現在)

資産総額	679,108,109,537円
負債総額	17,008,208,595円
純資産総額( - )	662,099,900,942円
発行済口数	509,767,700,618口
1口当たり純資産額( / )	1.2988円
(1万口当たり純資産額)	(12,988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 5月31日現在)

資産総額	759,543,238,956円
負債総額	488,956,007円
純資産総額( - )	759,054,282,949円
発行済口数	115,583,494,242口

1口当たり純資産額（ / ）	6.5672円
（1万口当たり純資産額）	（65,672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 5月31日現在）

資産総額	347,126,149,032円
負債総額	90,221,799円
純資産総額（ - ）	347,035,927,233円
発行済口数	95,719,909,232口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6255円
（1万口当たり純資産額）	（36,255円）

### 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 5月31日現在）

資産総額	207,104,457,042円
負債総額	571,642,075円
純資産総額（ - ）	206,532,814,967円
発行済口数	45,322,122,090口
1口当たり純資産額（ / ）	4.5570円
（1万口当たり純資産額）	（45,570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 5月31日現在）

資産総額	147,668,914,380円
負債総額	33,287,043円
純資産総額（ - ）	147,635,627,337円
発行済口数	63,173,291,300口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3370円
（1万口当たり純資産額）	（23,370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 5月31日現在）

資産総額	124,867,902,220円
負債総額	434,552,303円
純資産総額（ - ）	124,433,349,917円
発行済口数	60,520,476,033口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0561円

（1万口当たり純資産額）	（20,561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 5月31日現在）

資産総額	118,105,110,659円
負債総額	78,572,642円
純資産総額（ - ）	118,026,538,017円
発行済口数	40,357,299,720口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9245円
（1万口当たり純資産額）	（29,245円）

## 新興国REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年 5月31日現在）

資産総額	553,853,457円
負債総額	23,971円
純資産総額（ - ）	553,829,486円
発行済口数	631,196,897口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8774円
（1万口当たり純資産額）	（8,774円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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



載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【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 5月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

[ DO（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立した運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2024年 7月22日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2024年 5月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	531	15,038,146
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	211,761
単体型公社債投資信託	51	169,872
合計	644	15,419,779

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。  
なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

( 単位：百万円 )

	前事業年度 ( 2023年3月31日 )	当事業年度 ( 2024年3月31日 )
負債の部		
流動負債		

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077

その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-

その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

## 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。

## (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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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23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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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  
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

## (リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8・ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

## 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価  
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債  
前事業年度（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)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
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。

当事業年度（2024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)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(\*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1,017百万円）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18,596百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）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、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(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

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

(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(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)
店頭	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。

当事業年度(2024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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	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) 株式関連

前事業年度(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。

当事業年度（2024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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(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（2023年3月31日）

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		1,729	-	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

当事業年度（2024年3月31日）

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		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

### (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項  
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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109百万円、当事業年度122百万円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		

			有価証券報告書(内国投資信託受益証券)	
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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、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 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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (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（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）

当事業年度（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

##### (1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

##### (3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

##### (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

##### (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

2024年7月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2023年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2023年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	11,757	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	38,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
SMB C日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
GMOクリック証券株式会社	4,346	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1)受託会社

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023年3月末日現在）

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

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

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年 1月19日	有価証券届出書
2024年 1月19日	有価証券報告書

**独立監査人の監査報告書**

2024年6月3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**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2024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

2024年7月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田信之  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT インデックスバランス・オープンの2023年10月21日から2024年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの2024年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。