

**【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10月28日提出
【計算期間】	第3期(自 2023年8月1日至 2024年7月31日)
【ファンド名】	日興FWS・日本株インデックス 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・日本債インデックス 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・Jリートインデックス 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり) 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし) 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり) 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)
【発行者名】	三井住友D S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 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	竹本 政司
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-0265
【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】

- イ 各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。  
各マザーファンドおよびベンチマークについては後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンド金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

## 商品分類表

## 日興FWS・日本株インデックス

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

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

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

(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。

日興FWS・日本債インデックス

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

(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。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

単体型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単体型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	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。

日興FWS・Jリートインデックス

単体型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単体型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	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。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

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

## 日興FWS・日本株インデックス

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		日経225
	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ( )	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)		その他 ( )
資産複合 ( )		エマージング		
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債 その他債 券	年12回(毎月)	アジア			
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイ インデックス (配当込み、円 ヘッジ換算ベ ース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイ・ インデックス (配当込み、円換 算ベース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (限定ヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債 その他債 券	年12回(毎月)	アジア			
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、株価指数先 物取引)資産配 分変更型))		中近東(中東)			その他 (MSCIエマージ ング・マーケット インデックス (配当込み、米ド ル円ヘッジ換算 ベース))
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。

## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル			
一般					
大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債					
券					
クレジット属	日々	オセアニア			TOPIX
性					
( )					
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
	( )	アフリカ			
その他資産					
(投資信託証券					
(資産複合(株					
式、株価指数先					
物取引)資産配					
分変更型))					
		中近東(中東)			その他
					(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))
資産複合		エマージング			
( )					
資産配分固					
定型					
資産配分変					
更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・日本債インデックス

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般				
大型株	年2回	日本		日経225
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ( )	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		アフリカ		
		中近東(中東)		その他 (NOMURA - BPI (総合))
資産複合 ( )		エマージング		
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債 その他債 券	年12回(毎月)	アジア			
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		中近東(中東)			その他 (FTSE世界国債 インデックス (除く日本、円ヘッ ジ換算ベース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		中近東(中東)			その他 (FTSE世界国債 インデックス (除く日本、円換 算ベース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

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
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 北米			日経225
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 その他 ( )	欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり (フルヘッジ) なし	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		中近東(中東)			その他 (JPモルガン・エ マージング・マー ケット・ボンド・イ ンデックス・プラス (円ヘッジ換算 ベース))
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。

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券 一般	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
公債	年12回(毎月)	アジア			
社債					
その他債 券					
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		中近東(中東)			その他 (JPモルガン・エ マージング・マー ケット・ボンド・イ ンデックス・プラス (円換算ベース))
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。

## 日興FWS・Jリートインデックス

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般				
大型株	年2回	日本		日経225
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性	日々	オセアニア		TOPIX
( )				
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
( )		アフリカ		
その他資産				
(投資信託証券				
(不動産投信))		中近東(中東)		その他
				(東証REIT指数(配
				当込み))
資産複合		エマージング		
( )				
資産配分固定				
型				
資産配分変更				
型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債 その他債 券	年12回(毎月)	アジア			
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))		中近東(中東)			その他 (S&P先進国 REIT指数 (除く日本、配当 込み、円ヘッジ換 算ベース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))		中近東(中東)			その他 (S&P先進国 REIT指数 (除く日本、配当 込み、円換算 ベース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

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
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債 券					
クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 商品)		中近東(中東)			その他 (LBMA金価格 (円ヘッジ換算 ベース))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

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
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般 公債 社債 その他債 券 クレジット属 性 ( )	年6回(隔月)	欧州			
	年12回(毎月)	アジア			TOPIX
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 商品)		中近東(中東)			その他 (LBMA金価格 円換算ベース)
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類および属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。

商品分類および属性区分の用語の定義については下記をご覧ください。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/>)でもご覧頂けます。

## 一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」

## 商品分類表定義

## 1. 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。

## 2. 投資対象地域による区分

- (1) 国内... 目論見書また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... 目論見書また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... 目論見書または投資信託約款において、国内およ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。

### 3. 投資対象資産(収益の源泉)による区分

(1) 株式... 目論見書また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... 目論見書また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)...

目論見書また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およ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... 目論見書また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... 目論見書また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。

### 4. 独立した区分

(1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2) MR F(マネー・リザーブ・ファンド)...

「MR F及びMMFの運営に関する規則」に定めるMR Fをいう。

(3) E T F... 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。

### 5. 補足分類

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

### 属性区分表定義

#### 1. 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すべてのものをいう。

大型株... 目論見書また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... 目論見書また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すべてのものをいう。

- 公債... 目論見書または投資信託約款において、日本国また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... 目論見書また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... 目論見書または投資信託約款において、公債また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...

目論見書また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... 組み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... 目論見書また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... 目論見書また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。

## 2. 決算頻度による属性区分

- 年1回... 目論見書また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。
- 年2回... 目論見書また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。
- 年4回... 目論見書また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。
- 年6回(隔月)... 目論見書また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。
- 年12回(毎月)... 目論見書また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。
- 日々... 目論見書また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。
- その他... 上記属性にあてはまらないすべてのものをいう。

## 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

- グローバル... 目論見書また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。
- 日本... 目論見書また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。
- 北米... 目論見書また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。
- 欧州... 目論見書また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。
- アジア... 目論見書また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。

- オセアニア... 目論見書また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。
- 中南米... 目論見書また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。
- アフリカ... 目論見書また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。
- 中近東(中東)... 目論見書また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。
- エマージング... 目論見書また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。

#### 4. 投資形態による属性区分

- ファミリーファンド... 目論見書また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。
- 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。

#### 5. 為替ヘッジによる属性区分

- 為替ヘッジあり... 目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまた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。
- 為替ヘッジなし... 目論見書また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または為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### 6. 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

- 日経225  
TOPIX  
その他の指数... 上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

#### 7. 特殊型

- ブル・ベア型... 目論見書また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・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動も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。
- 条件付運用型... 目論見書また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。
- ロング・ショート型/絶対収益追求型... 目論見書また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もしくはロング・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。
- その他型... 目論見書または投資信託約款において、上記 から 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。

#### (2) 【ファンドの沿革】

2021年8月3日 信託契約締結、設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

## イ 当ファンドの関係法人とその役割

## (イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

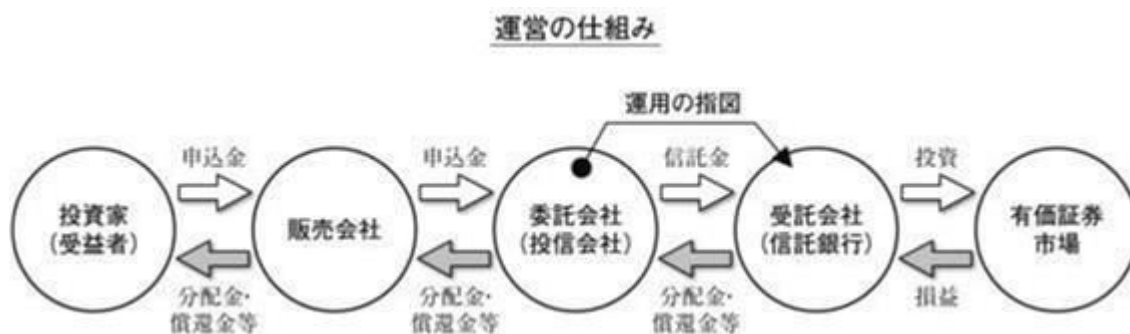
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

## (ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

## (ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。



## ロ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

20億円（2024年7月31日現在）

## (ロ) 会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

## (ハ) 大株主の状況

（2024年7月31日現在）

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1



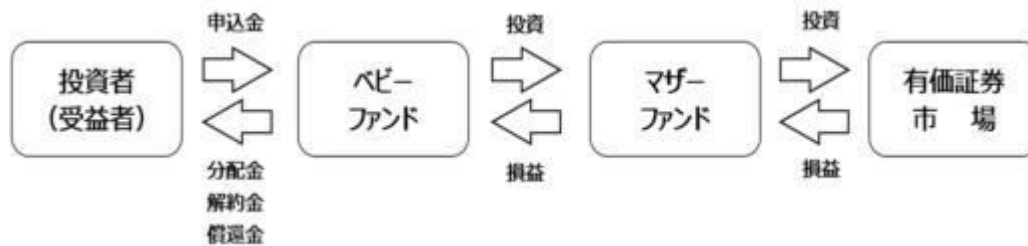
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 八 ファンドの運用形態

各ファンド(日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)を除く)

(ファミリーファンド方式による運用)

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。

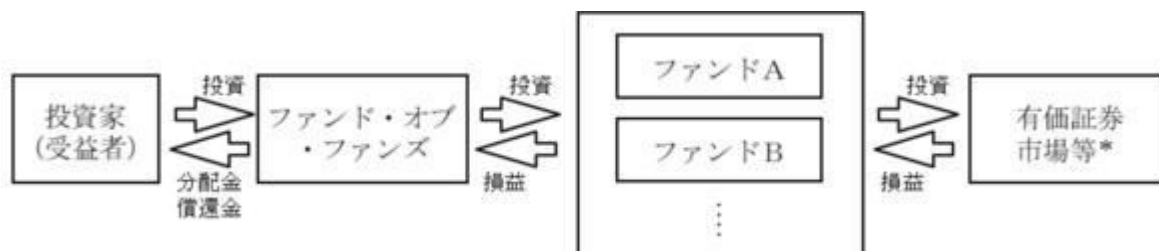


日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

(ファンド・オブ・ファンズによる運用)

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託(ファンド)を組み入れることにより運用を行います(投資信託に投資する投資信託)。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。



\*当ファンドにおいては金現物を含みます。

なお、当ファンドは、「ファミリーファンド方式」を採用しており、実際の他のファンドへの投資は、マザーファンドを通じて行います。

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ 基本方針

各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象

とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### □ 投資態度

##### 日興FWS・日本株インデックス

- (イ) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)への投資を通じて、主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資することにより、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) 外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことにより、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 外国株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資することにより、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指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 外国株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、実質組入外貨建資産について原則として米ドル売り円買いの為替取引を行うことにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として米ドル売り円買いの為替取引を活用し、為替変動リスクの低減を図ります。そのため、米ドル建て以外の通貨建資産については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式(預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資することにより、MSCIE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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・日本債インデックス

- (イ) 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・Jリートインデックス

- (イ) Jリート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・主として日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)に投資することにより、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
  - ・不動産投資信託(REIT)への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
  - ・ベンチマークとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引等を活用する場合があります。このため、不動産投資信託(REIT)の実質組入時価総額と不動産投信指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が純資産総額を超えることがあります。
- (ロ) Jリート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)等に投資し、実質組入外貨建資産については原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
  - ・不動産投資信託(REIT)等への投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)等に投資することにより、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
  - ・不動産投資信託(REIT)等への投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

- (イ) ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連

動を目指す投資信託証券に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、ロンドン貴金属市場協会(LBMA)金価格(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- (ロ) ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。
- (ハ) ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

- (イ) ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資することにより、ロンドン貴金属市場協会(LBMA)金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。
- (ハ) ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

**1** 「日興ファンドラップ セレクト インデックス・シリーズ」は、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産管理を行う口座の資金を運用するための専用ファンドです。

※「日興ファンドラップ セレクト インデックス・シリーズ」のご購入のお申込みには、販売会社のラップ口座の開設が必要です。

**2** 「日興ファンドラップ セレクト インデックス・シリーズ」は、複数ファンドで構成されており、各ファンドは投資対象とする各マザーファンドへの投資を通じて、実質的に投資対象とする資産に投資します。

※各マザーファンドおよび投資対象とする資産については後掲の「ファンドのしくみ」をご参照ください。

**3** 各ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

ファンド名	ベンチマーク
日本株インデックス	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
先進国株インデックスヘッジ有	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)
先進国株インデックスヘッジ無	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
新興国株インデックスヘッジ有	MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース)
新興国株インデックスヘッジ無	MSCIE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)
日本債インデックス	NOMURA-BPI(総合)
先進国債インデックスヘッジ有	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)
先進国債インデックスヘッジ無	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)
新興国債インデックスヘッジ有	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース)
新興国債インデックスヘッジ無	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)
Jリートインデックス	東証REIT指数(配当込み)
Gリートインデックスヘッジ有	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)
Gリートインデックスヘッジ無	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)
ゴールドヘッジ有	LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)
ゴールドヘッジ無	LBMA金価格(円換算ベース)

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。



## ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。

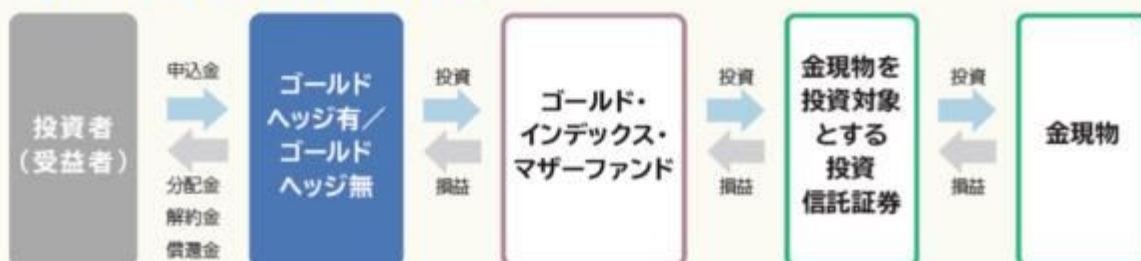
### ▶各ファンド(ゴールドヘッジ有、ゴールドヘッジ無を除く)



※上記における各ファンド、各マザーファンドおよび各投資対象資産は以下のとおりになります。

ファンド	マザーファンド	投資対象資産
日本株インデックス	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	日本の株式等
先進国株インデックスヘッジ有	外国株式インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の株式等
先進国株インデックスヘッジ無	外国株式インデックス・マザーファンド	
新興国株インデックスヘッジ有	エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国の株式および 株式指数先物取引等
新興国株インデックスヘッジ無	エマージング株式インデックス・マザーファンド	
日本債インデックス	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	日本の公社債等
先進国債インデックスヘッジ有	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の公社債等
先進国債インデックスヘッジ無	外国債券パッシブ・マザーファンド	
新興国債インデックスヘッジ有	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	新興国の公社債等
新興国債インデックスヘッジ無	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	
Jリートインデックス	Jリート・インデックス・マザーファンド	日本のリート等
Gリートインデックスヘッジ有	外国リート・インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域のリート等
Gリートインデックスヘッジ無	外国リート・インデックス・マザーファンド	

### ▶ゴールドヘッジ有、ゴールドヘッジ無



## 各ファンドの運用の基本方針等

## ▶ 国内株式

## 日本株インデックス

ベンチマーク TOPIX(東証株価指数、配当込み)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※株価指数先物取引等を利用することがあります。

## ▶ 先進国株式

## 先進国株インデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※株価指数先物取引等を利用することがあります。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。  
※一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。

## 先進国株インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※株価指数先物取引等を利用することがあります。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 新興国株式

## 新興国株インデックスヘッジ有・・・限定為替ヘッジ

ベンチマーク MSCIEマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式\*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
\*預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券等を含みます。  
※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- 実質組入外貨建資産については、原則として米ドル売り円買いの為替取引を行い、為替変動リスクの低減を図ります。  
※米ドル建て以外の通貨建資産については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。



**新興国株インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし**

ベンチマーク MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式\*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
\*預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。  
※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。



## 預託証券(DR)とは

Depository Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

## ▶ 国内債券

**日本債インデックス**

ベンチマーク NOMURA-BPI(総合)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

## ▶ 先進国債券

**先進国債インデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり**

ベンチマーク FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、マザーファンドにおいて、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。  
※完全に為替変動リスクを回避することはできません。

**先進国債インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし**

ベンチマーク FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 新興国債券

## 新興国債インデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。  
※完全に為替変動リスクを回避することはできません。

## 新興国債インデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 国内リート

## Jリートインデックス

ベンチマーク 東証REIT指数(配当込み)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※不動産投信指数先物取引等を利用することがあります。

## ▶ 外国リート

## Gリートインデックスヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク S&amp;P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。  
※一部の通貨建資産については為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。

## Gリートインデックスヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク S&amp;P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。



## ▶ 金

## ゴールドヘッジ有・・・為替ヘッジあり

ベンチマーク LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>* マザーファンドが投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。</li> <li>※ 実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。</li> <li>● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。</li> <li>※ 完全に為替変動リスクを回避することはできません。</li> </ul>
---------	--

## ゴールドヘッジ無・・・為替ヘッジなし

ベンチマーク LBMA金価格(円換算ベース)

運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>* マザーファンドが投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。</li> <li>※ 実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。</li> <li>● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> <li>※ 基準価額は為替変動の影響を受けます。</li> </ul>
---------	---

## ■ ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

以下は、2024年7月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

ファンド名	iShares Gold Trust (iシェアーズ ゴールド・トラスト)	SPDR Gold MiniShares Trust (SPDR* ゴールド・ミニシェアーズ・トラスト)
形態	米国籍上場投資信託(米ドル建て)	米国籍上場投資信託(米ドル建て)
管理会社	iShares デラウェア・トラスト・スポンサー・ エルエルシー	WGC USAアセット・マネジメント・カンパニー・ エルエルシー
運用の基本方針	金地金価格の変動に概ね連動することを目標とします。	金地金の価格のパフォーマンスを反映させることを目標とします。
ベンチマーク	LBMA金価格	LBMA金価格
管理費用*1	年0.25%	年0.10%
購入の可否*2	日本において一般投資者の購入が可能です。	日本において一般投資者の購入が可能です。

\*1 管理費用とは各上場投資信託(以下「ETF」といいます。)の運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

\*2 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

## 為替の影響について

### ▶ 為替ヘッジあり

為替ヘッジあり\*

為替変動の影響は限定的

\*為替ヘッジコストがかかります。



為替ヘッジ

為替取引等を利用し、為替変動リスクを低減することです。

- 外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行う場合、基準価額への為替変動の影響は小さくなると考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。

### ▶ 限定為替ヘッジ



外貨建資産とほぼ同額程度の  
米ドル売り円買いの為替取引

為替取引後

米ドル建て資産

為替変動リスクは  
低減されます。

米ドル建て以外の資産

米ドルに対する組入通貨の  
為替変動の影響を受けます。

- 原則として外貨建資産とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行い、対円での為替変動リスクの低減を図ります。なお、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

(注) 左記は、限定為替ヘッジについて理解を深めていただくためのイメージです。

### ▶ 為替ヘッジなし

為替ヘッジなし

円安の場合(為替差益)  
基準価額にプラス

円高の場合(為替差損)  
基準価額にマイナス

- 外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行わない場合、基準価額は為替変動の影響を受けます。

## 各ファンドの運用プロセス



\*ユニバースの決定を行わないファンドもあります。

## [ポートフォリオの構築手法]

構築手法	ファンド名
最適化法	日本株インデックス、先進国株インデックスヘッジ有、先進国株インデックスヘッジ無、新興国株インデックスヘッジ有、新興国株インデックスヘッジ無
層化抽出法	日本債インデックス、先進国債インデックスヘッジ有、先進国債インデックスヘッジ無、新興国債インデックスヘッジ有、新興国債インデックスヘッジ無
完全法	Jリートインデックス、Gリートインデックスヘッジ有、Gリートインデックスヘッジ無



## 最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように、インデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

## 層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出して構成銘柄を選択し、ポートフォリオを構築する方法です。

## 完全法とは

指数を構成するすべての銘柄について、その時価構成比率に合わせて保有し、ポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

※ゴールドヘッジ有およびゴールドヘッジ無については、金現物に投資する投資信託証券への投資により、インデックスの動きへの連動を目指した運用を行います。



## 追加的記載事項

### ●各ファンドがベンチマークとする指数の著作権等について

#### <日本株インデックス、Jリートインデックス>

- TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPIX総研または株式会社JPIX総研の関連会社(以下「JPIX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIX、東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPIXが有します。
- JPIXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX、東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- JPIXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX、東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- JPIXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPIXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、JPIXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- JPIXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- JPIXは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、JPIXは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

#### <先進国株インデックスヘッジ有、先進国株インデックスヘッジ無、新興国株インデックスヘッジ有、新興国株インデックスヘッジ無>

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)は、MSCI INC.(以下「MSCI」)が公表する指数(MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス)を基に委託会社が換算したものです。

当ファンドは、MSCI、その関連会社、情報提供会社またはMSCI INDEXの編集または計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」といいます。)が支援、保証、売却または宣伝するものではありません。

MSCI INDEXは、MSCIの専有財産です。

MSCIおよびMSCI INDEXの名称は、MSCIもしくはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のための使用について許可されているものです。

いかなるMSCI当事者も、委託会社、受益者、またはその他の個人もしくは事業体に対して、ファンド投資一般、当ファンドへの投資、もしくはMSCI INDEXが対応する株式市場パフォーマンスを記録する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明または保証を行いません。

MSCIもしくは関連会社は、当ファンド、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体とは無関係にMSCIが決定、構成、計算するMSCI INDEXに関する特定の商標、サービスマーク、商号のライセンサーです。

いかなるMSCI当事者も、MSCI INDEXについて決定、構成または計算するにあたり、委託会社または受益者、またはその他のあらゆる個人または事業体のニーズを考慮する義務を負いません。

いかなるMSCI当事者も、当ファンドの発行時期、価格、数量に関する決定、当ファンドの償還価格および数式の決定および算定に参加しておらず、かつその責任を負いません。

さらに、いかなるMSCI当事者も、当ファンドの運営、マーケティング、またはオフリングに関連して、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体に対して一切の義務または責任を負いません。

MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI INDEXの算出に使用するための情報を入手するものとしませんが、いずれのMSCI当事者も、MSCI INDEXまたはそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。

MSCI当事者は、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体がMSCI INDEXもしくはそのデータを使用して得る情報またはその結果に関して、明示・黙示の保証をしません。

MSCI当事者は、MSCI INDEXもしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示・黙示の保証責任も負わず、MSCI INDEXもしくはそのデータに関して、商品性および特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなるMSCI当事者も、直接、間接、特別、懲罰的、結果的な損害、およびその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

#### <日本債インデックス>

NOMURA-BPIIに関する一切の知的財産権その他の一切の権利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ております。また、同社はファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

#### <先進国債インデックスヘッジ有、先進国債インデックスヘッジ無>

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース/円換算ベース）は、FTSE Fixed Income LLCが公表する指数（FTSE世界国債インデックス）を基に委託会社が換算したものです。

FTSE世界国債インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLC に帰属します。同社は、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、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、同社は、当該データの正確性および完全性を保証せず、データの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。また、同社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

#### <新興国債インデックスヘッジ有、新興国債インデックスヘッジ無>

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジ換算ベース/円換算ベース）は、J.P. Morgan・セキュリティーズ・エルエルシーが公表する指数（JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス）を基に委託会社が換算したものです。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスは、信頼できるとされる情報に基づいて作成していますが、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。委託会社は同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なく同インデックスを複製・使用・頒布することは禁じられています。また、J.P. Morganは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

Copyright © 2021, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.



**<Gリートインデックスヘッジ有、Gリートインデックスヘッジ無>**

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表する指数(S&P先進国REIT指数)を基に委託会社が換算したものです。

S&P先進国REIT指数は、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(以下「SPDJ」といいます。)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、Standard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」といいます。)の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」といいます。)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」といいます。)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesおよび委託会社との間にある唯一の関係は、同インデックスとS&P Dow Jones Indicesおよび/またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は委託会社に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において委託会社および当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格および数量、または当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

**<ゴールドヘッジ有、ゴールドヘッジ無>**

LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース/円換算ベース)は、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)が公表する指数(LBMA金価格)を基に委託会社が換算したものです。

LBMA金価格はICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドが算出し公表している指数であり、同社は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

**(2)【投資対象】****イ 投資対象とする資産の種類**

- 日興FWS・日本株インデックス
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・日本債インデックス
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)



日興FWS・Jリートインデックス

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

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(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
4. 金銭債権

(ロ)特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

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(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
3. 金銭債権

(ロ)特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

#### ロ 投資対象とする有価証券

日興FWS・日本株インデックス

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・日本債インデックス

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

委託会社は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券または次の有価証券(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. 株券または新株引受権証券
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と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かかる優先出資証券(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また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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1

項第13号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー
  12. 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。)および新株予約権証券
  13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託また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。)
  15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(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。次号において同じ。)で次号に定めるもの以外のもの
  16. 投資法人債券(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。以下本号において同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  17. 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。)
  18. オプションを表示する証券または証書(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、有価証券にかかるものに限ります。)
  19. 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。)
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
  22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
  23. 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。)
- なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券また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号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

#### 日興FWS・Jリートインデックス

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(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. 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および社債券(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および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 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。)
5. 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。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができるものとします。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(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. 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および社債券(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および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託また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。)
5. 投資証券または外国投資証券(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。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができます。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## 八 投資対象とする金融商品

- 日興FWS・日本株インデックス
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・日本債インデックス
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

委託会社は、信託金を、上記口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

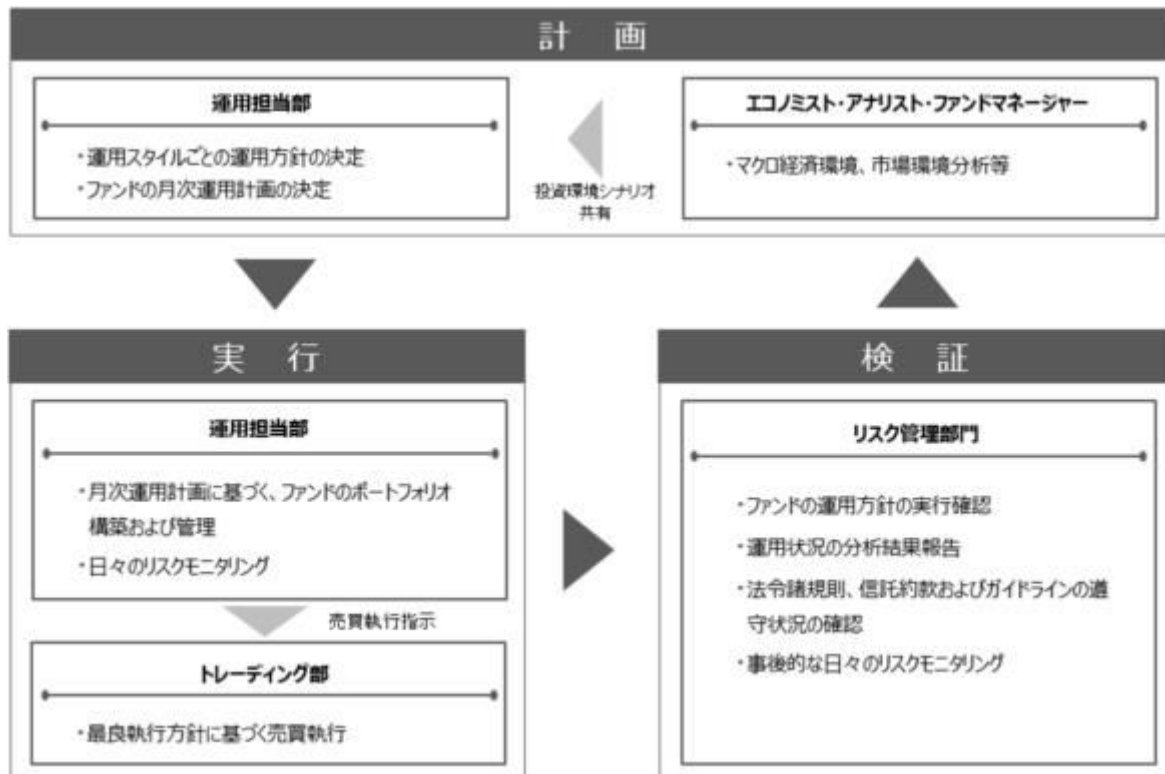
- 日興FWS・Jリートインデックス
- 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)
- 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)
- 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

委託会社は、信託金を、上記口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

## (3) 【運用体制】

## イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

## ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

## (4) 【分配方針】

年1回（原則として毎年7月31日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、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。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。  
（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

## (5) 【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限  
日興FWS・日本株インデックス

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)

- ロ 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・日本債インデックス

- イ 株式への投資は、転換社債の転換、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ロ 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ロ 国債を除く同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ロ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・Jリートインデックス

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 株式への投資は行いません。
- ハ 外貨建資産への投資は行いません。
- ニ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 株式への投資は行いません。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

日興FWS・日本株インデックス

- イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

#### ロ 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、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券およ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)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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。

#### ハ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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り扱うものとします(以下同じ。 )。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利また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。 )を行うことの指図を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) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち

信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 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。

#### ヘ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利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が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利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。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
  1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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)の各号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、有価証券の貸付け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。

#### チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。



できるものとしします。

- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとしします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が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けの一部を決済するための指図をするものとしします。

#### リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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するものとしします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとしします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券の一部を返還するための指図をするものとしします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ヌ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。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します。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額としします。
  1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は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します。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

#### ロ 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、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所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します。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券およ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)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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。

#### 八 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまた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、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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り扱うものとします(以下同じ。 )。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。 )を行うことの指図を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) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

- (ヘ) 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。
- ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図
- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引およ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が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引およ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。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- (リ)「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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)の各号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、有価証券の貸付け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。

#### チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡また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)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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するものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ヌ 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、日本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。

#### ル 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産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)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド

の時価総額にマザーファンドの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。

#### ヲ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 日興FWS・日本債インデックス

##### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

##### ロ 投資する株式等の範囲

委託会社が投資することを指図する株式は、転換社債の転換、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権の行使による取得に限り、日本の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

#### ハ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまた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、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号

イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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り扱うものとします(以下同じ。 )。

- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利また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。 )を行うことの指図を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) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 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。

#### ヘ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利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が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利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。

(ト)「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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)の各号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、有価証券の貸付け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。

#### チ 有価証券の空売りの指図

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまた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)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ)信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### リ 有価証券の借入れの指図

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ)信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ヌ 資金の借入れ

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

(ロ)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定し



ている資金の額の範囲内

2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

(八) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は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、信託財産中から支弁します。

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）

日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

#### ロ 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、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券およ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)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場また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。

#### ハ 同一発行体の発行する公社債への投資制限

(イ) 委託会社は、信託財産に属する同一の発行体にかかる公社債（日本および外国の国債証券を除きます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一発行体にかかる公社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

(ロ) 上記(イ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### ニ 信用取引の指図

(イ) 委託会社は、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、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### ホ 先物取引等の指図

(イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図を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



取り扱うものとし(以下同じ。)

- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ヘ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。)を行うことの指図を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(以下「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。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) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし(以下「スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が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スワップ取引の一部の解約を指図するものとし。)
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとし(以下「スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとし。)
- (ヘ) 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(以下「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。)

#### ト 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引およ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(以下「金利先渡取引、為替先渡取引およ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。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。)
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が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金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとし。)
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額に

マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引およ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。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

#### チ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
  1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、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。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、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)の各号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、有価証券の貸付け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。

#### リ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が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けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### ヌ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券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するものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が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有価証券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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ル 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、日本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。

#### ロ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産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) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの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。

#### ワ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

## イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

## ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、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するものとします。
  - (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
  - (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が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。
- (二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

## ハ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## 二 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  - (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
    - 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
    - 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
    - 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
  - (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、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、信託財産中から支弁します。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

## イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、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。

## ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、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するものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が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。

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ハ 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、日本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。

#### ニ 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの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。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### ホ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ヘ 資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

(ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

#### イ 公社債の借入れの指図

(イ) 委託会社は、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られたときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が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)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ロ 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、日本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。

## 八 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの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。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

### 二 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

### 法令に基づく投資制限

- イ 同一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第9条）  
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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）  
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）  
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

## (国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

## (1)投資方針等

## イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

(イ)主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ)株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(ハ)株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

## (2)投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2)投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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、かつ本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

5. 投資信託また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。)

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2)投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・日本株インデックスが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

## (3)投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ)外貨建資産への投資は行いません。

(ロ)株式への投資割合には制限を設けません。

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

(ニ)デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

## (1)投資方針等

## イ 基本方針

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、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指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- （イ）主として世界各国の株式に投資し、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指して運用を行います。
- （ロ）外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- （ハ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## （２）投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．特別の法律により法人の発行する債券
- ４．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（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。）
- ５．コマーシャル・ペーパー
- ６．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。）および新株予約権証券
- ７．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- ８．投資信託また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。）
- ９．投資証券または外国投資証券（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。）
- １０．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。）
- １１．オプションを表示する証券または証書（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。）
- １２．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。）
- １３．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- １４．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。）
- １５．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
- １６．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

### ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）および日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）が投資対象とする金融商品に同じです。

## （３）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限



- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- (ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。
- (ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

## (エマージング株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

M S C I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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として新興国の株式(預託証券(D R)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、M S C I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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

#### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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. 株券または新株引受権証券
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と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. 特定目的会社にかかる特定社債券(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かかる優先出資証券(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. 特定目的会社にかかる優先出資証券また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。)および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託また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または外国投資証券(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または証書(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、有価証券にかかるものに限ります。)
  17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  20. 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
  21. 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
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

- イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限
- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
  - (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
  - (ハ) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - (ニ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
  - (ヘ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。
  - (ト) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

### (国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

日本の公社債を中心に投資し、安定した利子等収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

## □ 投資態度

- (イ) 主として日本の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 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およ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日本の有価証券先物取引、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および金利に係るオプション取引と類似の取引（「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです（為替手形を除きます。）。

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 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を除きます。）
5. 特定目的会社にかかる特定社債券（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。）
- 5の2. 投資法人債券（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。）
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
8. オプションを表示する証券または証書（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、有価証券にかかるものに限ります。）
9. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・日本債インデックスが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は行いません。
- (ロ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

## イ 基本方針

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指した運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## ( 2 ) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 ( 2 ) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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. 株券または新株引受権証券
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と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. 特定目的会社にかかる特定社債券（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かかる優先出資証券（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. 特定目的会社にかかる優先出資証券また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。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託また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. 投資証券または外国投資証券（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または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

- 17. 預託証券(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券
- 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 20. 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
- 21. 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

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)が投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

##### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。 )への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ホ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (チ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。 )は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。
- (リ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

#### (外国債券パッシブ・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指した運用を行います。

##### ロ 投資態度

- (イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運

用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券と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. 特定目的会社にかかる特定社債券(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かかる優先出資証券(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. 特定目的会社にかかる優先出資証券また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。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託また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. 投資証券または外国投資証券(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または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 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
21. 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

### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

## (米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ハ) 公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ホ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5で定めるものをいいます。)は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする資産の種類に同じです。

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

#### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ハ) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### (Jリート・インデックス・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)されている不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- (イ) 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 不動産投資信託(REIT)への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 東証REIT指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証REIT指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (2) 投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

##### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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. 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および社債券(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および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 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。)
5. 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。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

##### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・Jリートインデックスが投資対象とする金融商品に同じです。



### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- （ロ）株式への投資は行いません。
- （ハ）外貨建資産への投資は行いません。
- （ニ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- （ホ）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

### （外国リート・インデックス・マザーファンド）

#### （１）投資方針等

##### イ 基本方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託（REIT）などを主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- （イ）S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- （ロ）不動産投資信託（REIT）などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数（除く日本）採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
- （ハ）不動産投資信託（REIT）の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ニ）外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。
- （ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### （２）投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針（２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです（デリバティブ取引にかかる権利を除きます。）。

##### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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. 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および社債券（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および短期社債等を除きます。）
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託また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。）
5. 投資証券または外国投資証券（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。）
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

##### ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興F

WS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)および日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

### (ゴールド・インデックス・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

イ 基本方針

L B M A金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資することにより、ロンドン貴金属市場協会(L B M A)金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券とは、下記のものとします。

iShares Gold Trust  
SPDR Gold MiniShares Trust

(ロ) 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)が投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)が投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)および日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)が投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

- (二) 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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。したがって、投資者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。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

各ファンドの主要なリスクは以下の通りです。内容につきましては、後掲をご覧ください。

ファンド名	価格変動リスク				信用 リスク	為替変動リスク			カントリー リスク	流動性 リスク
	株式市場 リスク	債券市場 リスク	不動産 投資信託 (リート) に関する リスク	金に 関する リスク		為替 ヘッジ あり	限定 為替 ヘッジ	為替 ヘッジ なし		
日本株インデックス	●				●					●
先進国株インデックス ヘッジ有	●				●	●			●	●
先進国株インデックス ヘッジ無	●				●			●	●	●
新興国株インデックス ヘッジ有	●				●		●		●	●
新興国株インデックス ヘッジ無	●				●			●	●	●
日本債インデックス		●			●					●
先進国債インデックス ヘッジ有		●			●	●			●	●
先進国債インデックス ヘッジ無		●			●			●	●	●
新興国債インデックス ヘッジ有		●			●	●			●	●
新興国債インデックス ヘッジ無		●			●			●	●	●
Jリートインデックス			●		●					●
Gリートインデックス ヘッジ有			●		●	●			●	●
Gリートインデックス ヘッジ無			●		●			●	●	●
ゴールドヘッジ有				●	●	●			●	●
ゴールドヘッジ無				●	●			●	●	●

#### (イ) 株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (ロ) 債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、債券の種類や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

#### (ハ) 不動産投資信託（リート）に関するリスク

リーートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値や賃貸収入、個々のリーートの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリーートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (ニ) 金に関するリスク

ファンドは金の指標価格に連動することを目指した上場投資信託証券に投資します。一般に、金価

格は、金の需給の変化や為替・金利動向等の様々な要因の影響を受けて変動します。金価格が下落した場合、組入上場投資信託証券の価格も下がり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 為替変動リスク

(為替ヘッジあり)

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する(円高となる)場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

原則として対円で為替ヘッジを行うため為替の変動による影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、「先進国株インデックスヘッジ有」および「Gリートインデックスヘッジ有」については、一部の通貨建資産について為替ヘッジが困難等と判断された場合、他の通貨で代替した為替取引を行うことまたは為替ヘッジを行わないことがあります。

(限定為替ヘッジ)

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する(円高となる)場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

「新興国株インデックスヘッジ有」については、外貨建資産とほぼ同額程度の米ドル売り円買いの為替取引を行います。したがって、米ドル建て資産については、為替の変動による影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。また、実質的な通貨配分にかかわらず、米ドル売り円買いの為替取引を行うため、米ドル以外の組入通貨については、米ドルに対する当該通貨の為替変動の影響を受けます。

なお、円金利が米ドルの金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。

(為替ヘッジなし)

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する(円高となる)場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

(ト) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(チ) 流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

なお、海外の取引所によっては、長期間にわたる個別銘柄の売買停止措置がとられることがあり、そのような場合には一般社団法人投資信託協会規則もしくは委託会社の社内ルールに従って、当該有価証券の評価を行います。

(リ) 対象インデックスの動きと連動しない要因

各ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。以下の要因等により、各対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること
- ・「ゴールドヘッジ有」および「ゴールドヘッジ無」は、金の指標価格と当該指標との連動を目指した上場投資信託証券の取引価格の動きに不一致が生じること

(ヌ) 外国税制に関する留意点

投資対象国によっては、有価証券の売買を行う際の売買益等に対して課税される場合があります。将来、これらの税率や課税方法が変更された場合、または新たな税制が適用された場合、基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ル) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ロ) 換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や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、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ワ) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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およ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、分配金の一部または全部が、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。

ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会

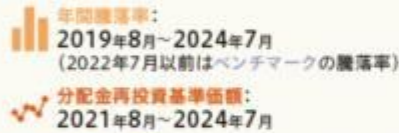


議に報告します。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

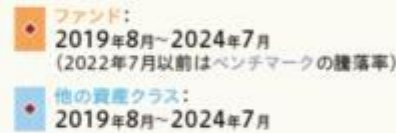
### ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

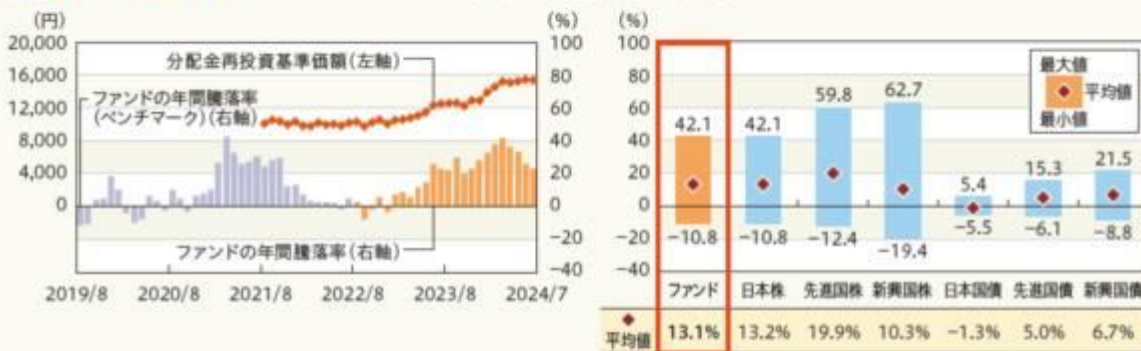


### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



#### ■日本株インデックス (ベンチマーク: TOPIX (東証株価指数、配当込み))



#### ■先進国株インデックスヘッジ有 (ベンチマーク: MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ヘッジ換算ベース))



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

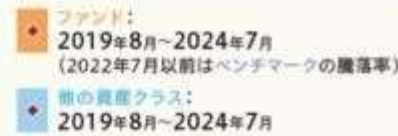
## 【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



## 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■先進国株インデックスヘッジ無 (ベンチマーク:MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース))



### ■新興国株インデックスヘッジ有 (ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、米ドル円ヘッジ換算ベース))



### ■新興国株インデックスヘッジ無 (ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース))



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

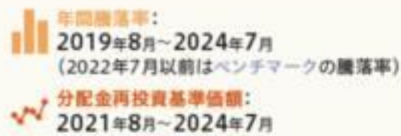
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移



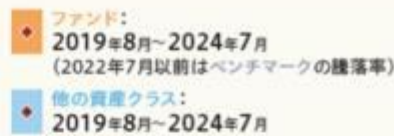
各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



## ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■日本債インデックス (ベンチマーク：NOMURA-BPI (総合))



### ■先進国債インデックスヘッジ有 (ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ換算ベース))



### ■先進国債インデックスヘッジ無 (ベンチマーク：FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース))



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

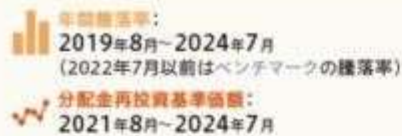
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

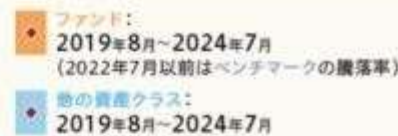
## 〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

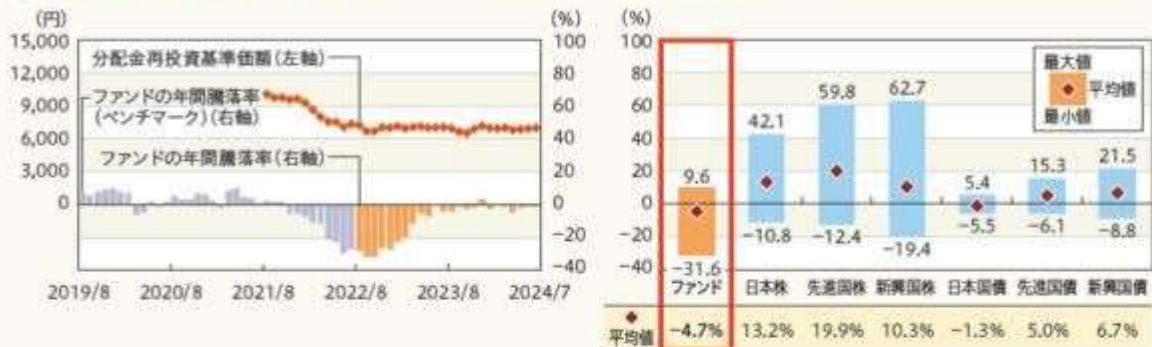


## 〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■新興国債インデックスヘッジ有(ベンチマーク：JPモルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース))



### ■新興国債インデックスヘッジ無(ベンチマーク：JPモルガン・エマーシング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース))



### ■Jリートインデックス(ベンチマーク：東証REIT指数(配当込み))



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



## ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■グリーントインデックスヘッジ有(ベンチマーク：S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース))



### ■グリーントインデックスヘッジ無(ベンチマーク：S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))



### ■ゴールドヘッジ有(ベンチマーク：LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))



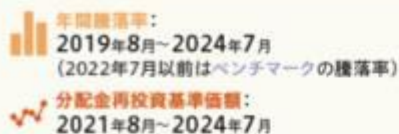
※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕



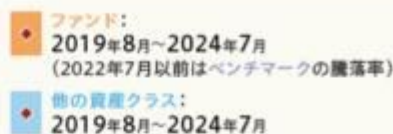
各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



## 〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕



ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■ゴールドヘッジ無（ベンチマーク：LBMA金価格（円換算ベース））



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 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指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	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・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。  
※上記各指数に関する知的財産権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

ありません。

### (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

### (3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド名	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
日本株インデックス	年0.121% （税抜き0.11%）	年0.06%	年0.03%	年0.02%
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	年0.121% （税抜き0.11%）	年0.06%	年0.03%	年0.02%
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	年0.198% （税抜き0.18%）	年0.13%	年0.03%	年0.02%
日本債インデックス	年0.11% （税抜き0.1%）	年0.055%	年0.025%	年0.02%
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	年0.121% （税抜き0.11%）	年0.06%	年0.03%	年0.02%
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	年0.198% （税抜き0.18%）	年0.13%	年0.03%	年0.02%
Jリートインデックス	年0.1375% （税抜き0.125%）	年0.075%	年0.03%	年0.02%
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	年0.154% （税抜き0.14%）	年0.09%	年0.03%	年0.02%
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	年0.198% （税抜き0.18%）	年0.13%	年0.03%	年0.02%
マザーファンドが投資対象とする投資信託	年0.25%程度*			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.448%（税抜き0.43%）程度*			
<p>* 投資対象とする投資信託の運用管理費用は、管理費用が最大の投資信託の数値を用いています。なお、管理費用は、今後変更される場合があります。また、実際の組入状況等により実質的な負担も変動します。</p> <p>上記の料率は、2024年7月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。</p> <p>投資対象とする投資信託の変更等に伴い、実質的な負担が変更となる場合があります。</p>				

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	交付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	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

#### （４）【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、「新興国債インデックスヘッジ有」、「新興国債インデックスヘッジ無」、「ゴールドヘッジ有」および「ゴールドヘッジ無」は各計算期末または信託終了のときに、その他のファンドは毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管

等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなるものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額等を具体的に記載することはできません。

リートを実質的な主要投資対象とするファンドでは、株式と同様に取引所等の市場で売買される多数の銘柄のリートの中から、約款上の選定基準に従って適宜組入銘柄を選定して分散投資を行い、また売却を行いますので、組み入れるリートの銘柄や構成比は流動的となります。

リートの多くは法人形態をとっており、その費用には、運用者等に支払う費用以外に、一般の会社と同じように多種多様なものがあり、また、国・地域によっては、開示する項目の基準が異なります。

したがって、委託会社において、ファンドが実質的に組み入れる様々なリートの費用等を網羅的に調査し、ファンドへの投資等のための参考になるような情報として、その上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等および投資対象のリートの組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

#### (5)【課税上の取扱い】

##### イ 個別元本について

(イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかか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)にあたります。

(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。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

(ハ) 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(収益分配金の課税について)を参照。)

##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

##### ハ 収益分配金の課税について

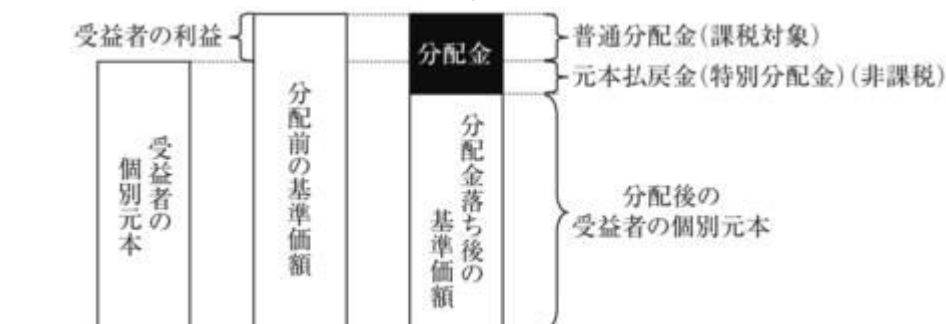
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

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また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ます。





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。なお、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。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

### (ロ) 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ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、「日本株インデックス」は、配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。その他のファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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。



課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等に確認されることをお勧めいたします。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年7月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

### （参考情報）総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2022年8月2日～2023年7月31日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
日本株インデックス	0.13%	0.12%	0.01%
先進国株インデックスヘッジ有	0.16%	0.12%	0.04%
先進国株インデックスヘッジ無	0.16%	0.12%	0.04%
新興国株インデックスヘッジ有	0.31%	0.20%	0.11%
新興国株インデックスヘッジ無	0.31%	0.20%	0.11%
日本債インデックス	0.11%	0.11%	0.00%
先進国債インデックスヘッジ有	0.19%	0.12%	0.07%
先進国債インデックスヘッジ無	0.16%	0.12%	0.04%
新興国債インデックスヘッジ有	0.23%	0.20%	0.03%
新興国債インデックスヘッジ無	0.23%	0.20%	0.03%
Jリートインデックス	0.14%	0.14%	0.01%
Gリートインデックスヘッジ有	0.21%	0.15%	0.06%
Gリートインデックスヘッジ無	0.21%	0.15%	0.06%
ゴールドヘッジ有	0.38%	0.20%	0.18%
ゴールドヘッジ無	0.38%	0.20%	0.18%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。)です。

※当ファンド(ゴールドヘッジ有およびゴールドヘッジ無を除く)が上場投資信託(ETF)および上場不動産投資信託(REIT)に投資している場合、当該ETFおよびREITの管理費用等は含まれていません。ゴールドヘッジ有およびゴールドヘッジ無は、投資しているETFの費用は、その他費用に含めています。

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

運用報告書は、委託会社のホームページ(<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>)から検索いただけます。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

日興FWS・日本株インデックス

2024年7月31日現在

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	13,574,735,299	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	7,340,611	0.05
合計(純資産総額)		13,567,394,688	100.00

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

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,396,299,523	95.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	61,637,155	4.23
合計(純資産総額)		1,457,936,678	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	1,435,957,689	98.49

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

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	32,589,122,432	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	17,961,850	0.06
合計(純資産総額)		32,571,160,582	100.00

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

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	871,319,282	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	36,542,483	4.03
合計(純資産総額)		907,861,765	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	899,144,729	99.04

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

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	9,438,570,921	100.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	8,548,213	0.09
合計(純資産総額)		9,430,022,708	100.00

日興FWS・日本債インデックス

2024年7月31日現在

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	20,590,663,238	100.05

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	10,022,155	0.05
合計(純資産総額)		20,580,641,083	100.00

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

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	410,101,393	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	256,449	0.06
合計(純資産総額)		409,844,944	100.00

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

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	10,040,524,428	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	5,442,301	0.05
合計(純資産総額)		10,035,082,127	100.00

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

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	308,952,288	96.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	10,173,951	3.19
合計(純資産総額)		319,126,239	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	-	7,599,000	2.38
為替予約取引	売建	-	313,078,800	98.11

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

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	8,202,873,415	99.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	39,590,382	0.48
合計(純資産総額)		8,242,463,797	100.00

## 日興FWS・Jリートインデックス

2024年7月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,796,618,301	100.06
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,706,657	0.06
合計（純資産総額）		2,794,911,644	100.00

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

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	203,636,640	95.74
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,050,324	4.26
合計（純資産総額）		212,686,964	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	207,970,631	97.78

日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）

2024年7月31日現在

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	3,901,404,589	100.07
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,582,054	0.07
合計（純資産総額）		3,898,822,535	100.00

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

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	339,754,759	96.62
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	11,896,493	3.38
合計（純資産総額）		351,651,252	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	-	22,007,085	6.26
為替予約取引	売建	-	351,658,041	100.00

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

2024年7月31日現在

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	10,723,318,671	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	81,046	0.00
合計(純資産総額)		10,723,399,717	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

日興FWS・日本株インデックス

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
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 (B号)	2,723,061,784	4.2521	11,578,805,966	4.9851	13,574,735,299	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05
合計	100.05

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	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	151,969,909	7.3578	1,118,158,331	9.1880	1,396,299,523	95.77

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.77
合計	95.77

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	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	3,546,922,337	7.6952	27,294,292,996	9.1880	32,589,122,432	100.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	412,205,167	1.8749	772,852,940	2.1138	871,319,282	95.97

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	95.97
合計	95.97

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	4,465,214,742	1.9029	8,496,992,113	2.1138	9,438,570,921	100.09

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.09
合計	100.09

## 日興FWS・日本債インデックス

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	15,780,704,505	1.3407	21,157,124,151	1.3048	20,590,663,238	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.05
合計	100.05

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	336,645,373	1.2293	413,836,412	1.2182	410,101,393	100.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在



国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	4,343,726,770	2.1472	9,326,732,076	2.3115	10,040,524,428	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.05
合計	100.05

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	274,673,087	0.9948	273,231,273	1.1248	308,952,288	96.81

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	96.81
合計	96.81

日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）

イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	7,292,739,523	1.0199	7,437,980,389	1.1248	8,202,873,415	99.52

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率 (%)
----	----------

親投資信託受益証券	99.52
合計	99.52

## 日興FWS・Jリートインデックス

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	1,098,306,681	2.6125	2,869,363,331	2.5463	2,796,618,301	100.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	57,305,935	2.9873	171,188,214	3.5535	203,636,640	95.74

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.74
合計	95.74

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

## イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	1,097,904,767	3.0510	3,349,691,004	3.5535	3,901,404,589	100.07

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.07
合計	100.07

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	191,249,513	1.3662	261,287,790	1.7765	339,754,759	96.62

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	96.62
合計	96.62

日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	6,036,205,275	1.4261	8,607,954,771	1.7765	10,723,318,671	100.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

【投資不動産物件】

日興FWS・日本株インデックス

該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)  
該当事項はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)  
該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)  
該当事項はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)  
該当事項はありません。

日興FWS・日本債インデックス  
該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)  
該当事項はありません。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)  
該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)  
該当事項はありません。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)  
該当事項はありません。

日興FWS・Jリートインデックス  
該当事項はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)  
該当事項はありません。

## 日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

## 日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## 日興FWS・日本株インデックス

該当事項はありません。

## 日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	7,393,824.72	1,169,555,196	1,123,713,480	77.08
	ユーロ	売建	788,980.31	135,888,841	129,826,710	8.90
	イギリス・ポンド	売建	297,408.44	60,766,789	58,056,120	3.98
	カナダ・ドル	売建	414,495.19	48,137,067	45,496,359	3.12
	スイス・フラン	売建	222,104.63	39,376,308	38,367,086	2.63
	オーストラリア・ドル	売建	284,895.70	30,500,649	28,317,692	1.94
	スウェーデン・クロー ナ	売建	861,811.65	12,985,347	12,180,242	0.84

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	5,916,204.30	935,214,332	899,144,729	99.04

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 日興FWS・日本債インデックス

該当事項はありません。

## 日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

## 日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

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	50,000.00	7,692,415	7,599,000	2.38
	アメリカ・ドル	売建	2,060,000.00	320,967,982	313,078,800	98.11

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 日興FWS・Jリートインデックス

該当事項はありません。

## 日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	1,077,885.90	170,426,050	163,817,097	77.02
	オーストラリア・ドル	売建	158,389.86	16,929,839	15,743,428	7.40
	イギリス・ポンド	売建	51,706.31	10,564,684	10,093,418	4.75
	ユーロ	売建	43,752.25	7,535,604	7,199,432	3.38
	シンガポール・ドル	売建	55,680.35	6,562,978	6,315,265	2.97
	カナダ・ドル	売建	26,967.96	3,121,974	2,960,091	1.39
	香港・ドル	売建	94,634.55	1,918,222	1,841,900	0.87

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## 日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

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	145,000.00	22,177,536	22,007,085	6.26
	アメリカ・ドル	売建	2,317,000.00	363,313,212	351,658,041	100.00

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 日興FWS・日本株インデックス

年月日	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 (2022年 8月 1日)	2,799,088,382	2,799,088,382	10,285	10,285
第2期 (2023年 7月31日)	7,273,190,384	7,273,190,384	12,493	12,493
第3期 (2024年 7月31日)	13,567,394,688	13,567,394,688	15,353	15,353
2023年 7月末日	7,273,190,384	-	12,493	-
8月末日	7,675,962,649	-	12,545	-
9月末日	7,934,790,362	-	12,609	-
10月末日	7,122,619,331	-	12,228	-
11月末日	7,951,562,891	-	12,889	-
12月末日	8,430,516,203	-	12,859	-
2024年 1月末日	9,506,485,614	-	13,863	-
2月末日	10,396,860,892	-	14,545	-
3月末日	11,389,070,731	-	15,189	-
4月末日	11,755,143,151	-	15,050	-
5月末日	12,267,515,616	-	15,220	-
6月末日	13,259,603,307	-	15,439	-
7月末日	13,567,394,688	-	15,353	-

## 日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

年月日	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 (2022年 8月 1日)	1,248,913,323	1,248,913,323	9,157	9,157
第2期 (2023年 7月31日)	2,276,545,764	2,276,545,764	9,803	9,803
第3期 (2024年 7月31日)	1,457,936,678	1,457,936,678	10,937	10,937
2023年 7月末日	2,276,545,764	-	9,803	-
8月末日	2,173,570,516	-	9,603	-
9月末日	2,007,745,265	-	9,175	-
10月末日	1,603,938,380	-	8,828	-
11月末日	1,656,605,078	-	9,562	-
12月末日	1,608,419,260	-	9,993	-
2024年 1月末日	1,609,901,318	-	10,187	-
2月末日	1,631,189,301	-	10,434	-
3月末日	1,487,645,483	-	10,786	-
4月末日	1,460,613,023	-	10,509	-
5月末日	1,449,538,568	-	10,695	-
6月末日	1,521,312,100	-	11,017	-
7月末日	1,457,936,678	-	10,937	-

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	4,920,711,373	4,920,711,373	10,977	10,977
第2期 (2023年 7月31日)	15,583,517,947	15,583,517,947	13,165	13,165
第3期 (2024年 7月31日)	32,571,160,582	32,571,160,582	16,667	16,667
2023年 7月末日	15,583,517,947	-	13,165	-
8月末日	16,968,897,322	-	13,392	-
9月末日	17,140,848,698	-	13,068	-
10月末日	15,589,314,954	-	12,624	-
11月末日	18,007,887,040	-	13,613	-
12月末日	19,683,223,071	-	13,851	-
2024年 1月末日	22,033,317,864	-	14,695	-
2月末日	24,124,276,163	-	15,402	-
3月末日	26,710,627,200	-	16,043	-
4月末日	28,241,183,905	-	16,255	-
5月末日	29,841,514,020	-	16,640	-
6月末日	33,549,579,586	-	17,654	-
7月末日	32,571,160,582	-	16,667	-

## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)



年月日	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 (2022年 8月 1日)	799,117,318	799,117,318	7,793	7,793
第2期 (2023年 7月31日)	1,557,178,946	1,557,178,946	7,872	7,872
第3期 (2024年 7月31日)	907,861,765	907,861,765	7,773	7,773
2023年 7月末日	1,557,178,946	-	7,872	-
8月末日	1,443,492,809	-	7,420	-
9月末日	1,327,692,731	-	7,057	-
10月末日	1,123,929,394	-	6,854	-
11月末日	1,141,899,991	-	7,280	-
12月末日	1,070,586,455	-	7,544	-
2024年 1月末日	1,006,145,390	-	7,196	-
2月末日	1,005,717,077	-	7,444	-
3月末日	928,705,448	-	7,587	-
4月末日	932,932,788	-	7,641	-
5月末日	918,581,768	-	7,668	-
6月末日	953,162,540	-	7,838	-
7月末日	907,861,765	-	7,773	-

## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	1,592,980,698	1,592,980,698	9,596	9,596
第2期 (2023年 7月31日)	5,115,594,082	5,115,594,082	10,903	10,903
第3期 (2024年 7月31日)	9,430,022,708	9,430,022,708	12,314	12,314
2023年 7月末日	5,115,594,082	-	10,903	-
8月末日	5,391,306,622	-	10,718	-
9月末日	5,495,155,244	-	10,483	-
10月末日	5,247,718,047	-	10,227	-
11月末日	5,798,921,859	-	10,731	-
12月末日	6,217,849,839	-	10,785	-
2024年 1月末日	6,487,128,100	-	10,764	-
2月末日	7,214,669,788	-	11,411	-
3月末日	7,799,461,364	-	11,745	-
4月末日	8,460,058,868	-	12,308	-
5月末日	8,759,463,966	-	12,404	-
6月末日	9,770,156,427	-	13,079	-
7月末日	9,430,022,708	-	12,314	-

## 日興FWS・日本債インデックス

年月日	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 (2022年 8月 1日)	4,102,674,873	4,102,674,873	9,693	9,693
第2期 (2023年 7月31日)	10,732,308,025	10,732,308,025	9,498	9,498
第3期 (2024年 7月31日)	20,580,641,083	20,580,641,083	9,144	9,144
2023年 7月末日	10,732,308,025	-	9,498	-
8月末日	11,351,017,936	-	9,428	-
9月末日	11,813,172,957	-	9,358	-
10月末日	12,419,508,159	-	9,207	-
11月末日	13,342,930,464	-	9,401	-
12月末日	14,170,726,062	-	9,439	-
2024年 1月末日	14,778,268,188	-	9,370	-
2月末日	15,467,646,967	-	9,399	-
3月末日	16,776,200,376	-	9,387	-
4月末日	17,964,187,393	-	9,279	-
5月末日	18,248,331,764	-	9,130	-
6月末日	19,940,192,692	-	9,154	-
7月末日	20,580,641,083	-	9,144	-

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	697,412,778	697,412,778	8,902	8,902
第2期 (2023年 7月31日)	759,134,978	759,134,978	8,008	8,008
第3期 (2024年 7月31日)	409,844,944	409,844,944	7,902	7,902
2023年 7月末日	759,134,978	-	8,008	-
8月末日	752,771,194	-	7,945	-
9月末日	717,173,069	-	7,731	-
10月末日	505,971,558	-	7,686	-
11月末日	512,055,850	-	7,905	-
12月末日	503,597,827	-	8,123	-
2024年 1月末日	491,293,498	-	7,984	-
2月末日	481,838,210	-	7,894	-
3月末日	439,615,656	-	7,939	-
4月末日	434,895,349	-	7,788	-
5月末日	420,190,627	-	7,766	-
6月末日	422,965,488	-	7,839	-
7月末日	409,844,944	-	7,902	-

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	599,972,982	599,972,982	10,152	10,152
第2期 (2023年 7月31日)	2,359,142,500	2,359,142,500	10,357	10,357
第3期 (2024年 7月31日)	10,035,082,127	10,035,082,127	11,532	11,532
2023年 7月末日	2,359,142,500	-	10,357	-
8月末日	2,573,438,686	-	10,636	-
9月末日	2,638,566,227	-	10,478	-
10月末日	5,640,957,122	-	10,458	-
11月末日	6,197,794,147	-	10,820	-
12月末日	6,615,935,532	-	10,830	-
2024年 1月末日	7,062,893,476	-	11,020	-
2月末日	7,492,956,384	-	11,160	-
3月末日	8,130,299,341	-	11,297	-
4月末日	8,740,197,412	-	11,508	-
5月末日	9,115,375,331	-	11,569	-
6月末日	10,080,924,607	-	11,966	-
7月末日	10,035,082,127	-	11,532	-

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	499,040,748	499,040,748	7,390	7,390
第2期 (2023年 7月31日)	445,115,997	445,115,997	7,042	7,042
第3期 (2024年 7月31日)	319,126,239	319,126,239	6,970	6,970
2023年 7月末日	445,115,997	-	7,042	-
8月末日	434,200,909	-	6,923	-
9月末日	404,572,087	-	6,631	-
10月末日	390,285,254	-	6,504	-
11月末日	396,921,517	-	6,876	-
12月末日	390,994,538	-	7,166	-
2024年 1月末日	374,935,521	-	6,972	-
2月末日	363,242,107	-	6,919	-
3月末日	335,726,270	-	6,983	-
4月末日	326,370,999	-	6,783	-
5月末日	320,937,456	-	6,842	-
6月末日	327,918,904	-	6,921	-
7月末日	319,126,239	-	6,970	-

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	909,275,454	909,275,454	9,071	9,071
第2期 (2023年 7月31日)	2,841,117,482	2,841,117,482	9,685	9,685
第3期 (2024年 7月31日)	8,242,463,797	8,242,463,797	11,005	11,005
2023年 7月末日	2,841,117,482	-	9,685	-
8月末日	3,093,716,422	-	9,925	-
9月末日	3,166,724,659	-	9,774	-
10月末日	4,660,031,841	-	9,628	-
11月末日	5,135,523,577	-	10,064	-
12月末日	5,518,097,001	-	10,179	-
2024年 1月末日	5,900,290,380	-	10,354	-
2月末日	6,321,367,047	-	10,537	-
3月末日	6,800,404,358	-	10,736	-
4月末日	7,226,691,084	-	10,869	-
5月末日	7,564,421,474	-	11,002	-
6月末日	8,362,829,573	-	11,480	-
7月末日	8,242,463,797	-	11,005	-

## 日興FWS・Jリートインデックス

年月日	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 (2022年 8月 1日)	660,722,369	660,722,369	9,752	9,752
第2期 (2023年 7月31日)	1,468,523,681	1,468,523,681	9,355	9,355
第3期 (2024年 7月31日)	2,794,911,644	2,794,911,644	8,972	8,972
2023年 7月末日	1,468,523,681	-	9,355	-
8月末日	1,576,132,635	-	9,492	-
9月末日	1,617,741,802	-	9,344	-
10月末日	1,804,751,757	-	9,151	-
11月末日	1,934,743,760	-	9,327	-
12月末日	2,005,816,218	-	9,173	-
2024年 1月末日	2,091,831,640	-	9,164	-
2月末日	2,112,369,987	-	8,725	-
3月末日	2,371,935,692	-	9,223	-
4月末日	2,505,729,892	-	9,316	-
5月末日	2,512,034,659	-	8,997	-
6月末日	2,693,590,334	-	8,945	-
7月末日	2,794,911,644	-	8,972	-

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	223,557,535	223,557,535	9,413	9,413
第2期 (2023年 7月31日)	280,614,480	280,614,480	8,241	8,241
第3期 (2024年 7月31日)	212,686,964	212,686,964	8,620	8,620
2023年 7月末日	280,614,480	-	8,241	-
8月末日	267,587,818	-	8,055	-
9月末日	240,227,705	-	7,431	-
10月末日	223,210,620	-	6,989	-
11月末日	237,044,794	-	7,734	-
12月末日	245,110,362	-	8,560	-
2024年 1月末日	230,397,014	-	8,150	-
2月末日	227,412,095	-	8,102	-
3月末日	211,702,103	-	8,341	-
4月末日	199,593,483	-	7,869	-
5月末日	197,417,500	-	7,946	-
6月末日	203,393,114	-	8,078	-
7月末日	212,686,964	-	8,620	-

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	705,091,584	705,091,584	11,414	11,414
第2期 (2023年 7月31日)	1,707,663,787	1,707,663,787	11,161	11,161
第3期 (2024年 7月31日)	3,898,822,535	3,898,822,535	13,358	13,358
2023年 7月末日	1,707,663,787	-	11,161	-
8月末日	1,852,241,738	-	11,328	-
9月末日	1,827,251,223	-	10,706	-
10月末日	1,899,183,931	-	10,106	-
11月末日	2,221,808,088	-	11,126	-
12月末日	2,550,791,375	-	12,006	-
2024年 1月末日	2,639,056,009	-	11,909	-
2月末日	2,821,783,221	-	12,121	-
3月末日	3,103,741,930	-	12,588	-
4月末日	3,197,953,065	-	12,377	-
5月末日	3,364,248,979	-	12,571	-
6月末日	3,740,722,736	-	13,169	-
7月末日	3,898,822,535	-	13,358	-

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	379,591,347	379,591,347	9,260	9,260
第2期 (2023年 7月31日)	484,347,107	484,347,107	9,620	9,620
第3期 (2024年 7月31日)	351,651,252	351,651,252	11,060	11,060
2023年 7月末日	484,347,107	-	9,620	-
8月末日	471,756,041	-	9,481	-
9月末日	439,602,224	-	9,065	-
10月末日	403,314,015	-	9,628	-
11月末日	404,497,300	-	9,809	-
12月末日	379,144,280	-	9,840	-
2024年 1月末日	368,736,723	-	9,644	-
2月末日	357,624,986	-	9,590	-
3月末日	351,465,250	-	10,409	-
4月末日	367,105,742	-	10,891	-
5月末日	356,622,151	-	10,862	-
6月末日	353,735,699	-	10,740	-
7月末日	351,651,252	-	11,060	-

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

年月日	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 (2022年 8月 1日)	1,659,064,454	1,659,064,454	11,456	11,456
第2期 (2023年 7月31日)	4,807,475,147	4,807,475,147	13,424	13,424
第3期 (2024年 7月31日)	10,723,399,717	10,723,399,717	17,682	17,682
2023年 7月末日	4,807,475,147	-	13,424	-
8月末日	5,216,884,094	-	13,801	-
9月末日	5,301,798,067	-	13,568	-
10月末日	5,969,902,273	-	14,465	-
11月末日	6,345,418,819	-	14,573	-
12月末日	6,572,689,698	-	14,200	-
2024年 1月末日	7,029,194,174	-	14,539	-
2月末日	7,458,480,877	-	14,831	-
3月末日	8,636,382,253	-	16,248	-
4月末日	9,748,530,999	-	17,681	-
5月末日	9,970,346,520	-	17,697	-
6月末日	10,699,255,244	-	18,054	-
7月末日	10,723,399,717	-	17,682	-

## 【分配の推移】

## 日興FWS・日本株インデックス

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・日本債インデックス

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0

第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0
-----	-------------------------	---

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・Jリートインデックス

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)



	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月 3日～2022年 8月 1日	0
第2期	2022年 8月 2日～2023年 7月31日	0
第3期	2023年 8月 1日～2024年 7月31日	0

## 【収益率の推移】

## 日興FWS・日本株インデックス

	収益率(%)
第1期	2.9
第2期	21.5
第3期	22.9

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	8.4
第2期	7.1
第3期	11.6

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

## 日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期	9.8
第2期	19.9
第3期	26.6

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

## 日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	22.1
第2期	1.0

第3期	1.3
-----	-----

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期	4.0
第2期	13.6
第3期	12.9

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・日本債インデックス

	収益率(%)
第1期	3.1
第2期	2.0
第3期	3.7

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	11.0
第2期	10.0
第3期	1.3

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期	1.5
第2期	2.0
第3期	11.3

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	26.1
第2期	4.7
第3期	1.0

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期	9.3
第2期	6.8
第3期	13.6

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・Jリートインデックス

	収益率(%)
第1期	2.5
第2期	4.1
第3期	4.1

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	5.9
第2期	12.5
第3期	4.6

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期	14.1
第2期	2.2
第3期	19.7

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	7.4
第2期	3.9
第3期	15.0

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

	収益率(%)
第1期	14.6
第2期	17.2
第3期	31.7

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

(4) 【設定及び解約の実績】

日興FWS・日本株インデックス

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,890,422,774	168,911,148
第2期	4,297,436,756	1,197,309,718
第3期	4,672,800,551	1,657,460,653

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,404,107,104	40,263,404
第2期	1,519,173,996	560,820,462
第3期	213,156,900	1,202,323,222

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	4,695,605,698	212,948,338
第2期	8,789,526,644	1,435,143,891
第3期	10,577,162,915	2,871,814,397

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,069,832,666	44,346,404
第2期	1,424,902,597	472,336,385
第3期	195,507,747	1,005,571,489

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,780,724,937	120,670,708
第2期	3,496,690,057	465,030,283
第3期	3,931,696,475	965,572,142

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 日興FWS・日本債インデックス

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	4,507,092,311	274,639,349
第2期	8,024,842,487	957,166,018
第3期	13,422,124,144	2,214,511,761

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	819,677,926	36,239,986
第2期	486,790,484	322,210,248
第3期	99,477,078	528,829,238

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	628,252,986	37,254,796
第2期	1,885,666,023	198,801,468
第3期	6,964,299,671	540,473,289

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,033,256,409	357,926,095
第2期	377,079,050	420,354,931
第3期	83,454,131	257,663,288

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,073,795,109	71,378,806
第2期	2,199,858,549	268,648,368
第3期	5,078,374,121	522,565,784

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・Jリートインデックス

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	707,908,297	30,413,449
第2期	1,039,940,827	147,641,594
第3期	1,783,263,714	237,870,804

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	252,217,041	14,721,288
第2期	214,040,924	111,046,591
第3期	55,964,696	149,714,645

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	651,494,466	33,763,766
第2期	1,088,596,448	176,347,368
第3期	1,596,850,660	208,013,230

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	431,017,114	21,071,654
第2期	262,998,864	169,464,709
第3期	54,914,140	240,439,631

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,531,395,090	83,190,473
第2期	2,431,110,301	298,066,647
第3期	3,024,185,731	540,679,263

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	340,364,255,920	98.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,678,652,595	1.07
合計(純資産総額)		344,042,908,515	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,664,070,000	1.07
合計	買建	-	3,664,070,000	1.07

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	579,142,787,570	71.30
	イギリス	30,709,936,198	3.78
	カナダ	26,325,776,625	3.24
	スイス	24,616,129,416	3.03
	フランス	22,331,178,461	2.75
	ドイツ	18,648,539,392	2.30
	オランダ	14,813,751,054	1.82
	アイルランド	14,509,624,558	1.79
	オーストラリア	14,267,984,656	1.76
	デンマーク	8,041,150,886	0.99
	スウェーデン	6,885,512,312	0.85
	スペイン	5,708,512,699	0.70
	イタリア	4,642,730,282	0.57
	香港	2,874,297,165	0.35
	ジャージー	2,443,350,520	0.30
	シンガポール	2,364,049,172	0.29
	フィンランド	2,172,076,367	0.27
	ベルギー	1,749,527,138	0.22
	イスラエル	1,609,930,542	0.20
	ノルウェー	1,247,876,357	0.15
	バミューダ	990,240,605	0.12
	ケイマン諸島	960,557,890	0.12
	オランダ領キュ ラソー	881,806,710	0.11
	ニュージーラン ド	547,709,529	0.07
	リベリア	518,407,717	0.06
	ルクセンブルグ	443,065,728	0.05
オーストリア	400,580,365	0.05	
ポルトガル	332,864,983	0.04	
パナマ	221,347,880	0.03	

	マン島	46,546,074	0.01
	小計	790,447,848,851	97.32
投資証券	アメリカ	13,698,496,906	1.69
	オーストラリア	1,413,740,060	0.17
	イギリス	280,925,448	0.03
	フランス	279,062,939	0.03
	シンガポール	194,306,102	0.02
	香港	152,390,171	0.02
	カナダ	58,914,901	0.01
	ベルギー	58,377,899	0.01
	ケイマン諸島	50,993,677	0.01
	小計	16,187,208,103	1.99
	現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,586,196,875
合計（純資産総額）		812,221,253,829	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	イギリス	243,324,786	0.03
株価指数先物取引	買建	ドイツ	827,444,402	0.10
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,713,387,635	0.58
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	157,726,020	0.02
合計	買建	-	5,941,882,843	0.73

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	-	1,450,290,938	0.18

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	インド	9,121,638,015	18.79
	台湾	8,311,128,911	17.12
	ケイマン諸島	6,148,748,438	12.66
	韓国	5,440,822,595	11.21
	中国	2,687,159,957	5.53
	ブラジル	1,874,128,643	3.86
	南アフリカ	1,259,675,457	2.59
	インドネシア	747,521,738	1.54
	メキシコ	703,878,711	1.45
	マレーシア	650,227,332	1.34
	タイ	632,088,797	1.30
	ポーランド	380,211,888	0.78
	トルコ	354,615,048	0.73
	香港	346,366,629	0.71
	フィリピン	244,697,626	0.50
	ギリシャ	234,709,155	0.48



	チリ	198,917,516	0.41
	バミューダ	186,260,103	0.38
	アメリカ	122,610,917	0.25
	ハンガリー	113,494,754	0.23
	イギリス	69,619,158	0.14
	チェコ	59,277,664	0.12
	ルクセンブルグ	52,012,437	0.11
	コロンビア	45,216,958	0.09
	エジプト	33,708,007	0.07
	オランダ	26,190,393	0.05
	ペルー	15,435,391	0.03
	シンガポール	8,051,094	0.02
	小計	40,068,413,332	82.52
投資信託受益証券	香港	1,755,442,948	3.62
投資証券	アメリカ	2,988,226,670	6.15
	メキシコ	250,092,021	0.52
	ブラジル	76,662,041	0.16
	小計	3,314,980,732	6.83
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,417,508,768	7.03
合計（純資産総額）		48,556,345,780	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	3,408,170,440	7.02
合計	買建	-	3,408,170,440	7.02

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	-	97,295,495	0.20
為替予約取引	売建	-	596,585,496	1.23

#### 国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	99,040,149,280	76.63
地方債証券	日本	11,674,967,200	9.03
特殊債券	日本	9,649,739,907	7.47
社債券	日本	8,264,364,100	6.39
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	618,560,184	0.48
合計（純資産総額）		129,247,780,671	100.00

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	12,580,989,252	44.31

	中国	2,730,669,256	9.62
	フランス	2,051,187,145	7.22
	イタリア	1,890,023,066	6.66
	ドイツ	1,642,053,206	5.78
	イギリス	1,413,855,007	4.98
	スペイン	1,249,230,433	4.40
	カナダ	531,676,194	1.87
	ベルギー	436,355,728	1.54
	オランダ	393,080,776	1.38
	オーストラリア	339,492,951	1.20
	オーストリア	314,945,011	1.11
	シンガポール	241,904,896	0.85
	メキシコ	201,912,801	0.71
	ポーランド	148,022,116	0.52
	フィンランド	140,347,656	0.49
	アイルランド	127,175,848	0.45
	イスラエル	83,052,658	0.29
	デンマーク	69,531,897	0.24
	ニュージーランド	65,555,073	0.23
	スウェーデン	41,466,427	0.15
	ノルウェー	39,951,975	0.14
	小計	26,732,479,372	94.15
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,661,832,444	5.85
合計（純資産総額）		28,394,311,816	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	-	1,087,871,858	3.83
為替予約取引	売建	-	26,636,403,601	93.81

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	87,444,142,489	46.44
	中国	18,997,693,237	10.09
	フランス	14,252,726,797	7.57
	イタリア	13,001,358,350	6.90
	ドイツ	11,416,403,022	6.06
	イギリス	9,837,180,980	5.22
	スペイン	8,626,041,526	4.58
	カナダ	3,735,498,100	1.98
	ベルギー	3,031,443,157	1.61
	オランダ	2,742,064,587	1.46
	オーストラリア	2,364,652,945	1.26

	オーストリア	2,193,770,595	1.16
	メキシコ	1,428,923,410	0.76
	ポーランド	1,063,768,440	0.56
	フィンランド	1,012,754,050	0.54
	マレーシア	942,578,973	0.50
	アイルランド	937,747,567	0.50
	シンガポール	765,297,785	0.41
	イスラエル	575,091,343	0.31
	デンマーク	490,031,454	0.26
	ニュージーランド	470,598,390	0.25
	ノルウェー	300,349,368	0.16
	スウェーデン	299,998,432	0.16
	小計	185,930,114,997	98.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,383,109,252	1.27
合計(純資産総額)		188,313,224,249	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	-	99	0.00
為替予約取引	売建	-	1,273,739,828	0.68

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	トルコ	1,035,547,938	10.51
	サウジアラビア	945,573,887	9.60
	メキシコ	859,993,613	8.73
	アラブ首長国連邦	747,109,507	7.58
	ブラジル	734,047,685	7.45
	チリ	598,864,960	6.08
	ポーランド	590,715,670	6.00
	コロンビア	555,127,790	5.63
	ドミニカ共和国	512,926,301	5.21
	ハンガリー	414,611,647	4.21
	カタール	389,766,976	3.96
	パナマ	375,118,254	3.81
	ペルー	315,912,387	3.21
	南アフリカ	296,770,039	3.01
	オマーン	285,289,020	2.90
	中国	260,820,419	2.65
	インドネシア	252,598,262	2.56
	ウルグアイ	164,984,287	1.67
フィリピン	111,018,088	1.13	

	小計	9,446,796,730	95.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	406,659,333	4.13
合計(純資産総額)		9,853,456,063	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	-	76,208,500	0.77

## Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	15,107,449,600	98.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	201,057,782	1.31
合計(純資産総額)		15,308,507,382	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	34,250,000	0.22
合計	買建	-	34,250,000	0.22

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	30,935,696,587	77.25
	オーストラリア	2,817,563,246	7.04
	イギリス	1,917,441,928	4.79
	シンガポール	1,200,808,313	3.00
	フランス	656,155,461	1.64
	カナダ	545,320,533	1.36
	ベルギー	396,989,058	0.99
	香港	343,516,374	0.86
	スペイン	186,407,219	0.47
	ニュージーランド	105,644,748	0.26
	ガーンジー	76,391,431	0.19
	韓国	70,532,422	0.18
	オランダ	66,254,417	0.17
	イスラエル	38,322,819	0.10
	ドイツ	13,929,140	0.03
	アイルランド	9,556,443	0.02
イタリア	2,634,154	0.01	
小計		39,383,164,293	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	661,229,950	1.65
合計(純資産総額)		40,044,394,243	100.00

その他以下の取引を行っております。

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	-	136,499,698	0.34
為替予約取引	売建	-	80,935,100	0.20

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	12,277,249,183	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	214,796,308	1.72
合計(純資産総額)		12,492,045,491	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,598,900	2,810.12	12,923,465,291	2,949.00	13,562,156,100	3.94
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,186,800	1,265.29	6,562,780,733	1,750.00	9,076,900,000	2.64
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	605,700	12,833.36	7,773,168,868	13,530.00	8,195,121,000	2.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,099,600	2,086.54	4,380,908,578	3,288.00	6,903,484,800	2.01
日本	株式	三井住友フィ ナンシャルグ ループ	銀行業	596,300	7,312.83	4,360,640,819	10,915.00	6,508,614,500	1.89
日本	株式	キーエンス	電気機器	86,600	63,554.90	5,503,854,162	65,890.00	5,706,074,000	1.66
日本	株式	東京エレクト ロン	電気機器	183,100	24,404.62	4,468,486,385	31,020.00	5,679,762,000	1.65
日本	株式	リクルート ホールディン グス	サービス 業	640,000	5,559.65	3,558,177,634	8,658.00	5,541,120,000	1.61
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,754,600	2,316.14	4,063,901,586	3,144.00	5,516,462,400	1.60
日本	株式	信越化学工業	化学	776,200	5,244.69	4,070,932,063	6,748.00	5,237,797,600	1.52
日本	株式	東京海上ホー ルディングス	保険業	831,700	3,688.04	3,067,346,403	6,022.00	5,008,497,400	1.46
日本	株式	三井物産	卸売業	1,370,300	2,722.43	3,730,544,612	3,530.00	4,837,159,000	1.41
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	615,000	5,785.84	3,558,291,819	7,783.00	4,786,545,000	1.39
日本	株式	第一三共	医薬品	756,000	4,042.84	3,056,389,321	6,148.00	4,647,888,000	1.35
日本	株式	任天堂	その他製 品	546,400	6,961.72	3,803,882,791	8,388.00	4,583,203,200	1.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	25,808,200	172.80	4,459,538,328	160.40	4,139,635,280	1.20

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,149,000	2,529.14	2,905,983,808	3,448.00	3,961,752,000	1.15
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	427,800	6,126.95	2,621,109,031	9,162.00	3,919,503,600	1.14
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,048,200	1,515.43	3,103,904,852	1,647.00	3,373,385,400	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	766,900	4,165.24	3,194,324,232	4,302.00	3,299,203,800	0.96
日本	株式	HOYA	精密機器	170,300	16,736.54	2,850,232,361	18,940.00	3,225,482,000	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	638,500	4,616.26	2,947,482,613	4,520.00	2,886,020,000	0.84
日本	株式	三菱重工業	機械	1,528,000	845.60	1,292,075,375	1,830.00	2,796,240,000	0.81
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,388,300	1,803.15	2,503,312,068	1,965.00	2,728,009,500	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	772,800	2,888.25	2,232,038,846	3,351.00	2,589,652,800	0.75
日本	株式	三菱電機	電気機器	957,500	2,024.18	1,938,153,733	2,601.00	2,490,457,500	0.72
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	517,800	3,814.72	1,975,263,616	4,434.00	2,295,925,200	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	104,300	22,149.42	2,310,184,532	21,905.00	2,284,691,500	0.66
日本	株式	富士通	電気機器	804,800	2,122.45	1,708,144,814	2,732.50	2,199,116,000	0.64
日本	株式	丸紅	卸売業	758,200	2,319.48	1,758,628,093	2,860.50	2,168,831,100	0.63

□ 種類別・業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.30
	建設業	2.11
	食料品	3.19
	繊維製品	0.37
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.68
	医薬品	4.76
	石油・石炭製品	0.52
	ゴム製品	0.62
	ガラス・土石製品	0.68
	鉄鋼	0.85
	非鉄金属	0.72
	金属製品	0.53
	機械	5.46
	電気機器	17.02
	輸送用機器	7.69
	精密機器	2.24
	その他製品	2.40
	電気・ガス業	1.37
陸運業	2.27	
海運業	0.74	
空運業	0.35	

倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.09
卸売業	7.45
小売業	3.99
銀行業	8.25
証券、商品先物取引業	0.94
保険業	3.26
その他金融業	1.20
不動産業	2.00
サービス業	4.51
合計	98.93

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,243,931	28,908.58	35,960,273,429	33,353.87	41,489,915,350	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	598,569	58,373.27	34,940,429,905	64,469.92	38,589,698,417	4.75
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,119,936	8,120.58	17,215,102,736	15,812.60	33,521,702,537	4.13
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	794,249	22,829.98	18,132,686,109	27,699.87	22,000,595,953	2.71
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	185,998	52,710.13	9,803,978,818	70,608.68	13,133,073,932	1.62
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	500,270	20,934.98	10,473,140,706	25,959.01	12,986,512,732	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	433,389	21,126.44	9,155,968,328	26,198.34	11,354,071,680	1.40

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	68,665	93,376.50	6,411,697,336	120,459.61	8,271,359,285	1.02
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	243,551	36,457.06	8,879,154,169	33,936.19	8,265,193,692	1.02
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	374,030	14,932.50	5,585,203,376	21,878.19	8,183,098,956	1.01
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	244,189	24,058.66	5,874,861,330	32,803.56	8,010,269,391	0.99
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	111,499	55,447.00	6,182,284,842	67,265.67	7,500,055,429	0.92
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	381,611	15,637.26	5,967,352,167	18,013.83	6,874,277,511	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,138	81,093.10	6,336,453,013	87,855.75	6,864,872,218	0.85
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	277,624	15,678.77	4,352,802,445	19,810.44	5,499,853,594	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	134,642	38,987.30	5,249,328,407	40,106.96	5,400,081,846	0.66
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	204,222	23,224.87	4,743,028,817	24,593.15	5,022,461,299	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	200,057	23,194.87	4,640,296,873	24,649.55	4,931,314,624	0.61



アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融 サービス	70,969	63,046.17	4,474,323,621	68,209.28	4,840,744,250	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必 需品流 通・小 売り	37,769	92,662.49	3,499,769,659	123,480.97	4,663,752,876	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消 費財・ サービ ス流 通・小 売り	83,986	47,926.40	4,025,146,960	55,440.90	4,656,259,729	0.57
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導 体・半 導体製 造装置	34,014	107,527.94	3,657,455,266	132,851.87	4,518,823,608	0.56
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬 品・バ イオテ クノー ロジー ・ライ フサイ エンス	151,029	21,656.07	3,270,694,205	28,472.74	4,300,209,932	0.53
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必 需品流 通・小 売り	377,914	8,091.78	3,057,996,409	10,547.32	3,985,981,250	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	605,819	4,734.31	2,868,132,238	6,292.72	3,812,251,276	0.47
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬 品・バ イオテ クノー ロジー ・ライ フサイ エンス	215,920	15,837.06	3,419,538,264	17,568.71	3,793,435,863	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネル ギー	149,775	22,064.91	3,304,772,551	24,324.85	3,643,254,528	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・ 飲料・ タバコ	349,662	8,932.33	3,123,296,249	10,317.14	3,607,511,526	0.44
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディ ア・娯 楽	36,929	74,375.02	2,746,595,164	94,906.10	3,504,787,189	0.43
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・ 飲料・ タバコ	227,729	17,070.68	3,887,489,026	15,328.34	3,490,707,084	0.43

□ 種類別・業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	4.48
	素材	3.65
	資本財	6.97
	商業・専門サービス	1.60
	運輸	1.58
	自動車・自動車部品	1.66
	耐久消費財・アパレル	1.30
	消費者サービス	1.82
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.80
	生活必需品流通・小売り	1.75
	食品・飲料・タバコ	3.18
	家庭用品・パーソナル用品	1.56
	ヘルスケア機器・サービス	4.12
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.16
	銀行	5.76
	金融サービス	6.70
	保険	3.06
	ソフトウェア・サービス	9.74
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.59
	半導体・半導体製造装置	8.52
電気通信サービス	1.11	
公益事業	2.63	
メディア・娯楽	6.31	
不動産管理・開発	0.29	
投資証券	-	1.99
合計		99.31

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	980,000	2,756.06	2,700,936,340	4,359.16	4,271,972,880	8.80
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	263,200	6,175.59	1,625,415,655	6,898.74	1,815,747,315	3.74
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	281,351	6,075.11	1,709,238,556	6,381.14	1,795,339,669	3.70
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,412,000	755.4633	1,822,177,580	727.7956	1,755,442,948	3.62

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	190,175	8,046.32	1,530,209,525	8,950.50	1,702,161,337	3.51
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	620,900	1,419.29	881,235,713	1,486.66	923,068,435	1.90
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	121,499	4,504.97	547,348,926	5,538.13	672,877,135	1.39
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	225,837	2,250.59	508,265,562	2,268.31	512,267,693	1.05
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	207,767	1,751.85	363,977,518	2,213.29	459,849,350	0.95
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	21,815	14,943.52	325,992,822	20,873.45	455,354,311	0.94
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	132,055	2,697.23	356,182,366	3,435.18	453,633,289	0.93
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	495,800	486.04	240,976,759	908.93	450,647,692	0.93
ケイマン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	23,872	21,475.76	512,669,454	18,774.51	448,185,112	0.92
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	201,660	1,759.95	354,911,344	2,075.86	418,618,734	0.86
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,845,000	89.03	342,317,649	105.94	407,336,608	0.84
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	60,000	4,516.71	271,002,746	5,819.94	349,196,220	0.72
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	132,398	2,642.74	349,893,396	2,626.54	347,748,801	0.72
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	67,182	4,607.38	309,532,933	4,954.76	332,870,505	0.69
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	112,586	2,831.59	318,797,865	2,956.46	332,855,611	0.69
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	35,970	6,525.09	234,707,355	7,988.59	287,349,600	0.59
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	91,051	1,878.42	171,031,805	2,690.74	244,994,613	0.50

韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	33,054	6,458.21	213,469,587	6,961.50	230,105,421	0.47
ブラジル	株式	VALE SA	素材	136,588	1,966.81	268,642,155	1,634.25	223,218,988	0.46
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,614,000	73.73	192,740,219	84.28	220,316,284	0.45
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	77,700	3,411.18	265,048,399	2,782.13	216,171,190	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,190,000	56.57	180,469,470	67.11	214,094,936	0.44
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	2,231,900	84.58	188,776,372	95.65	213,470,075	0.44
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	7,012	28,406.99	199,189,805	28,874.31	202,466,664	0.42
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	37,574	3,112.08	116,933,327	5,347.44	200,924,823	0.41
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	91,881	1,953.61	179,499,894	2,141.10	196,726,409	0.41

□ 種類別・業種別投資比率

2024年7月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	4.21
	素材	5.12
	資本財	4.13
	商業・専門サービス	0.03
	運輸	1.64
	自動車・自動車部品	3.55
	耐久消費財・アパレル	0.94
	消費者サービス	2.10
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.43
	生活必需品流通・小売り	1.21
	食品・飲料・タバコ	2.09
	家庭用品・パーソナル用品	0.76
	ヘルスケア機器・サービス	0.63
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.21
	銀行	12.06
	金融サービス	2.19
	保険	2.35
ソフトウェア・サービス	2.33	
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.19	
半導体・半導体製造装置	11.64	

	電気通信サービス	1.89
	公益事業	2.35
	メディア・娯楽	5.56
	不動産管理・開発	0.90
投資信託受益証券	-	3.62
投資証券	-	6.83
合計		92.96

## 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	154 5年国債	1,610,000,000	99.18	1,596,798,000	98.75	1,589,858,900	0.100	2027/09/20	1.23
日本	国債 証券	149 5年国債	1,570,000,000	99.36	1,559,999,100	99.08	1,555,540,300	0.005	2026/09/20	1.20
日本	国債 証券	146 5年国債	1,280,000,000	99.86	1,278,182,400	99.69	1,276,019,200	0.100	2025/12/20	0.99
日本	国債 証券	156 5年国債	1,250,000,000	99.40	1,242,437,500	98.92	1,236,475,000	0.200	2027/12/20	0.96
日本	国債 証券	141 20年国 債	1,100,000,000	107.38	1,181,125,000	106.36	1,169,982,000	1.700	2032/12/20	0.91
日本	国債 証券	374 10年国 債	1,180,000,000	98.48	1,162,069,200	97.90	1,155,196,400	0.800	2034/03/20	0.89
日本	国債 証券	366 10年国 債	1,210,000,000	96.03	1,161,927,900	95.27	1,152,791,200	0.200	2032/03/20	0.89
日本	国債 証券	372 10年国 債	1,160,000,000	99.27	1,151,532,000	98.45	1,142,008,400	0.800	2033/09/20	0.88
日本	国債 証券	367 10年国 債	1,190,000,000	95.74	1,139,329,800	94.95	1,129,916,900	0.200	2032/06/20	0.87
日本	国債 証券	373 10年国 債	1,160,000,000	97.16	1,127,056,000	96.40	1,118,263,200	0.600	2033/12/20	0.87
日本	国債 証券	362 10年国 債	1,160,000,000	96.53	1,119,700,000	95.80	1,111,303,200	0.100	2031/03/20	0.86
日本	国債 証券	365 10年国 債	1,170,000,000	95.61	1,118,583,200	94.85	1,109,780,100	0.100	2031/12/20	0.86
日本	国債 証券	360 10年国 債	1,150,000,000	97.08	1,116,362,500	96.33	1,107,760,500	0.100	2030/09/20	0.86
日本	国債 証券	364 10年国 債	1,150,000,000	95.95	1,103,456,900	95.18	1,094,535,500	0.100	2031/09/20	0.85

日本	国債証券	3 4 4 1 0 年国債	1,100,000,000	99.58	1,095,325,000	99.28	1,092,080,000	0.100	2026/09/20	0.84
日本	国債証券	4 6 2 2 年国債	1,090,000,000	100.10	1,091,106,300	99.93	1,089,269,700	0.400	2026/07/01	0.84
日本	国債証券	3 6 3 1 0 年国債	1,140,000,000	96.29	1,097,660,400	95.49	1,088,631,600	0.100	2031/06/20	0.84
日本	国債証券	3 6 1 1 0 年国債	1,120,000,000	96.83	1,084,524,800	96.07	1,075,950,400	0.100	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	3 5 7 1 0 年国債	1,040,000,000	97.66	1,015,657,200	96.96	1,008,394,400	0.100	2029/12/20	0.78
日本	国債証券	3 5 9 1 0 年国債	1,040,000,000	97.30	1,011,940,800	96.55	1,004,161,600	0.100	2030/06/20	0.78
日本	国債証券	3 5 6 1 0 年国債	1,015,000,000	97.80	992,695,400	97.15	986,021,750	0.100	2029/09/20	0.76
日本	国債証券	3 5 8 1 0 年国債	1,010,000,000	97.50	984,718,300	96.77	977,417,400	0.100	2030/03/20	0.76
日本	国債証券	3 4 2 1 0 年国債	900,000,000	99.76	897,804,000	99.56	896,049,000	0.100	2026/03/20	0.69
日本	国債証券	1 6 3 5 年国債	880,000,000	99.77	877,976,000	99.21	873,065,600	0.400	2028/09/20	0.68
日本	国債証券	3 6 9 1 0 年国債	850,000,000	97.32	827,253,300	96.69	821,882,000	0.500	2032/12/20	0.64
日本	国債証券	3 7 1 1 0 年国債	860,000,000	96.07	826,202,000	95.30	819,562,800	0.400	2033/06/20	0.63
日本	国債証券	1 4 2 2 0 年国債	730,000,000	108.17	789,655,600	107.14	782,143,900	1.800	2032/12/20	0.61
日本	国債証券	3 7 0 1 0 年国債	790,000,000	97.23	768,117,000	96.45	761,939,200	0.500	2033/03/20	0.59
日本	国債証券	1 5 3 5 年国債	770,000,000	99.02	762,454,000	98.63	759,481,800	0.005	2027/06/20	0.59
日本	国債証券	1 6 8 5 年国債	750,000,000	100.41	753,075,000	99.86	748,980,000	0.600	2029/03/20	0.58

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	76.63
地方債証券	9.03
特殊債証券	7.47
社債券	6.39

合 計	99.52
-----	-------

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2,010,000	14,091.83	283,245,703	14,266.40	286,754,685	0.750	2026/05/31	1.01
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	11,000,000	2,130.36	234,339,621	2,196.02	241,562,430	2.670	2033/05/25	0.85
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,200,000	15,449.97	185,399,643	15,741.72	188,900,599	4.625	2031/04/30	0.67
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,200,000	15,336.89	184,042,717	15,351.78	184,221,300	4.500	2027/04/15	0.65
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,190,000	15,198.66	180,864,044	15,149.79	180,282,525	4.000	2027/01/15	0.63
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,140,000	14,516.56	165,488,833	14,672.81	167,270,003	2.750	2027/04/30	0.59
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,700,000	2,129.28	163,954,430	2,150.03	165,552,267	2.370	2029/01/15	0.58
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000	2,107.24	164,364,685	2,114.04	164,895,103	1.850	2027/05/15	0.58
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	980,000	15,506.37	151,962,400	15,770.38	154,549,678	4.750	2043/11/15	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,020,000	14,266.77	145,521,012	14,557.72	148,488,694	3.500	2033/02/15	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	980,000	14,739.62	144,448,287	14,936.68	146,379,473	3.500	2028/01/31	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,131.77	141,317,672	14,373.87	143,738,724	2.750	2029/05/31	0.51
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	940,000	14,411.00	135,463,394	14,904.82	140,105,317	3.625	2030/03/31	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	900,000	15,192.91	136,736,198	15,273.42	137,460,788	4.625	2026/03/15	0.48
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000	2,107.75	134,896,258	2,132.91	136,506,148	2.300	2026/05/15	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	900,000	14,853.69	133,683,215	15,071.29	135,641,569	4.000	2034/02/15	0.48
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	940,000	14,125.82	132,782,718	14,403.97	135,397,279	2.500	2043/05/25	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	890,000	15,079.35	134,206,212	15,206.96	135,341,918	4.000	2029/01/31	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	930,000	13,608.25	126,556,700	14,522.20	135,056,428	4.125	2053/08/15	0.48

中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	2,141.88	128,513,021	2,197.20	131,832,083	2.800	2030/03/25	0.46
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	2,092.75	125,564,761	2,128.87	127,731,915	2.180	2026/08/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	830,000	14,877.39	123,482,364	15,034.09	124,782,947	3.625	2026/05/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	800,000	15,097.83	120,782,667	15,386.88	123,095,001	0.000	2027/02/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	15,204.38	121,635,043	15,360.01	122,880,054	4.500	2027/05/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	13,801.11	117,309,461	14,207.26	120,761,672	1.250	2026/12/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	14,799.48	118,395,859	15,051.32	120,410,526	3.750	2028/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	14,426.53	115,412,232	14,939.88	119,519,057	3.875	2033/08/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	14,538.97	116,311,720	14,926.32	119,410,520	3.500	2028/04/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	13,680.33	116,282,794	14,004.82	119,040,929	2.875	2032/05/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,108.82	118,093,762	2,121.18	118,786,010	2.180	2025/08/25	0.42

## □ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	94.15
合計	94.15

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,450,000	14,331.65	1,640,973,535	14,510.31	1,661,430,069	1.625	2026/05/15	0.88
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	72,000,000	2,117.88	1,524,876,233	2,139.31	1,540,303,541	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	14,571.59	1,194,870,147	14,702.69	1,205,620,215	2.250	2026/03/31	0.64
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,121.03	1,060,515,674	2,151.78	1,075,888,671	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,403.60	930,193,072	2,651.61	1,026,173,199	3.720	2051/04/12	0.54



アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	15,184.62	911,077,477	14,939.88	896,392,932	3.875	2033/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	14,744.91	899,439,597	14,557.72	888,020,622	3.500	2033/02/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	2,098.75	860,487,923	2,148.47	880,873,149	2.400	2028/07/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	15,188.69	880,943,900	15,173.42	880,058,376	4.250	2025/12/31	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,400,000	2,166.73	832,023,998	2,240.48	860,343,333	3.020	2031/05/27	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	15,460.01	865,760,418	15,263.21	854,739,616	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	15,066.70	828,668,675	15,196.90	835,829,282	4.125	2027/02/15	0.44
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	2,097.87	818,167,958	2,121.18	827,259,716	2.180	2025/08/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,382.25	789,552,766	13,584.08	801,460,769	0.750	2028/01/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	15,089.12	799,723,410	15,095.68	800,070,821	3.875	2026/01/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,092.32	803,262,000	14,004.82	798,274,468	2.875	2032/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,593.69	802,653,002	14,399.18	791,954,763	3.375	2033/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,518.39	769,474,436	14,555.58	771,445,790	2.750	2028/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,884.95	759,132,449	15,071.29	768,635,559	4.000	2034/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	13,347.95	747,485,271	13,558.17	759,257,298	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,248.12	762,405,794	15,185.01	759,250,286	4.000	2028/02/29	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,924.39	764,370,644	15,661.99	751,775,543	4.500	2033/11/15	0.40
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	35,000,000	2,113.82	739,837,273	2,121.92	742,670,538	1.990	2026/03/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,213.56	745,464,255	15,149.79	742,339,811	4.000	2027/01/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,382.73	738,371,188	15,351.78	736,885,203	4.625	2026/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,670.05	722,192,884	12,712.89	724,634,515	1.125	2031/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,029.35	716,614,342	13,050.54	717,779,746	1.625	2031/05/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,102.07	705,103,598	14,155.43	707,771,298	2.375	2029/03/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,542.47	698,038,613	14,610.92	701,324,000	2.625	2027/05/31	0.37

中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,106.71	674,147,615	2,176.42	696,453,201	2.600	2030/09/15	0.37
----	------	-----------------------	------------	----------	-------------	----------	-------------	-------	------------	------

## ロ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.73
合計	98.73

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ポーランド	国債証券	REPUBLIC OF POLAND	2,100,000	15,146.02	318,066,517	15,257.11	320,399,306	5.125	2034/09/18	3.25
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,700,000	13,978.51	237,634,752	14,994.91	254,913,521	6.000	2033/02/22	2.59
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000	16,415.28	229,813,970	17,343.56	242,809,785	9.375	2033/01/19	2.46
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000	16,189.22	226,649,011	16,898.28	236,575,904	9.875	2028/01/15	2.40
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000	14,911.68	208,763,531	15,473.57	216,630,044	7.500	2034/02/02	2.20
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000	14,556.68	203,793,529	14,961.99	209,467,804	6.000	2033/10/20	2.13
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,400,000	14,820.78	207,490,962	14,736.68	206,313,515	6.400	2035/02/14	2.09
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	12,265.47	196,247,597	12,298.25	196,771,991	2.250	2033/02/02	2.00
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,200,000	15,559.17	186,710,036	15,928.00	191,135,979	6.250	2031/01/25	1.94
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000	15,627.71	171,904,758	16,899.04	185,889,451	9.125	2030/07/13	1.89
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,400,000	12,014.26	168,199,704	13,098.71	183,381,966	5.875	2060/01/30	1.86
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,300,000	13,255.90	172,326,712	14,074.94	182,974,189	7.300	2052/04/20	1.86

ポーランド	国債証券	REPUBLIC OF POLAND	1,200,000	15,097.20	181,166,403	14,910.92	178,931,023	5.500	2054/03/18	1.82
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	12,494.49	162,428,326	12,772.64	166,044,355	1.875	2031/09/15	1.69
ハンガリー	国債証券	HUNGARY	1,100,000	14,750.26	162,252,867	14,904.67	163,951,354	5.500	2036/03/26	1.66
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	12,705.26	152,463,170	12,788.04	153,456,469	2.659	2031/05/24	1.56
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,000,000	15,112.96	151,129,625	15,169.15	151,691,519	5.000	2034/01/16	1.54
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,000,000	14,484.09	144,840,866	14,655.12	146,551,242	3.750	2030/04/16	1.49
ハンガリー	国債証券	HUNGARY	900,000	14,671.33	132,042,003	15,940.65	143,465,857	6.250	2032/09/22	1.46
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,000,000	14,243.78	142,437,801	14,310.15	143,101,525	4.875	2033/05/19	1.45
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	11,044.75	143,581,711	10,649.92	138,448,904	3.125	2049/09/30	1.41
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,000,000	12,954.20	129,541,987	13,206.33	132,063,345	2.783	2031/01/23	1.34
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	14,579.11	131,211,967	14,568.69	131,118,217	6.338	2053/05/04	1.33
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	15,694.80	125,558,425	15,984.55	127,876,428	8.000	2033/04/20	1.30
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	900,000	13,396.43	120,567,844	13,474.63	121,271,660	4.400	2050/04/16	1.23
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	800,000	15,191.60	121,532,790	15,155.28	121,242,239	6.000	2036/05/07	1.23
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	900,000	13,328.24	119,954,121	13,461.21	121,150,927	3.500	2034/01/31	1.23
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	800,000	14,626.47	117,011,724	15,100.55	120,804,431	5.625	2050/11/18	1.23
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	14,186.37	113,490,970	15,092.47	120,739,797	6.125	2028/10/24	1.23
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	800,000	14,902.92	119,223,324	14,924.03	119,392,227	5.750	2054/01/16	1.21

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	95.87
合計	95.87

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,771	585,798.68	1,037,449,459	579,000.00	1,025,409,000	6.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,559	539,768.84	841,499,625	520,000.00	810,680,000	5.30
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,908	151,200.80	742,093,535	147,700.00	724,911,600	4.74
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	7,646	91,751.81	701,534,317	93,600.00	715,665,600	4.67
日本	投資証券	GLP投資法人	5,098	122,489.52	624,451,574	131,400.00	669,877,200	4.38
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4,246	150,465.87	638,878,082	154,600.00	656,431,600	4.29
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,644	256,652.38	678,588,904	247,100.00	653,332,400	4.27
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,363	64,280.84	537,580,695	68,100.00	569,520,300	3.72
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,288	247,590.30	566,486,605	242,100.00	553,924,800	3.62
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,395	143,436.30	486,966,251	143,400.00	486,843,000	3.18
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,024	162,164.38	490,385,090	156,100.00	472,046,400	3.08
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,492	313,105.83	467,153,891	315,000.00	469,980,000	3.07
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,576	75,066.04	418,568,240	76,800.00	428,236,800	2.80
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	4,561	74,941.28	341,807,156	79,300.00	361,687,300	2.36
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,779	125,790.92	349,572,975	123,600.00	343,484,400	2.24
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,038	331,189.85	343,775,061	326,500.00	338,907,000	2.21
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	524	597,052.19	312,855,346	642,000.00	336,408,000	2.20

日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,944	146,123.73	284,064,531	148,200.00	288,100,800	1.88
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	633	432,104.32	273,522,037	422,500.00	267,442,500	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	1,020	260,573.06	265,784,518	256,200.00	261,324,000	1.71
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	738	390,024.05	287,837,750	353,500.00	260,883,000	1.70
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	563	426,350.43	240,035,294	434,500.00	244,623,500	1.60
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,862	133,273.11	248,154,530	129,600.00	241,315,200	1.58
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	764	294,695.77	225,147,567	311,500.00	237,986,000	1.55
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,278	102,896.89	234,399,105	101,900.00	232,128,200	1.52
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,785	131,051.73	233,927,341	128,600.00	229,551,000	1.50
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,926	71,523.64	209,278,165	69,800.00	204,234,800	1.33
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	524	358,802.76	188,012,646	378,500.00	198,334,000	1.30
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,341	150,191.43	201,406,705	142,700.00	191,360,700	1.25
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	644	295,343.62	190,201,290	293,400.00	188,949,600	1.23

## □ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.69
合計	98.69

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年7月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	167,586	20,112.84	3,370,630,981	19,221.16	3,221,197,252	8.04
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	17,094	133,282.36	2,278,328,613	117,191.30	2,003,268,061	5.00
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	108,411	14,385.54	1,559,551,263	17,109.87	1,854,897,639	4.63
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	158,136	8,076.05	1,277,114,240	8,897.92	1,407,081,919	3.51

アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	59,090	22,891.06	1,352,632,650	23,599.24	1,394,478,878	3.48
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	28,551	43,364.50	1,238,099,804	46,398.16	1,324,713,946	3.31
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	58,588	21,160.30	1,239,739,429	22,109.90	1,295,374,680	3.23
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	314,107	2,900.69	911,127,619	3,492.73	1,097,091,727	2.74
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	38,227	21,419.72	818,811,700	24,862.96	950,436,524	2.37
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	188,053	4,567.07	858,851,815	4,789.66	900,710,834	2.25
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	52,925	11,544.41	610,987,942	15,440.65	817,196,274	2.04
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,857	27,017.68	698,596,146	31,423.98	812,529,892	2.03
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	62,983	9,256.44	582,998,398	10,605.25	667,950,511	1.67
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	72,232	6,744.29	487,153,440	8,362.86	604,065,987	1.51
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	103,209	5,096.08	525,961,341	5,333.88	550,503,966	1.37
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,835	18,584.18	535,874,690	18,143.41	523,165,192	1.31
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,550	35,247.65	407,110,320	42,805.15	494,399,505	1.23
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,016	19,356.30	406,792,015	21,541.30	452,711,885	1.13
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	22,550	19,909.17	448,951,851	19,396.47	437,390,299	1.09
イギリス	投資証券	SEGRE PLC	239,847	1,698.03	407,268,110	1,787.29	428,675,856	1.07
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	128,507	2,565.85	329,730,012	3,329.29	427,837,018	1.07
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	117,891	2,966.59	349,734,814	3,358.25	395,907,828	0.99
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,019	6,924.83	339,448,006	7,660.11	375,490,932	0.94
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	39,026	8,549.51	333,653,048	9,268.35	361,706,705	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,434	10,130.23	348,824,340	10,449.76	359,827,104	0.90
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	130,084	3,072.61	399,696,856	2,713.43	352,974,088	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	55,893	5,504.43	307,658,901	6,227.17	348,055,436	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	19,215	14,570.35	279,969,311	17,041.27	327,447,956	0.82
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,403	5,394.92	320,474,640	5,509.18	327,261,914	0.82

オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	960,992	309.95	297,862,284	338.81	325,593,699	0.81
---------	------	---------------	---------	--------	-------------	--------	-------------	------

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.35
合計	98.35

ゴールド・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2024年7月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	1,083,160	6,127.9165	6,637,514,019	7,272.9124	7,877,727,795	63.06
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	634,440	5,701.5526	3,617,293,013	6,934.4956	4,399,521,388	35.22

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2024年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.28
合計	98.28

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド( B号)

2024年7月31日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	TOPI X 先 物 0609 月 2024年 9月	買建	131	日本・円	3,685,659,100	3,664,070,000	1.07

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	国/ 地域	取引 所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	IC E- EU	FTS E 10 0 ID X FU T SE P 24 2024年9月	買建	15	イギリ ス・ポ ンド	1,234,240.00	241,614,822	1,242,975.00	243,324,786	0.03
	ドイ ツ	EU RE X	EUR OST OXX 50 S EP 24 2024年9月	買建	103	ユーロ	5,082,356.00	838,029,680	5,018,160.00	827,444,402	0.10
	アメ リカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 500 EMIN I FU T SE P 24 2024年9月	買建	113	アメリ カ・ド ル	31,455,939.00	4,795,143,341	30,919,625.00	4,713,387,635	0.58



オー スト ラリ ア	シド ニー 先物 取引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S S E P 2 4 2024年 9月	買建	8	オース トラリ ア・ド ル	1,577,886.00	157,236,339	1,582,800.00	157,726,020	0.02
---------------------	---------------------------	--	----	---	------------------------	--------------	-------------	--------------	-------------	------

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2024年7月31日現在

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	8,514,000.00	1,304,618,080	1,297,413,838	0.16
	ユーロ	買建	672,000.00	112,204,041	110,794,656	0.01
	イギリス・ポンド	買建	215,000.00	42,578,449	42,082,444	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	国/ 地域	取引 所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	アメ リカ	I C E - U S	M S C I E M G M K T S E P 2 4 2024年9月	買建	417	アメ リカ・ ドル	22,747,912.00	3,467,691,705	22,357,455.00	3,408,170,440	7.02

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2024年7月31日現在

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	638,450.54	97,900,000	97,295,495	0.20
	アメリカ・ドル	売建	3,914,757.12	602,900,000	596,585,496	1.23

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

該当事項はありません。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	3,520,393.00	544,816,015	536,459,860	1.89
	ユーロ	買建	2,018,290.13	337,371,164	332,719,587	1.17
	オフショア・人民元	買建	4,700,000.00	99,600,520	98,969,310	0.35
	イギリス・ポンド	買建	292,081.87	57,932,423	57,160,134	0.20
	カナダ・ドル	買建	174,640.00	19,488,060	19,210,443	0.07
	オーストラリア・ドル	買建	139,203.00	14,102,881	13,867,550	0.05

メキシコ・ペソ	買建	818,890.63	6,750,624	6,633,341	0.02
ポーランド・ズロチ	買建	167,067.60	6,483,307	6,419,220	0.02
シンガポール・ドル	買建	52,416.18	6,010,656	5,956,364	0.02
イスラエル・シケル	買建	133,914.00	5,527,133	5,450,728	0.02
ニュージーランド・ドル	買建	51,851.18	4,698,354	4,665,221	0.02
デンマーク・クローネ	買建	10,000.00	231,611	220,883	0.00
ノルウェー・クローネ	買建	10,000.00	150,662	139,217	0.00
アメリカ・ドル	売建	82,321,417.56	13,153,381,601	12,539,610,027	44.16
ユーロ	売建	49,660,000.00	8,520,942,935	8,184,216,300	28.82
オフショア・人民元	売建	130,430,000.00	2,861,566,706	2,745,642,801	9.67
イギリス・ポンド	売建	7,230,000.00	1,461,831,752	1,414,344,891	4.98
カナダ・ドル	売建	4,780,026.79	558,482,302	525,563,946	1.85
オーストラリア・ドル	売建	3,400,003.00	362,848,359	338,551,898	1.19
シンガポール・ドル	売建	2,100,000.00	248,146,932	238,560,000	0.84
メキシコ・ペソ	売建	25,010,000.00	217,428,374	202,378,419	0.71
ポーランド・ズロチ	売建	3,910,000.00	155,390,470	150,151,820	0.53
イスラエル・シケル	売建	2,040,000.00	86,615,080	83,034,528	0.29
デンマーク・クローネ	売建	3,140,000.00	72,347,201	69,357,262	0.24
ニュージーランド・ドル	売建	710,000.00	68,895,698	63,852,643	0.22
スウェーデン・クローナ	売建	2,900,000.00	43,886,311	41,044,570	0.14
ノルウェー・クローネ	売建	2,880,000.00	43,313,673	40,094,496	0.14

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	オーストラリア・ドル	買建	1.00	101	99	0.00
	アメリカ・ドル	売建	4,253,130.56	655,308,926	648,151,577	0.34
	ユーロ	売建	2,852,322.84	475,517,071	470,222,533	0.25
	オフショア・人民元	売建	4,920,000.00	104,236,920	103,561,572	0.05
	イギリス・ポンド	売建	243,188.39	48,151,954	47,593,110	0.03
	オーストラリア・ドル	売建	42,269.00	4,263,978	4,211,036	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	500,000.00	77,144,000	76,208,500	0.77

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	TREI T 先 物 0609 月 2024年 9月	買建	20	日本・円	34,094,400	34,250,000	0.22

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年7月31日現在

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	518,108.19	79,100,000	78,932,921	0.20
	ユーロ	買建	167,400.76	27,600,000	27,599,865	0.07
	イギリス・ポンド	買建	63,388.66	12,400,000	12,400,197	0.03
	オーストラリア・ドル	買建	122,638.21	12,300,000	12,215,842	0.03
	香港・ドル	買建	274,295.47	5,400,000	5,350,873	0.01
	アメリカ・ドル	売建	495,432.03	76,300,000	75,500,868	0.19
	オーストラリア・ドル	売建	54,547.04	5,500,000	5,434,232	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報

基準日:2024年7月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

### ■日本株インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■先進国株インデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■先進国株インデックスヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■新興国株インデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■新興国株インデックスヘッジ無

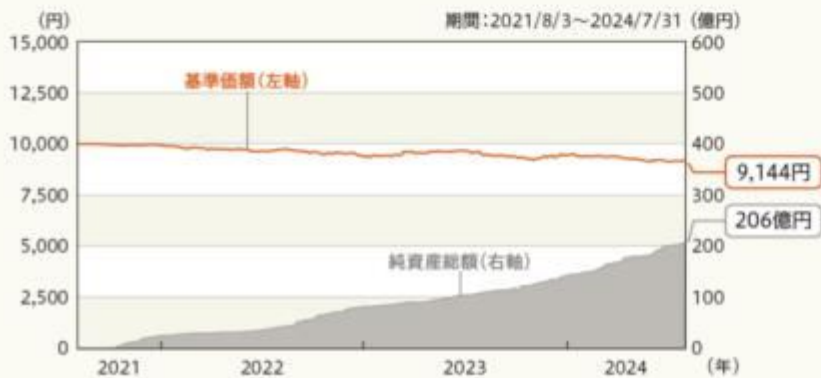


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■日本債インデックス

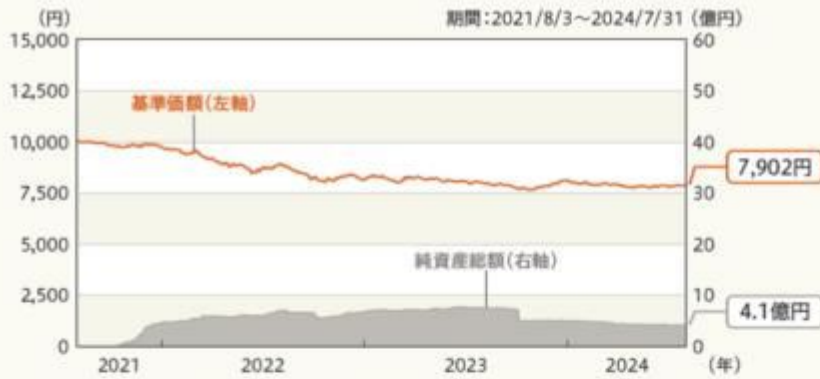


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■先進国債インデックスヘッジ有

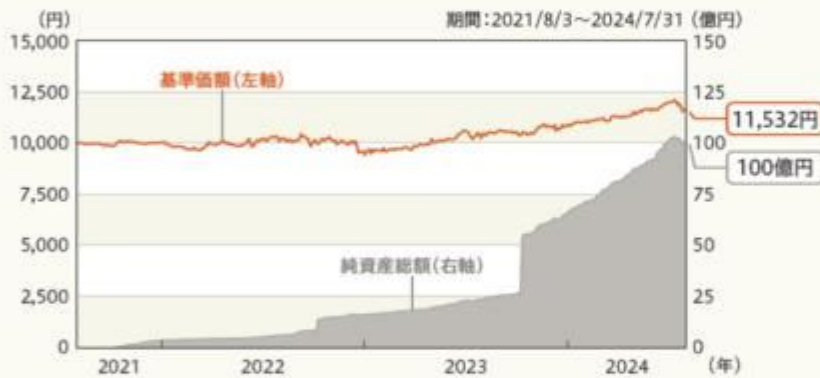


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■先進国債インデックスヘッジ無

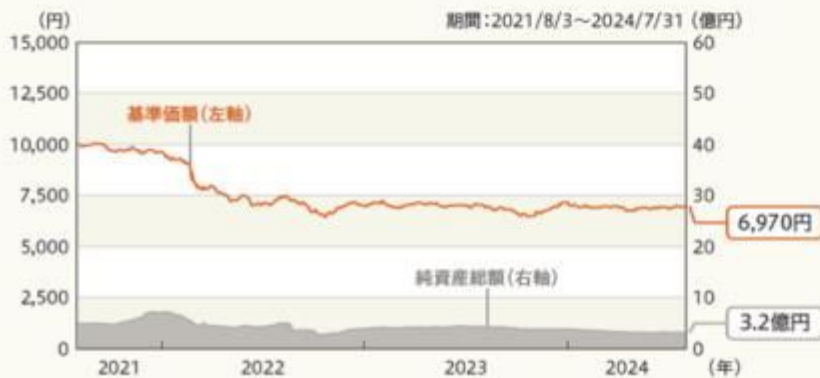


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■新興国債インデックスヘッジ有

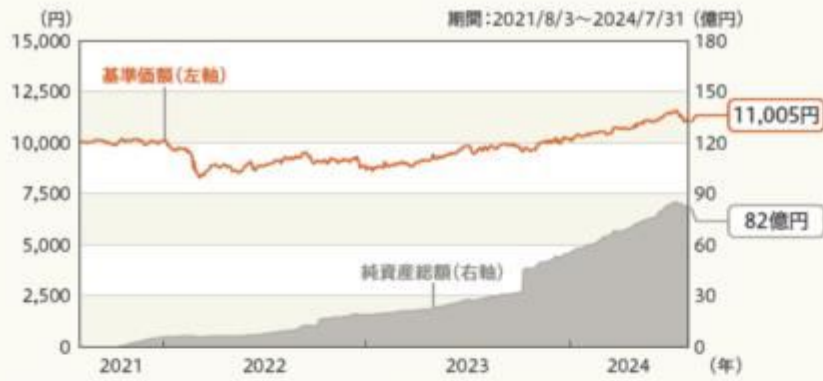


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■新興国債インデックスヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■Jリートインデックス

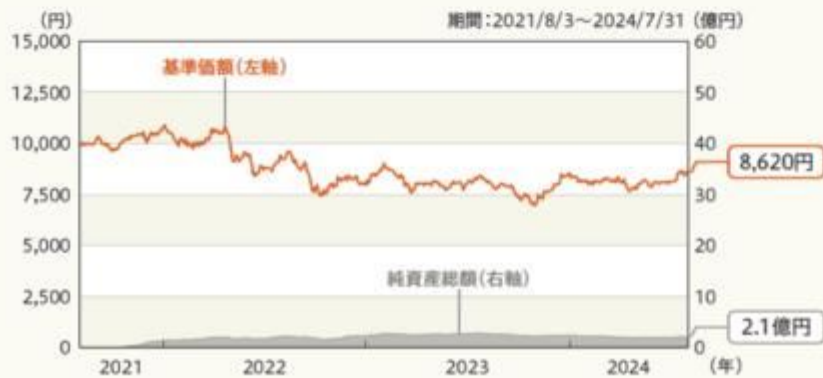


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■Gリートインデックスヘッジ有



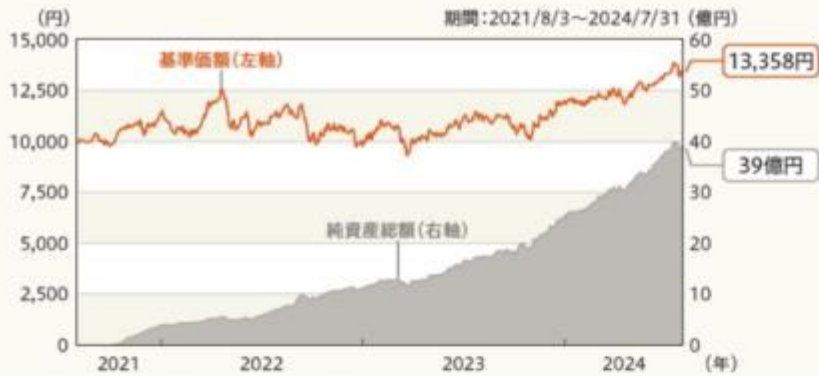
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。



## ■Gリートインデックスヘッジ無

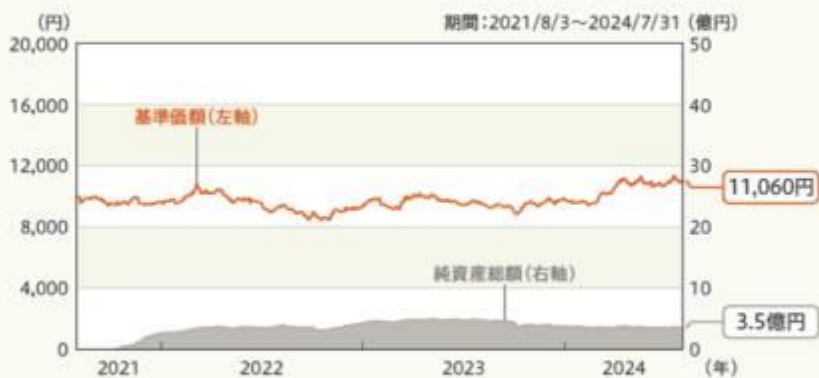


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## ■ゴールドヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## ■ゴールドヘッジ無



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2024年7月	0円
2023年7月	0円
2022年8月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。



## 主要な資産の状況

### ■日本株インデックス

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.05
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
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(B号)	100.05

### ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.07
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.07%

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.94
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.64
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.89
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.66
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.65
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.61
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.60
日本	株式	信越化学工業	化学	1.52

### ■先進国株インデックスヘッジ有

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.23
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	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	95.77

### ■先進国株インデックスヘッジ無

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.06
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	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	100.06

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	71.30
	イギリス	3.78
	カナダ	3.24
	スイス	3.03
	フランス	2.75
	ドイツ	2.30
	その他	10.92
	投資証券	アメリカ・その他
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.69
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 0.73%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ソフトウェア	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.75
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.13
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費サービス・流通小売	2.71
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.62
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.40
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・ヘルスケア	1.02
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.02
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1.01

## ■新興国株インデックスヘッジ有

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.03
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	95.97

## ■新興国株インデックスヘッジ無

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.09
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	100.09

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	インド	18.79
	台湾	17.12
	ケイマン諸島	12.66
	韓国	11.21
	その他	22.75
	投資証券	アメリカ
投資証券	その他	0.67
投資信託受益証券	香港	3.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7.03
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 7.02%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	8.80
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.74
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	3.70
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	3.62
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ソフトウェア	3.51
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費サービス・流通小売	1.90
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.39
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	1.05
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	0.95
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	0.94

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※[主要投資銘柄(上位10銘柄)]は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。



## ■日本債インデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.05
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券(NOMURA-BPI) マザーファンド	100.05

## ■国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	76.63
地方債証券	日本	9.03
特殊債証券	日本	7.47
社債証券	日本	6.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.48
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	154 5年国債	0.100	2027/09/20	1.23
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	1.20
日本	国債証券	146 5年国債	0.100	2025/12/20	0.99
日本	国債証券	156 5年国債	0.200	2027/12/20	0.96
日本	国債証券	141 20年国債	1.700	2032/12/20	0.91
日本	国債証券	374 10年国債	0.800	2034/03/20	0.89
日本	国債証券	366 10年国債	0.200	2032/03/20	0.89
日本	国債証券	372 10年国債	0.800	2033/09/20	0.88
日本	国債証券	367 10年国債	0.200	2032/06/20	0.87
日本	国債証券	373 10年国債	0.600	2033/12/20	0.87

## ■先進国債インデックスヘッジ有

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.06
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・ マザーファンド	100.06

## ■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	44.31
	中国	9.62
	フランス	7.22
	イタリア	6.66
	ドイツ	5.78
	イギリス	4.98
	スペイン	4.40
	その他	11.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.85
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2026/05/31	1.01
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.670	2033/05/25	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2031/04/30	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2027/04/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2027/01/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2027/04/30	0.59
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.370	2029/01/15	0.58
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.850	2027/05/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2043/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	0.52

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■先進国債インデックスヘッジ無

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.05
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.05

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	46.44
	中国	10.09
	フランス	7.57
	イタリア	6.90
	ドイツ	6.06
	イギリス	5.22
	スペイン	4.58
	その他	11.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.27
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.88
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.64
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2033/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.400	2028/07/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2025/12/31	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.46

## ■新興国債インデックスヘッジ有

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.19
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・ マザーファンド	96.81

## ■新興国債インデックスヘッジ無

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.48
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・ マザーファンド	99.52

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。



## ■米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	トルコ	10.51
	サウジアラビア	9.60
	メキシコ	8.73
	アラブ首長国連邦	7.58
	ブラジル	7.45
	チリ	6.08
	ポーランド	6.00
	その他	39.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.13
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ポーランド	国債証券	REPUBLIC OF POLAND	5.125	2034/09/18	3.25
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	2.59
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.375	2033/01/19	2.46
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	2028/01/15	2.40
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.500	2034/02/02	2.20
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.000	2033/10/20	2.13
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	6.400	2035/02/14	2.09
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	2.00
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNL BOND	6.250	2031/01/25	1.94
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.125	2030/07/13	1.89

## ■Jリートインデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.06
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	100.06

## ■Jリート・インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.31
合計(純資産総額)		100.00

※Jリート指数先物取引の買建て 0.22%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.30
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.74
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.67
日本	投資証券	GLP投資法人	4.38
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4.29
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.27
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3.72
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.62
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.18

## ■Gリートインデックスヘッジ有

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.26
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	95.74

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■グリートインデックスヘッジ無

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.07
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	100.07

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	77.25
	オーストラリア	7.04
	イギリス	4.79
	シンガポール	3.00
	フランス	1.64
	カナダ	1.36
	ベルギー	0.99
	その他	2.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.65
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.04
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.00
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	4.63
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.51
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.48
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.31
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.23
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	2.74
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	2.37
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.25

## ■ゴールドヘッジ有

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.38
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	96.62

## ■ゴールドヘッジ無

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.00
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	100.00

## ■ゴールド・インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	98.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.72
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	63.06
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	35.22

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

■日本株インデックス (ベンチマーク: TOPIX (東証株価指数、配当込み))



■先進国株インデックスヘッジ有 (ベンチマーク: MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ヘッジ換算ベース))



■先進国株インデックスヘッジ無 (ベンチマーク: MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。



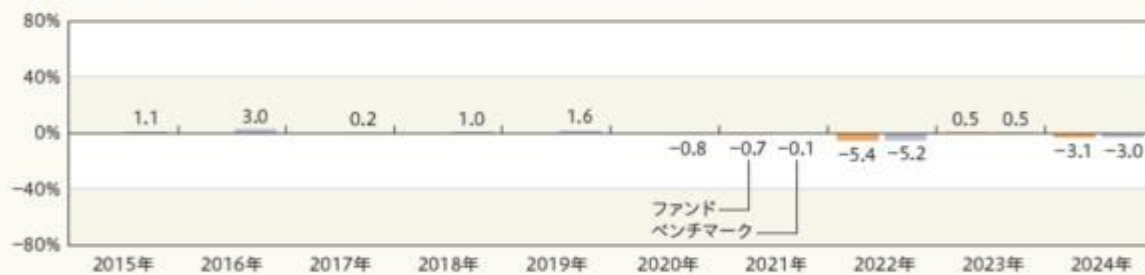
### ■新興国株インデックスヘッジ有（ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み,米ドル円ヘッジ換算ベース)）



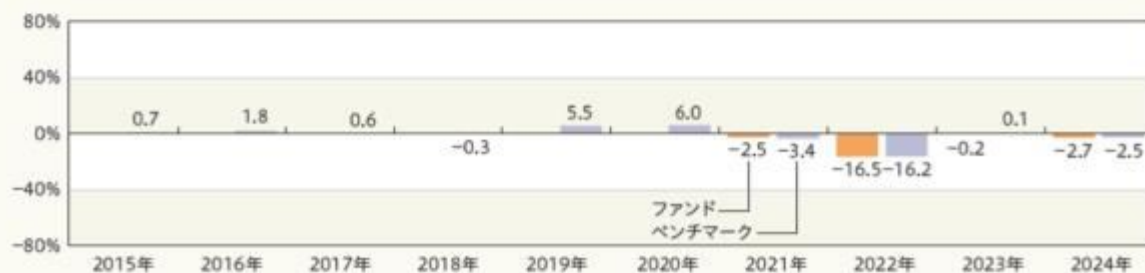
### ■新興国株インデックスヘッジ無（ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み,円換算ベース)）



### ■日本債インデックス（ベンチマーク:NOMURA-BPI（総合））



### ■先進国債インデックスヘッジ有（ベンチマーク:FTSE世界国債インデックス(除く日本,円ヘッジ換算ベース)）



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。



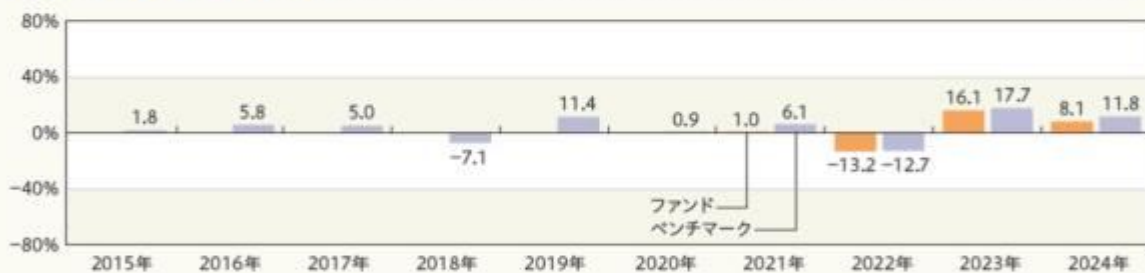
### ■先進国債インデックスヘッジ無 (ベンチマーク: FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))



### ■新興国債インデックスヘッジ有 (ベンチマーク: JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジ換算ベース))



### ■新興国債インデックスヘッジ無 (ベンチマーク: JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース))



### ■Jリートインデックス (ベンチマーク: 東証REIT指数(配当込み))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

### ■Gリートインデックスヘッジ有（ベンチマーク：S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ換算ベース））



### ■Gリートインデックスヘッジ無（ベンチマーク：S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））



### ■ゴールドヘッジ有（ベンチマーク：LBMA金価格（円ヘッジ換算ベース））



### ■ゴールドヘッジ無（ベンチマーク：LBMA金価格（円換算ベース））



※ファンドの収益率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

（イ）当ファンドは日興ファンドラップ専用ファンドです。取得申込みにあたっては、販売会社所定の手続きが必要となります。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。

お申込みの販売会社にお問い合わせください。

- (ロ) 原則として午後3時\*までに、取得申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。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、お申込みの販売会社にご確認ください。

\*2024年11月5日以降、「日本債インデックス」以外のファンドは、午後3時30分までに販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とする予定です。なお、「日本債インデックス」については変更ありません。

また、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

- (ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

- (二) 申込不可日

上記にかかわらず、各ファンドにつき、取得申込日が以下の申込不可日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・香港の取引所の休業日
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・オーストラリアの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日

「日本株インデックス」、「日本債インデックス」、「Gリートインデックス」は、申込不可日はありません。

- ロ 申込価額

各ファンドにつき、以下の通りとなります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ファンド名	申込価額
日本株インデックス 日本債インデックス Gリートインデックス	取得申込受付日の基準価額となります。

先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無 Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。
--	-------------------------

八 申込手数料

ありません。

二 申込単位

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、各ファンドにつき、以下の申込金額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

ファンド名	申込金額
日本株インデックス 日本債インデックス Jリートインデックス	取得申込受付日の基準価額 × 申込口数
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無 Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	取得申込受付日の翌営業日の基準価額 × 申込口数

2 【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求(一部解約の実行請求)により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下の申込不可日に当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・香港の取引所の休業日
先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無	・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・オーストラリアの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日

「日本株インデックス」、「日本債インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時\*までに、解約請求のお申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。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、お申込みの販売会社にご確認ください。

\*2024年11月5日以降、「日本債インデックス」以外のファンドは、午後3時30分までに販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とする予定です。なお、「日本債インデックス」については変更ありません。

また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかか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または記録が行われます。

一部解約金は、各ファンドにつき、解約請求受付日から起算して以下の日からお支払いします。

ファンド名	一部解約金支払開始日
日本株インデックス 日本債インデックス	4営業日目
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 Jリートインデックス Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	5営業日目

新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無	6営業日目
--	-------

一部解約価額は、各ファンドにつき、以下の通りとなります。

ファンド名	一部解約価額
日本株インデックス 日本債インデックス Jリートインデックス	解約請求受付日の基準価額
先進国株インデックスヘッジ有 先進国株インデックスヘッジ無 新興国株インデックスヘッジ有 新興国株インデックスヘッジ無 先進国債インデックスヘッジ有 先進国債インデックスヘッジ無 新興国債インデックスヘッジ有 新興国債インデックスヘッジ無 Gリートインデックスヘッジ有 Gリートインデックスヘッジ無 ゴールドヘッジ有 ゴールドヘッジ無	解約請求受付日の翌営業日の基準価額

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、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。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、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令およ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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本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するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<主要投資対象の評価方法>

「各マザーファンド（ゴールド・インデックス・マザーファンドを除く）」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
--------	------------

株式、投資証券、債券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

「ゴールド・インデックス・マザーファンド」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

#### □ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、以下の通り掲載されます。

ファンド名	掲載名
日本株インデックス	NS日株イ
先進国株インデックスヘッジ有	NS先株イ有
先進国株インデックスヘッジ無	NS先株イ無
新興国株インデックスヘッジ有	NS興株イ有
新興国株インデックスヘッジ無	NS興株イ無
日本債インデックス	NS日債イ
先進国債インデックスヘッジ有	NS先債イ有
先進国債インデックスヘッジ無	NS先債イ無
新興国債インデックスヘッジ有	NS興債イ有
新興国債インデックスヘッジ無	NS興債イ無
Jリートインデックス	NSJリイ
Gリートインデックスヘッジ有	NSGリイ有
Gリートインデックスヘッジ無	NSGリイ無
ゴールドヘッジ有	NS金イ有
ゴールドヘッジ無	NS金イ無

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

#### (2) 【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載ま

たは記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2021年8月3日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年8月1日から翌年7月31日までとすることを原則としますが、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するものとします。なお、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】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドの残存口数が30億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約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、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)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、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 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。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面また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、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社はその任務に違反して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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任し



ます。

- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### (イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。  
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### (ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

#### 八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その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。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）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、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およ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、当ファンドの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。
- (ハ) 上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）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、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 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（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- (ホ) 上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面また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。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、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、相手方とな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、併合を行うことはできません。

## 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

## 4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

### ロ 償還金請求権

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、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載ま

た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かか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または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われま

す。  
償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### 八 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

#### 二 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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)ならびに同規則第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3期(2023年8月1日から2024年7月31日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【日興FWS・日本株インデックス】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	188,028	54,548
コール・ローン	6,667,923	11,563,586
親投資信託受益証券	7,276,860,431	13,574,735,299
流動資産合計	7,283,716,382	13,586,353,433
資産合計	7,283,716,382	13,586,353,433
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,855,572	11,586,356
未払受託者報酬	638,308	1,282,146
未払委託者報酬	2,872,586	5,769,790
その他未払費用	159,532	320,453
流動負債合計	10,525,998	18,958,745
負債合計	10,525,998	18,958,745
純資産の部		
元本等		
元本	5,821,638,664	8,836,978,562
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,451,551,720	4,730,416,126
(分配準備積立金)	1,166,991,226	2,818,878,264
元本等合計	7,273,190,384	13,567,394,688
純資産合計	7,273,190,384	13,567,394,688
負債純資産合計	7,283,716,382	13,586,353,433

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
<b>営業収益</b>				
受取利息		27		1,365
有価証券売買等損益		1,145,313,600		2,026,173,688
営業収益合計		1,145,313,627		2,026,175,053
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,856		1,044
受託者報酬		1,077,612		2,148,251
委託者報酬		4,849,674		9,667,381
その他費用		269,319		536,936
営業費用合計		6,198,461		12,353,612
営業利益又は営業損失( )		1,139,115,166		2,013,821,441
経常利益又は経常損失( )		1,139,115,166		2,013,821,441
当期純利益又は当期純損失( )		1,139,115,166		2,013,821,441
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		2,510,884		90,049,894
期首剰余金又は期首欠損金( )		77,576,756		1,451,551,720
剰余金増加額又は欠損金減少額		271,326,733		1,780,313,352
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		271,326,733		1,780,313,352
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,956,051		425,220,493
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,956,051		425,220,493
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,451,551,720		4,730,416,126

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,821,638,664口	8,836,978,562口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2493円 (1万口当たりの純資産額12,493円)	1口当たり純資産額 1.5353円 (1万口当たりの純資産額15,353円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(126,233,451円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,010,370,831円)、収益調整金(284,560,494円)、および分配準備積立金(30,386,944円)より、分配対象収益は1,451,551,720円(1万口当たり2,493.37円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(221,015,978円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,702,755,569円)、収益調整金(1,911,537,862円)、および分配準備積立金(895,106,717円)より、分配対象収益は4,730,416,126円(1万口当たり5,352.98円)であります。分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。



<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,167,183,176円
合計	1,167,183,176円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,995,929,333円
合計	1,995,929,333円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	2,721,511,626円	5,821,638,664円
期中追加設定元本額	4,297,436,756円	4,672,800,551円
期中一部解約元本額	1,197,309,718円	1,657,460,653円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
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(B号)	2,723,061,784	13,574,735,299	
	親投資信託受益証券 小計		13,574,735,299	
合 計			13,574,735,299	

## 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。

## 【日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	10	298
コール・ローン	347	63,136
親投資信託受益証券	2,301,116,736	1,396,299,523
派生商品評価勘定	13,097	61,252,508
未収入金	-	39,581,799
流動資産合計	2,301,130,190	1,497,197,264
資産合計	2,301,130,190	1,497,197,264
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,293,695	-
未払解約金	-	38,295,882
未払受託者報酬	222,519	166,321
未払委託者報酬	1,001,533	748,569
その他未払費用	66,679	49,814
流動負債合計	24,584,426	39,260,586
負債合計	24,584,426	39,260,586
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,322,197,234	1,333,030,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	45,651,470	124,905,766
(分配準備積立金)	128,161,289	211,995,081
元本等合計	2,276,545,764	1,457,936,678
純資産合計	2,276,545,764	1,457,936,678
負債純資産合計	2,301,130,190	1,497,197,264

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		-		944
有価証券売買等損益		388,617,619		375,381,957
為替差損益		210,136,218		238,777,667
営業収益合計		178,481,401		136,605,234
営業費用				
支払利息		2,238		1,417
受託者報酬		376,519		365,969
委託者報酬		1,694,670		1,647,180
その他費用		112,915		109,692
営業費用合計		2,186,342		2,124,258
営業利益又は営業損失（ ）		176,295,059		134,480,976
経常利益又は経常損失（ ）		176,295,059		134,480,976
当期純利益又は当期純損失（ ）		176,295,059		134,480,976
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（ ）		9,028,961		12,785,284
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		114,930,377		45,651,470
剰余金増加額又は欠損金減少額		52,582,017		25,252,384
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		52,582,017		25,252,384
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		168,627,130		1,961,408
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		168,627,130		1,961,408
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		45,651,470		124,905,766

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,322,197,234口	1,333,030,912口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 45,651,470円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9803円 (1万口当たりの純資産額9,803円)	1口当たり純資産額 1.0937円 (1万口当たりの純資産額10,937円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(33,459,585円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(87,098,714円)、収益調整金(13,371,988円)、および分配準備積立金(7,602,990円)より、分配対象収益は141,533,277円(1万口当たり609.48円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(22,866,668円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(124,399,592円)、収益調整金(16,703,858円)、および分配準備積立金(64,728,821円)より、分配対象収益は228,698,939円(1万口当たり1,715.63円)であります。分配を行っておりません。</p>
----------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日</p>
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	363,575,980円
合計	363,575,980円

## 第3期（自 2023年8月1日 至 2024年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	278,141,192円
合計	278,141,192円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 第2期（2023年7月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	1,708,574,113	-	1,727,176,551	18,602,438
	カナダ・ドル	75,786,217	-	76,369,677	583,460
	オーストラリア・ド ル	47,454,399	-	47,571,977	117,578
	イギリス・ポンド	95,847,808	-	96,147,460	299,652
	スイス・フラン	65,095,817	-	66,268,413	1,172,596
	スウェーデン・ク ローナ	20,449,524	-	20,859,808	410,284
	ユーロ	219,248,704	-	221,343,294	2,094,590
	小計	2,232,456,582	-	2,255,737,180	23,280,598
	合 計	2,232,456,582	-	2,255,737,180	23,280,598

## 第3期（2024年7月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	1,169,555,196	-	1,123,713,480	45,841,716
	カナダ・ドル	48,137,067	-	45,496,359	2,640,708
	オーストラリア・ド ル	30,500,649	-	28,317,692	2,182,957
	イギリス・ポンド	60,766,789	-	58,056,120	2,710,669
	スイス・フラン	39,376,308	-	38,367,086	1,009,222
	スウェーデン・ク ローナ	12,985,347	-	12,180,242	805,105



	ユーロ	135,888,841	-	129,826,710	6,062,131
	小計	1,497,210,197	-	1,435,957,689	61,252,508
	合計	1,497,210,197	-	1,435,957,689	61,252,508

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

## (その他の注記)

項目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	1,363,843,700円	2,322,197,234円
期中追加設定元本額	1,519,173,996円	213,156,900円
期中一部解約元本額	560,820,462円	1,202,323,222円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	151,969,909	1,396,299,523	
	親投資信託受益証券 小計		1,396,299,523	

合 計	1,396,299,523	
-----	---------------	--

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)」に記載しております。

## 【日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2023年 7月31日現在）	第3期 （2024年 7月31日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	53,653	327,772
コール・ローン	1,902,660	69,483,733
親投資信託受益証券	15,591,242,905	32,589,122,432
流動資産合計	15,593,199,218	32,658,933,937
資産合計	15,593,199,218	32,658,933,937
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,954,734	69,787,853
未払受託者報酬	1,332,130	3,100,930
未払委託者報酬	5,994,731	13,954,372
その他未払費用	399,676	930,200
流動負債合計	9,681,271	87,773,355
負債合計	9,681,271	87,773,355
純資産の部		
元本等		
元本	11,837,040,113	19,542,388,631
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,746,477,834	13,028,771,951
（分配準備積立金）	2,366,453,680	7,015,453,965
元本等合計	15,583,517,947	32,571,160,582
純資産合計	15,583,517,947	32,571,160,582
負債純資産合計	15,593,199,218	32,658,933,937

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		59		3,555
有価証券売買等損益		2,331,088,440		5,298,599,817
営業収益合計		2,331,088,499		5,298,603,372
営業費用				
支払利息		5,325		2,278
受託者報酬		2,217,621		5,044,969
委託者報酬		9,979,601		22,702,654
その他費用		665,455		1,513,529
営業費用合計		12,868,002		29,263,430
営業利益又は営業損失（ ）		2,318,220,497		5,269,339,942
経常利益又は経常損失（ ）		2,318,220,497		5,269,339,942
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,318,220,497		5,269,339,942
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（ ）		71,865,305		164,153,689
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		438,054,013		3,746,477,834
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,213,979,911		5,114,692,765
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,213,979,911		5,114,692,765
剰余金減少額又は欠損金増加額		151,911,282		937,584,901
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		151,911,282		937,584,901
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,746,477,834		13,028,771,951

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	11,837,040,113口	19,542,388,631口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3165円 (1万口当たりの純資産額13,165円)	1口当たり純資産額 1.6667円 (1万口当たりの純資産額16,667円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(194,941,961円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,051,413,231円)、収益調整金(1,380,024,154円)、および分配準備積立金(120,098,488円)より、分配対象収益は3,746,477,834円(1万口当たり3,165.05円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(401,504,652円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(4,703,681,601円)、収益調整金(6,013,317,986円)、および分配準備積立金(1,910,267,712円)より、分配対象収益は13,028,771,951円(1万口当たり6,666.93円)であります。分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,317,034,138円
合計	2,317,034,138円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,294,829,436円
合計	5,294,829,436円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	4,482,657,360円	11,837,040,113円
期中追加設定元本額	8,789,526,644円	10,577,162,915円
期中一部解約元本額	1,435,143,891円	2,871,814,397円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
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	3,546,922,337	32,589,122,432	
	親投資信託受益証券 小計		32,589,122,432	
合 計			32,589,122,432	

## 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。



## 【日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	111,149	411
コール・ローン	3,941,598	87,223
親投資信託受益証券	1,576,312,344	871,319,282
派生商品評価勘定	-	36,069,603
未収入金	2,164,700	20,323,261
流動資産合計	1,582,529,791	927,799,780
資産合計	1,582,529,791	927,799,780
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,812,006	-
未払金	846,645	-
未払解約金	6,215,980	18,959,354
未払受託者報酬	157,863	104,662
未払委託者報酬	1,263,177	837,448
その他未払費用	55,174	36,551
流動負債合計	25,350,845	19,938,015
負債合計	25,350,845	19,938,015
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,978,052,474	1,167,988,732
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	420,873,528	260,126,967
(分配準備積立金)	41,313,558	39,303,658
元本等合計	1,557,178,946	907,861,765
純資産合計	1,557,178,946	907,861,765
負債純資産合計	1,582,529,791	927,799,780

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		14		368
有価証券売買等損益		193,712,994		107,402,448
為替差損益		132,224,181		167,581,672
営業収益合計		61,488,827		60,178,856
営業費用				
支払利息		1,406		735
受託者報酬		270,561		238,963
委託者報酬		2,165,092		1,912,166
その他費用		94,600		83,509
営業費用合計		2,531,659		2,235,373
営業利益又は営業損失（ ）		58,957,168		62,414,229
経常利益又は経常損失（ ）		58,957,168		62,414,229
当期純利益又は当期純損失（ ）		58,957,168		62,414,229
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（ ）		7,876,828		57,231,951
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		226,368,944		420,873,528
剰余金増加額又は欠損金減少額		113,356,970		217,031,313
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		113,356,970		217,031,313
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		374,695,550		51,102,474
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		374,695,550		51,102,474
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		420,873,528		260,126,967

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	（2023年7月31日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,978,052,474口	1,167,988,732口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 420,873,528円	元本の欠損 260,126,967円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.7872円 （1万口当たりの純資産額7,872円）	1口当たり純資産額 0.7773円 （1万口当たりの純資産額7,773円）

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	
自 2023年8月1日 至 2024年7月31日		

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(32,978,875円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(18,394,576円)、および分配準備積立金(8,334,683円)より、分配対象収益は59,708,134円(1万口当たり301.85円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,967,968円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(14,197,107円)、および分配準備積立金(21,335,690円)より、分配対象収益は53,500,765円(1万口当たり458.06円)であります。分配を行っておりません。
----------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	185,283,432円
合計	185,283,432円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	98,466,342円
合計	98,466,342円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 第2期(2023年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	1,517,598,767	-	1,534,410,773	16,812,006
	小計	1,517,598,767	-	1,534,410,773	16,812,006
合 計		1,517,598,767	-	1,534,410,773	16,812,006

## 第3期(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	935,214,332	-	899,144,729	36,069,603
	小計	935,214,332	-	899,144,729	36,069,603
合 計		935,214,332	-	899,144,729	36,069,603

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	1,025,486,262円	1,978,052,474円
期中追加設定元本額	1,424,902,597円	195,507,747円
期中一部解約元本額	472,336,385円	1,005,571,489円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	412,205,167	871,319,282	
	親投資信託受益証券 小計		871,319,282	
合 計			871,319,282	

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)」に記載しております。

## 【日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2023年 7月31日現在）	第3期 （2024年 7月31日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	14,626	90,046
コール・ローン	518,676	19,088,603
親投資信託受益証券	5,119,720,723	9,438,570,921
流動資産合計	5,120,254,025	9,457,749,570
資産合計	5,120,254,025	9,457,749,570
負債の部		
流動負債		
未払解約金	523,421	19,147,426
未払受託者報酬	442,397	917,562
未払委託者報酬	3,539,329	7,340,802
その他未払費用	154,796	321,072
流動負債合計	4,659,943	27,726,862
負債合計	4,659,943	27,726,862
純資産の部		
元本等		
元本	4,691,714,003	7,657,838,336
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	423,880,079	1,772,184,372
（分配準備積立金）	485,813,622	1,314,461,219
元本等合計	5,115,594,082	9,430,022,708
純資産合計	5,115,594,082	9,430,022,708
負債純資産合計	5,120,254,025	9,457,749,570



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		70		1,600
有価証券売買等損益		566,831,531		928,046,698
営業収益合計		566,831,601		928,048,298
営業費用				
支払利息		2,510		1,128
受託者報酬		742,731		1,539,480
委託者報酬		5,942,442		12,316,531
その他費用		259,899		538,763
営業費用合計		6,947,582		14,395,902
営業利益又は営業損失（ ）		559,884,019		913,652,396
経常利益又は経常損失（ ）		559,884,019		913,652,396
当期純利益又は当期純損失（ ）		559,884,019		913,652,396
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（ ）		11,176,447		7,734,766
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		67,073,531		423,880,079
剰余金増加額又は欠損金減少額		16,299,747		527,371,285
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		16,299,747		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		527,371,285
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,053,709		84,984,622
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		84,984,622
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,053,709		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		423,880,079		1,772,184,372

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,691,714,003口	7,657,838,336口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0903円 (1万口当たりの純資産額10,903円)	1口当たり純資産額 1.2314円 (1万口当たりの純資産額12,314円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(96,758,796円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(370,649,427円)、収益調整金(56,093,345円)、および分配準備積立金(18,405,399円)より、分配対象収益は541,906,967円(1万口当たり1,155.03円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(191,095,881円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(714,821,749円)、収益調整金(484,703,763円)、および分配準備積立金(408,543,589円)より、分配対象収益は1,799,164,982円(1万口当たり2,349.44円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	565,696,396円
合計	565,696,396円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	941,578,808円
合計	941,578,808円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	1,660,054,229円	4,691,714,003円
期中追加設定元本額	3,496,690,057円	3,931,696,475円
期中一部解約元本額	465,030,283円	965,572,142円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	4,465,214,742	9,438,570,921	
	親投資信託受益証券 小計		9,438,570,921	
合 計			9,438,570,921	

## 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。

## 【日興FWS・日本債インデックス】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 ( 2023年 7月31日現在 )	第3期 ( 2024年 7月31日現在 )
資産の部		
流動資産		
金銭信託	364,041	33,065
コール・ローン	12,909,781	7,009,477
親投資信託受益証券	10,737,584,217	20,590,663,238
流動資産合計	10,750,858,039	20,597,705,780
資産合計	10,750,858,039	20,597,705,780
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,224,335	6,991,946
未払受託者報酬	1,024,137	1,937,059
未払委託者報酬	4,096,746	7,748,368
その他未払費用	204,796	387,324
流動負債合計	18,550,014	17,064,697
負債合計	18,550,014	17,064,697
純資産の部		
元本等		
元本	11,300,129,431	22,507,741,814
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	567,821,406	1,927,100,731
( 分配準備積立金 )	67,398,002	165,086,148
元本等合計	10,732,308,025	20,580,641,083
純資産合計	10,732,308,025	20,580,641,083
負債純資産合計	10,750,858,039	20,597,705,780

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	2022年 8月 2日	自	2023年 8月 1日
	至	2023年 7月31日	至	2024年 7月31日
<b>営業収益</b>				
受取利息		26		2,014
有価証券売買等損益		132,993,113		577,495,479
営業収益合計		132,993,087		577,493,465
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,171		1,817
受託者報酬		1,747,864		3,332,009
委託者報酬		6,991,728		13,328,286
その他費用		349,552		666,367
営業費用合計		9,092,315		17,328,479
営業利益又は営業損失( )		142,085,402		594,821,944
経常利益又は経常損失( )		142,085,402		594,821,944
当期純利益又は当期純損失( )		142,085,402		594,821,944
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( )		6,354,108		26,925,121
期首剰余金又は期首欠損金( )		129,778,089		567,821,406
剰余金増加額又は欠損金減少額		34,838,754		119,321,241
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		34,838,754		119,321,241
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		337,150,777		910,703,743
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		337,150,777		910,703,743
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		567,821,406		1,927,100,731

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	11,300,129,431口	22,507,741,814口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 567,821,406円	元本の欠損 1,927,100,731円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9498円 (1万口当たりの純資産額9,498円)	1口当たり純資産額 0.9144円 (1万口当たりの純資産額9,144円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（53,883,323円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（38,303,571円）、および分配準備積立金（13,514,679円）より、分配対象収益は105,701,573円（1万口当たり93.54円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（107,172,639円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（160,106,873円）、および分配準備積立金（57,913,509円）より、分配対象収益は325,193,021円（1万口当たり144.48円）ですが、分配を行っておりません。</p>



## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	131,792,709円
合計	131,792,709円

## 第3期（自 2023年8月1日 至 2024年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	566,460,913円
合計	566,460,913円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	4,232,452,962円	11,300,129,431円
期中追加設定元本額	8,024,842,487円	13,422,124,144円
期中一部解約元本額	957,166,018円	2,214,511,761円

## （4）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	国内債券（NOMURA - B P I） マザーファンド	15,780,704,505	20,590,663,238	
	親投資信託受益証券 小計		20,590,663,238	
合 計			20,590,663,238	

## 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。

## 【日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2023年 7月31日現在）	第3期 （2024年 7月31日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	44	103
コール・ローン	1,559	21,862
親投資信託受益証券	759,589,242	410,101,393
未収入金	-	9,751,850
流動資産合計	759,590,845	419,875,208
資産合計	759,590,845	419,875,208
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	9,751,841
未払受託者報酬	79,252	48,397
未払委託者報酬	356,872	218,001
その他未払費用	19,743	12,025
流動負債合計	455,867	10,030,264
負債合計	455,867	10,030,264
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	948,018,176	518,666,016
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	188,883,198	108,821,072
（分配準備積立金）	18,497,630	17,924,751
元本等合計	759,134,978	409,844,944
純資産合計	759,134,978	409,844,944
負債純資産合計	759,590,845	419,875,208

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		10		6
有価証券売買等損益		72,016,012		14,307,569
営業収益合計		72,016,002		14,307,563
営業費用				
支払利息		145		40
受託者報酬		151,015		113,451
委託者報酬		679,999		510,866
その他費用		37,601		28,213
営業費用合計		868,760		652,570
営業利益又は営業損失( )		72,884,762		14,960,133
経常利益又は経常損失( )		72,884,762		14,960,133
当期純利益又は当期純損失( )		72,884,762		14,960,133
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( )		16,117,511		10,615,801
期首剰余金又は期首欠損金( )		86,025,162		188,883,198
剰余金増加額又は欠損金減少額		38,429,287		105,882,009
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		38,429,287		105,882,009
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		84,520,072		21,475,551
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		84,520,072		21,475,551
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		188,883,198		108,821,072

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	948,018,176口	518,666,016口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 188,883,198円	元本の欠損 108,821,072円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.8008円 (1万口当たりの純資産額8,008円)	1口当たり純資産額 0.7902円 (1万口当たりの純資産額7,902円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,014,316円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（5,528,741円）、および分配準備積立金（4,483,314円）より、分配対象収益は24,026,371円（1万口当たり253.44円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（9,154,424円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（4,516,760円）、および分配準備積立金（8,770,327円）より、分配対象収益は22,441,511円（1万口当たり432.68円）であります。分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第2期(自 2022年8月2日 至 2023年7月31日)



種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	57,854,960円
合計	57,854,960円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,735,019円
合計	3,735,019円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	783,437,940円	948,018,176円
期中追加設定元本額	486,790,484円	99,477,078円
期中一部解約元本額	322,210,248円	528,829,238円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券バッシュ・マ ザーファンド	336,645,373	410,101,393	
	親投資信託受益証券 小計		410,101,393	
合 計			410,101,393	

## 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。

## 【日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	18,432	90,363
コール・ローン	653,638	19,155,815
親投資信託受益証券	2,360,376,395	10,040,524,428
流動資産合計	2,361,048,465	10,059,770,606
資産合計	2,361,048,465	10,059,770,606
負債の部		
流動負債		
未払解約金	670,264	19,222,737
未払受託者報酬	214,885	950,548
未払委託者報酬	967,158	4,277,647
その他未払費用	53,658	237,547
流動負債合計	1,905,965	24,688,479
負債合計	1,905,965	24,688,479
純資産の部		
元本等		
元本	2,277,862,745	8,701,689,127
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	81,279,755	1,333,393,000
(分配準備積立金)	72,447,605	744,660,792
元本等合計	2,359,142,500	10,035,082,127
純資産合計	2,359,142,500	10,035,082,127
負債純資産合計	2,361,048,465	10,059,770,606

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		7		1,087
有価証券売買等損益		67,266,922		718,883,453
営業収益合計		67,266,929		718,884,540
営業費用				
支払利息		666		452
受託者報酬		352,125		1,482,080
委託者報酬		1,584,892		6,669,726
その他費用		87,900		370,374
営業費用合計		2,025,583		8,522,632
営業利益又は営業損失（ ）		65,241,346		710,361,908
経常利益又は経常損失（ ）		65,241,346		710,361,908
当期純利益又は当期純損失（ ）		65,241,346		710,361,908
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（ ）		125,724		31,715,574
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,974,792		81,279,755
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,429,384		600,605,838
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,429,384		600,605,838
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,240,043		27,138,927
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,240,043		27,138,927
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		81,279,755		1,333,393,000

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,277,862,745口	8,701,689,127口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0357円 (1万口当たりの純資産額10,357円)	1口当たり純資産額 1.1532円 (1万口当たりの純資産額11,532円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(36,037,589円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(29,078,033円)、収益調整金(28,426,309円)、および分配準備積立金(7,331,983円)より、分配対象収益は100,873,914円(1万口当たり442.84円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(176,075,107円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(502,571,227円)、収益調整金(588,732,208円)、および分配準備積立金(66,014,458円)より、分配対象収益は1,333,393,000円(1万口当たり1,532.34円)であります。分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第2期(自 2022年8月2日 至 2023年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	67,393,698円
合計	67,393,698円

## 第3期（自 2023年8月1日 至 2024年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	713,792,352円
合計	713,792,352円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	590,998,190円	2,277,862,745円
期中追加設定元本額	1,885,666,023円	6,964,299,671円
期中一部解約元本額	198,801,468円	540,473,289円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	4,343,726,770	10,040,524,428	
	親投資信託受益証券 小計		10,040,524,428	
合 計			10,040,524,428	

## 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。

## 【日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2023年 7月31日現在）	第3期 （2024年 7月31日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	146,364	11,164
コール・ローン	5,190,404	2,366,533
親投資信託受益証券	444,388,464	308,952,288
派生商品評価勘定	-	7,889,182
未収入金	859,652	7,189,155
流動資産合計	450,584,884	326,408,322
資産合計	450,584,884	326,408,322
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,265,920	93,415
未払解約金	1,756,465	6,832,552
未払受託者報酬	46,647	36,845
未払委託者報酬	373,491	295,053
その他未払費用	26,364	24,218
流動負債合計	5,468,887	7,282,083
負債合計	5,468,887	7,282,083
純資産の部		
元本等		
元本	632,054,433	457,845,276
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	186,938,436	138,719,037
（分配準備積立金）	26,385,161	31,242,642
元本等合計	445,115,997	319,126,239
純資産合計	445,115,997	319,126,239
負債純資産合計	450,584,884	326,408,322



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
<b>営業収益</b>				
受取利息		25		850
有価証券売買等損益		31,632,702		49,029,822
為替差損益		53,012,493		54,548,499
<b>営業収益合計</b>		<b>21,379,766</b>		<b>5,517,827</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,599		963
受託者報酬		88,417		81,280
委託者報酬		707,953		650,727
その他費用		32,327		30,186
<b>営業費用合計</b>		<b>830,296</b>		<b>763,156</b>
営業利益又は営業損失（ ）		22,210,062		6,280,983
経常利益又は経常損失（ ）		22,210,062		6,280,983
当期純利益又は当期純損失（ ）		22,210,062		6,280,983
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（ ）		12,857,073		4,609,997
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		176,289,566		186,938,436
剰余金増加額又は欠損金減少額		111,654,113		76,835,180
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		111,654,113		76,835,180
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		112,949,994		26,944,795
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		112,949,994		26,944,795
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		186,938,436		138,719,037

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	（2023年7月31日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	632,054,433口	457,845,276口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 186,938,436円	元本の欠損 138,719,037円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.7042円 （1万口当たりの純資産額7,042円）	1口当たり純資産額 0.6970円 （1万口当たりの純資産額6,970円）

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,735,736円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(12,027,299円)、および分配準備積立金(9,649,425円)より、分配対象収益は38,412,460円(1万口当たり607.74円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,817,735円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(11,613,941円)、および分配準備積立金(16,424,907円)より、分配対象収益は42,856,583円(1万口当たり936.05円)であります。分配を行っておりません。</p>
----------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日</p>
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,794,488円
合計	27,794,488円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	35,721,015円
合計	35,721,015円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 第2期(2023年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	439,200,405	-	442,466,325	3,265,920
	小計	439,200,405	-	442,466,325	3,265,920
合 計		439,200,405	-	442,466,325	3,265,920

## 第3期(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	7,692,415	-	7,599,000	93,415
	小計	7,692,415	-	7,599,000	93,415
	売建				
	アメリカ・ドル	320,967,982	-	313,078,800	7,889,182
	小計	320,967,982	-	313,078,800	7,889,182
合 計		328,660,397	-	320,677,800	7,795,767

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
  - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
- 3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
- 2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

項 目	第2期 ( 2023年7月31日現在 )	第3期 ( 2024年7月31日現在 )
期首元本額	675,330,314円	632,054,433円
期中追加設定元本額	377,079,050円	83,454,131円
期中一部解約元本額	420,354,931円	257,663,288円

## ( 4 ) 【 附属明細表 】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

( 単位 : 円 )

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	米ドル建て新興国債インデックス・ マザーファンド	274,673,087	308,952,288	
	親投資信託受益証券 小計		308,952,288	
合 計			308,952,288	

## 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)」に記載しております。

## 【日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2023年 7月31日現在）	第3期 （2024年 7月31日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	741,615	294,023
コール・ローン	26,299,442	62,329,348
親投資信託受益証券	2,816,851,389	8,202,873,415
流動資産合計	2,843,892,446	8,265,496,786
資産合計	2,843,892,446	8,265,496,786
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	346,164	15,539,624
未払受託者報酬	255,557	790,139
未払委託者報酬	2,044,810	6,321,396
その他未払費用	128,433	381,830
流動負債合計	2,774,964	23,032,989
負債合計	2,774,964	23,032,989
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,933,626,484	7,489,434,821
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	92,509,002	753,028,976
（分配準備積立金）	104,710,779	814,691,373
元本等合計	2,841,117,482	8,242,463,797
純資産合計	2,841,117,482	8,242,463,797
負債純資産合計	2,843,892,446	8,265,496,786

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		147		15,293
有価証券売買等損益		157,789,609		764,893,026
営業収益合計		157,789,756		764,908,319
営業費用				
支払利息		7,991		6,329
受託者報酬		428,315		1,273,275
委託者報酬		3,427,283		10,186,892
その他費用		128,760		382,410
営業費用合計		3,992,349		11,848,906
営業利益又は営業損失（ ）		153,797,407		753,059,413
経常利益又は経常損失（ ）		153,797,407		753,059,413
当期純利益又は当期純損失（ ）		153,797,407		753,059,413
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,964,036		32,527,501
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		93,140,849		92,509,002
剰余金増加額又は欠損金減少額		23,728,667		125,006,066
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		23,728,667		11,309,098
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		113,696,968
剰余金減少額又は欠損金増加額		173,930,191		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		173,930,191		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		92,509,002		753,028,976



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,933,626,484口	7,489,434,821口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 92,509,002円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9685円 (1万口当たりの純資産額9,685円)	1口当たり純資産額 1.1005円 (1万口当たりの純資産額11,005円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(86,808,640円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(57,883,015円)、および分配準備積立金(17,902,139円)より、分配対象収益は162,593,794円(1万口当たり554.24円)ですが、分配を行っていません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(290,607,385円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(429,197,725円)、収益調整金(340,473,659円)、および分配準備積立金(94,886,263円)より、分配対象収益は1,155,165,032円(1万口当たり1,542.39円)ですが、分配を行っていません。</p>
----------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日</p>
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	157,718,263円
合計	157,718,263円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	764,893,026円
合計	764,893,026円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	1,002,416,303円	2,933,626,484円
期中追加設定元本額	2,199,858,549円	5,078,374,121円
期中一部解約元本額	268,648,368円	522,565,784円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	7,292,739,523	8,202,873,415	
	親投資信託受益証券 小計		8,202,873,415	
合 計			8,202,873,415	

## 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。

## 【日興FWS・Jリートインデックス】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	20,726	19,306
コール・ローン	734,976	4,092,693
親投資信託受益証券	1,469,395,632	2,796,618,301
流動資産合計	1,470,151,334	2,800,730,300
資産合計	1,470,151,334	2,800,730,300
負債の部		
流動負債		
未払解約金	753,695	4,088,745
未払受託者報酬	134,433	266,129
未払委託者報酬	705,986	1,397,330
その他未払費用	33,539	66,452
流動負債合計	1,627,653	5,818,656
負債合計	1,627,653	5,818,656
純資産の部		
元本等		
元本	1,569,794,081	3,115,186,991
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	101,270,400	320,275,347
(分配準備積立金)	58,395,494	144,736,645
元本等合計	1,468,523,681	2,794,911,644
純資産合計	1,468,523,681	2,794,911,644
負債純資産合計	1,470,151,334	2,800,730,300

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		7		445
有価証券売買等損益		24,653,895		73,618,761
営業収益合計		24,653,888		73,618,316
営業費用				
支払利息		617		265
受託者報酬		235,032		463,268
委託者報酬		1,234,336		2,432,559
その他費用		58,608		115,653
営業費用合計		1,528,593		3,011,745
営業利益又は営業損失（ ）		26,182,481		76,630,061
経常利益又は経常損失（ ）		26,182,481		76,630,061
当期純利益又は当期純損失（ ）		26,182,481		76,630,061
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（ ）		5,293,081		3,899,590
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		16,772,479		101,270,400
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,710,438		16,720,124
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,710,438		16,720,124
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		69,318,959		162,994,600
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		69,318,959		162,994,600
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		101,270,400		320,275,347

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,569,794,081口	3,115,186,991口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 101,270,400円	元本の欠損 320,275,347円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9355円 (1万口当たりの純資産額9,355円)	1口当たり純資産額 0.8972円 (1万口当たりの純資産額8,972円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（41,896,150円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（32,811,077円）、および分配準備積立金（16,499,344円）より、分配対象収益は91,206,571円（1万口当たり581.01円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（92,330,860円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（133,095,197円）、および分配準備積立金（52,405,785円）より、分配対象収益は277,831,842円（1万口当たり891.86円）ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。



<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	23,027,608円
合計	23,027,608円

## 第3期（自 2023年8月1日 至 2024年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	72,745,030円
合計	72,745,030円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	677,494,848円	1,569,794,081円
期中追加設定元本額	1,039,940,827円	1,783,263,714円
期中一部解約元本額	147,641,594円	237,870,804円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザー ファンド	1,098,306,681	2,796,618,301	
	親投資信託受益証券 小計		2,796,618,301	
合 計			2,796,618,301	

## 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。

## 【日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年 7月31日現在)	第3期 (2024年 7月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	67	427
コール・ローン	2,366	90,559
親投資信託受益証券	283,703,049	203,636,640
派生商品評価勘定	5,185	9,088,720
未収入金	-	3,163,134
流動資産合計	283,710,667	215,979,480
資産合計	283,710,667	215,979,480
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,883,764	-
未払解約金	-	3,124,685
未払受託者報酬	29,088	22,969
未払委託者報酬	174,692	138,045
その他未払費用	8,643	6,817
流動負債合計	3,096,187	3,292,516
負債合計	3,096,187	3,292,516
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	340,490,086	246,740,137
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	59,875,606	34,053,173
(分配準備積立金)	11,984,409	14,407,493
元本等合計	280,614,480	212,686,964
純資産合計	280,614,480	212,686,964
負債純資産合計	283,710,667	215,979,480

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		1		134
有価証券売買等損益		483,754		39,116,331
為替差損益		29,167,832		32,016,028
営業収益合計		28,684,077		7,100,437
営業費用				
支払利息		321		185
受託者報酬		52,525		50,011
委託者報酬		315,560		300,510
その他費用		15,600		14,857
営業費用合計		384,006		365,563
営業利益又は営業損失（ ）		29,068,083		6,734,874
経常利益又は経常損失（ ）		29,068,083		6,734,874
当期純利益又は当期純損失（ ）		29,068,083		6,734,874
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（ ）		10,558,018		4,419,861
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		13,938,218		59,875,606
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,511,881		27,130,329
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,511,881		27,130,329
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		36,939,204		12,462,631
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		36,939,204		12,462,631
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		59,875,606		34,053,173

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	（2023年7月31日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	340,490,086口	246,740,137口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 59,875,606円	元本の欠損 34,053,173円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.8241円 （1万口当たりの純資産額8,241円）	1口当たり純資産額 0.8620円 （1万口当たりの純資産額8,620円）

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	
		第3期
		自 2023年8月1日 至 2024年7月31日

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,278,723円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(4,432,332円)、および分配準備積立金(2,705,686円)より、分配対象収益は16,416,741円(1万口当たり482.15円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,236,544円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(4,825,705円)、および分配準備積立金(7,170,949円)より、分配対象収益は19,233,198円(1万口当たり779.49円)であります。分配を行っておりません。</p>
----------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日</p>
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,175,195円
合計	6,175,195円

## 第3期（自 2023年8月1日 至 2024年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	32,448,426円
合計	32,448,426円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 第2期（2023年7月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	224,491,108	-	226,946,073	2,454,965
	カナダ・ドル	4,629,229	-	4,664,325	35,096
	オーストラリア・ド ル	18,106,579	-	18,151,195	44,616
	香港・ドル	3,582,335	-	3,631,775	49,440
	シンガポール・ドル	9,827,333	-	9,984,702	157,369
	イギリス・ポンド	13,195,031	-	13,236,333	41,302
	ユーロ	10,134,096	-	10,229,887	95,791
	小計	283,965,711	-	286,844,290	2,878,579
	合 計	283,965,711	-	286,844,290	2,878,579

## 第3期（2024年7月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	170,426,050	-	163,817,097	6,608,953
	カナダ・ドル	3,121,974	-	2,960,091	161,883
	オーストラリア・ド ル	16,929,839	-	15,743,428	1,186,411
	香港・ドル	1,918,222	-	1,841,900	76,322
	シンガポール・ドル	6,562,978	-	6,315,265	247,713
	イギリス・ポンド	10,564,684	-	10,093,418	471,266
	ユーロ	7,535,604	-	7,199,432	336,172
	小計	217,059,351	-	207,970,631	9,088,720



合計	217,059,351	-	207,970,631	9,088,720
----	-------------	---	-------------	-----------

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
期首元本額	237,495,753円	340,490,086円
期中追加設定元本額	214,040,924円	55,964,696円
期中一部解約元本額	111,046,591円	149,714,645円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	57,305,935	203,636,640	
	親投資信託受益証券 小計		203,636,640	
合計			203,636,640	

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）」に記載しております。

## 【日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年 7月31日現在)	第3期 (2024年 7月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,962	33,450
コール・ローン	175,977	7,091,006
親投資信託受益証券	1,708,763,533	3,901,404,589
流動資産合計	1,708,944,472	3,908,529,045
資産合計	1,708,944,472	3,908,529,045
負債の部		
流動負債		
未払解約金	178,963	7,111,148
未払受託者報酬	150,883	355,512
未払委託者報酬	905,635	2,133,272
その他未払費用	45,204	106,578
流動負債合計	1,280,685	9,706,510
負債合計	1,280,685	9,706,510
純資産の部		
元本等		
元本	1,529,979,780	2,918,817,210
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	177,684,007	980,005,325
(分配準備積立金)	77,332,181	595,653,592
元本等合計	1,707,663,787	3,898,822,535
純資産合計	1,707,663,787	3,898,822,535
負債純資産合計	1,708,944,472	3,908,529,045

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		4		409
有価証券売買等損益		26,035,705		553,161,226
営業収益合計		26,035,709		553,161,635
営業費用				
支払利息		500		178
受託者報酬		261,005		587,590
委託者報酬		1,566,521		3,525,968
その他費用		78,161		176,126
営業費用合計		1,906,187		4,289,862
営業利益又は営業損失（ ）		24,129,522		548,871,773
経常利益又は経常損失（ ）		24,129,522		548,871,773
当期純利益又は当期純損失（ ）		24,129,522		548,871,773
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（ ）		10,370,223		12,687,245
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		87,360,884		177,684,007
剰余金増加額又は欠損金減少額		75,530,726		291,186,595
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		75,530,726		291,186,595
剰余金減少額又は欠損金増加額		19,707,348		25,049,805
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		19,707,348		25,049,805
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		177,684,007		980,005,325

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,529,979,780口	2,918,817,210口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1161円 (1万口当たりの純資産額11,161円)	1口当たり純資産額 1.3358円 (1万口当たりの純資産額13,358円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(46,263,645円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(100,351,826円)、および分配準備積立金(31,068,536円)より、分配対象収益は177,684,007円(1万口当たり1,161.35円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(103,706,047円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(421,808,862円)、収益調整金(384,351,733円)、および分配準備積立金(70,138,683円)より、分配対象収益は980,005,325円(1万口当たり3,357.54円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	31,816,654円
合計	31,816,654円

## 第3期（自 2023年8月1日 至 2024年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	551,713,585円
合計	551,713,585円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	617,730,700円	1,529,979,780円
期中追加設定元本額	1,088,596,448円	1,596,850,660円
期中一部解約元本額	176,347,368円	208,013,230円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1,097,904,767	3,901,404,589	
	親投資信託受益証券 小計		3,901,404,589	
合 計			3,901,404,589	

## 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。



## 【日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	19,429	1,932
コール・ローン	689,014	409,639
親投資信託受益証券	489,846,900	339,754,759
派生商品評価勘定	7,026	11,655,171
未収入金	493,154	7,503,329
流動資産合計	491,055,523	359,324,830
資産合計	491,055,523	359,324,830
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,215,920	170,451
未払解約金	-	7,122,851
未払受託者報酬	51,597	39,402
未払委託者報酬	413,058	315,530
その他未払費用	27,841	25,344
流動負債合計	6,708,416	7,673,578
負債合計	6,708,416	7,673,578
純資産の部		
元本等		
元本	503,479,615	317,954,124
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	19,132,508	33,697,128
(分配準備積立金)	6,867,193	48,944,360
元本等合計	484,347,107	351,651,252
純資産合計	484,347,107	351,651,252
負債純資産合計	491,055,523	359,324,830

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		7		42
有価証券売買等損益		71,661,179		104,001,488
為替差損益		53,924,747		58,698,125
営業収益合計		17,736,439		45,303,405
営業費用				
支払利息		193		113
受託者報酬		93,329		84,973
委託者報酬		747,250		680,398
その他費用		33,781		31,284
営業費用合計		874,553		796,768
営業利益又は営業損失（ ）		16,861,886		44,506,637
経常利益又は経常損失（ ）		16,861,886		44,506,637
当期純利益又は当期純損失（ ）		16,861,886		44,506,637
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（ ）		770,450		652,362
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		30,354,113		19,132,508
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,941,522		9,420,887
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,941,522		9,420,887
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		19,352,253		1,750,250
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		19,352,253		1,750,250
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		19,132,508		33,697,128

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	503,479,615口	317,954,124口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 19,132,508円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9620円 (1万口当たりの純資産額9,620円)	1口当たり純資産額 1.1060円 (1万口当たりの純資産額11,060円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,867,193円)、収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は6,867,193円(1万口当たり136.39円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,929円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(45,154,868円)、収益調整金(549,910円)、および分配準備積立金(3,786,563円)より、分配対象収益は49,494,270円(1万口当たり1,556.65円)であります。分配を行っておりません。
----------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	58,338,757円
合計	58,338,757円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	78,466,969円
合計	78,466,969円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 第2期(2023年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	477,586,537	-	483,795,431	6,208,894
	小計	477,586,537	-	483,795,431	6,208,894
合 計		477,586,537	-	483,795,431	6,208,894

## 第3期(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	22,177,536	-	22,007,085	170,451
	小計	22,177,536	-	22,007,085	170,451
	売建				
	アメリカ・ドル	363,313,212	-	351,658,041	11,655,171
	小計	363,313,212	-	351,658,041	11,655,171
合 計		385,490,748	-	373,665,126	11,484,720

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	409,945,460円	503,479,615円
期中追加設定元本額	262,998,864円	54,914,140円
期中一部解約元本額	169,464,709円	240,439,631円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	ゴールド・インデックス・マザー ファンド	191,249,513	339,754,759	
	親投資信託受益証券 小計		339,754,759	
合 計			339,754,759	

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）」に記載しております。

## 【日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	53,674	84,643
コール・ローン	1,903,412	17,943,225
親投資信託受益証券	4,807,402,680	10,723,318,671
未収入金	4,268,637	9,648,638
流動資産合計	4,813,628,403	10,750,995,177
資産合計	4,813,628,403	10,750,995,177
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,891,390	17,951,528
未払受託者報酬	448,545	1,016,136
未払委託者報酬	3,588,642	8,129,379
その他未払費用	224,679	498,417
流動負債合計	6,153,256	27,595,460
負債合計	6,153,256	27,595,460
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,581,248,271	6,064,754,739
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,226,226,876	4,658,644,978
(分配準備積立金)	622,994,674	2,590,375,283
元本等合計	4,807,475,147	10,723,399,717
純資産合計	4,807,475,147	10,723,399,717
負債純資産合計	4,813,628,403	10,750,995,177



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自 至	2022年 8月 2日 2023年 7月31日	自 至	2023年 8月 1日 2024年 7月31日
営業収益				
受取利息		13		1,299
有価証券売買等損益		539,982,346		2,125,263,042
営業収益合計		539,982,359		2,125,264,341
営業費用				
支払利息		1,401		630
受託者報酬		749,370		1,661,904
委託者報酬		5,995,489		13,295,834
その他費用		224,689		498,444
営業費用合計		6,970,949		15,456,812
営業利益又は営業損失（ ）		533,011,410		2,109,807,529
経常利益又は経常損失（ ）		533,011,410		2,109,807,529
当期純利益又は当期純損失（ ）		533,011,410		2,109,807,529
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（ ）		25,695,052		72,394,738
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		210,859,837		1,226,226,876
剰余金増加額又は欠損金減少額		560,355,962		1,592,163,414
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		560,355,962		1,592,163,414
剰余金減少額又は欠損金増加額		52,305,281		197,158,103
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		52,305,281		197,158,103
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,226,226,876		4,658,644,978

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2023年7月31日現在)	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,581,248,271口	6,064,754,739口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3424円 (1万口当たりの純資産額13,424円)	1口当たり純資産額 1.7682円 (1万口当たりの純資産額17,682円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2022年8月2日 至 2023年7月31日	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(507,331,187円)、収益調整金(603,250,286円)、および分配準備積立金(115,663,487円)より、分配対象収益は1,226,244,960円(1万口当たり3,424.07円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(54,860円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,037,341,877円)、収益調整金(2,068,269,695円)、および分配準備積立金(552,978,546円)より、分配対象収益は4,658,644,978円(1万口当たり7,681.51円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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る場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2022年8月2日 至 2023年7月31日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	532,535,547円
合計	532,535,547円

## 第3期(自 2023年8月1日 至 2024年7月31日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,115,363,900円
合計	2,115,363,900円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2023年7月31日現在)	第3期 (2024年7月31日現在)
期首元本額	1,448,204,617円	3,581,248,271円
期中追加設定元本額	2,431,110,301円	3,024,185,731円
期中一部解約元本額	298,066,647円	540,679,263円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザー ファンド	6,036,205,275	10,723,318,671	
	親投資信託受益証券 小計		10,723,318,671	
合 計			10,723,318,671	

## 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)

「日興FWS・日本株インデックス」、「日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・日本債

インデックス」、「日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・Jリートインデックス」、「日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)」、「日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)」、「日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)」および「日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年7月31日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	29,081,075
コール・ローン	6,164,839,218
株式	340,364,255,920
派生商品評価勘定	34,912,900
未収入金	356,742,929
未収配当金	412,103,799
前払金	83,550,000
差入委託証拠金	184,077,732
流動資産合計	347,629,563,573
資産合計	
	347,629,563,573
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,502,000
未払金	2,345,514,801
未払解約金	1,184,638,257
流動負債合計	3,586,655,058
負債合計	
	3,586,655,058
純資産の部	
元本等	
元本	69,013,827,909
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	275,029,080,606
元本等合計	344,042,908,515
純資産合計	
	344,042,908,515
負債純資産合計	
	347,629,563,573

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,013,827,909口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.9851円 (1万口当たりの純資産額49,851円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

### 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（株式）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>



	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0609月	3,685,659,100	-	3,664,070,000	21,589,100
	小計	3,685,659,100	-	3,664,070,000	21,589,100
合 計		3,685,659,100	-	3,664,070,000	21,589,100

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に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。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2024年7月31日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,616,435,931円
同期中における追加設定元本額	12,147,280,843円
同期中における一部解約元本額	9,749,888,865円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,693,407,707円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	910,424,516円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,161,660,705円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,599,563,436円

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	125,864,491円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,893,514円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	11,333,698円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	42,712,605円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	129,366,834円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	127,630,559円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	256,423,489円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,431,838,715円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	28,742,378,482円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	109,600,264円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	155,329,154円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	94,180,935円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	64,915,978円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	200,647,807円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	208,354,863円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	855,190,326円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	516,882,372円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	653,141,193円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,976,061円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,392,407,362円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	40,590,670円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	248,769,162円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	282,683,195円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,284,280円
日興FWS・日本株インデックス	2,723,061,784円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	162,819,095円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	17,570,293円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	10,153,704円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	11,284,678円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	5,708,219円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	3,011,918円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	667,303円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	19,733,480円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	97,908,650円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	103,198,107円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	37,614,943円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,965,659,136円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	7,007,633円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	33,548,131円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	704,945,394円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	982,249,599円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	3,879,969,472円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	23,860,855円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	90,371,685円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	567,812,241円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	30,254,020円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	155,287,022円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	543,730,636円

SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	355,840,917円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,026,248,062円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	22,216,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	23,974,982円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	19,576,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,084,116円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	53,316,712円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	140,153,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	28,569,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	28,385,337円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,486,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	24,270,627円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	324,237,533円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	146,552,018円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	130,389,464円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	53,003,126円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	38,414,398円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	24,166,736円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	42,951,144円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	21,355,561円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	34,632,913円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	47,522,624円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	8,929,794円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	94,668,503円
合計	69,013,827,909円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	4,055.000	18,247,500	
ニッスイ	120,500	901.700	108,654,850	
マルハニチロ	17,700	3,372.000	59,684,400	
雪国まいたけ	11,400	1,021.000	11,639,400	
カネコ種苗	4,800	1,430.000	6,864,000	
サカタのタネ	13,500	3,485.000	47,047,500	
ホクト	10,100	1,915.000	19,341,500	
住石ホールディングス	15,600	1,040.000	16,224,000	
日鉄鉱業	4,600	4,785.000	22,011,000	
三井松島ホールディングス	7,500	5,250.000	39,375,000	
INPEX	370,800	2,326.000	862,480,800	
石油資源開発	13,800	6,260.000	86,388,000	

K & O エナジーグループ	5,800	3,430.000	19,894,000
ショーボンドホールディングス	16,300	5,788.000	94,344,400
ミライト・ワン	39,000	2,140.000	83,460,000
タマホーム	7,900	4,510.000	35,629,000
日本アクア	3,300	898.000	2,963,400
安藤・間	68,700	1,217.000	83,607,900
東急建設	35,000	791.000	27,685,000
コムシスホールディングス	37,900	3,257.000	123,440,300
ピーアールホールディングス	18,500	373.000	6,900,500
高松コンストラクシヨングループ	8,500	3,145.000	26,732,500
東建コーポレーション	3,200	11,880.000	38,016,000
ヤマウラ	6,300	1,304.000	8,215,200
オリエンタル白石	44,000	349.000	15,356,000
大成建設	77,700	6,425.000	499,222,500
大林組	303,500	1,985.500	602,599,250
清水建設	238,800	950.700	227,027,160
飛島建設	9,400	1,530.000	14,382,000
長谷工コーポレーション	78,700	1,884.000	148,270,800
松井建設	9,700	859.000	8,332,300
銭高組	1,500	4,175.000	6,262,500
鹿島建設	186,300	2,920.000	543,996,000
不動テトラ	5,800	2,393.000	13,879,400
鉄建建設	6,700	2,599.000	17,413,300
西松建設	16,100	4,898.000	78,857,800
三井住友建設	65,600	398.000	26,108,800
大豊建設	3,800	3,645.000	13,851,000
奥村組	13,200	5,140.000	67,848,000
東鉄工業	10,900	3,260.000	35,534,000
浅沼組	31,000	780.000	24,180,000
戸田建設	113,100	1,090.500	123,335,550
熊谷組	13,800	3,630.000	50,094,000
北野建設	1,900	3,790.000	7,201,000
矢作建設工業	11,500	1,681.000	19,331,500
ピーエス・コンストラクシヨン	10,900	1,029.000	11,216,100
日本ハウスホールディングス	19,500	358.000	6,981,000
新日本建設	11,500	1,681.000	19,331,500
東亜道路工業	17,000	1,248.000	21,216,000
日本道路	9,300	1,684.000	15,661,200
東亜建設工業	26,800	1,021.000	27,362,800
日本国土開発	24,300	500.000	12,150,000
若築建設	3,200	3,400.000	10,880,000
東洋建設	22,400	1,538.000	34,451,200
五洋建設	118,900	669.200	79,567,880
世紀東急工業	10,800	1,736.000	18,748,800
福田組	3,100	6,210.000	19,251,000
住友林業	74,500	6,425.000	478,662,500
巴コーポレーション	11,300	880.000	9,944,000
大和ハウス工業	234,300	4,293.000	1,005,849,900

ライト工業	16,100	2,183.000	35,146,300
積水ハウス	256,900	3,780.000	971,082,000
日特建設	6,800	1,148.000	7,806,400
北陸電気工事	4,700	1,211.000	5,691,700
ユアテック	18,800	1,516.000	28,500,800
日本リーテック	7,700	1,261.000	9,709,700
四電工	3,500	3,850.000	13,475,000
中電工	13,000	3,520.000	45,760,000
関電工	52,100	2,056.000	107,117,600
きんでん	58,400	3,199.000	186,821,600
東京エネシス	8,700	1,310.000	11,397,000
トーエネック	2,900	5,000.000	14,500,000
住友電設	8,100	4,155.000	33,655,500
日本電設工業	14,700	2,028.000	29,811,600
エクシオグループ	80,300	1,649.000	132,414,700
新日本空調	5,300	4,545.000	24,088,500
九電工	18,500	6,947.000	128,519,500
三機工業	17,200	2,356.000	40,523,200
日揮ホールディングス	83,300	1,286.000	107,123,800
中外炉工業	3,000	3,040.000	9,120,000
ヤマト	7,000	1,002.000	7,014,000
太平電業	5,400	5,290.000	28,566,000
高砂熱学工業	22,800	5,960.000	135,888,000
三晃金属工業	1,200	4,425.000	5,310,000
朝日工業社	8,000	1,341.000	10,728,000
明星工業	16,000	1,381.000	22,096,000
大気社	9,500	5,230.000	49,685,000
ダイダン	11,200	3,105.000	34,776,000
日比谷総合設備	6,400	3,300.000	21,120,000
テスホールディングス	19,300	409.000	7,893,700
インフロニア・ホールディングス	96,800	1,309.000	126,711,200
東洋エンジニアリング	12,300	816.000	10,036,800
レイズネクスト	12,800	1,856.000	23,756,800
ニッポン	24,500	2,367.000	57,991,500
日清製粉グループ本社	78,200	1,866.000	145,921,200
日東富士製粉	1,700	7,000.000	11,900,000
昭和産業	6,800	3,285.000	22,338,000
鳥越製粉	10,700	720.000	7,704,000
中部飼料	11,500	1,508.000	17,342,000
フィード・ワン	12,900	953.000	12,293,700
日本甜菜製糖	5,200	2,714.000	14,112,800
DM三井製糖ホールディングス	7,900	3,310.000	26,149,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,350.000	11,045,000
森永製菓	35,700	2,893.000	103,280,100
中村屋	3,100	3,390.000	10,509,000
江崎グリコ	24,200	4,600.000	111,320,000
井村屋グループ	4,600	2,608.000	11,996,800
不二家	5,700	2,720.000	15,504,000

山崎製パン	57,700	3,719.000	214,586,300
モロゾフ	2,600	4,495.000	11,687,000
亀田製菓	5,100	4,375.000	22,312,500
寿スピリッツ	40,800	1,928.000	78,662,400
カルビー	39,100	3,447.000	134,777,700
森永乳業	29,600	3,612.000	106,915,200
六甲バター	6,300	1,526.000	9,613,800
ヤクルト本社	121,200	3,086.000	374,023,200
明治ホールディングス	103,800	3,799.000	394,336,200
雪印メグミルク	20,300	2,862.000	58,098,600
プリマハム	10,700	2,508.000	26,835,600
日本ハム	36,400	4,976.000	181,126,400
丸大食品	8,400	1,759.000	14,775,600
S Foods	8,900	2,998.000	26,682,200
柿安本店	3,100	2,677.000	8,298,700
伊藤ハム米久ホールディングス	12,200	4,445.000	54,229,000
サッポロホールディングス	28,300	6,484.000	183,497,200
アサヒグループホールディングス	212,800	5,555.000	1,182,104,000
キリンホールディングス	352,800	2,130.500	751,640,400
宝ホールディングス	57,100	1,145.000	65,379,500
オエノンホールディングス	26,200	429.000	11,239,800
養命酒製造	2,500	2,380.000	5,950,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	62,500	2,234.000	139,625,000
ライフドリンク カンパニー	2,100	7,030.000	14,763,000
サントリー食品インターナショナル	59,800	5,422.000	324,235,600
ガイドグループホールディングス	9,200	2,721.000	25,033,200
伊藤園	28,800	3,577.000	103,017,600
キーコーヒー	9,800	2,119.000	20,766,200
日清オイリオグループ	11,400	5,200.000	59,280,000
不二製油グループ本社	20,000	3,151.000	63,020,000
かどや製油	1,800	3,650.000	6,570,000
J - オイルミルズ	8,300	2,097.000	17,405,100
キッコーマン	281,500	1,890.000	532,035,000
味の素	201,000	6,231.000	1,252,431,000
ブルドックソース	4,700	2,003.000	9,414,100
キューピー	46,000	3,848.000	177,008,000
ハウス食品グループ本社	28,500	2,968.500	84,602,250
カゴメ	36,800	3,510.000	129,168,000
アリアケジャパン	8,800	5,390.000	47,432,000
エバラ食品工業	2,800	2,970.000	8,316,000
やまみ	900	3,455.000	3,109,500
ニチレイ	38,900	3,951.000	153,693,900
東洋水産	43,000	10,245.000	440,535,000
イトアンドホールディングス	4,100	2,127.000	8,720,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,000	1,598.000	7,990,000
日清食品ホールディングス	89,900	4,473.000	402,122,700
フジッコ	7,600	1,858.000	14,120,800

ロック・フィールド	9,200	1,519.000	13,974,800
日本たばこ産業	517,800	4,434.000	2,295,925,200
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,157.000	13,589,100
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,594.000	16,082,800
なとり	4,600	2,199.000	10,115,400
ファーマフーズ	12,200	1,101.000	13,432,200
ユーグレナ	55,500	554.000	30,747,000
紀文食品	7,100	1,242.000	8,818,200
ピクルスホールディングス	5,200	1,133.000	5,891,600
ミヨシ油脂	5,200	1,550.000	8,060,000
理研ビタミン	7,200	2,832.000	20,390,400
片倉工業	9,000	2,099.000	18,891,000
ゲンゼ	5,900	5,590.000	32,981,000
東洋紡	36,100	1,034.000	37,327,400
ユニチカ	30,500	291.000	8,875,500
富士紡ホールディングス	3,600	5,190.000	18,684,000
倉敷紡績	6,600	4,580.000	30,228,000
シキボウ	5,700	1,170.000	6,669,000
日本毛織	21,800	1,335.000	29,103,000
ダイドーリミテッド	2,700	871.000	2,351,700
帝国繊維	9,300	2,500.000	23,250,000
帝人	82,600	1,450.000	119,770,000
東レ	575,200	785.300	451,704,560
ダイニック	3,300	800.000	2,640,000
セーレン	16,000	2,371.000	37,936,000
小松マテーレ	13,300	764.000	10,161,200
ワコールホールディングス	17,700	4,382.000	77,561,400
ホギメディカル	11,300	4,130.000	46,669,000
T S Iホールディングス	28,800	907.000	26,121,600
ワールド	11,800	2,260.000	26,668,000
三陽商会	3,700	2,546.000	9,420,200
オンワードホールディングス	54,600	560.000	30,576,000
ルックホールディングス	3,700	2,857.000	10,570,900
ゴールドウイン	15,300	9,316.000	142,534,800
デサント	15,200	3,985.000	60,572,000
特種東海製紙	4,400	3,875.000	17,050,000
王子ホールディングス	359,700	638.100	229,524,570
日本製紙	49,600	971.000	48,161,600
北越コーポレーション	44,900	1,162.000	52,173,800
大王製紙	39,700	893.700	35,479,890
レンゴー	79,400	1,048.000	83,211,200
トーモク	5,400	2,656.000	14,342,400
ザ・パック	6,500	3,925.000	25,512,500
北の達人コーポレーション	41,500	179.000	7,428,500
クラレ	125,400	1,859.000	233,118,600
旭化成	581,100	1,094.000	635,723,400
レゾナック・ホールディングス	80,500	3,778.000	304,129,000
住友化学	636,700	388.800	247,548,960

住友精化	3,900	5,340.000	20,826,000
日産化学	41,500	4,874.000	202,271,000
ラサ工業	3,400	2,859.000	9,720,600
クレハ	19,600	2,989.000	58,584,400
多木化学	3,300	4,470.000	14,751,000
テイカ	6,500	1,706.000	11,089,000
石原産業	14,800	1,566.000	23,176,800
日本曹達	10,100	5,420.000	54,742,000
東ソー	119,000	2,053.000	244,307,000
トクヤマ	29,000	2,968.000	86,072,000
セントラル硝子	9,900	3,795.000	37,570,500
東亜合成	41,100	1,618.500	66,520,350
大阪ソーダ	6,100	9,950.000	60,695,000
関東電化工業	16,400	970.000	15,908,000
デンカ	34,800	2,196.500	76,438,200
信越化学工業	776,200	6,748.000	5,237,797,600
日本カーバイド工業	3,800	1,857.000	7,056,600
堺化学工業	6,300	2,871.000	18,087,300
第一稀元素化学工業	8,000	865.000	6,920,000
エア・ウォーター	80,000	2,222.500	177,800,000
日本酸素ホールディングス	85,000	4,970.000	422,450,000
日本化学工業	3,000	2,500.000	7,500,000
日本パーカライジング	39,000	1,248.000	48,672,000
高压ガス工業	12,600	963.000	12,133,800
四国化成ホールディングス	11,000	2,314.000	25,454,000
ステラ ケミファ	4,800	4,160.000	19,968,000
保土谷化学工業	2,600	5,120.000	13,312,000
日本触媒	50,400	1,635.500	82,429,200
大日精化工業	5,800	3,265.000	18,937,000
カネカ	23,400	4,276.000	100,058,400
三菱瓦斯化学	62,900	2,866.000	180,271,400
三井化学	72,000	4,377.000	315,144,000
東京応化工業	42,000	3,905.000	164,010,000
大阪有機化学工業	7,700	3,490.000	26,873,000
三菱ケミカルグループ	627,100	894.200	560,752,820
K Hネオケム	13,300	2,249.000	29,911,700
ダイセル	110,600	1,465.500	162,084,300
住友ベークライト	24,400	4,272.000	104,236,800
積水化学工業	174,000	2,273.500	395,589,000
日本ゼオン	59,000	1,336.500	78,853,500
アイカ工業	22,000	3,484.000	76,648,000
U B E	41,900	2,704.000	113,297,600
積水樹脂	13,300	2,534.000	33,702,200
タキロンシーアイ	20,700	857.000	17,739,900
旭有機材	5,900	4,820.000	28,438,000
ニチバン	5,100	1,928.000	9,832,800
リケンテクノス	18,200	996.000	18,127,200
大倉工業	4,000	2,899.000	11,596,000



積水化成成品工業	7,800	452.000	3,525,600
群栄化学工業	2,100	3,175.000	6,667,500
ミライアル	2,700	1,425.000	3,847,500
ダイキョーニシカワ	18,600	700.000	13,020,000
森六ホールディングス	4,400	2,727.000	11,998,800
恵和	6,300	1,571.000	9,897,300
日本化薬	69,000	1,265.000	87,285,000
カーリット	8,700	1,469.000	12,780,300
日本精化	5,400	2,618.000	14,137,200
扶桑化学工業	9,400	3,905.000	36,707,000
トリケミカル研究所	10,800	3,735.000	40,338,000
A D E K A	30,000	3,220.000	96,600,000
日油	81,000	2,158.500	174,838,500
ハリマ化成グループ	5,800	983.000	5,701,400
花王	210,300	6,604.000	1,388,821,200
第一工業製薬	3,400	3,200.000	10,880,000
石原ケミカル	4,000	2,511.000	10,044,000
三洋化成工業	5,800	4,110.000	23,838,000
大日本塗料	9,700	1,225.000	11,882,500
日本ペイントホールディングス	393,800	957.800	377,181,640
関西ペイント	78,000	2,474.000	192,972,000
中国塗料	18,200	2,111.000	38,420,200
日本特殊塗料	5,200	1,252.000	6,510,400
藤倉化成	13,700	542.000	7,425,400
太陽ホールディングス	15,000	3,600.000	54,000,000
D I C	33,200	3,098.000	102,853,600
サカタインクス	19,000	1,781.000	33,839,000
a r t i e n c e	18,500	3,205.000	59,292,500
富士フイルムホールディングス	480,900	3,580.000	1,721,622,000
資生堂	180,500	4,720.000	851,960,000
ライオン	111,800	1,295.500	144,836,900
高砂香料工業	6,300	3,905.000	24,601,500
マンダム	21,300	1,273.000	27,114,900
ミルボン	13,200	3,345.000	44,154,000
コーセー	17,600	9,985.000	175,736,000
コタ	8,600	1,673.000	14,387,800
ポーラ・オルビスホールディングス	47,200	1,416.500	66,858,800
ノエビアホールディングス	8,200	5,820.000	47,724,000
新日本製薬	5,000	1,770.000	8,850,000
I - n e	2,400	1,756.000	4,214,400
アクシージア	6,300	965.000	6,079,500
エステー	6,700	1,591.000	10,659,700
アグロ カネショウ	4,400	1,191.000	5,240,400
コニシ	25,100	1,207.000	30,295,700
長谷川香料	16,400	3,255.000	53,382,000
小林製薬	23,800	6,026.000	143,418,800
荒川化学工業	7,700	1,193.000	9,186,100
メック	7,600	3,825.000	29,070,000

日本高純度化学	2,300	3,530.000	8,119,000
タカラバイオ	25,600	1,152.000	29,491,200
J C U	9,700	3,770.000	36,569,000
新田ゼラチン	6,000	765.000	4,590,000
O A Tアグリオ	3,300	1,848.000	6,098,400
デクセリアルズ	21,400	7,329.000	156,840,600
アース製薬	8,500	5,020.000	42,670,000
北興化学工業	9,600	1,696.000	16,281,600
大成ラミック	3,500	2,806.000	9,821,000
クミアイ化学工業	34,600	794.000	27,472,400
日本農薬	15,900	732.000	11,638,800
アキレス	5,700	1,563.000	8,909,100
有沢製作所	15,900	1,575.000	25,042,500
日東電工	55,500	13,140.000	729,270,000
レック	12,300	1,125.000	13,837,500
三光合成	11,700	696.000	8,143,200
きもと	21,600	254.000	5,486,400
藤森工業	6,700	4,530.000	30,351,000
前澤化成工業	6,000	1,929.000	11,574,000
未来工業	3,200	3,640.000	11,648,000
J S P	6,000	2,302.000	13,812,000
エフピコ	16,500	2,594.000	42,801,000
天馬	6,100	2,801.000	17,086,100
信越ポリマー	19,000	1,618.000	30,742,000
東リ	18,200	428.000	7,789,600
ニフコ	26,000	3,874.000	100,724,000
バルカー	7,500	3,680.000	27,600,000
ユニ・チャーム	180,400	5,018.000	905,247,200
協和キリン	105,000	3,179.000	333,795,000
武田薬品工業	766,900	4,302.000	3,299,203,800
アステラス製薬	760,300	1,747.500	1,328,624,250
塩野義製薬	105,400	6,597.000	695,323,800
わかもと製薬	9,000	245.000	2,205,000
日本新薬	22,300	3,449.000	76,912,700
中外製薬	271,800	6,609.000	1,796,326,200
科研製薬	13,600	4,085.000	55,556,000
エーザイ	105,300	5,760.000	606,528,000
ロート製薬	83,900	3,535.000	296,586,500
小野薬品工業	176,400	2,237.500	394,695,000
久光製薬	19,900	4,143.000	82,445,700
持田製薬	11,300	3,540.000	40,002,000
参天製薬	150,500	1,808.000	272,104,000
扶桑薬品工業	4,500	2,276.000	10,242,000
ツムラ	26,900	4,005.000	107,734,500
キッセイ薬品工業	15,500	3,495.000	54,172,500
生化学工業	19,000	899.000	17,081,000
栄研化学	17,300	2,445.000	42,298,500
鳥居薬品	5,300	3,745.000	19,848,500

J C Rファーマ	31,800	588.000	18,698,400
東和薬品	14,500	3,065.000	44,442,500
富士製薬工業	7,900	1,405.000	11,099,500
ゼリア新薬工業	13,500	2,193.000	29,605,500
ネクセラファーマ	40,500	1,680.000	68,040,000
第一三共	756,000	6,148.000	4,647,888,000
杏林製薬	21,900	1,721.000	37,689,900
大幸薬品	24,400	448.000	10,931,200
ダイト	8,000	2,394.000	19,152,000
大塚ホールディングス	216,400	7,763.000	1,679,913,200
ペプチドリーム	42,300	2,773.000	117,297,900
セルソース	3,600	1,557.000	5,605,200
あすか製薬ホールディングス	9,900	2,365.000	23,413,500
サワイグループホールディングス	19,400	6,628.000	128,583,200
日本コークス工業	86,900	111.000	9,645,900
ニチレキ	11,800	2,456.000	28,980,800
ユシロ化学工業	4,500	1,810.000	8,145,000
富士石油	25,400	463.000	11,760,200
出光興産	449,600	1,004.000	451,398,400
E N E O Sホールディングス	1,370,900	792.200	1,086,026,980
コスモエネルギーホールディングス	25,600	8,172.000	209,203,200
横浜ゴム	43,000	3,457.000	148,651,000
T O Y O T I R E	49,500	2,492.500	123,378,750
ブリヂストン	253,900	6,185.000	1,570,371,500
住友ゴム工業	83,500	1,587.000	132,514,500
藤倉コンポジット	7,100	1,339.000	9,506,900
オカモト	4,100	5,170.000	21,197,000
フコク	5,000	2,053.000	10,265,000
ニッタ	9,100	4,100.000	37,310,000
住友理工	13,800	1,529.000	21,100,200
三ツ星ベルト	10,500	4,425.000	46,462,500
バンドー化学	12,700	1,948.000	24,739,600
日東紡績	11,100	5,770.000	64,047,000
A G C	83,900	5,399.000	452,976,100
日本山村硝子	2,700	1,474.000	3,979,800
日本電気硝子	35,000	3,598.000	125,930,000
オハラ	5,300	1,448.000	7,674,400
住友大阪セメント	14,600	4,228.000	61,728,800
太平洋セメント	51,300	4,131.000	211,920,300
日本ヒューム	8,400	1,240.000	10,416,000
日本コンクリート工業	19,100	385.000	7,353,500
三谷セキサン	4,000	5,630.000	22,520,000
アジアパイルホールディングス	13,500	987.000	13,324,500
東海カーボン	78,700	968.500	76,220,950
日本カーボン	4,700	4,985.000	23,429,500
東洋炭素	6,100	6,150.000	37,515,000
ノリタケ	9,600	4,000.000	38,400,000
T O T O	56,900	4,129.000	234,940,100

日本碍子	100,700	2,046.500	206,082,550
日本特殊陶業	72,000	4,520.000	325,440,000
ダントーホールディングス	3,600	517.000	1,861,200
M A R U W A	3,200	40,600.000	129,920,000
品川リフラクトリーズ	10,700	1,847.000	19,762,900
黒崎播磨	7,200	2,663.000	19,173,600
ヨータイ	5,000	1,819.000	9,095,000
東京窯業	10,700	433.000	4,633,100
フジインコーポレーテッド	23,800	3,200.000	76,160,000
ニチアス	21,400	4,695.000	100,473,000
ニチハ	10,800	3,760.000	40,608,000
日本製鉄	410,200	3,280.000	1,345,456,000
神戸製鋼所	178,000	1,886.000	335,708,000
中山製鋼所	19,400	966.000	18,740,400
合同製鐵	4,700	4,925.000	23,147,500
J F E ホールディングス	245,700	2,210.000	542,997,000
東京製鐵	25,300	1,915.000	48,449,500
共英製鋼	9,600	2,010.000	19,296,000
大和工業	16,500	7,983.000	131,719,500
東京鐵鋼	4,000	5,090.000	20,360,000
大阪製鐵	5,300	2,562.000	13,578,600
淀川製鋼所	9,800	5,680.000	55,664,000
中部鋼鉄	6,500	2,548.000	16,562,000
丸一鋼管	26,900	3,674.000	98,830,600
モリ工業	2,000	5,620.000	11,240,000
大同特殊鋼	54,500	1,510.500	82,322,250
日本冶金工業	6,300	4,960.000	31,248,000
山陽特殊製鋼	8,800	2,139.000	18,823,200
愛知製鋼	5,100	3,430.000	17,493,000
日本金属	3,600	774.000	2,786,400
大平洋金属	8,100	1,364.000	11,048,400
新日本電工	48,000	291.000	13,968,000
栗本鐵工所	4,500	4,735.000	21,307,500
三菱製鋼	6,400	1,436.000	9,190,400
日本精線	6,800	1,199.000	8,153,200
エンビプロ・ホールディングス	6,800	470.000	3,196,000
新家工業	1,900	5,260.000	9,994,000
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,251.000	15,262,200
日本軽金属ホールディングス	25,500	1,774.000	45,237,000
三井金属鉱業	26,000	5,029.000	130,754,000
三菱マテリアル	63,400	2,817.000	178,597,800
住友金属鉱山	103,400	4,610.000	476,674,000
D O W A ホールディングス	22,100	5,541.000	122,456,100
古河機械金属	12,900	1,840.000	23,736,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,900	2,471.000	39,288,900
東邦チタニウム	19,500	1,381.000	26,929,500
U A C J	12,500	4,290.000	53,625,000
C K サンエツ	2,200	3,750.000	8,250,000

古河電気工業	29,700	4,145.000	123,106,500
住友電気工業	334,200	2,310.000	772,002,000
フジクラ	105,700	3,059.000	323,336,300
SWCC	10,400	4,545.000	47,268,000
平河ヒューテック	5,500	1,484.000	8,162,000
リョービ	9,700	2,083.000	20,205,100
アーレスティ	7,100	744.000	5,282,400
AREホールディングス	34,300	2,052.000	70,383,600
稲葉製作所	6,200	1,720.000	10,664,000
宮地エンジニアリンググループ	5,200	4,835.000	25,142,000
トーカロ	26,400	1,982.000	52,324,800
アルファ	3,900	1,370.000	5,343,000
SUMCO	169,300	2,493.500	422,149,550
川田テクノロジーズ	6,900	2,716.000	18,740,400
RS TECHNOLOGIES	6,500	3,265.000	21,222,500
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,564.000	2,502,400
信和	7,900	757.000	5,980,300
東洋製罐グループホールディングス	51,700	2,584.000	133,592,800
ホッカンホールディングス	5,100	1,725.000	8,797,500
横河ブリッジホールディングス	14,300	2,726.000	38,981,800
駒井ハルテック	800	1,814.000	1,451,200
三和ホールディングス	89,700	3,250.000	291,525,000
文化シャッター	24,300	1,747.000	42,452,100
三協立山	11,300	752.000	8,497,600
アルインコ	7,700	1,070.000	8,239,000
LIXIL	139,700	1,740.000	243,078,000
ノーリツ	15,200	1,882.000	28,606,400
長府製作所	9,600	2,158.000	20,716,800
リンナイ	42,900	3,700.000	158,730,000
日東精工	13,700	603.000	8,261,100
岡部	16,300	794.000	12,942,200
ジーテクト	10,800	1,835.000	19,818,000
東プレ	15,300	2,092.000	32,007,600
高周波熱錬	14,700	1,100.000	16,170,000
東京製綱	5,800	1,274.000	7,389,200
パイオラックス	12,000	2,480.000	29,760,000
エイチワン	9,600	1,000.000	9,600,000
日本発条	79,400	1,659.000	131,724,600
中央発條	5,400	1,156.000	6,242,400
立川ブラインド工業	4,400	1,398.000	6,151,200
日本製鋼所	24,000	4,300.000	103,200,000
三浦工業	36,300	3,491.000	126,723,300
タクマ	29,000	1,758.000	50,982,000
ツガミ	18,500	1,668.000	30,858,000
オークマ	7,800	7,569.000	59,038,200
芝浦機械	8,500	3,730.000	31,705,000
アマダ	134,800	1,787.500	240,955,000
アイダエンジニアリング	18,000	857.000	15,426,000

F U J I	39,900	2,535.000	101,146,500
牧野フライス製作所	9,400	6,780.000	63,732,000
オーエスジー	38,200	2,079.500	79,436,900
旭ダイヤモンド工業	21,200	958.000	20,309,600
D M G 森精機	55,200	3,871.000	213,679,200
ソディック	22,400	760.000	17,024,000
ディスコ	42,100	49,460.000	2,082,266,000
日東工器	4,300	2,310.000	9,933,000
日進工具	7,100	929.000	6,595,900
富士ダイス	5,400	875.000	4,725,000
豊和工業	5,500	892.000	4,906,000
石川製作所	3,100	1,770.000	5,487,000
リケンN P R	9,200	2,759.000	25,382,800
島精機製作所	13,500	1,710.000	23,085,000
オプトラン	14,200	1,973.000	28,016,600
イワキ	6,100	3,055.000	18,635,500
フリーー	9,200	1,070.000	9,844,000
ヤマシンフィルタ	21,800	442.000	9,635,600
日阪製作所	8,800	1,090.000	9,592,000
やまびこ	13,400	2,149.000	28,796,600
野村マイクロ・サイエンス	11,900	3,600.000	42,840,000
平田機工	4,000	6,260.000	25,040,000
P E G A S U S	11,000	590.000	6,490,000
マルマエ	4,300	1,770.000	7,611,000
タツモ	5,600	3,130.000	17,528,000
ナブテスコ	54,500	2,975.500	162,164,750
三井海洋開発	11,100	2,846.000	31,590,600
レオン自動機	9,400	1,558.000	14,645,200
S M C	26,100	74,150.000	1,935,315,000
ホソカワミクロン	5,700	4,090.000	23,313,000
ユニオンツール	3,800	5,840.000	22,192,000
瑞光	6,500	1,110.000	7,215,000
オイレス工業	11,100	2,364.000	26,240,400
日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,560.000	18,904,000
サトーホールディングス	11,600	2,181.000	25,299,600
技研製作所	8,100	1,780.000	14,418,000
日本エアテック	5,400	1,239.000	6,690,600
日精樹脂工業	6,400	1,049.000	6,713,600
ワイエイシイホールディングス	3,700	2,217.000	8,202,900
小松製作所	409,600	4,357.000	1,784,627,200
住友重機械工業	50,700	4,091.000	207,413,700
日立建機	34,100	3,792.000	129,307,200
日工	11,000	786.000	8,646,000
巴工業	3,700	4,350.000	16,095,000
井関農機	8,400	1,021.000	8,576,400
T O W A	9,900	8,720.000	86,328,000
ローツェ	4,600	24,850.000	114,310,000
クボタ	456,100	2,180.000	994,298,000

荏原実業	4,400	4,105.000	18,062,000
三菱化工機	3,000	3,950.000	11,850,000
月島ホールディングス	11,500	1,480.000	17,020,000
帝国電機製作所	5,900	2,700.000	15,930,000
新東工業	16,700	1,122.000	18,737,400
澁谷工業	8,000	3,680.000	29,440,000
アイチコーポレーション	12,000	1,266.000	15,192,000
小森コーポレーション	20,900	1,236.000	25,832,400
鶴見製作所	7,500	4,000.000	30,000,000
酒井重工業	1,400	5,900.000	8,260,000
荏原製作所	178,000	2,194.000	390,532,000
西島製作所	7,600	3,135.000	23,826,000
北越工業	8,700	2,159.000	18,783,300
ダイキン工業	104,300	21,905.000	2,284,691,500
オルガノ	10,400	6,880.000	71,552,000
トーヨーカネツ	2,900	3,755.000	10,889,500
栗田工業	49,900	6,462.000	322,453,800
椿本チエイン	11,600	6,520.000	75,632,000
大同工業	6,300	920.000	5,796,000
木村化工機	8,700	720.000	6,264,000
アネスト岩田	13,200	1,486.000	19,615,200
ダイフク	146,300	2,741.000	401,008,300
サムコ	2,300	4,270.000	9,821,000
加藤製作所	3,200	1,229.000	3,932,800
タダノ	48,900	1,129.500	55,232,550
フジテック	20,500	4,375.000	89,687,500
C K D	23,900	3,025.000	72,297,500
平和	26,700	2,159.000	57,645,300
理想科学工業	7,100	3,395.000	24,104,500
S A N K Y O	88,000	1,669.000	146,872,000
日本金銭機械	10,800	1,007.000	10,875,600
マースグループホールディングス	4,800	3,665.000	17,592,000
フクシマガリレイ	5,900	6,790.000	40,061,000
ダイコク電機	4,600	3,745.000	17,227,000
竹内製作所	15,600	4,880.000	76,128,000
アマノ	24,500	3,815.000	93,467,500
J U K I	13,700	504.000	6,904,800
ジャノメ	9,400	700.000	6,580,000
マックス	12,000	3,800.000	45,600,000
グローリー	20,400	2,735.500	55,804,200
新晃工業	8,500	4,095.000	34,807,500
大和冷機工業	12,900	1,585.000	20,446,500
セガサミーホールディングス	77,800	2,447.500	190,415,500
T P R	9,800	2,504.000	24,539,200
ツバキ・ナカシマ	19,100	789.000	15,069,900
ホシザキ	58,200	4,747.000	276,275,400
大豊工業	9,000	747.000	6,723,000
日本精工	158,500	795.700	126,118,450

NTN	185,600	306.500	56,886,400
ジェイテクト	75,300	1,097.000	82,604,100
不二越	6,300	3,350.000	21,105,000
日本トムソン	21,200	608.000	12,889,600
THK	49,900	2,866.000	143,013,400
ユーシン精機	7,900	712.000	5,624,800
前澤給装工業	6,900	1,470.000	10,143,000
イーグル工業	9,300	2,128.000	19,790,400
前澤工業	4,900	1,437.000	7,041,300
PILLAR	7,900	5,120.000	40,448,000
キッツ	29,500	1,113.000	32,833,500
マキタ	99,900	4,938.000	493,306,200
三井E & S	43,500	1,339.000	58,246,500
日立造船	76,100	1,101.000	83,786,100
三菱重工業	1,528,000	1,830.000	2,796,240,000
IHI	66,800	5,550.000	370,740,000
スター精密	15,300	2,124.000	32,497,200
日清紡ホールディングス	64,200	1,103.500	70,844,700
イビデン	45,300	5,843.000	264,687,900
コニカミノルタ	193,300	444.700	85,960,510
ブラザー工業	115,600	3,113.000	359,862,800
ミネベアミツミ	151,000	3,628.000	547,828,000
日立製作所	2,099,600	3,288.000	6,903,484,800
三菱電機	957,500	2,601.000	2,490,457,500
富士電機	52,700	8,532.000	449,636,400
東洋電機製造	5,000	1,224.000	6,120,000
安川電機	94,100	5,258.000	494,777,800
シンフォニアテクノロジー	10,000	3,235.000	32,350,000
明電舎	16,000	3,460.000	55,360,000
オリジン	3,500	1,250.000	4,375,000
山洋電気	3,600	7,310.000	26,316,000
デンヨー	6,800	2,680.000	18,224,000
KOKUSAI ELECTRIC	45,600	4,200.000	191,520,000
ソシオネクスト	63,400	3,078.000	195,145,200
東芝テック	11,300	3,390.000	38,307,000
芝浦メカトロニクス	5,000	7,970.000	39,850,000
マブチモーター	42,100	2,321.500	97,735,150
ニデック	193,100	6,698.000	1,293,383,800
トレックス・セミコンダクター	4,300	1,967.000	8,458,100
東光高岳	5,300	2,021.000	10,711,300
ダイヘン	8,300	7,440.000	61,752,000
ヤーマン	17,100	838.000	14,329,800
JVCケンウッド	69,200	929.000	64,286,800
ミマキエンジニアリング	9,000	1,706.000	15,354,000
I-PEX	6,200	2,047.000	12,691,400
大崎電気工業	21,000	686.000	14,406,000
オムロン	66,700	5,571.000	371,585,700
日東工業	11,400	3,435.000	39,159,000



I D E C	12,400	3,100.000	38,440,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	33,600	2,694.500	90,535,200
サクサ	1,700	2,577.000	4,380,900
メルコホールディングス	3,300	3,290.000	10,857,000
日本電気	115,400	13,000.000	1,500,200,000
富士通	804,800	2,732.500	2,199,116,000
沖電気工業	39,200	1,024.000	40,140,800
電気興業	3,700	2,164.000	8,006,800
サンケン電気	8,100	7,340.000	59,454,000
アイホン	4,900	3,065.000	15,018,500
ルネサスエレクトロニクス	665,400	2,578.000	1,715,401,200
セイコーエプソン	113,000	2,630.500	297,246,500
ワコム	64,900	728.000	47,247,200
アルバック	19,000	9,311.000	176,909,000
アクセル	4,400	1,433.000	6,305,200
E I Z O	6,100	4,880.000	29,768,000
日本信号	19,000	1,052.000	19,988,000
京三製作所	19,500	638.000	12,441,000
能美防災	11,200	2,488.000	27,865,600
ホーチキ	6,400	2,300.000	14,720,000
エレコム	20,200	1,649.000	33,309,800
パナソニック ホールディングス	1,037,100	1,246.000	1,292,226,600
シャープ	147,000	878.200	129,095,400
アンリツ	61,400	1,291.000	79,267,400
富士通ゼネラル	24,900	1,981.500	49,339,350
ソニーグループ	605,700	13,530.000	8,195,121,000
T D K	137,400	10,535.000	1,447,509,000
帝国通信工業	4,100	2,186.000	8,962,600
タムラ製作所	36,200	680.000	24,616,000
アルプスアルパイン	77,800	1,603.000	124,713,400
日本電波工業	10,800	1,412.000	15,249,600
鈴木	5,300	1,448.000	7,674,400
メイコー	8,900	6,110.000	54,379,000
日本トリム	2,200	3,435.000	7,557,000
フォスター電機	8,200	1,636.000	13,415,200
S M K	2,500	2,524.000	6,310,000
ヨコオ	7,500	1,964.000	14,730,000
ホシデン	19,300	2,069.000	39,931,700
ヒロセ電機	12,800	18,925.000	242,240,000
日本航空電子工業	20,800	2,541.000	52,852,800
T O A	10,100	1,097.000	11,079,700
マクセル	18,900	1,733.000	32,753,700
古野電気	11,500	2,001.000	23,011,500
スミダコーポレーション	11,500	1,070.000	12,305,000
アイコム	3,600	3,095.000	11,142,000
リオン	3,800	2,420.000	9,196,000
横河電機	94,900	3,821.000	362,612,900
新電元工業	3,400	2,929.000	9,958,600

アズビル	59,000	4,388.000	258,892,000
東亜ディーケーケー	5,600	837.000	4,687,200
日本光電工業	73,800	2,313.000	170,699,400
チノー	3,700	2,473.000	9,150,100
日本電子材料	6,500	3,065.000	19,922,500
堀場製作所	16,400	11,995.000	196,718,000
アドバンテスト	248,200	6,029.000	1,496,397,800
エスベック	7,100	2,869.000	20,369,900
キーエンス	86,600	65,890.000	5,706,074,000
日置電機	4,100	8,070.000	33,087,000
シスメックス	224,700	2,472.500	555,570,750
日本マイクロニクス	15,600	6,000.000	93,600,000
メガチップス	6,800	4,215.000	28,662,000
OBARA GROUP	5,900	4,015.000	23,688,500
コーセル	9,800	1,230.000	12,054,000
イリソ電子工業	7,700	3,050.000	23,485,000
オブテックスグループ	15,100	1,727.000	26,077,700
千代田インテグレ	3,800	3,390.000	12,882,000
レーザーテック	39,700	26,830.000	1,065,151,000
スタンレー電気	56,000	2,982.500	167,020,000
ウシオ電機	42,300	2,159.500	91,346,850
日本セラミック	10,000	2,487.000	24,870,000
遠藤照明	3,200	1,500.000	4,800,000
山一電機	7,700	3,225.000	24,832,500
図研	7,200	3,700.000	26,640,000
日本電子	21,500	6,103.000	131,214,500
カシオ計算機	62,000	1,215.500	75,361,000
ファナック	418,900	4,510.000	1,889,239,000
日本シイエムケイ	19,800	543.000	10,751,400
エンプラス	2,600	7,650.000	19,890,000
大真空	12,700	723.000	9,182,100
ローム	158,700	2,049.000	325,176,300
浜松ホトニクス	68,700	4,349.000	298,776,300
三井ハイテック	38,000	1,169.000	44,422,000
新光電気工業	29,100	5,693.000	165,666,300
京セラ	538,100	1,901.000	1,022,928,100
太陽誘電	41,800	4,546.000	190,022,800
村田製作所	772,800	3,351.000	2,589,652,800
双葉電子工業	17,400	602.000	10,474,800
北陸電気工業	3,200	1,394.000	4,460,800
ニチコン	21,200	1,108.000	23,489,600
K O A	12,700	1,337.000	16,979,900
市光工業	15,900	496.000	7,886,400
小糸製作所	89,100	2,245.500	200,074,050
ミツバ	16,200	1,046.000	16,945,200
S C R E E Nホールディングス	29,400	12,895.000	379,113,000
キヤノン電子	9,100	2,312.000	21,039,200
キヤノン	431,900	4,742.000	2,048,069,800

リコー	214,700	1,411.500	303,049,050
象印マホービン	32,000	1,510.000	48,320,000
東京エレクトロン	183,100	31,020.000	5,679,762,000
イノテック	6,500	1,663.000	10,809,500
トヨタ紡織	35,700	2,050.500	73,202,850
ユニプレス	15,100	1,277.000	19,282,700
豊田自動織機	74,500	12,830.000	955,835,000
モリタホールディングス	14,600	1,938.000	28,294,800
三櫻工業	13,000	1,012.000	13,156,000
デンソー	714,700	2,514.000	1,796,755,800
東海理化電機製作所	23,100	2,069.000	47,793,900
川崎重工業	72,100	5,606.000	404,192,600
名村造船所	26,100	2,001.000	52,226,100
日本車輛製造	3,300	2,301.000	7,593,300
三菱ロジスネクスト	15,200	1,336.000	20,307,200
日産自動車	1,134,300	486.200	551,496,660
いすゞ自動車	244,200	2,067.500	504,883,500
トヨタ自動車	4,598,900	2,949.000	13,562,156,100
日野自動車	129,200	490.500	63,372,600
三菱自動車工業	334,600	439.100	146,922,860
武蔵精密工業	20,300	2,131.000	43,259,300
日産車体	6,700	939.000	6,291,300
新明和工業	25,900	1,483.000	38,409,700
極東開発工業	14,300	2,700.000	38,610,000
トピー工業	7,100	2,346.000	16,656,600
ティラド	2,400	3,730.000	8,952,000
タチエス	16,300	2,005.000	32,681,500
N O K	33,200	2,223.000	73,803,600
フタバ産業	23,900	774.000	18,498,600
カヤバ	7,900	5,250.000	41,475,000
大同メタル工業	19,500	600.000	11,700,000
プレス工業	36,200	631.000	22,842,200
太平洋工業	18,400	1,580.000	29,072,000
アイシン	66,100	5,150.000	340,415,000
マツダ	283,700	1,372.000	389,236,400
今仙電機製作所	6,300	608.000	3,830,400
本田技研工業	2,048,200	1,647.000	3,373,385,400
スズキ	635,500	1,759.500	1,118,162,250
S U B A R U	267,900	2,986.500	800,083,350
安永	4,400	554.000	2,437,600
ヤマハ発動機	370,700	1,415.000	524,540,500
エクセディ	13,800	3,200.000	44,160,000
豊田合成	23,800	2,787.000	66,330,600
愛三工業	14,000	1,544.000	21,616,000
日本プラスト	10,500	413.000	4,336,500
ヨロズ	9,500	1,160.000	11,020,000
エフ・シー・シー	14,200	2,364.000	33,568,800
シマノ	37,800	26,730.000	1,010,394,000

テイ・エス テック	32,200	2,010.500	64,738,100
ジャムコ	4,900	1,563.000	7,658,700
テルモ	482,900	2,706.000	1,306,727,400
日機装	19,100	1,198.000	22,881,800
日本エム・ディ・エム	5,400	708.000	3,823,200
島津製作所	115,700	4,458.000	515,790,600
長野計器	6,200	2,860.000	17,732,000
ブイ・テクノロジー	4,600	2,936.000	13,505,600
東京計器	6,700	3,410.000	22,847,000
愛知時計電機	3,800	2,293.000	8,713,400
インターアクション	5,500	1,369.000	7,529,500
オーバル	7,300	444.000	3,241,200
東京精密	17,700	10,445.000	184,876,500
マニー	34,600	2,118.000	73,282,800
ニコン	123,700	1,735.500	214,681,350
トプコン	42,400	1,570.000	66,568,000
オリンパス	495,800	2,604.000	1,291,063,200
理研計器	12,700	4,440.000	56,388,000
タムロン	12,000	4,280.000	51,360,000
HOYA	170,300	18,940.000	3,225,482,000
ノーリツ鋼機	8,100	4,105.000	33,250,500
A & Dホロンホールディングス	12,300	2,827.000	34,772,100
朝日インテック	104,900	2,381.000	249,766,900
シチズン時計	78,600	1,025.000	80,565,000
リズム	1,300	3,745.000	4,868,500
メニコン	30,000	1,407.500	42,225,000
松風	3,900	4,740.000	18,486,000
セイコーグループ	12,400	4,515.000	55,986,000
ニプロ	71,600	1,317.000	94,297,200
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,535.000	47,911,500
トランザクション	5,600	1,800.000	10,080,000
ニホンフラッシュ	8,600	930.000	7,998,000
前田工織	14,800	1,646.000	24,360,800
永大産業	17,800	242.000	4,307,600
アートネイチャー	9,800	839.000	8,222,200
フルヤ金属	8,100	4,610.000	37,341,000
バンダイナムコホールディングス	235,400	3,206.000	754,692,400
SHOEI	23,700	2,005.000	47,518,500
フランスベッドホールディングス	10,500	1,215.000	12,757,500
パイロットコーポレーション	12,400	4,528.000	56,147,200
萩原工業	6,300	1,598.000	10,067,400
フジシールインターナショナル	17,100	2,413.000	41,262,300
タカラトミー	39,000	3,435.000	133,965,000
広済堂ホールディングス	26,200	542.000	14,200,400
プロネクサス	7,700	1,297.000	9,986,900
TOPPANホールディングス	104,700	4,275.000	447,592,500
大日本印刷	90,000	4,970.000	447,300,000
共同印刷	2,800	3,900.000	10,920,000

N I S S H A	15,100	1,842.000	27,814,200
T A K A R A & C O M P A N Y	5,300	3,025.000	16,032,500
アシックス	317,800	2,475.000	786,555,000
ツツミ	3,200	2,166.000	6,931,200
ローランド	6,300	3,910.000	24,633,000
小松ウオール工業	3,300	3,190.000	10,527,000
ヤマハ	54,000	3,595.000	194,130,000
河合楽器製作所	2,500	2,978.000	7,445,000
クリナップ	9,800	738.000	7,232,400
ピジョン	55,500	1,528.500	84,831,750
キングジム	8,800	890.000	7,832,000
リンテック	16,900	3,400.000	57,460,000
イトーキ	17,400	1,536.000	26,726,400
任天堂	546,400	8,388.000	4,583,203,200
三菱鉛筆	12,000	2,343.000	28,116,000
タカラスタンド	17,700	1,742.000	30,833,400
コクヨ	41,200	2,531.000	104,277,200
グローブライド	7,100	2,115.000	15,016,500
オカムラ	25,200	2,225.000	56,070,000
美津濃	8,500	7,640.000	64,940,000
東京電力ホールディングス	777,200	747.800	581,190,160
中部電力	318,100	1,893.500	602,322,350
関西電力	334,700	2,572.500	861,015,750
中国電力	148,700	1,089.000	161,934,300
北陸電力	87,700	954.900	83,744,730
東北電力	226,200	1,274.500	288,291,900
四国電力	79,200	1,307.000	103,514,400
九州電力	198,200	1,580.000	313,156,000
北海道電力	83,500	1,019.500	85,128,250
沖縄電力	22,300	1,107.000	24,686,100
電源開発	70,400	2,479.000	174,521,600
エフオン	9,900	407.000	4,029,300
イーレックス	17,200	715.000	12,298,000
レノバ	24,800	917.000	22,741,600
東京瓦斯	168,900	3,302.000	557,707,800
大阪瓦斯	172,900	3,407.000	589,070,300
東邦瓦斯	38,200	4,648.000	177,553,600
北海道瓦斯	5,000	3,270.000	16,350,000
広島ガス	19,100	405.000	7,735,500
西部ガスホールディングス	8,100	1,927.000	15,608,700
静岡ガス	18,000	954.000	17,172,000
メタウォーター	10,800	1,876.000	20,260,800
S B S ホールディングス	9,000	2,767.000	24,903,000
東武鉄道	94,800	2,641.000	250,366,800
相鉄ホールディングス	31,700	2,468.000	78,235,600
東急	243,600	1,821.500	443,717,400
京浜急行電鉄	107,200	1,187.000	127,246,400
小田急電鉄	143,100	1,521.500	217,726,650

京王電鉄	41,900	3,763.000	157,669,700
京成電鉄	56,200	4,499.000	252,843,800
富士急行	12,100	3,085.000	37,328,500
東日本旅客鉄道	477,200	2,825.000	1,348,090,000
西日本旅客鉄道	205,300	2,956.000	606,866,800
東海旅客鉄道	333,200	3,545.000	1,181,194,000
西武ホールディングス	106,000	2,817.000	298,602,000
鴻池運輸	16,800	2,411.000	40,504,800
西日本鉄道	22,600	2,495.500	56,398,300
ハマキョウレックス	7,200	4,775.000	34,380,000
サカイ引越センター	11,000	2,669.000	29,359,000
近鉄グループホールディングス	86,200	3,486.000	300,493,200
阪急阪神ホールディングス	115,200	4,305.000	495,936,000
南海電気鉄道	39,300	2,662.500	104,636,250
京阪ホールディングス	47,700	3,061.000	146,009,700
神戸電鉄	2,700	2,830.000	7,641,000
名古屋鉄道	89,800	1,828.500	164,199,300
山陽電気鉄道	6,400	2,036.000	13,030,400
ヤマトホールディングス	107,000	1,827.000	195,489,000
山九	21,500	5,160.000	110,940,000
丸全昭和運輸	5,900	5,410.000	31,919,000
センコーグループホールディングス	46,900	1,152.000	54,028,800
トナミホールディングス	1,900	6,340.000	12,046,000
ニッコンホールディングス	26,900	3,791.000	101,977,900
福山通運	9,800	4,055.000	39,739,000
セイノーホールディングス	49,700	2,353.000	116,944,100
神奈川中央交通	2,600	3,435.000	8,931,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	25,600	1,300.000	33,280,000
九州旅客鉄道	61,400	4,020.000	246,828,000
S Gホールディングス	146,800	1,523.500	223,649,800
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	31,200	7,460.000	232,752,000
日本郵船	223,200	4,899.000	1,093,456,800
商船三井	186,200	4,812.000	895,994,400
川崎汽船	207,600	2,340.000	485,784,000
N Sユナイテッド海運	4,700	4,895.000	23,006,500
明海グループ	7,400	715.000	5,291,000
飯野海運	31,300	1,284.000	40,189,200
乾汽船	12,600	1,136.000	14,313,600
日本航空	210,300	2,463.000	517,968,900
A N Aホールディングス	235,900	2,876.500	678,566,350
トランコム	2,400	6,680.000	16,032,000
日新	6,700	4,520.000	30,284,000
三菱倉庫	20,500	5,299.000	108,629,500
三井倉庫ホールディングス	7,700	4,820.000	37,114,000
住友倉庫	22,800	2,833.000	64,592,400
澁澤倉庫	3,300	3,060.000	10,098,000
東陽倉庫	3,700	1,450.000	5,365,000

日本トランスシティ	16,800	973.000	16,346,400
川西倉庫	5,200	1,153.000	5,995,600
安田倉庫	6,500	1,610.000	10,465,000
上組	39,400	3,440.000	135,536,000
キムラユニティー	4,000	1,634.000	6,536,000
キューソー流通システム	6,700	1,903.000	12,750,100
エーアイティー	5,400	1,940.000	10,476,000
内外トランスライン	3,500	2,849.000	9,971,500
日本コンセプト	3,300	1,739.000	5,738,700
NEC ネットズエスアイ	33,600	2,785.000	93,576,000
クロスキャット	7,100	1,339.000	9,506,900
システナ	134,900	340.000	45,866,000
デジタルアーツ	5,400	4,765.000	25,731,000
日鉄ソリューションズ	30,600	3,445.000	105,417,000
キューブシステム	3,500	1,183.000	4,140,500
コア	3,300	2,100.000	6,930,000
手間いらず	1,900	3,540.000	6,726,000
ラクーンホールディングス	8,100	598.000	4,843,800
ソリトンシステムズ	4,800	1,206.000	5,788,800
ソフトクリエイティブホールディングス	7,100	1,796.000	12,751,600
T I S	92,700	3,230.000	299,421,000
グリー	30,500	531.000	16,195,500
コーエーテックモホールディングス	54,500	1,469.500	80,087,750
三菱総合研究所	3,900	4,745.000	18,505,500
ファインデックス	7,900	1,091.000	8,618,900
ブレインパッド	7,500	988.000	7,410,000
ポルトゥウィンホールディングス	15,000	447.000	6,705,000
ネクソン	190,700	3,275.000	624,542,500
アイスタイル	29,900	442.000	13,215,800
エムアップホールディングス	11,100	1,328.000	14,740,800
エイチーム	6,700	670.000	4,489,000
エニグモ	12,700	351.000	4,457,700
コロプラ	32,000	612.000	19,584,000
ブロードリーフ	43,900	618.000	27,130,200
デジタルハーツホールディングス	5,700	998.000	5,688,600
メディアドゥ	4,300	1,402.000	6,028,600
じげん	25,500	584.000	14,892,000
フィックスターズ	9,800	1,725.000	16,905,000
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,475.000	6,490,000
オブティム	8,500	680.000	5,780,000
セレス	3,800	1,694.000	6,437,200
S H I F T	5,900	11,465.000	67,643,500
ティーガイア	9,500	3,905.000	37,097,500
セック	1,300	4,250.000	5,525,000
テクマトリックス	16,800	2,095.000	35,196,000
プロシップ	3,900	1,486.000	5,795,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,800	2,928.000	66,758,400
G M O ペイメントゲートウェイ	19,800	8,469.000	167,686,200

システムリサーチ	5,600	1,534.000	8,590,400
インターネットイニシアティブ	41,900	2,538.000	106,342,200
さくらインターネット	11,100	3,085.000	34,243,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	3,105.000	8,383,500
SRAホールディングス	4,200	4,370.000	18,354,000
朝日ネット	5,600	669.000	3,746,400
eBASE	12,200	667.000	8,137,400
アバントグループ	10,700	1,370.000	14,659,000
アドソル日進	3,500	1,903.000	6,660,500
フリービット	4,600	1,388.000	6,384,800
コムチュア	12,300	1,897.000	23,333,100
アイル	5,400	2,703.000	14,596,200
マークライズ	4,700	3,010.000	14,147,000
メディカル・データ・ビジョン	12,600	544.000	6,854,400
テラスカイ	4,300	2,217.000	9,533,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,920.000	9,024,000
ネオジャパン	3,200	1,760.000	5,632,000
PR TIMES	2,200	1,799.000	3,957,800
ラクス	41,500	2,078.000	86,237,000
ダブルスタンダード	3,400	1,848.000	6,283,200
オープンドア	6,300	787.000	4,958,100
アカツキ	4,500	2,376.000	10,692,000
UBICOMホールディングス	3,100	1,339.000	4,150,900
カナミックネットワーク	12,200	556.000	6,783,200
チェンジホールディングス	19,600	1,127.000	22,089,200
シンクロ・フード	2,300	498.000	1,145,400
オークネット	3,500	2,420.000	8,470,000
セグエグループ	4,500	619.000	2,785,500
マクロミル	17,000	884.000	15,028,000
オロ	3,600	2,559.000	9,212,400
ユーザーローカル	3,800	2,058.000	7,820,400
マネーフォワード	21,200	4,948.000	104,897,600
SUN ASTERISK	6,600	917.000	6,052,200
プラスアルファ・コンサルティング	11,300	1,916.000	21,650,800
電算システムホールディングス	4,200	2,873.000	12,066,600
APPIER GROUP	30,100	1,234.000	37,143,400
ビジョナル	10,400	7,880.000	81,952,000
プロトコーポレーション	9,900	1,479.000	14,642,100
野村総合研究所	188,000	4,670.000	877,960,000
日本システム技術	8,000	1,653.000	13,224,000
インテージホールディングス	9,900	1,610.000	15,939,000
東邦システムサイエンス	3,800	1,783.000	6,775,400
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,167.000	29,254,500
HEROZ	4,100	1,220.000	5,002,000
ラクスル	22,000	1,135.000	24,970,000
メルカリ	42,600	2,235.000	95,211,000
IPS	2,900	2,205.000	6,394,500



システムサポート	3,300	1,984.000	6,547,200
イーソル	7,500	835.000	6,262,500
ウイングアーク1st	9,500	2,818.000	26,771,000
サーバーワークス	2,100	3,005.000	6,310,500
Sansan	29,100	2,256.000	65,649,600
ギフトィ	8,000	1,196.000	9,568,000
メドレー	11,900	4,060.000	48,314,000
ベース	3,200	2,814.000	9,004,800
JMDC	14,900	3,307.000	49,274,300
フォーカスシステムズ	6,000	1,287.000	7,722,000
クレスコ	14,000	1,337.000	18,718,000
フジ・メディア・ホールディングス	82,500	1,893.000	156,172,500
オービック	29,000	22,800.000	661,200,000
ジャストシステム	12,500	3,165.000	39,562,500
TDCソフト	16,800	1,291.000	21,688,800
LINEヤフー	1,235,900	373.000	460,990,700
トレンドマイクロ	45,500	7,249.000	329,829,500
IDホールディングス	5,900	1,413.000	8,336,700
日本オラクル	16,600	12,230.000	203,018,000
アルファシステムズ	2,500	3,040.000	7,600,000
フューチャー	21,300	1,714.000	36,508,200
CAC HOLDINGS	4,300	1,898.000	8,161,400
オービックビジネスコンサルタント	12,300	6,383.000	78,510,900
アイティフォー	10,900	1,510.000	16,459,000
東計電算	2,800	4,550.000	12,740,000
大塚商会	98,100	3,331.000	326,771,100
サイボウズ	12,700	1,799.000	22,847,300
電通総研	10,000	5,690.000	56,900,000
ACCESS	10,400	1,331.000	13,842,400
デジタルガレージ	14,300	2,804.000	40,097,200
イーエムシステムズ	14,500	645.000	9,352,500
ウェザーニューズ	2,700	5,740.000	15,498,000
CIJ	23,400	468.000	10,951,200
ビジネスエンジニアリング	1,800	4,150.000	7,470,000
WOWOW	7,000	1,161.000	8,127,000
スカラ	9,000	623.000	5,607,000
ANYCOLOR	12,700	2,534.000	32,181,800
IMAGICA GROUP	8,700	500.000	4,350,000
ネットワンシステムズ	34,800	3,027.000	105,339,600
システムソフト	27,400	72.000	1,972,800
アルゴグラフィックス	8,200	5,120.000	41,984,000
マーベラス	14,200	653.000	9,272,600
エイベックス	15,200	1,508.000	22,921,600
BIPROGY	28,400	4,919.000	139,699,600
都築電気	4,500	2,297.000	10,336,500
TBSホールディングス	43,600	4,261.000	185,779,600
日本テレビホールディングス	76,600	2,425.000	185,755,000
朝日放送グループホールディングス	9,600	688.000	6,604,800

テレビ朝日ホールディングス	20,800	2,103.000	43,742,400
スカパーJ S A Tホールディングス	67,900	890.000	60,431,000
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,690.000	22,140,000
日本BS放送	3,500	922.000	3,227,000
ビジョン	13,400	1,342.000	17,982,800
U - N E X T H O L D I N G S	10,100	5,160.000	52,116,000
日本通信	91,400	188.000	17,183,200
日本電信電話	25,808,200	160.400	4,139,635,280
K D D I	638,500	4,520.000	2,886,020,000
ソフトバンク	1,388,300	1,965.000	2,728,009,500
光通信	8,700	28,210.000	245,427,000
エムティーアイ	7,400	837.000	6,193,800
GMOインターネットグループ	31,700	2,489.500	78,917,150
ファイバーゲート	5,000	1,189.000	5,945,000
K A D O K A W A	46,100	2,784.000	128,342,400
学研ホールディングス	14,600	1,080.000	15,768,000
ゼンリン	14,500	969.000	14,050,500
アイネット	5,600	1,873.000	10,488,800
松竹	4,700	9,640.000	45,308,000
東宝	48,200	5,418.000	261,147,600
東映	14,500	3,880.000	56,260,000
N T T データグループ	230,300	2,359.500	543,392,850
ピー・シー・エー	5,700	2,050.000	11,685,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	2,118.000	6,989,400
D T S	17,900	4,330.000	77,507,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,600	5,092.000	201,643,200
シーイーシー	11,700	1,966.000	23,002,200
カブコン	155,500	3,202.000	497,911,000
アイ・エス・ピー	4,600	1,606.000	7,387,600
S C S K	62,000	2,953.500	183,117,000
N S W	3,300	3,260.000	10,758,000
アイネス	6,400	1,795.000	11,488,000
T K C	14,900	3,575.000	53,267,500
富士ソフト	24,100	7,230.000	174,243,000
N S D	30,700	3,100.000	95,170,000
コナミグループ	32,500	11,410.000	370,825,000
福井コンピュータホールディングス	5,200	2,581.000	13,421,200
J B C C ホールディングス	5,900	4,150.000	24,485,000
ミロク情報サービス	7,900	1,953.000	15,428,700
ソフトバンクグループ	427,800	9,162.000	3,919,503,600
リョーサン菱洋ホールディングス	17,200	2,895.000	49,794,000
高千穂交易	2,900	4,015.000	11,643,500
伊藤忠食品	2,000	6,960.000	13,920,000
エレマテック	8,000	1,920.000	15,360,000
あらた	13,500	3,595.000	48,532,500
トーメンデバイス	1,400	7,150.000	10,010,000
東京エレクトロン デバイス	9,400	3,950.000	37,130,000
円谷フィールズホールディングス	16,800	1,586.000	26,644,800

双日	100,800	3,601.000	362,980,800
アルフレッサ ホールディングス	91,000	2,364.000	215,124,000
横浜冷凍	24,300	1,089.000	26,462,700
ラサ商事	5,000	1,721.000	8,605,000
アルコニックス	12,000	1,489.000	17,868,000
神戸物産	71,600	3,958.000	283,392,800
あい ホールディングス	14,600	2,533.000	36,981,800
ダイワボウホールディングス	40,300	2,849.000	114,814,700
マクニカホールディングス	21,600	6,105.000	131,868,000
ラクト・ジャパン	3,800	2,984.000	11,339,200
グリムス	3,800	2,410.000	9,158,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	1,321.000	17,701,400
八洲電機	6,300	1,732.000	10,911,600
メディアスホールディングス	7,000	867.000	6,069,000
レスター	8,000	2,964.000	23,712,000
ジオリーブグループ	1,600	1,185.000	1,896,000
T O K A Iホールディングス	46,500	1,010.000	46,965,000
三洋貿易	9,900	1,515.000	14,998,500
ビューティガレージ	3,300	1,500.000	4,950,000
ウイン・パートナーズ	5,200	1,234.000	6,416,800
シップヘルスケアホールディングス	33,000	2,300.000	75,900,000
スターティアホールディングス	1,000	2,153.000	2,153,000
コメダホールディングス	22,800	2,692.000	61,377,600
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,340.000	19,422,000
ヤマエグループホールディングス	9,100	2,360.000	21,476,000
小野建	8,700	1,630.000	14,181,000
南陽	5,000	1,093.000	5,465,000
佐鳥電機	5,700	2,101.000	11,975,700
エコートレーディング	2,500	1,008.000	2,520,000
伯東	5,200	5,050.000	26,260,000
コンドーテック	7,000	1,388.000	9,716,000
ナガイレーベン	12,000	2,702.000	32,424,000
三菱食品	9,300	5,320.000	49,476,000
松田産業	6,800	2,984.000	20,291,200
第一興商	34,400	1,822.500	62,694,000
メディバルホールディングス	92,000	2,727.000	250,884,000
S P K	4,200	2,296.000	9,643,200
萩原電気ホールディングス	4,300	3,835.000	16,490,500
アズワン	28,200	3,245.000	91,509,000
スズデン	3,800	1,900.000	7,220,000
尾家産業	2,500	2,038.000	5,095,000
シモジマ	6,600	1,323.000	8,731,800
ドウシシャ	8,800	2,290.000	20,152,000
高速	4,900	2,500.000	12,250,000
たけびし	3,400	2,491.000	8,469,400
リックス	2,000	3,065.000	6,130,000
丸文	8,300	1,157.000	9,603,100
ハピネット	9,400	3,265.000	30,691,000

日本ライフライン	25,900	1,164.000	30,147,600
タカショー	11,900	512.000	6,092,800
I D O M	26,300	1,154.000	30,350,200
進和	5,800	2,677.000	15,526,600
ダイترون	3,600	2,778.000	10,000,800
シークス	12,500	1,260.000	15,750,000
オーハシテクニカ	4,700	1,934.000	9,089,800
白銅	2,600	2,605.000	6,773,000
伊藤忠商事	615,000	7,783.000	4,786,545,000
丸紅	758,200	2,860.500	2,168,831,100
長瀬産業	41,100	3,318.000	136,369,800
蝶理	5,500	3,795.000	20,872,500
豊田通商	238,800	3,033.000	724,280,400
三共生興	14,800	695.000	10,286,000
兼松	37,100	2,561.000	95,013,100
三井物産	1,370,300	3,530.000	4,837,159,000
日本紙パルプ商事	4,600	6,620.000	30,452,000
カメイ	9,500	2,265.000	21,517,500
スターゼン	6,200	3,150.000	19,530,000
山善	26,300	1,559.000	41,001,700
椿本興業	6,000	2,051.000	12,306,000
住友商事	552,600	3,778.000	2,087,722,800
内田洋行	3,700	7,840.000	29,008,000
三菱商事	1,754,600	3,144.000	5,516,462,400
第一実業	9,200	2,366.000	21,767,200
キヤノンマーケティングジャパン	20,800	4,663.000	96,990,400
西華産業	4,000	4,195.000	16,780,000
佐藤商事	6,200	1,688.000	10,465,600
東京産業	8,900	739.000	6,577,100
ユアサ商事	7,300	5,630.000	41,099,000
神鋼商事	2,300	8,810.000	20,263,000
阪和興業	16,000	5,830.000	93,280,000
正栄食品工業	6,100	5,080.000	30,988,000
カナデン	6,700	1,630.000	10,921,000
R Y O D E N	7,100	2,861.000	20,313,100
岩谷産業	20,600	9,582.000	197,389,200
ナイス	2,600	2,013.000	5,233,800
極東貿易	5,400	1,724.000	9,309,600
アステナホールディングス	18,300	558.000	10,211,400
三愛オブリ	22,200	2,067.000	45,887,400
稲畑産業	17,400	3,375.000	58,725,000
G S I クレオス	5,000	2,232.000	11,160,000
明和産業	12,500	705.000	8,812,500
ワキタ	16,100	1,684.000	27,112,400
東邦ホールディングス	25,100	4,386.000	110,088,600
サンゲツ	21,200	3,000.000	63,600,000
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,699.000	21,747,200
シナネンホールディングス	2,900	5,350.000	15,515,000

伊藤忠エネクス	21,100	1,719.000	36,270,900
サンリオ	76,200	3,216.000	245,059,200
サンワ テクノス	4,600	2,177.000	10,014,200
新光商事	12,300	891.000	10,959,300
トーヨー	4,000	3,200.000	12,800,000
三信電気	3,900	2,169.000	8,459,100
東陽テクニカ	9,100	1,594.000	14,505,400
モスフードサービス	13,300	3,535.000	47,015,500
加賀電子	8,000	5,470.000	43,760,000
ソーダニッカ	8,000	1,188.000	9,504,000
立花エレテック	6,400	3,015.000	19,296,000
フォーバル	1,700	1,565.000	2,660,500
PALTAC	13,100	4,633.000	60,692,300
三谷産業	19,000	360.000	6,840,000
太平洋興発	3,400	791.000	2,689,400
西本Wismettacホールディングス	6,900	1,406.000	9,701,400
コア商事ホールディングス	4,100	717.000	2,939,700
KPPグループホールディングス	24,800	747.000	18,525,600
ヤマタネ	4,500	3,275.000	14,737,500
泉州電業	5,900	5,140.000	30,326,000
トラスコ中山	18,200	2,445.000	44,499,000
オートバックスセブン	31,900	1,660.500	52,969,950
モリト	7,100	1,455.000	10,330,500
加藤産業	10,700	4,290.000	45,903,000
イエローハット	15,000	2,635.000	39,525,000
JKホールディングス	7,800	1,109.000	8,650,200
日伝	6,400	3,485.000	22,304,000
杉本商事	4,300	2,946.000	12,667,800
因幡電機産業	22,800	3,960.000	90,288,000
東テク	9,700	2,569.000	24,919,300
ミスミグループ本社	139,300	2,782.500	387,602,250
タキヒヨー	3,200	1,297.000	4,150,400
スズケン	34,300	5,500.000	188,650,000
ジェコス	6,100	981.000	5,984,100
サンエー	6,600	5,130.000	33,858,000
カワチ薬品	7,000	2,789.000	19,523,000
エービーシー・マート	41,600	2,947.500	122,616,000
ハードオフコーポレーション	3,500	2,095.000	7,332,500
アスクル	22,400	2,129.000	47,689,600
ゲオホールディングス	10,400	1,658.000	17,243,200
アダストリア	11,100	3,315.000	36,796,500
くら寿司	10,800	3,895.000	42,066,000
キャンドウ	4,200	4,010.000	16,842,000
バルグループホールディングス	18,800	2,030.000	38,164,000
エディオン	35,000	1,751.000	61,285,000
サーラコーポレーション	18,900	832.000	15,724,800
ハローズ	4,000	4,585.000	18,340,000
フジオフードグループ本社	10,600	1,405.000	14,893,000

あみやき亭	2,400	5,550.000	13,320,000
大黒天物産	3,000	10,660.000	31,980,000
ハニーズホールディングス	8,000	1,614.000	12,912,000
アルペン	7,300	2,204.000	16,089,200
クオールホールディングス	12,400	1,529.000	18,959,600
ジンスホールディングス	7,400	4,570.000	33,818,000
ビックカメラ	55,200	1,698.000	93,729,600
D C Mホールディングス	49,200	1,449.000	71,290,800
MonotaRO	130,100	2,115.000	275,161,500
DDグループ	2,900	1,436.000	4,164,400
J . フロント リテイリング	104,200	1,828.000	190,477,600
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,338.000	36,005,200
マツキヨココカラ&カンパニー	168,400	2,450.500	412,664,200
ブロンコビリー	5,400	3,530.000	19,062,000
Z O Z O	58,400	4,386.000	256,142,400
トレジャー・ファクトリー	6,600	1,888.000	12,460,800
物語コーポレーション	15,300	3,420.000	52,326,000
三越伊勢丹ホールディングス	151,500	3,031.000	459,196,500
H a m e e	4,900	1,140.000	5,586,000
ウエルシアホールディングス	47,700	2,011.000	95,924,700
クリエイイトSDホールディングス	13,500	3,370.000	45,495,000
チムニー	2,200	1,364.000	3,000,800
シュッピン	8,200	1,458.000	11,955,600
オイシックス・ラ・大地	12,300	1,370.000	16,851,000
ネクステージ	21,700	2,032.000	44,094,400
ジョイフル本田	25,700	2,179.000	56,000,300
エターナルホスピタリティグループ	3,600	3,835.000	13,806,000
ホットランド	7,200	2,383.000	17,157,600
すかいらくホールディングス	124,500	2,064.000	256,968,000
S F Pホールディングス	4,600	2,125.000	9,775,000
綿半ホールディングス	5,600	1,855.000	10,388,000
ヨシックスホールディングス	1,900	3,070.000	5,833,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,800	898.000	29,454,400
B E E N O S	5,500	2,545.000	13,997,500
あさひ	7,500	1,479.000	11,092,500
日本調剤	6,400	1,574.000	10,073,600
コスモス薬品	7,800	13,415.000	104,637,000
セブン&アイ・ホールディングス	922,500	1,810.500	1,670,186,250
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	62,600	1,075.000	67,295,000
ツルハホールディングス	19,200	9,281.000	178,195,200
サンマルクホールディングス	7,000	2,150.000	15,050,000
フェリシモ	4,000	925.000	3,700,000
トリドールホールディングス	26,000	3,937.000	102,362,000
T O K Y O B A S E	11,600	278.000	3,224,800
J Mホールディングス	6,900	2,887.000	19,920,300
アレンザホールディングス	6,500	1,148.000	7,462,000

串カツ田中ホールディングス	800	1,643.000	1,314,400
クスリのアオキホールディングス	27,800	3,121.000	86,763,800
力の源ホールディングス	5,500	1,429.000	7,859,500
FOOD & LIFE COMPANIES	48,700	2,633.500	128,251,450
メディカルシステムネットワーク	12,000	547.000	6,564,000
ノジマ	26,900	1,655.000	44,519,500
カップ・クリエイト	14,400	1,889.000	27,201,600
良品計画	108,900	2,841.500	309,439,350
アドヴァングループ	4,900	930.000	4,557,000
アルビス	2,500	2,881.000	7,202,500
G - 7ホールディングス	9,500	1,698.000	16,131,000
イオン北海道	31,800	916.000	29,128,800
コジマ	17,400	1,081.000	18,809,400
コーナン商事	11,700	4,050.000	47,385,000
エコス	3,600	2,259.000	8,132,400
ワタミ	10,300	948.000	9,764,400
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	184,600	3,941.000	727,508,600
西松屋チェーン	18,400	2,282.000	41,988,800
ゼンショーホールディングス	46,800	6,107.000	285,807,600
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,342.000	9,125,600
サイゼリヤ	13,900	5,790.000	80,481,000
V Tホールディングス	33,100	523.000	17,311,300
フジ・コーポレーション	3,800	2,114.000	8,033,200
ユナイテッドアローズ	10,500	2,121.000	22,270,500
ハイデイ日高	13,400	2,773.000	37,158,200
コロワイド	39,700	2,070.500	82,198,850
壱番屋	35,500	1,070.000	37,985,000
スギホールディングス	58,400	2,571.500	150,175,600
薬王堂ホールディングス	4,600	2,835.000	13,041,000
スクロール	13,200	1,029.000	13,582,800
ヨンドシーホールディングス	8,100	1,971.000	15,965,100
木曽路	13,600	2,645.000	35,972,000
S R Sホールディングス	14,900	1,283.000	19,116,700
リテールパートナーズ	13,000	1,696.000	22,048,000
上新電機	8,000	2,823.000	22,584,000
日本瓦斯	51,400	2,349.500	120,764,300
ロイヤルホールディングス	16,500	2,538.000	41,877,000
いなげや	8,600	1,275.000	10,965,000
チヨダ	9,500	952.000	9,044,000
ライフコーポレーション	9,300	3,665.000	34,084,500
リンガーハット	12,100	2,268.000	27,442,800
Mr Max HD	10,700	717.000	7,671,900
A O K Iホールディングス	18,500	1,380.000	25,530,000
オークワ	14,400	887.000	12,772,800
コメリ	13,800	3,700.000	51,060,000
青山商事	19,500	1,540.000	30,030,000

しまむら	22,500	7,344.000	165,240,000
高島屋	61,500	2,813.000	172,999,500
松屋	15,300	1,078.000	16,493,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,600	2,635.000	128,061,000
近鉄百貨店	4,900	2,326.000	11,397,400
丸井グループ	60,400	2,436.500	147,164,600
アクシアル リテイリング	23,600	1,027.000	24,237,200
イオン	308,500	3,435.000	1,059,697,500
イズミ	18,900	3,588.000	67,813,200
平和堂	14,900	2,470.000	36,803,000
フジ	13,200	1,977.000	26,096,400
ヤオコー	11,000	9,171.000	100,881,000
ゼビオホールディングス	12,200	1,210.000	14,762,000
ケーズホールディングス	61,500	1,621.500	99,722,250
Genky DrugStores	8,400	3,445.000	28,938,000
ブックオフグループホールディングス	6,100	1,371.000	8,363,100
ギフトホールディングス	4,200	2,547.000	10,697,400
アインホールディングス	12,600	5,811.000	73,218,600
元気寿司	5,800	3,900.000	22,620,000
ヤマダホールディングス	288,200	456.500	131,563,300
アークランズ	27,100	1,820.000	49,322,000
ニトリホールディングス	33,200	17,865.000	593,118,000
グルメ杵屋	5,900	1,137.000	6,708,300
ケーユーホールディングス	2,900	1,213.000	3,517,700
吉野家ホールディングス	34,000	2,894.000	98,396,000
松屋フーズホールディングス	4,100	5,880.000	24,108,000
サガミホールディングス	13,800	1,682.000	23,211,600
王将フードサービス	6,600	9,170.000	60,522,000
ミニストップ	6,700	1,696.000	11,363,200
アークス	16,100	2,735.000	44,033,500
パローホールディングス	16,900	2,550.000	43,095,000
ベルク	4,400	6,280.000	27,632,000
大 庄	5,500	1,218.000	6,699,000
ファーストリテイリング	51,300	41,650.000	2,136,645,000
サンドラッグ	33,000	4,170.000	137,610,000
サックスパー ホールディングス	7,700	796.000	6,129,200
やまや	1,000	3,140.000	3,140,000
ベルーナ	21,200	785.000	16,642,000
いよぎんホールディングス	100,100	1,523.000	152,452,300
しずおかフィナンシャルグループ	187,100	1,517.500	283,924,250
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	70,500	1,689.500	119,109,750
楽天銀行	40,200	3,370.000	135,474,000
京都フィナンシャルグループ	107,500	2,840.000	305,300,000
じもとホールディングス	11,000	335.000	3,685,000
めぶきフィナンシャルグループ	405,700	635.000	257,619,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,585.000	48,142,500
九州フィナンシャルグループ	163,300	934.300	152,571,190
ゆうちょ銀行	936,700	1,575.500	1,475,770,850



富山第一銀行	27,100	1,323.000	35,853,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	452,000	960.000	433,920,000
西日本フィナンシャルホールディングス	49,000	2,065.000	101,185,000
三十三フィナンシャルグループ	7,500	2,072.000	15,540,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	6,040.000	76,104,000
ひろぎんホールディングス	117,800	1,233.000	145,247,400
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,910.000	20,079,000
十六フィナンシャルグループ	10,500	4,865.000	51,082,500
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	5,700.000	50,730,000
プロクレアホールディングス	10,100	1,917.000	19,361,700
あいちフィナンシャルグループ	17,400	2,736.000	47,606,400
あおぞら銀行	61,500	2,507.500	154,211,250
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,186,800	1,750.000	9,076,900,000
りそなホールディングス	984,400	1,092.000	1,074,964,800
三井住友トラスト・ホールディングス	303,600	3,841.000	1,166,127,600
三井住友フィナンシャルグループ	596,300	10,915.000	6,508,614,500
千葉銀行	238,200	1,428.500	340,268,700
群馬銀行	165,400	1,033.500	170,940,900
武蔵野銀行	10,300	3,260.000	33,578,000
千葉興業銀行	18,900	1,076.000	20,336,400
筑波銀行	36,200	327.000	11,837,400
七十七銀行	24,900	4,740.000	118,026,000
秋田銀行	4,900	2,565.000	12,568,500
山形銀行	9,100	1,168.000	10,628,800
岩手銀行	5,800	2,833.000	16,431,400
東邦銀行	64,500	317.000	20,446,500
東北銀行	4,600	1,235.000	5,681,000
ふくおかフィナンシャルグループ	73,400	4,273.000	313,638,200
スルガ銀行	72,500	1,199.000	86,927,500
八十二銀行	182,400	1,080.500	197,083,200
山梨中央銀行	8,900	2,038.000	18,138,200
大垣共立銀行	15,400	2,338.000	36,005,200
福井銀行	7,500	2,200.000	16,500,000
清水銀行	3,600	1,622.000	5,839,200
滋賀銀行	13,800	4,075.000	56,235,000
南都銀行	12,300	3,535.000	43,480,500
百五銀行	76,000	679.000	51,604,000
紀陽銀行	28,900	1,982.000	57,279,800
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	2,134.500	109,713,300
山陰合同銀行	51,900	1,440.000	74,736,000
鳥取銀行	3,900	1,372.000	5,350,800
百十四銀行	7,900	3,315.000	26,188,500
四国銀行	13,300	1,188.000	15,800,400
阿波銀行	11,500	2,807.000	32,280,500
大分銀行	5,100	3,420.000	17,442,000
宮崎銀行	5,200	3,410.000	17,732,000
佐賀銀行	5,100	2,761.000	14,081,100
琉球銀行	19,200	1,234.000	23,692,800

セブン銀行	267,800	283.500	75,921,300
みずほフィナンシャルグループ	1,149,000	3,448.000	3,961,752,000
山口フィナンシャルグループ	82,700	1,888.000	156,137,600
名古屋銀行	5,300	8,220.000	43,566,000
北洋銀行	127,100	515.000	65,456,500
大光銀行	5,300	1,642.000	8,702,600
愛媛銀行	11,600	1,244.000	14,430,400
トマト銀行	5,100	1,315.000	6,706,500
京葉銀行	37,400	854.000	31,939,600
栃木銀行	42,100	359.000	15,113,900
北日本銀行	2,600	2,828.000	7,352,800
東和銀行	15,200	695.000	10,564,000
大東銀行	8,500	769.000	6,536,500
トモニホールディングス	81,100	434.000	35,197,400
フィデアホールディングス	8,500	1,640.000	13,940,000
池田泉州ホールディングス	114,300	390.000	44,577,000
F P G	31,400	2,629.000	82,550,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,800	1,475.000	21,830,000
マーキュリアホールディングス	2,700	892.000	2,408,400
S B Iホールディングス	135,500	3,943.000	534,276,500
ジャフコ グループ	26,500	1,910.500	50,628,250
大和証券グループ本社	656,900	1,257.500	826,051,750
野村ホールディングス	1,428,100	940.100	1,342,556,810
岡三証券グループ	73,400	734.000	53,875,600
丸三証券	29,100	1,050.000	30,555,000
東洋証券	27,400	387.000	10,603,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	95,600	593.000	56,690,800
水戸証券	25,200	514.000	12,952,800
いちよし証券	14,800	820.000	12,136,000
松井証券	47,400	845.000	40,053,000
マネックスグループ	83,500	738.000	61,623,000
極東証券	13,200	1,588.000	20,961,600
岩井コスモホールディングス	9,400	2,222.000	20,886,800
アイザワ証券グループ	13,600	2,398.000	32,612,800
スパークス・グループ	9,200	1,650.000	15,180,000
かんぽ生命保険	86,300	3,133.000	270,377,900
F P パートナー	3,800	3,140.000	11,932,000
S O M P Oホールディングス	385,000	3,467.000	1,334,795,000
アニコム ホールディングス	28,500	657.000	18,724,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	571,900	3,582.000	2,048,545,800
第一生命ホールディングス	400,200	4,648.000	1,860,129,600
東京海上ホールディングス	831,700	6,022.000	5,008,497,400
T & Dホールディングス	228,600	2,849.000	651,281,400
アドバンスクリエイト	7,500	1,130.000	8,475,000
全国保証	22,200	6,229.000	138,283,800
ジェイリース	7,700	1,263.000	9,725,100
イントラスト	3,900	767.000	2,991,300

日本モーゲージサービス	10,100	431.000	4,353,100
S B Iアルヒ	11,000	946.000	10,406,000
プレミアグループ	15,300	2,010.000	30,753,000
クレディセゾン	53,500	3,506.000	187,571,000
芙蓉総合リース	7,500	12,340.000	92,550,000
みずほリース	68,400	1,140.000	77,976,000
東京センチュリー	63,000	1,614.000	101,682,000
日本証券金融	31,300	1,726.000	54,023,800
アイフル	130,200	392.000	51,038,400
リコーリース	7,600	5,480.000	41,648,000
イオンフィナンシャルサービス	48,000	1,384.000	66,432,000
アコム	162,500	433.800	70,492,500
ジャックス	8,900	4,905.000	43,654,500
オリエントコーポレーション	26,800	1,055.000	28,274,000
オリックス	510,200	3,664.000	1,869,372,800
三菱H C キャピタル	375,400	1,090.500	409,373,700
九州リースサービス	4,800	1,076.000	5,164,800
日本取引所グループ	219,800	3,549.000	780,070,200
イー・ギャランティ	15,100	1,471.000	22,212,100
アサックス	2,900	770.000	2,233,000
N E C キャピタルソリューション	3,900	4,295.000	16,750,500
R o b o t H o m e	32,000	173.000	5,536,000
大東建託	31,100	18,135.000	563,998,500
サムティホールディングス	10,100	2,757.000	27,845,700
いちご	100,700	427.000	42,998,900
日本駐車場開発	102,800	206.000	21,176,800
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	683.000	7,513,000
S R E ホールディングス	4,000	4,820.000	19,280,000
ヒューリック	195,900	1,471.500	288,266,850
野村不動産ホールディングス	47,300	4,241.000	200,599,300
三重交通グループホールディングス	19,100	553.000	10,562,300
ディア・ライフ	14,200	1,005.000	14,271,000
地主	6,800	2,200.000	14,960,000
プレサンスコーポレーション	14,600	2,047.000	29,886,200
J P M C	4,500	1,238.000	5,571,000
フージャースホールディングス	12,200	1,147.000	13,993,400
オープンハウスグループ	30,800	5,360.000	165,088,000
東急不動産ホールディングス	251,800	1,095.000	275,721,000
飯田グループホールディングス	80,100	2,260.000	181,026,000
ムゲンエステート	4,200	1,323.000	5,556,600
A n d D o ホールディングス	3,600	1,076.000	3,873,600
シーアールイー	5,300	1,600.000	8,480,000
ケイアイスター不動産	4,200	3,495.000	14,679,000
グッドコムアセット	8,900	885.000	7,876,500
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,963.000	13,037,200
ロードスターキャピタル	5,900	2,813.000	16,596,700
霞ヶ関キャピタル	3,900	12,920.000	50,388,000
パーク24	65,100	1,613.500	105,038,850

パラカ	3,200	2,085.000	6,672,000
宮越ホールディングス	4,600	2,713.000	12,479,800
三井不動産	1,181,600	1,573.500	1,859,247,600
三菱地所	536,200	2,574.500	1,380,446,900
平和不動産	13,900	4,350.000	60,465,000
東京建物	73,100	2,642.000	193,130,200
京阪神ビルディング	15,700	1,652.000	25,936,400
住友不動産	122,900	5,003.000	614,868,700
テーオーシー	18,100	714.000	12,923,400
レオパレス21	88,100	554.000	48,807,400
スターツコーポレーション	12,500	3,485.000	43,562,500
フジ住宅	10,800	812.000	8,769,600
空港施設	12,000	602.000	7,224,000
明和地所	6,200	969.000	6,007,800
ゴールドクレスト	8,200	2,890.000	23,698,000
エスリード	3,800	4,750.000	18,050,000
日神グループホールディングス	15,200	550.000	8,360,000
日本エスコン	16,700	1,044.000	17,434,800
MIRARTHホールディングス	43,900	543.000	23,837,700
イオンモール	43,400	2,064.500	89,599,300
毎日コムネット	6,300	764.000	4,813,200
カチタス	23,600	1,879.000	44,344,400
トーセイ	14,500	2,517.000	36,496,500
穴吹興産	2,700	2,121.000	5,726,700
サンフロンティア不動産	13,000	2,058.000	26,754,000
FJネクストホールディングス	8,800	1,328.000	11,686,400
日本空港ビルデング	29,900	5,501.000	164,479,900
LIFULL	36,500	162.000	5,913,000
MIXI	19,500	2,988.000	58,266,000
ジェイエイシーリクルートメント	32,000	727.000	23,264,000
日本M&Aセンターホールディングス	141,300	707.100	99,913,230
メンバーズ	4,400	927.000	4,078,800
UTグループ	11,900	3,265.000	38,853,500
アイティメディア	3,600	1,878.000	6,760,800
ケアネット	16,100	545.000	8,774,500
E・Jホールディングス	5,400	1,813.000	9,790,200
オープンアップグループ	26,800	2,176.000	58,316,800
コシダカホールディングス	27,700	1,012.000	28,032,400
アルトナー	2,000	1,874.000	3,748,000
パソナグループ	10,900	2,383.000	25,974,700
リンクアンドモチベーション	26,700	487.000	13,002,900
エス・エム・エス	31,900	2,170.500	69,238,950
パーソルホールディングス	895,300	258.500	231,435,050
リニカル	5,500	415.000	2,282,500
学情	4,700	1,901.000	8,934,700
スタジオアリス	4,800	2,139.000	10,267,200
NJS	2,000	3,920.000	7,840,000
総合警備保障	140,300	968.800	135,922,640

カカクコム	55,800	2,084.000	116,287,200
セントケア・ホールディング	7,500	897.000	6,727,500
ルネサンス	6,700	1,050.000	7,035,000
ディップ	13,900	3,075.000	42,742,500
デジタルホールディングス	6,000	1,067.000	6,402,000
新日本科学	8,700	1,260.000	10,962,000
エムスリー	172,800	1,405.500	242,870,400
ウェルネット	4,000	725.000	2,900,000
ワールドホールディングス	4,200	2,192.000	9,206,400
ディー・エヌ・エー	30,000	1,557.000	46,710,000
博報堂D Yホールディングス	111,400	1,232.000	137,244,800
ぐるなび	16,000	323.000	5,168,000
タカミヤ	13,200	476.000	6,283,200
ファンコミュニケーションズ	15,000	412.000	6,180,000
ライク	3,800	1,442.000	5,479,600
エスプール	30,200	318.000	9,603,600
WDBホールディングス	4,500	1,843.000	8,293,500
アドウェイズ	14,300	386.000	5,519,800
バリューコマース	8,700	1,176.000	10,231,200
インフォマート	94,600	321.000	30,366,600
J Pホールディングス	26,200	611.000	16,008,200
プレステージ・インターナショナル	43,300	714.000	30,916,200
アミューズ	5,300	1,614.000	8,554,200
ドリームインキュベータ	3,200	2,281.000	7,299,200
クイック	5,900	2,173.000	12,820,700
電通グループ	94,700	4,003.000	379,084,100
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,008.000	4,536,000
ぴあ	3,100	3,155.000	9,780,500
イオンファンタジー	3,600	2,546.000	9,165,600
シーティーエス	10,600	833.000	8,829,800
H . U . グループホールディングス	24,000	2,638.000	63,312,000
アルプス技研	8,200	2,689.000	22,049,800
日本空調サービス	10,200	1,029.000	10,495,800
オリエンタルランド	470,400	4,282.000	2,014,252,800
ダスキン	17,500	3,948.000	69,090,000
明光ネットワークジャパン	13,800	723.000	9,977,400
ファルコホールディングス	4,900	2,505.000	12,274,500
ラウンドワン	83,400	900.000	75,060,000
リゾートトラスト	39,000	2,533.000	98,787,000
ビー・エム・エル	11,500	3,005.000	34,557,500
リソー教育	50,300	244.000	12,273,200
早稲田アカデミー	5,500	1,636.000	8,998,000
ユー・エス・エス	197,200	1,356.000	267,403,200
東京個別指導学院	19,000	415.000	7,885,000
サイバーエージェント	193,300	966.400	186,805,120
楽天グループ	635,300	882.400	560,588,720
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,460.000	7,446,000
SBIグローバルアセットマネジメント	18,000	668.000	12,024,000

テー・オー・ダブリュー	23,800	358.000	8,520,400
山田コンサルティンググループ	4,300	2,202.000	9,468,600
セントラルスポーツ	3,700	2,541.000	9,401,700
フルキャストホールディングス	8,800	1,509.000	13,279,200
エン・ジャパン	15,200	2,819.000	42,848,800
テクノプロ・ホールディングス	52,000	2,883.000	149,916,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	1,051.000	5,675,400
Keeper 技研	5,700	3,630.000	20,691,000
Gunosy	9,200	846.000	7,783,200
イー・ガーディアン	4,300	1,997.000	8,587,100
ジャパンマテリアル	27,200	1,998.000	54,345,600
ベクトル	11,700	988.000	11,559,600
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,545.000	12,205,500
キャリアリンク	3,600	2,455.000	8,838,000
IBJ	8,600	632.000	5,435,200
アサンテ	5,200	1,824.000	9,484,800
バリューHR	8,000	1,545.000	12,360,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,700	2,140.000	16,478,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,033.000	6,404,600
ERIホールディングス	1,000	1,920.000	1,920,000
シグマクス・ホールディングス	12,300	1,484.000	18,253,200
ウィルグループ	7,000	1,042.000	7,294,000
メドピア	9,400	612.000	5,752,800
リクルートホールディングス	640,000	8,658.000	5,541,120,000
エラン	12,000	921.000	11,052,000
日本郵政	924,700	1,604.000	1,483,218,800
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,565.000	17,684,500
鎌倉新書	9,900	445.000	4,405,500
エアトリ	7,200	1,392.000	10,022,400
アトラエ	7,800	879.000	6,856,200
ストライク	4,000	4,060.000	16,240,000
ソラスト	25,400	509.000	12,928,600
セラク	2,500	1,388.000	3,470,000
インソース	20,100	877.000	17,627,700
ベイカレント・コンサルティング	65,100	4,545.000	295,879,500
Orchestra Holdings	2,500	1,202.000	3,005,000
アイモバイル	14,100	450.000	6,345,000
MS-Japan	4,000	1,068.000	4,272,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	28,800	2,779.000	80,035,200
グリーンズ	1,200	1,890.000	2,268,000
エル・ティー・エス	1,300	2,119.000	2,754,700
ミダックホールディングス	5,700	1,604.000	9,142,800
キュービーネットホールディングス	5,900	1,471.000	8,678,900
オープングループ	16,600	244.000	4,050,400
マネジメントソリューションズ	4,000	1,350.000	5,400,000
フロンティア・マネジメント	2,600	1,178.000	3,062,800
コプロ・ホールディングス	1,600	1,705.000	2,728,000

アンビスホールディングス	18,400	2,582.000	47,508,800
カーブスホールディングス	24,400	827.000	20,178,800
フォーラムエンジニアリング	13,000	997.000	12,961,000
FAST FITNESS JAPAN	3,800	1,270.000	4,826,000
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	231.000	3,187,800
ポピンズ	1,600	1,299.000	2,078,400
LITALICO	7,200	1,227.000	8,834,400
リログループ	42,900	1,789.000	76,748,100
東祥	6,000	732.000	4,392,000
ID&E ホールディングス	5,600	4,060.000	22,736,000
ビーウィズ	2,400	1,873.000	4,495,200
TREホールディングス	17,900	1,319.000	23,610,100
人・夢・技術グループ	3,600	1,904.000	6,854,400
NISSOホールディングス	9,000	832.000	7,488,000
大栄環境	16,400	2,887.000	47,346,800
日本管財ホールディングス	8,900	2,761.000	24,572,900
M&A総研ホールディングス	9,500	3,020.000	28,690,000
エイチ・アイ・エス	26,600	1,717.000	45,672,200
共立メンテナンス	28,600	2,922.500	83,583,500
イチネンホールディングス	9,100	1,739.000	15,824,900
建設技術研究所	4,600	5,050.000	23,230,000
スペース	7,100	1,162.000	8,250,200
燦ホールディングス	8,500	1,309.000	11,126,500
スバル興業	3,200	2,956.000	9,459,200
東京テアトル	7,000	1,131.000	7,917,000
ナガワ	2,900	7,710.000	22,359,000
東京都競馬	7,600	4,215.000	32,034,000
カナモト	14,400	2,821.000	40,622,400
ニシオホールディングス	8,300	4,100.000	34,030,000
トランス・コスモス	11,300	3,470.000	39,211,000
乃村工藝社	40,100	872.000	34,967,200
藤田観光	3,800	8,530.000	32,414,000
KNT-CTホールディングス	6,100	1,392.000	8,491,200
トーカイ	7,600	2,240.000	17,024,000
セコム	91,000	9,622.000	875,602,000
セントラル警備保障	5,000	2,754.000	13,770,000
丹青社	18,200	926.000	16,853,200
メイテックグループホールディングス	28,200	3,410.000	96,162,000
応用地質	8,700	2,504.000	21,784,800
船井総研ホールディングス	18,500	2,198.000	40,663,000
いであ	700	2,270.000	1,589,000
学究社	4,200	2,124.000	8,920,800
イオンディライト	9,700	3,915.000	37,975,500
ダイセキ	18,100	3,610.000	65,341,000
ステップ	3,200	2,057.000	6,582,400
合 計	141,024,000		340,364,255,920

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 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）」に記載しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年7月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,500,786,351
金銭信託	12,260,789
コール・ローン	2,599,140,216
株式	790,447,848,874
投資証券	16,187,208,107
派生商品評価勘定	2,654,686
未収配当金	483,224,899
差入委託証拠金	1,472,034,957
流動資産合計	813,705,158,879
資産合計	813,705,158,879
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101,810,555
未払解約金	1,382,094,495
流動負債合計	1,483,905,050
負債合計	1,483,905,050
純資産の部	
元本等	
元本	88,400,353,091
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	723,820,900,738
元本等合計	812,221,253,829
純資産合計	812,221,253,829
負債純資産合計	813,705,158,879

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。



		<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3.	その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	88,400,353,091口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 9.1880円 (1万口当たりの純資産額91,880円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p>

	<p>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(株式、新株予約権証券、投資証券)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT SEP24	4,795,091,664	-	4,713,387,635	81,704,029
	SPI 200 FUTURES SEP24	157,232,753	-	157,726,020	493,267
	FTSE 100 IDX FUT SEP24	241,608,950	-	243,324,786	1,715,836
	EURO STOXX 50 SEP24	837,995,714	-	827,444,402	10,551,312
	小計	6,031,929,081	-	5,941,882,843	90,046,238
	合計	6,031,929,081	-	5,941,882,843	90,046,238

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に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。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,304,618,080	-	1,297,413,838	7,204,242
	イギリス・ポンド	42,578,449	-	42,082,444	496,005
	ユーロ	112,204,041	-	110,794,656	1,409,385
	小計	1,459,400,570	-	1,450,290,938	9,109,632
合計	1,459,400,570	-	1,450,290,938	9,109,632	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 2024年7月31日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	78,629,202,191円
同期中における追加設定元本額	17,727,079,221円
同期中における一部解約元本額	7,955,928,321円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DC 外国株式インデックスファンド S	45,073,456,651円
三井住友・DC 年金バランス 30 (債券重点型)	239,501,134円
三井住友・DC 年金バランス 50 (標準型)	957,914,074円
三井住友・DC 年金バランス 70 (株式重点型)	756,636,342円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	49,170,081円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2020 (4資産タイプ)	633,438円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2025 (4資産タイプ)	2,550,694円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2030 (4資産タイプ)	10,892,543円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2035 (4資産タイプ)	34,368,867円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2040 (4資産タイプ)	42,216,331円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2045 (4資産タイプ)	95,460,175円
外国株式指数ファンド	1,192,512,279円
三井住友・DC つみたて N I S A ・ 全海外株インデックスファンド	23,811,217,407円
アセットアロケーション・ファンド (安定型)	24,701,254円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	68,010,186円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	41,457,674円
三井住友 D S ・ DC ターゲットイヤーファンド 2050	30,793,607円
三井住友・資産最適化ファンド (1安定重視型)	131,712,677円

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	131,048,655円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	529,153,007円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	332,555,548円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	489,697,171円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,920,073円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	3,000,397,348円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,547,892円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,205,197円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	59,384,626円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,972,890円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	2,001,107,184円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	151,969,909円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,546,922,337円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	161,083,629円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	7,275,361円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	4,416,566円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	5,178,298円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	2,733,585円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	1,442,227円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	132,742円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	4,208,693円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	21,394,790円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	22,854,403円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	8,392,412円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	243,336,429円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	1,847,382円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	9,177,883円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	245,794,741円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	452,629,384円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,047,321,017円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	6,385,797円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	31,449,420円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	343,570,870円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	23,753,768円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	54,210,390円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	286,136,389円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	186,617,063円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	404,330,166円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	162,281,503円
S M A M・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	35,732,170円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	4,136,470円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	4,129,448円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	3,245,145円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	9,235,593円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	31,411,809円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型)V A < 適格機関投資家限定 >	68,460,077円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A < 適格機関投資家限定 >	30,244,431円
S M A M・世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	106,428,793円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	39,195,813円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	248,792,790円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	30,660,080円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	14,536,347円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	23,235,506円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	20,855,233円
S M D A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) < 適格機関投資家限定 >	52,011,227円
合 計	88,400,353,091円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	27,608	31.030	856,676.24	
	BAKER HUGHES CO	87,866	38.240	3,359,995.84	
	CHENIERE ENERGY INC	19,829	181.880	3,606,498.52	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	76.240	586,666.80	
	CHEVRON CORP	149,775	159.570	23,899,596.75	
	CHORD ENERGY CORP	5,159	169.350	873,676.65	
	CONOCOPHILLIPS	97,908	109.910	10,761,068.28	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	25.700	1,535,343.70	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	46.170	2,303,744.49	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	14,567	198.080	2,885,431.36	
	EOG RESOURCES INC	50,441	126.150	6,363,132.15	
	EQT CORP	47,708	34.810	1,660,715.48	
	EXXON MOBIL CORP	381,611	118.170	45,094,971.87	
	HALLIBURTON CO	76,654	34.300	2,629,232.20	
	HESS CORP	23,450	151.690	3,557,130.50	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	51.510	549,251.13	
	KINDER MORGAN INC	173,893	21.720	3,776,955.96	
	MARATHON OIL CORP	53,220	27.640	1,471,000.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,431	178.290	5,425,542.99	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,692	60.270	3,477,096.84	
	ONEOK INC	47,832	82.790	3,960,011.28	
	OVINTIV INC	23,075	45.980	1,060,988.50	
	PHILLIPS 66	36,059	147.170	5,306,803.03	
	SCHLUMBERGER LTD	121,500	47.610	5,784,615.00	
	TARGA RESOURCES CORP	18,523	134.140	2,484,675.22	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,661	826.330	1,372,534.13	
VALERO ENERGY CORP	27,819	163.480	4,547,850.12		
WILLIAMS COS INC	104,963	42.950	4,508,160.85		

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,293	264.230	5,097,789.39	
ALBEMARLE CORP	8,338	92.510	771,348.38	
AMCOR PLC	122,899	10.480	1,287,981.52	
AVERY DENNISON CORP	6,759	215.780	1,458,457.02	
BALL CORP	28,423	63.250	1,797,754.75	
CELANESE CORP	8,742	139.450	1,219,071.90	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	76.430	1,071,548.60	
CLEVELAND-CLIFFS INC	47,180	14.970	706,284.60	
CORTEVA INC	60,038	55.530	3,333,910.14	
CRH PLC	58,997	84.060	4,959,287.82	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	87.360	822,319.68	
DOW INC	59,685	53.690	3,204,487.65	
DUPONT DE NEMOURS INC	36,397	80.410	2,926,682.77	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	103.270	982,820.59	
ECOLAB INC	22,474	228.860	5,143,399.64	
FREEMONT-MCMORAN INC	121,991	43.850	5,349,305.35	
INTERNATIONAL PAPER CO	31,632	45.920	1,452,541.44	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20,983	99.640	2,090,746.12	
LINDE PLC	40,847	450.850	18,415,869.95	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,165	98.260	2,177,932.90	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,394	585.020	3,155,597.88	
MOSAIC CO/THE	25,489	29.570	753,709.73	
NEWMONT CORP	94,978	47.410	4,502,906.98	
NUCOR CORP	20,787	159.430	3,314,071.41	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	197.740	1,406,129.14	
PPG INDUSTRIES INC	18,754	127.210	2,385,696.34	
RELIANCE INC	5,040	302.000	1,522,080.00	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	119.610	1,243,585.17	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,286	351.840	7,137,426.24	
SMURFIT WESTROCK PLC	47,029	46.740	2,198,135.46	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	128.850	1,638,070.05	
VULCAN MATERIALS CO	11,015	270.000	2,974,050.00	
WESTLAKE CORP	2,189	145.620	318,762.18	
3M CO	46,568	126.750	5,902,494.00	
AECOM	10,261	90.230	925,850.03	
AERCAP HOLDINGS NV	17,564	93.000	1,633,452.00	
ALLEGION PLC	6,843	139.340	953,503.62	
AMETEK INC	20,578	172.350	3,546,618.30	
AXON ENTERPRISE INC	5,927	304.720	1,806,075.44	
BOEING CO/THE	49,992	186.860	9,341,505.12	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	167.630	1,642,941.63	
CARLISLE COS INC	4,354	417.160	1,816,314.64	
CARRIER GLOBAL CORP	66,639	67.430	4,493,467.77	
CATERPILLAR INC	41,903	341.720	14,319,093.16	

CNH INDUSTRIAL NV	87,561	10.170	890,495.37	
CUMMINS INC	11,429	289.040	3,303,438.16	
DEERE & CO	22,561	371.770	8,387,502.97	
DOVER CORP	12,242	184.510	2,258,771.42	
EATON CORP PLC	34,397	287.240	9,880,194.28	
EMCOR GROUP INC	4,293	358.470	1,538,911.71	
EMERSON ELECTRIC CO	48,843	115.700	5,651,135.10	
FASTENAL CO	47,002	70.890	3,331,971.78	
FERGUSON PLC	18,036	218.740	3,945,194.64	
FORTIVE CORP	29,388	71.200	2,092,425.60	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	81.400	866,747.20	
GE VERNOVA INC	24,156	162.700	3,930,181.20	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,313	293.010	5,951,912.13	
GENERAL ELECTRIC CO	91,715	167.480	15,360,428.20	
GRACO INC	15,068	84.810	1,277,917.08	
HEICO CORP	3,085	238.660	736,266.10	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	187.730	1,237,703.89	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	54,475	202.640	11,038,814.00	
HOWMET AEROSPACE INC	33,070	93.810	3,102,296.70	
HUBBELL INC	4,737	379.800	1,799,112.60	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	279.760	807,946.88	
IDEX CORP	6,048	208.070	1,258,407.36	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,584	249.340	6,129,774.56	
INGERSOLL-RAND INC	33,421	98.870	3,304,334.27	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	35.500	411,800.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	57,700	69.030	3,983,031.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,814	227.740	3,601,480.36	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	574.030	1,578,582.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,693	537.660	10,050,478.38	
MASCO CORP	19,187	78.320	1,502,725.84	
NORDSON CORP	3,927	248.610	976,291.47	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,636	486.730	5,663,590.28	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,270	93.820	3,309,031.40	
OWENS CORNING	7,597	182.030	1,382,881.91	
PACCAR INC	43,068	97.050	4,179,749.40	
PARKER HANNIFIN CORP	11,200	551.210	6,173,552.00	
PENTAIR PLC	15,664	88.160	1,380,938.24	
QUANTA SERVICES INC	11,797	251.600	2,968,125.20	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,863	275.430	2,716,566.09	
RTX CORP	111,868	116.880	13,075,131.84	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	85.450	910,213.40	
SNAP-ON INC	4,041	285.240	1,152,654.84	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,024	106.050	1,593,295.20	
TEXTRON INC	14,870	92.060	1,368,932.20	



TORO CO	8,097	95.900	776,502.30	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,729	328.830	6,487,487.07	
TRANSDIGM GROUP INC	4,733	1,264.160	5,983,269.28	
UNITED RENTALS INC	5,948	737.080	4,384,151.84	
VERTIV HOLDINGS CO-A	32,504	73.030	2,373,767.12	
WABTEC CORP	15,150	159.380	2,414,607.00	
WATSCO INC	3,112	481.140	1,497,307.68	
WW GRAINGER INC	3,927	966.360	3,794,895.72	
XYLEM INC	19,463	133.480	2,597,921.24	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,745	257.740	8,955,176.30	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	138.820	1,476,628.34	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,783	215.390	2,322,550.37	
CINTAS CORP	7,515	766.170	5,757,767.55	
COPART INC	72,947	51.720	3,772,818.84	
DAYFORCE INC	10,485	53.680	562,834.80	
EQUIFAX INC	10,373	278.270	2,886,494.71	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	146.190	1,519,352.67	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,403	145.980	1,664,609.94	
PAYCHEX INC	27,578	127.920	3,527,777.76	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	165.470	625,145.66	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	148.650	404,030.70	
REPUBLIC SERVICES INC	17,805	192.360	3,424,969.80	
ROLLINS INC	25,137	47.970	1,205,821.89	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	73.460	1,418,806.44	
TRANSUNION	14,503	89.890	1,303,674.67	
VERALTO CORP	22,013	107.060	2,356,711.78	
VERISK ANALYTICS INC	12,690	285.990	3,629,213.10	
WASTE CONNECTIONS INC	22,344	176.360	3,940,587.84	
WASTE MANAGEMENT INC	33,524	201.100	6,741,676.40	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	89.340	779,580.84	
CSX CORP	165,227	35.020	5,786,249.54	
DELTA AIR LINES INC	14,192	43.230	613,520.16	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,237	124.960	1,654,095.52	
FEDEX CORP	19,408	300.880	5,839,479.04	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	216,253	3.300	713,634.90	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	172.160	1,085,985.28	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	54.330	656,795.37	
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,442	249.710	4,605,151.82	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	17,492	205.030	3,586,384.76	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	27.040	380,101.28	
UBER TECHNOLOGIES INC	157,907	63.090	9,962,352.63	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	63.050	368,842.50	
UNION PACIFIC CORP	52,401	245.430	12,860,777.43	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	61,570	129.030	7,944,377.10	

APTIV PLC	23,575	67.630	1,594,377.25	
FORD MOTOR CO	325,996	10.840	3,533,796.64	
GENERAL MOTORS CO	99,425	44.230	4,397,567.75	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	72,072	16.220	1,169,007.84	
TESLA INC	243,551	222.620	54,219,323.62	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,220	911.230	2,022,930.60	
DR HORTON INC	24,030	180.440	4,335,973.20	
GARMIN LTD	13,282	179.340	2,381,993.88	
LENNAR CORP-A	21,335	180.450	3,849,900.75	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,287	256.000	2,633,472.00	
NIKE INC -CL B	102,257	74.320	7,599,740.24	
NVR INC	250	8,661.980	2,165,495.00	
PULTEGROUP INC	17,535	133.180	2,335,311.30	
AIRBNB INC-CLASS A	38,522	138.990	5,354,172.78	
BOOKING HOLDINGS INC	2,937	3,720.990	10,928,547.63	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,881	36.900	586,008.90	
CARNIVAL CORP	84,815	17.120	1,452,032.80	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	117,100	52.570	6,155,947.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	148.140	1,381,109.22	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	429.150	1,233,806.25	
DOORDASH INC - A	24,823	107.210	2,661,273.83	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	35.870	1,157,345.55	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	128.530	1,295,710.93	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,638	218.760	4,733,528.88	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	151.400	510,369.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	39.470	1,104,252.19	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	20,953	238.770	5,002,947.81	
MCDONALD'S CORP	61,103	266.440	16,280,283.32	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	42.780	949,630.44	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,669	156.940	3,400,732.86	
STARBUCKS CORP	98,120	75.940	7,451,232.80	
WYNN RESORTS LTD	7,730	82.510	637,802.30	
YUM! BRANDS INC	22,535	132.170	2,978,450.95	
AMAZON.COM INC	794,249	181.710	144,322,985.79	
AUTOZONE INC	1,423	3,108.400	4,423,253.20	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	36.610	563,794.00	
BEST BUY CO INC	14,954	85.350	1,276,323.90	
BURLINGTON STORES INC	4,802	257.460	1,236,322.92	
CARMAX INC	14,212	84.320	1,198,355.84	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	209.770	924,246.62	
EBAY INC	40,534	55.400	2,245,583.60	
ETSY INC	9,090	64.520	586,486.80	
GENUINE PARTS CO	12,304	147.090	1,809,795.36	
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,348	33.910	249,170.68	

HOME DEPOT INC	83,986	363.690	30,544,868.34	
LKQ CORP	24,732	40.850	1,010,302.20	
LOWE'S COS INC	49,236	241.400	11,885,570.40	
MERCADOLIBRE INC	3,878	1,626.150	6,306,209.70	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,881	1,140.900	5,568,732.90	
POOL CORP	3,252	372.500	1,211,370.00	
ROSS STORES INC	29,519	142.750	4,213,837.25	
TJX COMPANIES INC	95,580	113.240	10,823,479.20	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,377	261.740	2,454,335.98	
ULTA BEAUTY INC	3,734	367.530	1,372,357.02	
WILLIAMS-SONOMA INC	10,952	149.220	1,634,257.44	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	19.700	628,567.90	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,769	810.030	30,594,023.07	
DOLLAR GENERAL CORP	18,277	120.000	2,193,240.00	
DOLLAR TREE INC	15,923	105.330	1,677,169.59	
KROGER CO	56,767	54.700	3,105,154.90	
SYSCO CORP	39,957	76.440	3,054,313.08	
TARGET CORP	38,491	147.950	5,694,743.45	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	12.160	642,145.28	
WALMART INC	377,914	69.190	26,147,869.66	
ALTRIA GROUP INC	143,314	50.550	7,244,522.70	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	62.500	2,643,062.50	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,548	44.460	824,644.08	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	114.560	1,414,014.08	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	47.630	616,570.35	
CELSIUS HOLDINGS INC	11,375	46.310	526,776.25	
COCA-COLA CO/THE	349,662	67.680	23,665,124.16	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	18,105	73.230	1,325,829.15	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	30.380	1,206,754.36	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,962	243.300	3,396,954.60	
GENERAL MILLS INC	46,029	68.050	3,132,273.45	
HERSHEY CO/THE	12,733	193.970	2,469,820.01	
HORMEL FOODS CORP	25,536	32.020	817,662.72	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	118.960	972,141.12	
KELLANOVA	25,249	57.550	1,453,079.95	
KEURIG DR PEPPER INC	93,410	34.120	3,187,149.20	
KRAFT HEINZ CO/THE	71,746	33.840	2,427,884.64	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	59.520	626,983.68	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	23,664	76.870	1,819,051.68	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	53.260	875,221.58	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	116,555	67.050	7,815,012.75	
MONSTER BEVERAGE CORP	66,279	51.570	3,418,008.03	
PEPSICO INC	117,477	173.180	20,344,666.86	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,443	114.700	14,961,812.10	

TYSON FOODS INC-CL A	25,497	60.910	1,553,022.27	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,954	99.430	1,984,026.22	
CLOROX COMPANY	9,104	131.730	1,199,269.92	
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,929	100.490	6,826,185.21	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,241	99.440	1,913,325.04	
KENVUE INC	158,991	18.750	2,981,081.25	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,172	136.380	3,842,097.36	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	200,057	161.700	32,349,216.90	
ABBOTT LABORATORIES	148,364	105.320	15,625,696.48	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	231.160	1,318,305.48	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	35.910	1,409,144.31	
BECTON DICKINSON AND CO	24,215	241.740	5,853,734.10	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,087	74.030	9,186,160.61	
CARDINAL HEALTH INC	20,986	100.260	2,104,056.36	
CENCORA INC	15,601	231.030	3,604,299.03	
CENTENE CORP	44,436	77.100	3,426,015.60	
COOPER COS INC/THE	17,340	92.690	1,607,244.60	
CVS HEALTH CORP	104,686	63.180	6,614,061.48	
DAVITA INC	4,138	136.470	564,712.86	
DEXCOM INC	33,202	69.700	2,314,179.40	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,676	63.640	3,288,660.64	
ELEVANCE HEALTH INC	19,423	536.260	10,415,777.98	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	35,095	82.650	2,900,601.75	
HCA HEALTHCARE INC	17,322	361.350	6,259,304.70	
HENRY SCHEIN INC	10,457	72.440	757,505.08	
HOLOGIC INC	19,730	82.510	1,627,922.30	
HUMANA INC	10,475	404.520	4,237,347.00	
IDEXX LABORATORIES INC	7,376	474.690	3,501,313.44	
INSULET CORP	5,082	193.790	984,840.78	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,402	432.690	13,154,641.38	
LABCORP HOLDINGS INC	6,245	213.060	1,330,559.70	
MCKESSON CORP	10,903	609.720	6,647,777.16	
MEDTRONIC PLC	112,127	80.810	9,060,982.87	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	350.730	1,638,961.29	
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,647	142.890	1,378,459.83	
RESMED INC	12,536	208.040	2,607,989.44	
SOLVENTUM CORP	10,620	58.950	626,049.00	
STERIS PLC	7,525	237.240	1,785,231.00	
STRYKER CORP	29,004	330.220	9,577,700.88	
TELEFLEX INC	3,067	222.710	683,051.57	
THE CIGNA GROUP	23,734	352.770	8,372,643.18	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,138	576.330	45,033,273.54	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	215.100	904,065.30	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,279	193.630	2,377,582.77	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,219	111.370	2,029,050.03	
ABBVIE INC	151,029	186.780	28,209,196.62	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,379	139.490	3,540,116.71	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,014	233.810	2,575,183.34	
AMGEN INC	45,937	333.280	15,309,883.36	
AVANTOR INC	56,039	27.650	1,549,478.35	
BIOGEN INC	12,779	211.890	2,707,742.31	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	84.390	1,167,282.48	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	340.230	587,917.44	
BIO-TECHNE CORP	13,296	81.970	1,089,873.12	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	175,807	49.050	8,623,333.35	
CATALENT INC	16,025	59.040	946,116.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,795	245.290	1,176,165.55	
DANAHER CORP	59,621	275.190	16,407,102.99	
ELI LILLY & CO	68,665	790.210	54,259,769.65	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	46.580	632,090.60	
GILEAD SCIENCES INC	108,072	78.050	8,435,019.60	
ILLUMINA INC	14,966	122.500	1,833,335.00	
INCYTE CORP	15,899	67.790	1,077,793.21	
IQVIA HOLDINGS INC	16,199	245.570	3,977,988.43	
JOHNSON & JOHNSON	204,222	161.330	32,947,135.26	
MERCK & CO. INC.	215,920	115.250	24,884,780.00	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,813	1,509.560	2,736,832.28	
MODERNA INC	27,369	118.840	3,252,531.96	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,744	141.180	1,234,477.92	
PFIZER INC	484,339	31.390	15,203,401.21	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,121	1,077.800	9,830,613.80	
REPLIGEN CORP	3,456	160.590	554,999.04	
REVVITY INC	10,411	127.160	1,323,862.76	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	28.540	775,203.48	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	102,259	16.410	1,678,070.19	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,651	615.060	20,082,324.06	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	337.540	1,193,878.98	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,794	502.600	10,953,664.40	
VIATRIS INC	83,466	12.130	1,012,442.58	
WATERS CORP	5,084	327.660	1,665,823.44	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,204	299.510	1,858,160.04	
ZOETIS INC	38,410	181.830	6,984,090.30	
BANK OF AMERICA CORP	605,819	41.280	25,008,208.32	
CITIGROUP INC	164,813	65.870	10,856,232.31	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	43.200	1,560,470.40	
FIFTH THIRD BANCORP	58,586	42.260	2,475,844.36	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	2,128.510	1,798,590.95	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	128,600	15.150	1,948,290.00	

JPMORGAN CHASE & CO	244,189	215.190	52,547,030.91	
KEYCORP	84,828	16.250	1,378,455.00	
M & T BANK CORP	15,212	173.610	2,640,955.32	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,800	181.980	5,968,944.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	22.730	1,797,692.97	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,627	44.940	4,971,577.38	
US BANCORP	129,406	45.470	5,884,090.82	
WELLS FARGO & CO	302,780	60.010	18,169,827.80	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	44.530	896,789.67	
AMERICAN EXPRESS CO	49,507	252.480	12,499,527.36	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,870	431.870	3,830,686.90	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,367	122.640	4,214,768.88	
ARES MANAGEMENT CORP - A	13,891	149.580	2,077,815.78	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	65.240	3,986,164.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	111,499	441.260	49,200,048.74	
BLACKROCK INC	12,569	872.590	10,967,583.71	
BLACKSTONE INC	60,652	141.340	8,572,553.68	
BLOCK INC	49,568	60.090	2,978,541.12	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32,018	152.250	4,874,740.50	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	48.520	811,739.60	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,059	187.050	1,694,485.95	
CME GROUP INC	30,011	197.200	5,918,169.20	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	16,066	224.460	3,606,174.36	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,925	29.750	592,768.75	
CORPAY INC	6,278	297.640	1,868,583.92	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,512	144.720	3,113,216.64	
EQUITABLE HOLDINGS INC	31,450	43.190	1,358,325.50	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	416.820	1,227,951.72	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	76.740	3,653,130.96	
FISERV INC	49,889	163.110	8,137,394.79	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	22.810	496,756.18	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,533	60.190	393,221.27	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	101.820	2,096,881.08	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,281	505.670	13,795,183.27	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	49,673	151.300	7,515,524.90	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	172.410	857,050.11	
KKR & CO INC	51,445	119.990	6,172,885.55	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	221.580	1,365,819.12	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	224.020	594,325.06	
MASTERCARD INC - A	70,969	447.450	31,755,079.05	
MOODY'S CORP	14,298	458.060	6,549,341.88	
MORGAN STANLEY	105,546	103.760	10,951,452.96	
MSCI INC	7,043	546.260	3,847,309.18	
NASDAQ INC	36,003	69.150	2,489,607.45	

NORTHERN TRUST CORP	16,793	88.950	1,493,737.35	
PAYPAL HOLDINGS INC	85,759	64.000	5,488,576.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,112	115.510	1,976,607.12	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	50,779	20.400	1,035,891.60	
S&P GLOBAL INC	26,757	488.510	13,071,062.07	
SCHWAB (CHARLES) CORP	125,183	64.910	8,125,628.53	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	67.670	510,908.50	
STATE STREET CORP	25,474	85.700	2,183,121.80	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	50.990	1,637,390.88	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,303	112.700	1,950,048.10	
TOAST INC-CLASS A	35,993	25.960	934,378.28	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	110.120	956,722.56	
VISA INC-CLASS A SHARES	134,642	263.100	35,424,310.20	
AFLAC INC	44,628	95.360	4,255,726.08	
ALLSTATE CORP	22,831	173.590	3,963,233.29	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	130.930	637,105.38	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	79.010	4,366,408.64	
AON PLC-CLASS A	16,323	328.740	5,366,023.02	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	32,647	98.200	3,205,935.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,202	285.000	5,187,570.00	
ASSURANT INC	4,977	175.840	875,155.68	
BROWN & BROWN INC	18,424	99.840	1,839,452.16	
CHUBB LTD	34,294	276.660	9,487,778.04	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	130.180	1,725,015.18	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	442.630	993,261.72	
EVEREST GROUP LTD	3,547	389.440	1,381,343.68	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	55.040	1,048,952.32	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,592	111.780	2,860,673.76	
LOEWS CORP	16,971	80.480	1,365,826.08	
MARKEL GROUP INC	1,175	1,645.690	1,933,685.75	
MARSH & MCLENNAN COS	41,510	222.420	9,232,654.20	
METLIFE INC	52,395	76.750	4,021,316.25	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	81.830	1,592,248.14	
PROGRESSIVE CORP	50,406	215.680	10,871,566.08	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28,865	125.960	3,635,835.40	
TRAVELERS COS INC/THE	20,199	220.420	4,452,263.58	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,308	284.420	2,647,381.36	
WR BERKLEY CORP	27,229	55.460	1,510,120.34	
ACCENTURE PLC-CL A	52,728	329.200	17,358,057.60	
ADOBE INC	38,248	538.710	20,604,580.08	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,226	97.880	1,294,560.88	
ANSYS INC	7,892	304.450	2,402,719.40	
APPLOVIN CORP-CLASS A	15,026	74.830	1,124,395.58	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	189.910	361,018.91	

ATLASSIAN CORP-CL A	12,421	174.380	2,165,973.98	
AUTODESK INC	17,384	243.340	4,230,222.56	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	15,779	47.860	755,182.94	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,681	253.110	5,740,787.91	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	182.430	1,379,353.23	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	27,192	76.030	2,067,407.76	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,604	75.820	3,154,415.28	
CONFLUENT INC-CLASS A	15,954	24.290	387,522.66	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19,060	233.650	4,453,369.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,025	256.400	1,032,010.00	
DATADOG INC - CLASS A	22,908	114.680	2,627,089.44	
DOCUSIGN INC	17,164	55.430	951,400.52	
DYNATRACE INC	21,256	44.810	952,481.36	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	213.710	1,029,013.65	
FAIR ISAAC CORP	2,176	1,588.500	3,456,576.00	
FORTINET INC	52,961	57.500	3,045,257.50	
GARTNER INC	6,957	498.770	3,469,942.89	
GEN DIGITAL INC	41,779	25.770	1,076,644.83	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	143.800	1,710,501.00	
HUBSPOT INC	3,878	488.020	1,892,541.56	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	77,037	191.040	14,717,148.48	
INTUIT INC	23,504	635.800	14,943,843.20	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	255.000	1,185,240.00	
MICROSOFT CORP	598,569	422.920	253,146,801.48	
MICROSTRATEGY INC-CL A	1,402	1,604.070	2,248,906.14	
MONDAY.COM LTD	3,167	227.740	721,252.58	
MONGODB INC	5,921	245.350	1,452,717.35	
OKTA INC	13,914	92.820	1,291,497.48	
ORACLE CORP	140,872	135.670	19,112,104.24	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	165,132	26.370	4,354,530.84	
PALO ALTO NETWORKS INC	27,325	317.510	8,675,960.75	
PTC INC	9,246	176.470	1,631,641.62	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,360	544.810	5,099,421.60	
SALESFORCE INC	82,833	257.930	21,365,115.69	
SAMSARA INC-CL A	13,749	36.940	507,888.06	
SERVICENOW INC	17,584	798.800	14,046,099.20	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	24,978	128.880	3,219,164.64	
SYNOPSYS INC	12,929	525.890	6,799,231.81	
TWILIO INC - A	15,028	59.010	886,802.28	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,899	574.550	2,240,170.45	
UIPATH INC - CLASS A	44,652	12.060	538,503.12	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	16.170	308,297.22	
VERISIGN INC	7,316	186.960	1,367,799.36	
WIX.COM LTD	5,348	155.080	829,367.84	



WORKDAY INC-CLASS A	18,596	226.480	4,211,622.08	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	18,307	61.050	1,117,642.35	
ZSCALER INC	7,508	176.750	1,327,039.00	
AMPHENOL CORP-CL A	102,192	61.940	6,329,772.48	
APPLE INC	1,243,931	218.800	272,172,102.80	
ARISTA NETWORKS INC	22,956	311.420	7,148,957.52	
CDW CORP/DE	10,704	232.470	2,488,358.88	
CISCO SYSTEMS INC	339,548	48.140	16,345,840.72	
CORNING INC	64,764	39.740	2,573,721.36	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,828	108.610	2,370,739.08	
F5 INC	3,921	200.660	786,787.86	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	19.010	1,951,319.47	
HP INC	85,880	35.520	3,050,457.60	
JABIL INC	9,808	109.350	1,072,504.80	
JUNIPER NETWORKS INC	30,061	37.960	1,141,115.56	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,964	135.950	2,170,305.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,944	395.330	5,512,481.52	
NETAPP INC	17,045	122.570	2,089,205.65	
PURE STORAGE INC - CLASS A	28,039	56.500	1,584,203.50	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,879	99.100	1,573,608.90	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,557	666.310	3,036,374.67	
TE CONNECTIVITY LTD	25,716	152.950	3,933,262.20	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,328	423.980	1,834,985.44	
TRIMBLE INC	20,783	54.200	1,126,438.60	
WESTERN DIGITAL CORP	29,044	63.180	1,834,999.92	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	348.120	1,458,274.68	
ADVANCED MICRO DEVICES	137,868	138.440	19,086,445.92	
ANALOG DEVICES INC	41,224	224.580	9,258,085.92	
APPLIED MATERIALS INC	69,692	196.740	13,711,204.08	
BROADCOM INC	374,030	143.520	53,680,785.60	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	109.370	1,135,369.97	
ENTEGRIS INC	12,569	122.440	1,538,948.36	
FIRST SOLAR INC	8,882	210.890	1,873,124.98	
INTEL CORP	358,536	30.130	10,802,689.68	
KLA CORP	11,647	758.890	8,838,791.83	
LAM RESEARCH CORP	11,046	854.860	9,442,783.56	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	11,073	49.770	551,103.21	
MARVELL TECHNOLOGY INC	75,550	62.800	4,744,540.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,600	86.540	3,859,684.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	95,084	102.560	9,751,815.04	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,028	781.850	3,149,291.80	
NVIDIA CORP	2,119,936	103.730	219,900,961.28	
NXP SEMICONDUCTORS NV	22,287	251.680	5,609,192.16	
ON SEMICONDUCTOR	35,773	73.970	2,646,128.81	

QORVO INC	7,835	119.460	935,969.10	
QUALCOMM INC	95,349	166.940	15,917,562.06	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	117.690	1,589,521.14	
TERADYNE INC	12,464	121.340	1,512,381.76	
TEXAS INSTRUMENTS INC	77,927	200.990	15,662,547.73	
AT&T INC	602,847	18.980	11,442,036.06	
T-MOBILE US INC	45,251	175.360	7,935,215.36	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	353,013	40.040	14,134,640.52	
AES CORP	54,086	17.550	949,209.30	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	56.130	1,190,180.52	
AMEREN CORPORATION	24,874	79.520	1,977,980.48	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,705	98.140	4,289,208.70	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	143.670	2,182,490.97	
ATMOS ENERGY CORP	13,505	128.220	1,731,611.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,717	28.510	1,559,981.67	
CMS ENERGY CORP	23,541	65.110	1,532,754.51	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,772	98.160	2,824,259.52	
CONSTELLATION ENERGY	26,817	168.690	4,523,759.73	
DOMINION ENERGY INC	72,436	53.210	3,854,319.56	
DTE ENERGY COMPANY	16,277	120.630	1,963,494.51	
DUKE ENERGY CORP	65,574	109.900	7,206,582.60	
EDISON INTERNATIONAL	32,299	79.380	2,563,894.62	
ENTERGY CORP	17,246	116.340	2,006,399.64	
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,795	40.690	1,049,598.55	
EVERGY INC	17,275	57.710	996,940.25	
EVERSOURCE ENERGY	30,845	65.960	2,034,536.20	
EXELON CORP	84,941	37.220	3,161,504.02	
FIRSTENERGY CORP	45,110	41.800	1,885,598.00	
NEXTERA ENERGY INC	172,417	74.280	12,807,134.76	
NISOURCE INC	34,855	31.420	1,095,144.10	
NRG ENERGY INC	18,864	73.330	1,383,297.12	
P G & E CORP	181,193	18.330	3,321,267.69	
PPL CORP	68,423	29.970	2,050,637.31	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	44,422	78.000	3,464,916.00	
SEMPRA	53,312	80.220	4,276,688.64	
SOUTHERN CO/THE	94,341	83.380	7,866,152.58	
VISTRA CORP	29,322	69.000	2,023,218.00	
WEC ENERGY GROUP INC	25,816	85.600	2,209,849.60	
XCEL ENERGY INC	45,776	58.630	2,683,846.88	
ALPHABET INC-CL A	500,270	170.290	85,190,978.30	
ALPHABET INC-CL C	433,389	171.860	74,482,233.54	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	383.070	2,911,715.07	
COMCAST CORP-CLASS A	333,137	40.810	13,595,320.97	
ELECTRONIC ARTS INC	20,831	149.120	3,106,318.72	

	FOX CORP - CLASS A	23,886	38.420	917,700.12	
	FOX CORP - CLASS B	8,773	35.800	314,073.40	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	32,096	31.970	1,026,109.12	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	16,121	81.360	1,311,604.56	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,554	94.620	1,282,479.48	
	MATCH GROUP INC	28,069	33.690	945,644.61	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	185,998	463.190	86,152,413.62	
	NETFLIX INC	36,929	622.580	22,991,256.82	
	NEWS CORP - CLASS A	34,405	27.420	943,385.10	
	OMNICOM GROUP	15,106	97.920	1,479,179.52	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	11.240	460,435.36	
	PINTEREST INC- CLASS A	48,115	37.350	1,797,095.25	
	ROBLOX CORP -CLASS A	37,893	41.030	1,554,749.79	
	ROKU INC	9,945	57.440	571,240.80	
	SEA LTD-ADR	31,070	65.040	2,020,792.80	
	SNAP INC - A	86,463	13.090	1,131,800.67	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14,811	150.000	2,221,650.00	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,722	89.840	3,299,104.48	
	WALT DISNEY CO/THE	157,113	93.790	14,735,628.27	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	201,390	8.780	1,768,204.20	
	CBRE GROUP INC - A	27,148	112.000	3,040,576.00	
	COSTAR GROUP INC	33,292	78.480	2,612,756.16	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.280	259,448.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	10,672	49.250	525,596.00	
	アメリカ・ドル小計	31,201,787		3,950,512,179.82 (602,216,076,692)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	22.960	1,031,432.08	
	CAMECO CORP	33,586	61.350	2,060,501.10	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	185,040	47.370	8,765,344.80	
	CENOVUS ENERGY INC	120,048	27.090	3,252,100.32	
	ENBRIDGE INC	180,768	51.540	9,316,782.72	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	96.530	1,570,253.51	
	KEYERA CORP	19,802	38.920	770,693.84	
	MEG ENERGY CORP	21,651	27.570	596,918.07	
	PARKLAND CORP	16,066	38.480	618,219.68	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,973	53.200	2,445,763.60	
	SUNCOR ENERGY INC	108,809	53.220	5,790,814.98	
	TC ENERGY CORP	90,192	58.060	5,236,547.52	
	TOURMALINE OIL CORP	26,107	59.180	1,545,012.26	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	41,898	104.120	4,362,419.76	
	BARRICK GOLD CORP	139,992	25.130	3,517,998.96	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	74.190	984,352.92	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	68,446	16.000	1,095,136.00	
FRANCO-NEVADA CORP	17,604	176.120	3,100,416.48		

IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	17.560	990,945.92	
KINROSS GOLD CORP	110,156	12.100	1,332,887.60	
LUNDIN MINING CORP	46,446	13.870	644,206.02	
NUTRIEN LTD	42,180	70.300	2,965,254.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	30.660	771,313.62	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	40,547	65.650	2,661,910.55	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	121.390	538,728.82	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,353	81.560	3,291,190.68	
CAE INC	27,474	24.810	681,629.94	
STANTEC INC	9,939	118.200	1,174,789.80	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	125.780	758,076.06	
WSP GLOBAL INC	11,089	226.510	2,511,769.39	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	26.470	864,880.78	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	53.060	829,327.80	
RB GLOBAL INC	15,569	109.960	1,711,967.24	
THOMSON REUTERS CORP	13,747	222.560	3,059,532.32	
AIR CANADA	12,083	16.000	193,328.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,538	159.520	7,583,261.76	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	79,413	113.760	9,034,022.88	
TFI INTERNATIONAL INC	6,995	211.680	1,480,701.60	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	60.540	1,358,275.44	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	99.650	307,121.30	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	55.810	630,764.62	
RESTAURANT BRANDS INTERN	25,379	95.720	2,429,277.88	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	143.060	677,675.22	
DOLLARAMA INC	24,084	130.870	3,151,873.08	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	67,986	84.000	5,710,824.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	36.470	333,627.56	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,057	169.400	2,381,255.80	
METRO INC/CN	18,929	81.960	1,551,420.84	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	212.900	1,061,093.60	
SAPUTO INC	18,270	31.620	577,697.40	
BANK OF MONTREAL	60,312	114.330	6,895,470.96	
BANK OF NOVA SCOTIA	102,004	64.210	6,549,676.84	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	78,946	71.000	5,605,166.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,961	115.070	3,447,612.27	
ROYAL BANK OF CANADA	120,703	153.900	18,576,191.70	
TORONTO-DOMINION BANK	149,615	81.760	12,232,522.40	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	31,451	59.930	1,884,858.43	
BROOKFIELD CORP	118,751	66.240	7,866,066.24	
IGM FINANCIAL INC	4,949	39.160	193,802.84	
ONEX CORPORATION	4,217	94.980	400,530.66	
TMX GROUP LTD	26,034	41.770	1,087,440.18	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,594.250	2,781,966.25	

	GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	41.480	952,546.72	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,268	92.230	762,557.64	
	INTACT FINANCIAL CORP	14,283	244.680	3,494,764.44	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	158,627	36.140	5,732,779.78	
	POWER CORP OF CANADA	50,268	39.970	2,009,211.96	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	46,259	69.130	3,197,884.67	
	CGI INC	18,609	150.500	2,800,654.50	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,727	4,246.970	7,334,517.19	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	139.280	894,734.72	
	OPEN TEXT CORP	21,507	43.140	927,811.98	
	SHOPIFY INC - CLASS A	100,310	82.000	8,225,420.00	
	BCE INC	8,653	46.480	402,191.44	
	QUEBECOR INC -CL B	14,578	29.950	436,611.10	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	32,571	53.050	1,727,891.55	
	TELUS CORP	15,222	22.130	336,862.86	
	ALTAGAS LTD	27,309	32.720	893,550.48	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	38.170	427,504.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	32.360	237,651.84	
	EMERA INC	22,591	49.810	1,125,257.71	
	FORTIS INC	41,868	57.120	2,391,500.16	
	HYDRO ONE LTD	24,747	43.090	1,066,348.23	
	NORTHLAND POWER INC	30,259	23.070	698,075.13	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	243.000	891,567.00	
	カナダ・ドル小計	3,476,666		233,800,539.99 (25,725,073,415)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	33.030	628,098.48	
	SANTOS LTD	278,806	7.830	2,183,050.98	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	162,029	26.870	4,353,719.23	
	BHP GROUP LTD	432,744	41.540	17,976,185.76	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	21.620	804,566.68	
	FORTESCUE LTD	135,233	18.280	2,472,059.24	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,927	53.590	1,978,917.93	
	MINERAL RESOURCES LTD	17,115	51.980	889,637.70	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	13.880	1,290,284.80	
	ORICA LTD	36,212	17.520	634,434.24	
	PILBARA MINERALS LTD	280,194	2.790	781,741.26	
	RIO TINTO LTD	32,627	114.660	3,741,011.82	
	SOUTH32 LTD	336,639	3.010	1,013,283.39	
	REECE LTD	13,059	27.080	353,637.72	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	16,425	38.390	630,555.75	
	BRAMBLES LTD	122,717	15.300	1,877,570.10	
	COMPUTERSHARE LTD	50,853	28.020	1,424,901.06	
AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.650	475,416.15		
QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	6.180	483,436.68		

	ARISTOCRAT LEISURE LTD	50,926	53.900	2,744,911.40	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	4.920	852,478.56	
	WESFARMERS LTD	96,169	71.640	6,889,547.16	
	COLES GROUP LTD	111,645	17.960	2,005,144.20	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	5.370	745,023.06	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	107,347	34.380	3,690,589.86	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	62,913	12.330	775,717.29	
	COCHLEAR LTD	5,404	343.410	1,855,787.64	
	PRO MEDICUS LTD	5,586	138.180	771,873.48	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	44.930	654,405.45	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,362	27.230	1,017,367.26	
	CSL LTD	41,320	309.290	12,779,862.80	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	253,422	28.520	7,227,595.44	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	143,720	135.950	19,538,734.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,499	37.920	10,029,802.08	
	WESTPAC BANKING CORP	287,982	29.080	8,374,516.56	
	ASX LTD	15,385	64.980	999,717.30	
	MACQUARIE GROUP LTD	31,658	207.050	6,554,788.90	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	35.090	799,560.74	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	7.280	1,264,936.40	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.880	751,563.76	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	17.650	2,196,542.50	
	SUNCORP GROUP LTD	117,223	17.440	2,044,369.12	
	WISETECH GLOBAL LTD	12,907	93.460	1,206,288.22	
	XERO LTD	12,671	134.250	1,701,081.75	
	TELSTRA GROUP LTD	367,025	3.900	1,431,397.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	10.600	1,429,569.00	
	CAR GROUP LTD	33,837	34.030	1,151,473.11	
	REA GROUP LTD	3,813	200.340	763,896.42	
	SEEK LTD	29,833	20.780	619,929.74	
	オーストラリア・ドル小計	5,378,023		146,860,979.67 (14,634,696,624)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,924	40.800	8,034,499.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	121,500	95.800	11,639,700.00	
	MTR CORP	118,500	25.050	2,968,425.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	16.920	2,707,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	32.700	5,755,200.00	
	SANDS CHINA LTD	238,000	14.520	3,455,760.00	
	WH GROUP LTD	722,000	4.960	3,581,120.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	23.250	5,742,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	101.700	6,447,780.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,400	227.600	23,306,240.00	
	AIA GROUP LTD	971,200	52.650	51,133,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	62,000	52.050	3,227,100.00	

	CLP HOLDINGS LTD	142,100	66.600	9,463,860.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	6.370	5,487,047.93	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	49.350	5,477,850.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	29.100	4,682,888.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	145,384	21.700	3,154,832.80	
	SINO LAND CO	248,200	7.980	1,980,636.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,500	67.100	9,092,050.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	67.450	1,821,150.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	12.140	1,417,952.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	21.550	2,435,150.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	18.680	2,335,000.00	
	香港・ドル小計	5,365,221		175,347,871.33 (3,421,036,971)	
シンガポール・ドル	KEPPEL LTD	115,000	6.530	750,950.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.390	476,754.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.910	784,741.06	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	0.850	384,625.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.160	504,336.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	170,270	36.560	6,225,071.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	295,500	14.800	4,373,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	32.260	3,303,424.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.670	630,484.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	763,215	3.080	2,350,702.20	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	89,200	4.690	418,348.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.710	596,471.00	
	シンガポール・ドル小計	2,655,151		20,799,306.46 (2,364,049,172)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	133,941	7.500	1,004,557.50	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	46,548	32.300	1,503,500.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	121,519	4.260	517,670.94	
	MERCURY NZ LTD	40,731	6.900	281,043.90	
	MERIDIAN ENERGY LTD	137,123	6.530	895,413.19	
	ニュージーランド・ドル小計	479,862		4,202,185.93 (378,196,734)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,415,483	4.516	6,392,321.22	
	SHELL PLC	547,161	27.665	15,137,209.06	
	ANGLO AMERICAN PLC	104,777	22.770	2,385,772.29	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	19.315	598,436.64	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	39.750	409,266.00	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	17.400	304,621.80	
	GLENCORE PLC	869,792	4.166	3,623,553.47	
	MONDI PLC	45,625	15.210	693,956.25	
	RIO TINTO PLC	95,791	49.355	4,727,764.80	
	ASHTAD GROUP PLC	35,259	54.200	1,911,037.80	
	BAE SYSTEMS PLC	251,236	12.820	3,220,845.52	

BUNZL PLC	26,105	32.580	850,500.90	
DCC PLC	10,153	53.100	539,124.30	
MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	5.784	690,933.50	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	712,449	4.447	3,168,260.70	
SMITHS GROUP PLC	36,853	17.660	650,823.98	
SPIRAX GROUP PLC	5,904	87.700	517,780.80	
EXPERIAN PLC	81,296	36.320	2,952,670.72	
INTERTEK GROUP PLC	11,884	50.050	594,794.20	
RELX PLC	159,389	36.880	5,878,266.32	
RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	4.686	892,528.36	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	5.264	340,928.22	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,739	50.450	541,782.55	
BURBERRY GROUP PLC	26,233	7.628	200,105.32	
PERSIMMON PLC	27,665	15.820	437,660.30	
TAYLOR WIMPEY PLC	353,772	1.585	560,728.62	
COMPASS GROUP PLC	147,997	23.680	3,504,568.96	
ENTAIN PLC	42,158	5.640	237,771.12	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	15,196	149.950	2,278,640.20	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,491	80.780	1,170,582.98	
PEARSON PLC	46,942	10.465	491,248.03	
WHITBREAD PLC	16,522	28.700	474,181.40	
JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.295	325,669.19	
KINGFISHER PLC	179,593	2.751	494,060.34	
NEXT PLC	9,030	90.340	815,770.20	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.776	315,020.48	
TESCO PLC	623,187	3.317	2,067,111.27	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	24.810	768,911.52	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,558	27.600	4,624,600.80	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	28.520	509,538.32	
DIAGEO PLC	189,203	24.180	4,574,928.54	
IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	21.610	1,509,047.91	
HALEON PLC	547,292	3.460	1,893,630.32	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,558	41.520	2,348,288.16	
UNILEVER PLC	215,004	47.340	10,178,289.36	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	85,977	11.180	961,222.86	
ASTRAZENECA PLC	132,402	122.020	16,155,692.04	
GSK PLC	342,530	15.425	5,283,525.25	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	19.200	280,128.00	
BARCLAYS PLC	1,330,519	2.340	3,113,414.46	
HSBC HOLDINGS PLC	1,585,380	6.769	10,731,437.22	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,165,051	0.597	3,083,535.44	
NATWEST GROUP PLC	581,902	3.667	2,133,834.63	
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	7.700	1,404,456.90	



	3I GROUP PLC	81,145	30.720	2,492,774.40	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	11.085	343,723.68	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	39,127	94.680	3,704,544.36	
	M&G PLC	217,201	2.128	462,203.72	
	SCHRODERS PLC	61,711	3.914	241,536.85	
	WISE PLC - A	43,661	7.200	314,359.20	
	ADMIRAL GROUP PLC	19,808	27.370	542,144.96	
	AVIVA PLC	217,835	4.985	1,085,907.47	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	561,409	2.312	1,297,977.60	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.420	321,330.12	
	PRUDENTIAL PLC	232,133	6.822	1,583,611.32	
	SAGE GROUP PLC/THE	75,045	10.710	803,731.95	
	HALMA PLC	32,277	25.860	834,683.22	
	BT GROUP PLC	540,623	1.412	763,359.67	
	VODAFONE GROUP PLC	1,981,261	0.731	1,448,301.79	
	CENTRICA PLC	527,715	1.321	697,111.51	
	NATIONAL GRID PLC	413,245	9.800	4,049,801.00	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	25.400	510,971.80	
	SSE PLC	87,793	18.670	1,639,095.31	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	10.240	524,369.92	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	8.112	631,932.91	
	INFORMA PLC	130,107	8.734	1,136,354.53	
	WPP PLC	78,503	7.496	588,458.48	
	イギリス・ボンド小計	23,020,230		165,969,104.71 (32,490,111,938)	
イスラエ ル・シュケ ル	ICL GROUP LTD	67,143	15.870	1,065,559.41	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	673.000	1,489,349.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	34.510	3,393,264.77	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	32.560	3,774,908.72	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	118,638	19.400	2,301,577.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	136.000	1,620,576.00	
	NICE LTD	4,458	678.100	3,022,969.80	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	232.600	820,380.20	
	イスラエル・シュケル小計	422,159		17,488,585.10 (712,177,158)	
スイス・フ ラン	CLARIANT AG-REG	28,111	13.360	375,562.96	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	727.000	391,126.00	
	GIVAUDAN-REG	771	4,244.000	3,272,124.00	
	HOLCIM LTD	42,879	82.040	3,517,793.16	
	SIG GROUP AG	22,269	17.920	399,060.48	
	SIKA AG-REG	12,934	269.100	3,480,539.40	
	ABB LTD-REG	135,651	48.070	6,520,743.57	
	GEBERIT AG-REG	2,873	559.600	1,607,730.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	228.000	402,648.00	

SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,092	233.400	955,072.80		
VAT GROUP AG	2,164	425.600	920,998.40		
ADECCO GROUP AG-REG	14,810	30.000	444,300.00		
SGS SA-REG	11,450	95.640	1,095,078.00		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	272.600	1,143,284.40		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	44,847	134.250	6,020,709.75		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	181.100	474,300.90		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	35.350	184,703.75		
AVOLTA AG	8,656	34.500	298,632.00		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	382	1,411.000	539,002.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	11,040.000	794,880.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,600.000	876,800.00		
NESTLE SA-REG	227,729	88.680	20,195,007.72		
ALCON INC	41,643	82.920	3,453,037.56		
SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	266.500	1,112,104.50		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	113.250	999,204.75		
BACHEM HOLDING AG	1,756	77.550	136,177.80		
LONZA GROUP AG-REG	6,471	578.800	3,745,414.80		
NOVARTIS AG-REG	168,528	98.480	16,596,637.44		
ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	308.400	796,905.60		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60,135	285.500	17,168,542.50		
SANDOZ GROUP AG	30,936	37.260	1,152,675.36		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	93.050	279,708.30		
JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	47.840	725,637.12		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,044	1,171.500	2,394,546.00		
UBS GROUP AG-REG	273,261	26.700	7,296,068.70		
BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	158.300	618,794.70		
HELVETIA HOLDING AG-REG	4,111	131.500	540,596.50		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,719	673.200	1,830,430.80		
SWISS RE AG	24,764	109.050	2,700,514.20		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,448	484.300	6,028,566.40		
TEMENOS AG - REG	7,049	60.500	426,464.50		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	78.760	1,067,591.80		
SWISSCOM AG-REG	1,994	538.500	1,073,769.00		
BKW AG	1,385	158.100	218,968.50		
SWISS PRIME SITE-REG	7,190	88.500	636,315.00		
スイス・フラン小計	1,271,692		124,908,769.92 (21,590,480,881)		
デンマーク・クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,327	437.000	13,252,899.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,168	2,994.000	3,496,992.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	86,250	167.200	14,421,000.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	292	10,860.000	3,171,120.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	11,070.000	4,560,840.00	
DSV A/S	13,716	1,260.000	17,282,160.00		

	PANDORA A/S	6,892	1,088.000	7,498,496.00	
	CARLSBERG AS-B	8,080	842.000	6,803,360.00	
	COLOPLAST-B	10,365	893.200	9,258,018.00	
	DEMANT A/S	8,178	259.800	2,124,644.40	
	GENMAB A/S	5,493	1,946.500	10,692,124.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	277,624	896.400	248,862,153.60	
	DANSKE BANK A/S	59,312	212.500	12,603,800.00	
	TRYG A/S	24,975	151.800	3,791,205.00	
	ORSTED A/S	14,988	402.600	6,034,168.80	
	デンマーク・クローネ小計	548,072		363,852,981.30 (8,041,150,887)	
ノル ウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	27,948	255.900	7,151,893.20	
	EQUINOR ASA	81,088	282.500	22,907,360.00	
	NORSK HYDRO ASA	108,109	58.920	6,369,782.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	311.700	3,964,200.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	1,085.000	7,080,710.00	
	MOWI ASA	36,354	182.050	6,618,245.70	
	ORKLA ASA	63,195	91.850	5,804,460.75	
	SALMAR ASA	6,204	615.000	3,815,460.00	
	DNB BANK ASA	71,576	225.200	16,118,915.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	183.000	3,420,453.00	
	TELENOR ASA	48,435	130.700	6,330,454.50	
	ノルウェー・クローネ小計	480,844		89,581,935.23 (1,247,876,358)	
スウェーデ ン・クロー ナ	BOLIDEN AB	27,135	316.600	8,590,941.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	419.600	2,947,270.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	145.100	6,625,556.20	
	ALFA LAVAL AB	23,093	470.200	10,858,328.60	
	ASSA ABLOY AB-B	80,816	322.900	26,095,486.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	235,332	186.600	43,912,951.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	164.100	20,523,330.60	
	BEIJER REF AB	41,872	170.000	7,118,240.00	
	EPIROC AB-A	56,566	199.000	11,256,634.00	
	EPIROC AB-B	33,182	178.900	5,936,259.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	72.680	2,536,313.96	
	INDUTRADE AB	27,951	313.600	8,765,433.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	309.500	2,545,018.50	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	315.000	4,771,935.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	46.970	5,132,599.78	
	SAAB AB-B	27,812	241.950	6,729,113.40	
	SANDVIK AB	87,237	218.000	19,017,666.00	
SKANSKA AB-B SHS	26,915	210.800	5,673,682.00		
SKF AB-B SHARES	31,715	199.850	6,338,242.75		
	TRELLEBORG AB-B SHS	21,827	394.000	8,599,838.00	

	VOLVO AB-A SHS	13,283	278.000	3,692,674.00	
	VOLVO AB-B SHS	137,659	273.100	37,594,672.90	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	115.450	4,734,604.50	
	VOLVO CAR AB-B	100,230	30.655	3,072,550.65	
	EVOLUTION AB	14,444	1,032.000	14,906,208.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	167.450	8,742,564.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	50,329	302.700	15,234,588.30	
	GETINGE AB-B SHS	21,124	207.900	4,391,679.60	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	273.600	3,697,156.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	164.850	21,317,577.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,970	108.750	15,221,737.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	72,723	228.000	16,580,844.00	
	EQT AB	29,893	340.900	10,190,523.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	365.400	3,872,509.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,289	361.300	5,162,615.70	
	INVESTOR AB-B SHS	146,684	301.350	44,203,223.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	538.500	3,274,618.50	
	ERICSSON LM-B SHS	221,040	73.400	16,224,336.00	
	HEXAGON AB-B SHS	175,674	107.750	18,928,873.50	
	TELE2 AB-B SHS	58,043	110.950	6,439,870.85	
	TELIA CO AB	187,675	32.320	6,065,656.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	79.720	4,819,392.88	
	SAGAX AB-B	14,721	266.400	3,921,674.40	
	スウェーデン・クローナ小計	2,777,710		486,264,993.82 (6,885,512,312)	
ユーロ	ENI SPA	179,276	14.640	2,624,600.64	
	GALP ENERGIA SGPS SA	41,157	19.080	785,275.56	
	NESTE OYJ	31,509	18.350	578,190.15	
	OMV AG	13,588	38.240	519,605.12	
	REPSOL SA	96,457	13.035	1,257,316.99	
	TENARIS SA	41,201	14.545	599,268.54	
	TOTALENERGIES SE	180,347	62.080	11,195,941.76	
	AIR LIQUIDE SA	49,230	167.600	8,250,948.00	
	AKZO NOBEL N.V.	14,109	57.060	805,059.54	
	ARCELORMITTAL	44,177	20.620	910,929.74	
	ARKEMA	5,145	82.950	426,777.75	
	BASF SE	73,728	42.770	3,153,346.56	
	COVESTRO AG	16,049	54.680	877,559.32	
	DSM-FIRMENICH AG	15,761	115.950	1,827,487.95	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	18.905	334,032.44	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	12,541	97.800	1,226,509.80	
	OCI NV	11,025	22.120	243,873.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	11.525	550,410.95	
	SYENSQO SA	6,353	81.190	515,800.07	

SYMRISE AG	11,030	116.150	1,281,134.50	
UMICORE	16,912	12.640	213,767.68	
UPM-KYMMENE OYJ	48,031	30.160	1,448,614.96	
VOESTALPINE AG	9,720	23.320	226,670.40	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,741	40.560	800,694.96	
AIRBUS SE	49,345	133.580	6,591,505.10	
ALSTOM	25,574	18.045	461,482.83	
BOUYGUES SA	17,123	32.130	550,161.99	
BRENTAG SE	12,153	65.940	801,368.82	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	36,112	78.720	2,842,736.64	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	35.600	1,579,714.40	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	185.600	319,232.00	
EIFFAGE	6,641	92.600	614,956.60	
FERROVIAL SE	42,157	38.740	1,633,162.18	
GEA GROUP AG	10,467	40.480	423,704.16	
IMCD NV	4,340	132.450	574,833.00	
KINGSPAN GROUP PLC	11,832	85.950	1,016,960.40	
KNORR-BREMSE AG	7,217	74.500	537,666.50	
KONE OYJ-B	27,371	46.910	1,283,973.61	
LEGRAND SA	20,908	93.780	1,960,752.24	
LEONARDO SPA	35,486	22.640	803,403.04	
METSO CORP	50,483	9.350	472,016.05	
MTU AERO ENGINES AG	5,004	259.700	1,299,538.80	
PRYSMIAN SPA	19,681	63.100	1,241,871.10	
RATIONAL AG	350	793.000	277,550.00	
REXEL SA	23,491	23.480	551,568.68	
RHEINMETALL AG	3,447	498.500	1,718,329.50	
SAFRAN SA	29,696	205.000	6,087,680.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,198	216.100	9,983,387.80	
SIEMENS AG-REG	64,408	168.500	10,852,748.00	
SIEMENS ENERGY AG	55,049	25.410	1,398,795.09	
THALES SA	8,928	147.050	1,312,862.40	
VINCI SA	41,998	106.650	4,479,086.70	
WARTSILA OYJ ABP	45,125	19.065	860,308.12	
BUREAU VERITAS SA	30,794	28.780	886,251.32	
RANDSTAD NV	8,946	44.900	401,675.40	
TELEPERFORMANCE	4,299	108.000	464,292.00	
WOLTERS KLUWER	20,806	157.600	3,279,025.60	
ADP	3,679	121.100	445,526.90	
AENA SME SA	7,128	186.700	1,330,797.60	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	5.894	299,916.19	
DHL GROUP	82,316	41.030	3,377,425.48	
GETLINK SE	30,428	16.425	499,779.90	
INPOST SA	24,153	15.840	382,583.52	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,028	86.760	2,344,949.28	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,498	80.650	524,063.70	
CONTINENTAL AG	8,078	56.880	459,476.64	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	69.440	590,101.12	
FERRARI NV	10,626	382.000	4,059,132.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	70,222	61.630	4,327,781.86	
MICHELIN (CGDE)	59,151	36.480	2,157,828.48	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	41.400	585,478.80	
RENAULT SA	14,764	44.070	650,649.48	
STELLANTIS NV	190,785	15.486	2,954,496.51	
VOLKSWAGEN AG	1,960	109.800	215,208.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,257	104.050	1,691,540.85	
ADIDAS AG	13,498	236.600	3,193,626.80	
HERMES INTERNATIONAL	2,670	2,028.000	5,414,760.00	
KERING	6,767	287.400	1,944,835.80	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23,475	652.400	15,315,090.00	
MONCLER SPA	19,596	55.000	1,077,780.00	
PUMA SE	9,601	46.230	443,854.23	
SEB SA	1,127	92.150	103,853.05	
ACCOR SA	16,469	36.040	593,542.76	
AMADEUS IT GROUP SA	37,219	60.420	2,248,771.98	
DELIVERY HERO SE	13,293	20.190	268,385.67	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	35.500	205,367.50	
SODEXO SA	6,960	87.250	607,260.00	
D' IETEREN GROUP	1,885	214.200	403,767.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	95,743	45.160	4,323,753.88	
PROSUS NV	117,720	31.710	3,732,901.20	
ZALANDO SE	17,418	24.060	419,077.08	
CARREFOUR SA	49,914	13.770	687,315.78	
JERONIMO MARTINS	22,106	15.290	338,000.74	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	16.820	340,605.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	78,401	29.930	2,346,541.93	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	78,137	55.020	4,299,097.74	
DANONE	55,871	58.840	3,287,449.64	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	48,521	8.260	400,783.46	
HEINEKEN HOLDING NV	10,567	68.800	727,009.60	
HEINEKEN NV	22,805	81.980	1,869,553.90	
JDE PEET'S NV	13,317	18.470	245,964.99	
KERRY GROUP PLC-A	14,401	81.200	1,169,361.20	
LOTUS BAKERIES	31	9,950.000	308,450.00	
PERNOD RICARD SA	16,118	122.550	1,975,260.90	
REMY COINTREAU	2,008	72.650	145,881.20	
BEIERSDORF AG	8,764	135.550	1,187,960.20	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	71.600	623,922.40	

HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	15,381	78.580	1,208,638.98	
L'OREAL	20,668	392.300	8,108,056.40	
AMPLIFON SPA	10,123	28.170	285,164.91	
BIOMERIEUX	2,791	97.700	272,680.70	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	63.100	226,087.30	
DIASORIN SPA	1,313	98.360	129,146.68	
ESSILORLUXOTTICA	24,709	212.200	5,243,249.80	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	35.750	612,218.75	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	31.900	996,141.30	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	62,210	26.530	1,650,431.30	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,498	53.200	1,250,093.60	
ARGENX SE	4,867	466.600	2,270,942.20	
BAYER AG-REG	86,775	27.600	2,394,990.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,665	54.160	794,256.40	
GRIFOLS SA	15,169	9.070	137,582.83	
IPSEN	3,380	103.300	349,154.00	
MERCK KGAA	11,293	165.850	1,872,944.05	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	41.750	440,128.50	
QIAGEN N.V.	20,951	40.860	856,057.86	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	48.820	393,879.76	
SANOFI	96,131	95.390	9,169,936.09	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	252.700	546,842.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	179.250	395,604.75	
UCB SA	11,133	158.350	1,762,910.55	
ABN AMRO BANK NV-CVA	43,340	16.315	707,092.10	
AIB GROUP PLC	149,753	5.360	802,676.08	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	484,418	10.175	4,928,953.15	
BANCO BPM SPA	132,557	6.480	858,969.36	
BANCO DE SABADELL SA	515,705	2.014	1,038,629.87	
BANCO SANTANDER SA	1,319,421	4.512	5,953,227.55	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	87,661	10.415	912,989.31	
BNP PARIBAS	87,860	64.240	5,644,126.40	
CAIXABANK SA	308,048	5.424	1,670,852.35	
COMMERZBANK AG	82,105	15.070	1,237,322.35	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	13.925	1,265,768.57	
ERSTE GROUP BANK AG	26,641	48.360	1,288,358.76	
FINECOBANK SPA	60,333	16.140	973,774.62	
ING GROEP NV	288,375	16.832	4,853,928.00	
INTESA SANPAOLO	1,231,042	3.797	4,674,266.47	
KBC GROUP NV	20,304	71.860	1,459,045.44	
MEDIOBANCA SPA	47,708	14.995	715,381.46	
NORDEA BANK ABP	266,860	10.825	2,888,759.50	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	23.895	1,318,908.42	
UNICREDIT SPA	125,812	38.340	4,823,632.08	

ADYEN NV	1,711	1,124.400	1,923,848.40	
AMUNDI SA	3,955	68.250	269,928.75	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	161,748	14.614	2,363,785.27	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,203	189.550	3,071,278.65	
EDENRED	20,297	38.020	771,691.94	
EURAZEO SE	3,897	73.100	284,870.70	
EURONEXT NV	7,818	94.450	738,410.10	
EXOR NV	8,669	94.600	820,087.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	69.150	548,566.95	
NEXI SPA	57,060	5.694	324,899.64	
SOFINA	1,314	219.800	288,817.20	
AEGON LTD	127,748	5.966	762,144.56	
AGEAS	11,247	43.580	490,144.26	
ALLIANZ SE-REG	33,770	261.900	8,844,363.00	
ASR NEDERLAND NV	14,593	46.660	680,909.38	
AXA SA	158,340	32.690	5,176,134.60	
GENERALI	82,510	24.110	1,989,316.10	
HANNOVER RUECK SE	5,315	230.900	1,227,233.50	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,630	457.200	5,317,236.00	
NN GROUP NV	20,802	46.240	961,884.48	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	12.685	440,423.20	
SAMPO OYJ-A SHS	36,423	40.920	1,490,429.16	
TALANX AG	5,345	70.450	376,555.25	
BECHTLE AG	8,953	40.620	363,670.86	
CAPGEMINI SE	12,750	184.800	2,356,200.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	57,951	34.370	1,991,775.87	
NEMETSCHKE SE	5,941	86.150	511,817.15	
SAP SE	88,495	192.020	16,992,809.90	
NOKIA OYJ	442,364	3.647	1,613,301.50	
ASM INTERNATIONAL NV	4,006	606.600	2,430,039.60	
ASML HOLDING NV	34,014	805.700	27,405,079.80	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	116.900	734,833.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	106,869	31.600	3,377,060.40	
STMICROELECTRONICS NV	54,733	30.420	1,664,977.86	
CELLNEX TELECOM SA	39,938	32.460	1,296,387.48	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	274,682	24.090	6,617,089.38	
ELISA OYJ	14,245	43.120	614,244.40	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	10.320	290,920.80	
KONINKLIJKE KPN NV	367,935	3.628	1,334,868.18	
ORANGE	153,827	10.220	1,572,111.94	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.230	160,161.65	
TELEFONICA SA	412,202	4.210	1,735,370.42	
ACCIONA SA	1,810	117.400	212,494.00	
E.ON SE	178,555	12.940	2,310,501.70	



EDP RENOVAVEIS SA	27,294	14.360	391,941.84	
EDP SA	235,207	3.807	895,433.04	
ELIA GROUP SA/NV	3,348	95.550	319,901.40	
ENDESA SA	25,535	18.015	460,013.02	
ENEL SPA	694,419	6.630	4,603,997.97	
ENGIE	165,342	14.480	2,394,152.16	
FORTUM OYJ	42,339	13.980	591,899.22	
IBERDROLA SA	514,962	12.175	6,269,662.35	
REDEIA CORP SA	34,539	16.320	563,676.48	
RWE AG	53,937	34.240	1,846,802.88	
SNAM SPA	168,809	4.392	741,409.12	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	130,126	7.712	1,003,531.71	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,958	29.070	1,684,839.06	
VERBUND AG	5,338	73.950	394,745.10	
BOLLORE SE	69,288	5.765	399,445.32	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,099	80.000	487,920.00	
PUBLICIS GROUPE	18,281	97.100	1,775,085.10	
SCOUT24 SE	6,149	72.700	447,032.30	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	21.290	1,408,759.30	
VIVENDI SE	57,161	9.876	564,522.03	
LEG IMMOBILIEN SE	6,505	81.380	529,376.90	
VONOVIA SE	60,885	28.780	1,752,270.30	
ユーロ小計	15,476,637		429,021,831.12 (70,741,409,733)	
合計	92,554,054		790,447,848,874 (790,447,848,874)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建保有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	580銘柄	74.1%	76.2%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.2%	3.3%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	23銘柄	0.4%	0.4%
シンガポール・ドル	株式	12銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.0%	0.0%
イギリス・ポンド	株式	78銘柄	4.0%	4.1%
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.7%	2.7%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	43銘柄	0.8%	0.9%
ユーロ	株式	217銘柄	8.7%	8.9%

(b) 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 SOFTWARE INC- CW40	1,480.00	-	
		カナダ・ドル小計	1,480.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,588,083.86	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	950,120.60	
		AMERICAN TOWER CORP	40,171.00	8,960,141.55	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	707,188.26	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,975.00	2,468,526.50	
		BXP INC	13,802.00	1,002,439.26	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	878,781.19	
		CROWN CASTLE INC	38,498.00	4,212,451.16	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,519.00	3,991,355.76	
		EQUINIX INC	7,881.00	6,058,676.37	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	977,248.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,734.00	2,068,594.38	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,531,764.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,630.00	2,875,453.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	1,136,906.25	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,292.00	1,425,977.28	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	1,055,130.60	
		INVITATION HOMES INC	55,309.00	1,935,261.91	
		IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	2,408,068.46	
		KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,276,286.02	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,351,912.77	
		PROLOGIS INC	78,263.00	9,868,181.67	
		PUBLIC STORAGE	12,964.00	3,945,852.68	
		REALTY INCOME CORP	70,489.00	4,114,442.93	
		REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	895,977.39	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,996.00	2,178,528.24	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	28,094.00	4,349,232.14	
		SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,287,414.32	
		UDR INC	27,406.00	1,119,535.10	
		VENTAS INC	34,880.00	1,913,516.80	
		VICI PROPERTIES INC	84,341.00	2,649,994.22	
		WELLTOWER INC	49,760.00	5,585,062.40	
		WEYERHAEUSER CO	65,282.00	2,073,356.32	
WP CAREY INC	16,778.00	1,020,102.40			
アメリカ・ドル小計			1,084,831.00	89,861,564.59 (13,698,496,906)	
カナダ・ドル	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	400,166.60	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	135,277.38	

カナダ・ドル小計		15,611.00	535,443.98 (58,914,901)	
オーストラ リア・ドル	APA GROUP	108,912.00	847,335.36	
	DEXUS/AU	79,604.00	545,287.40	
	GOODMAN GROUP	141,942.00	4,975,067.10	
	GPT GROUP	159,776.00	706,209.92	
	MIRVAC GROUP	326,863.00	676,606.41	
	SCENTRE GROUP	452,086.00	1,537,092.40	
	STOCKLAND	193,824.00	860,578.56	
	TRANSURBAN GROUP	256,783.00	3,279,118.91	
オーストラリア・ドル小計		2,092,221.00	14,187,055.30 (1,413,740,061)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,613,720.00	
	LINK REIT	238,500.00	7,810,875.00	
香港・ドル小計		514,500.00	10,424,595.00 (203,383,848)	
シンガポ ール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	322,200.00	863,496.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	846,042.12	
シンガポール・ドル小計		730,916.00	1,709,538.12 (194,306,103)	
イギリス・ ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	380,690.52	
	SEGRO PLC	115,483.00	1,054,359.79	
イギリス・ポンド小計		175,340.00	1,435,050.31 (280,925,449)	
ユーロ	COVIVIO	7,110.00	336,303.00	
	GECINA SA	3,082.00	277,225.90	
	KLEPIERRE	18,172.00	459,388.16	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	619,501.76	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,027.00	354,041.48	
ユーロ小計		51,333.00	2,046,460.30 (337,440,839)	
投資証券合計			16,187,208,107 (16,187,208,107)	
合 計			16,187,208,107 (16,187,208,107)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入 新株予約権証券 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	投資証券	34銘柄	-	1.7%	84.6%
カナダ・ドル	新株予約権証券	1銘柄	-	-	-
	投資証券	2銘柄	-	0.0%	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	9銘柄	-	0.2%	8.7%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.3%

シンガポール・ドル	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.2%
イギリス・ボンド	投資証券	2銘柄	-	0.0%	1.7%
ユーロ	投資証券	5銘柄	-	0.0%	2.1%

## 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)」に記載しております。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年7月31日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		2,547,788,589
金銭信託		1,084,608
コール・ローン		229,923,792
株式		40,068,413,340
投資信託受益証券		1,755,442,948
投資証券		3,314,980,733
派生商品評価勘定		6,314,934
未収入金		498,390
未収配当金		245,264,156
差入委託証拠金		1,088,620,005
流動資産合計		49,258,331,495
資産合計		49,258,331,495
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		59,744,795
未払解約金		642,240,920
流動負債合計		701,985,715
負債合計		701,985,715
純資産の部		
元本等		
元本		22,971,208,792
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		25,585,136,988
元本等合計		48,556,345,780
純資産合計		48,556,345,780
負債純資産合計		49,258,331,495

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

		<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3.	その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	22,971,208,792口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1138円 (1万口当たりの純資産額21,138円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

### 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（株式、投資信託受益証券、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT SEP24	3,467,310,300	-	3,408,170,440	59,139,860
	小計	3,467,310,300	-	3,408,170,440	59,139,860
合計		3,467,310,300	-	3,408,170,440	59,139,860

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に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。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	97,900,000	-	97,295,495	604,505
	小計	97,900,000	-	97,295,495	604,505
	売建				
	アメリカ・ドル	602,900,000	-	596,585,496	6,314,504
	小計	602,900,000	-	596,585,496	6,314,504
合計		700,800,000	-	693,880,991	5,709,999

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下

の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 2024年7月31日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	19,588,408,146円
同期中における追加設定元本額	6,724,929,614円
同期中における一部解約元本額	3,342,128,968円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	12,327,140,999円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,478,602,972円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	21,555,748円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	165,292,419円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	112,032,284円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	66,060,814円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	114,115,247円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	94,774,016円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	453,058,618円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	313,476,928円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	489,664,140円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	137,463,690円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,541,608円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	412,205,167円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	4,465,214,742円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	103,186,983円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	15,504,224円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	9,415,709円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	11,120,498円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	5,850,281円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	3,085,871円



三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	216,138円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	6,478,679円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	31,885,413円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	33,684,069円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	12,753,493円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	78,828,042円
合 計	22,971,208,792円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	42,200	1.763	74,398.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	6,558	15.440	101,255.52	
	SOUTHERN COPPER CORP	3,288	101.150	332,581.20	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	16,891	18.640	314,848.24	
	NIO INC - ADR	51,172	4.420	226,180.24	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	7,842	29.620	232,280.04	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	16,231	10.330	167,666.23	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	15,709	30.030	471,741.27	
	PDD HOLDINGS INC	23,872	123.160	2,940,075.52	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	15,698	13.490	211,766.02	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,555	56.850	145,251.75	
	CREDICORP LTD	2,745	172.250	472,826.25	
	QIFU TECHNOLOGY INC	5,550	19.700	109,335.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	28,195	1.606	45,281.17	
	AUTOHOME INC-ADR	2,773	24.370	67,578.01	
	IQIYI INC-ADR	21,954	3.230	70,911.42	
	KANZHUN LTD - ADR	10,834	13.500	146,259.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	29,713	13.900	413,010.70	
KE HOLDINGS INC-ADR	25,734	13.510	347,666.34		
アメリカ・ドル小計		329,514		6,890,912.52 (1,050,450,705)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	72,000	7.550	543,600.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	74,000	6.550	484,700.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	946,000	4.840	4,578,640.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	131,000	31.950	4,185,450.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	52,000	8.880	461,760.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	854,000	6.690	5,713,260.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	119,600	9.650	1,154,140.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	176,000	4.230	744,480.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	53,000	18.900	1,001,700.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	122,000	9.290	1,133,380.00	

CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	216,000	2.510	542,160.00	
CMOC GROUP LTD-H	150,000	6.050	907,500.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	14,600	15.800	230,680.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	51,000	13.300	678,300.00	
MMG LTD	120,000	2.330	279,600.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	15.780	394,500.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	54,000	13.400	723,600.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	214,000	15.220	3,257,080.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	3.740	370,260.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	67.650	412,665.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	126,000	3.990	502,740.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	3.680	559,360.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	92,000	10.800	993,600.00	
CITIC LTD	233,000	7.090	1,651,970.00	
CRRC CORP LTD - H	144,000	4.860	699,840.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	3.980	286,560.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	21.000	441,000.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	30,000	18.980	569,400.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	68,000	12.100	822,800.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	19,400	28.200	547,080.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	60,140	11.400	685,596.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	114,400	10.760	1,230,944.00	
JD LOGISTICS INC	70,500	7.750	546,375.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	7.450	372,500.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	107.300	643,800.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	78,000	5.010	390,780.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	130,000	3.820	496,600.00	
BYD CO LTD-H	42,000	224.800	9,441,600.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	23,600	40.400	953,440.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	252,000	7.810	1,968,120.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	85,000	10.440	887,400.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	2.800	227,360.00	
LI AUTO INC-CLASS A	50,600	73.600	3,724,160.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	46,700	31.250	1,459,375.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	48,000	9.500	456,000.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	19,900	23.750	472,625.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	49,600	67.700	3,357,920.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	172,000	3.800	653,600.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	96,400	24.750	2,385,900.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	14,000	23.000	322,000.00	
LI NING CO LTD	98,000	14.080	1,379,840.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	34,400	63.200	2,174,080.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	59,000	12.160	717,440.00	
MEITUAN-CLASS B	201,660	106.400	21,456,624.00	

NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	57,400	53.550	3,073,770.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	52,400	13.280	695,872.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	8.470	245,630.00	
TRIP.COM GROUP LTD	22,150	331.400	7,340,510.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	620,900	76.200	47,312,580.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	5,000	52.150	260,750.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	7.120	485,584.00	
JD.COM INC-CLASS A	93,535	102.200	9,559,277.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	13,200	31.700	418,440.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	38.800	814,800.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	3.460	169,540.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	12.140	400,620.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	208,000	3.140	653,120.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	40,800	20.650	842,520.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	4,500	102.210	459,945.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	3.430	435,610.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	133,000	12.620	1,678,460.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	68,000	23.300	1,584,400.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	78,600	29.600	2,326,560.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	58,000	8.700	504,600.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	90,000	9.220	829,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	26,000	48.000	1,248,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	4.500	747,000.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	14,200	38.500	546,700.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	23.350	595,425.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	23.450	211,050.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	22.850	246,780.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	3.860	302,624.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	11.480	283,556.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	55,600	17.840	991,904.00	
AKESO INC	28,000	40.450	1,132,600.00	
BEIGENE LTD	28,500	95.300	2,716,050.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	5.170	281,765.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	324,800	5.670	1,841,616.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	50,000	11.860	593,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	48,000	16.360	785,280.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	48,500	36.800	1,784,800.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	387,000	2.730	1,056,510.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	13,711	29.850	409,273.35	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	150,500	10.500	1,580,250.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,080,000	3.520	3,801,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,190,000	3.440	10,973,600.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	325,000	5.650	1,836,250.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	363,000	4.640	1,684,320.00	

CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,845,000	5.430	20,878,350.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.330	179,410.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	158,500	31.950	5,064,075.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	265,100	2.720	721,072.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,614,000	4.320	11,292,480.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	326,000	4.160	1,356,160.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	132,000	3.700	488,400.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	58,400	8.020	468,368.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,500	10.960	706,920.00	
FAR EAST HORIZON LTD	84,000	5.260	441,840.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	6.420	174,624.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	3.420	276,336.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	8.290	358,128.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	292,000	10.460	3,054,320.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	110,400	19.680	2,172,672.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	61,000	7.980	486,780.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	30,100	14.520	437,052.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	308,000	2.580	794,640.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	286,000	10.020	2,865,720.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	269,500	33.300	8,974,350.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	104,000	5.660	588,640.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	33,000	28.300	933,900.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	29,000	29.650	859,850.00	
LENOVO GROUP LTD	316,000	10.020	3,166,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	26,200	41.750	1,093,850.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	608,800	16.320	9,935,616.00	
ZTE CORP-H	23,800	16.880	401,744.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	17,000	10.680	181,560.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	846,000	1.050	888,300.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	19.760	375,440.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	194,000	3.500	679,000.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,886,000	0.960	1,810,560.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	25.400	431,800.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	206,000	2.360	486,160.00	
CGN POWER CO LTD-H	446,000	3.260	1,453,960.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	7.000	660,800.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	141,000	7.140	1,006,740.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	227,000	3.720	844,440.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	39,400	26.350	1,038,190.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	78,000	21.750	1,696,500.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	32,300	54.800	1,770,040.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.080	375,360.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	152,000	4.900	744,800.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	162,000	7.720	1,250,640.00	

	BAIDU INC-CLASS A	91,900	87.150	8,009,085.00	
	BILIBILI INC-CLASS Z	10,220	117.100	1,196,762.00	
	CHINA LITERATURE LTD	12,200	24.000	292,800.00	
	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	304,000	2.050	623,200.00	
	KINGSOFT CORP LTD	33,600	21.350	717,360.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	91,100	42.100	3,835,310.00	
	NETEASE INC	77,700	142.600	11,080,020.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	263,200	353.600	93,067,520.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	12.680	266,280.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	152,500	12.420	1,894,050.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	126,000	23.150	2,916,900.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	21.450	501,930.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	78,900	4.090	322,701.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	80,500	9.760	785,680.00	
	香港・ドル小計	31,053,016		426,393,730.35 (8,318,941,679)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	40,000	64.000	2,560,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	103,000	41.300	4,253,900.00	
	CHINA STEEL CORP	489,000	23.100	11,295,900.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	128,000	49.850	6,380,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	159,000	57.900	9,206,100.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	198,000	49.550	9,810,900.00	
	TCC GROUP HOLDINGS CO LTD	270,676	34.650	9,378,923.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	840.000	4,200,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	105,000	33.650	3,533,250.00	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	5,500	714.000	3,927,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	3,000	1,830.000	5,490,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	108,000	34.850	3,763,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	22.400	2,374,400.00	
	EVA AIRWAYS CORP	91,000	34.200	3,112,200.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	39,096	167.000	6,529,032.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	29.850	1,910,400.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	76.200	1,951,101.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	75,000	62.300	4,672,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	63,000	48.200	3,036,600.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	6,000	528.000	3,168,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,276	137.000	2,914,812.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	418.000	2,508,000.00	
	POU CHEN	70,000	35.800	2,506,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,200	649.000	7,917,800.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,000	276.500	5,806,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	188,000	85.700	16,111,600.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	9,000	655.000	5,895,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	189,359	18.600	3,522,077.40	

CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	716,000	35.300	25,274,800.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	561,385	26.250	14,736,356.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	412,501	29.350	12,106,904.35	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	354,970	27.400	9,726,178.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	470,585	42.750	20,117,508.75	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	419,551	26.250	11,013,213.75	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	472,912	20.200	9,552,822.40	
TAIWAN BUSINESS BANK	213,032	18.600	3,962,395.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	389,563	26.650	10,381,853.95	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	143,299	41.400	5,932,578.60	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	58,988	149.500	8,818,706.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	419,013	32.350	13,555,070.55	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	388,000	61.700	23,939,600.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	639,196	16.000	10,227,136.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	316,897	86.500	27,411,590.50	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	498,432	10.750	5,358,144.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	20,000	510.000	10,200,000.00	
ACER INC	111,000	44.200	4,906,200.00	
ADVANTECH CO LTD	18,727	344.500	6,451,451.50	
ASIA VITAL COMPONENTS	13,000	639.000	8,307,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	28,000	447.000	12,516,000.00	
AUO CORP	222,600	18.200	4,051,320.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	26,000	214.000	5,564,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	157,000	31.750	4,984,750.00	
DELTA ELECTRONICS INC	79,000	400.000	31,600,000.00	
E INK HOLDINGS INC	32,000	268.000	8,576,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	22,000	258.000	5,676,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	495,800	196.000	97,176,800.00	
INNOLUX CORP	377,163	15.800	5,959,175.40	
INVENTEC CORP	110,000	47.300	5,203,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	4,480	2,915.000	13,059,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	84,000	99.800	8,383,200.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	27,000	171.500	4,630,500.00	
PEGATRON CORP	81,000	102.000	8,262,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	108,000	270.500	29,214,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	53,000	71.600	3,794,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	56,000	183.500	10,276,000.00	
WISTRON CORP	102,000	97.000	9,894,000.00	
WIWYNN CORP	4,000	1,990.000	7,960,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	62,520	85.200	5,326,704.00	
YAGEO CORPORATION	12,912	730.000	9,425,760.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	30,000	137.500	4,125,000.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	3,000	2,600.000	7,800,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	131,000	155.500	20,370,500.00	

	EMEMORY TECHNOLOGY INC	3,000	2,305.000	6,915,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	4,000	1,095.000	4,380,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	11,000	493.500	5,428,500.00	
	MEDIATEK INC	60,000	1,255.000	75,300,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	57.100	2,740,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	23,000	531.000	12,213,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	20,000	502.000	10,040,000.00	
	SILERGY CORP	13,800	462.000	6,375,600.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	980,000	940.000	921,200,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	448,000	50.000	22,400,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	40,000	120.000	4,800,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	118,000	22.700	2,678,600.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	147,000	121.000	17,787,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	72,000	86.500	6,228,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	73,000	105.500	7,701,500.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,443	51.500	3,782,314.50	
	台湾・ドル小計	13,680,481		1,823,515,129.50 (8,456,369,062)	
エジプト・ ポンド	EASTERN CO SAE	48,781	22.000	1,073,182.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	96,608	82.210	7,942,143.68	
	T M G HOLDING	30,309	56.030	1,698,213.27	
	エジプト・ポンド小計	175,698		10,713,538.95 (33,708,008)	
トルコ・リ ラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	38,176	161.600	6,169,241.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	48,657	55.900	2,719,926.30	
	SASA POLYESTER SANAYI	46,408	45.100	2,093,000.80	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	50,276	62.750	3,154,819.00	
	KOC HOLDING AS	31,180	217.900	6,794,122.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	47,908	47.180	2,260,299.44	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	9,051	226.100	2,046,431.10	
	TURK HAVA YOLLARI AO	22,378	293.500	6,567,943.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	994.500	2,556,859.50	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,752	277.750	1,319,868.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,318	615.500	11,274,729.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	3,549	889.500	3,156,835.50	
	AKBANK T.A.S.	126,956	62.750	7,966,489.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	46,491	100.200	4,658,398.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	320,199	14.910	4,774,167.09	
	YAPI VE KREDI BANKASI	148,083	29.860	4,421,758.38	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	48,118	105.400	5,071,637.20		
	トルコ・リラ小計	1,013,071		77,006,525.11 (354,615,048)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	126,200	102.990	12,997,338.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,795	254.240	1,727,560.80	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	40,100	24.240	972,024.00	

	ALFA S.A.B.-A	126,300	10.620	1,341,306.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	24,300	118.670	2,883,681.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	14,835	290.060	4,303,040.10	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	7,585	555.040	4,209,978.40	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	11,400	155.270	1,770,078.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	170.180	1,224,445.10	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	210,300	61.590	12,952,377.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,700	180.900	3,744,630.00	
	GRUMA S.A.B.-B	6,425	337.610	2,169,144.25	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	56,400	64.750	3,651,900.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	63,600	32.580	2,072,088.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	26,900	52.530	1,413,057.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	103,200	140.100	14,458,320.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	67,700	44.040	2,981,508.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	722,900	15.490	11,197,721.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	47,400	16.120	764,088.00	
	メキシコ・ペソ小計	1,690,235		86,834,284.65 (703,878,710)	
フィリピン・ペソ	AYALA CORPORATION	11,640	593.000	6,902,520.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	116,262	27.100	3,150,700.20	
	SM INVESTMENTS CORP	9,035	907.000	8,194,745.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	38,440	353.000	13,569,320.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	19,650	227.000	4,460,550.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	119.000	3,330,810.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	66,506	122.100	8,120,382.60	
	BDO UNIBANK INC	92,674	136.500	12,650,001.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	84,590	68.000	5,752,120.00	
	PLDT INC	2,690	1,493.000	4,016,170.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	390.000	3,923,400.00	
	AYALA LAND INC	275,600	30.050	8,281,780.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	404,100	29.250	11,819,925.00	
	フィリピン・ペソ小計	1,159,237		94,172,423.80 (244,697,626)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	17,285	6,759.600	116,839,686.00	
	EMPRESAS CMPC SA	48,976	1,645.000	80,565,520.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,698	36,030.000	205,298,940.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	747,361	64.850	48,466,360.85	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	6,352,877	11.880	75,472,178.76	
	FALABELLA SA	34,870	3,093.000	107,852,910.00	
	CENCOSUD SA	53,544	1,750.000	93,702,000.00	
	BANCO DE CHILE	1,720,479	112.190	193,020,539.01	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,107	27,400.000	85,131,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,408,919	46.700	112,496,517.30	
	ENEL AMERICAS SA	843,379	88.250	74,428,196.75	



	ENEL CHILE SA	971,320	54.000	52,451,280.00	
	チリ・ペソ小計	13,207,815		1,245,725,928.67 (198,917,515)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	9,095	36,200.000	329,239,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	16,140	33,240.000	536,493,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	19,631	17,640.000	346,290,840.00	
	コロンビア・ペソ小計	44,866		1,212,023,440.00 (45,216,957)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	57,472	348.200	20,011,750.40	
	COAL INDIA LTD	58,312	519.350	30,284,337.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	29,818	395.750	11,800,473.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	106,892	182.950	19,555,891.40	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	125,071	331.900	41,511,064.90	
	PETRONET LNG LTD	27,436	363.050	9,960,639.80	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	121,499	3,026.300	367,692,423.70	
	AMBUJA CEMENTS LTD	24,411	674.450	16,463,998.95	
	APL APOLLO TUBES LTD	6,265	1,472.100	9,222,706.50	
	ASIAN PAINTS LTD	15,258	3,005.050	45,851,052.90	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	10,470	2,790.900	29,220,723.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	53,203	660.500	35,140,581.50	
	JINDAL STAINLESS LTD	14,795	744.600	11,016,357.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	14,959	976.500	14,607,463.50	
	JSW STEEL LTD	22,672	902.100	20,452,411.20	
	NMDC LTD	43,717	243.030	10,624,542.51	
	PI INDUSTRIES LTD	3,459	4,384.850	15,167,196.15	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	5,741	3,156.000	18,118,596.00	
	SHREE CEMENT LTD	324	27,314.350	8,849,849.40	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	1,212	10,865.800	13,169,349.60	
	SRF LTD	5,894	2,552.350	15,043,550.90	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	2,423	5,326.250	12,905,503.75	
	TATA STEEL LTD	297,861	164.070	48,870,054.27	
	ULTRATECH CEMENT LTD	4,481	11,806.450	52,904,702.45	
	UPL LTD	15,397	564.900	8,697,765.30	
	VEDANTA LTD	44,346	447.200	19,831,531.20	
	ABB INDIA LTD	2,065	7,843.450	16,196,724.25	
	ADANI ENTERPRISES LTD	6,696	3,128.750	20,950,110.00	
	ASHOK LEYLAND LTD	56,114	253.590	14,229,949.26	
	ASTRAL LTD	4,691	2,194.000	10,292,054.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	149,477	318.100	47,548,633.70	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	39,537	317.400	12,549,043.80	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	23,122	739.550	17,099,875.10		
CUMMINS INDIA LTD	5,373	3,807.450	20,457,428.85		
HAVELLS INDIA LTD	9,425	1,815.800	17,113,915.00		
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	8,223	4,953.650	40,733,863.95		

LARSEN & TOUBRO LTD	26,787	3,784.650	101,379,419.55	
POLYCAB INDIA LTD	2,271	6,681.750	15,174,254.25	
SIEMENS LTD	3,370	7,021.150	23,661,275.50	
SUZLON ENERGY LTD	405,457	68.220	27,660,276.54	
THERMAX LTD	1,883	5,059.000	9,526,097.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	9,083	989.600	8,988,536.80	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	21,871	1,546.250	33,818,033.75	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	1,048.650	10,553,613.60	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	104,248	99.970	10,421,672.56	
INTERGLOBE AVIATION LTD	7,201	4,474.000	32,217,274.00	
BAJAJ AUTO LTD	2,566	9,564.350	24,542,122.10	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	3,466	3,260.750	11,301,759.50	
BHARAT FORGE LTD	10,961	1,743.850	19,114,339.85	
BOSCH LTD	318	34,924.550	11,106,006.90	
EICHER MOTORS LTD	5,181	4,951.850	25,655,534.85	
HERO MOTOCORP LTD	4,539	5,444.300	24,711,677.70	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	37,574	2,922.100	109,794,985.40	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,722	12,873.650	73,663,025.30	
MRF LTD	88	139,938.500	12,314,588.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	116,035	194.110	22,523,553.85	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	15,537	679.000	10,549,623.00	
TATA MOTORS LTD	67,389	1,161.850	78,295,909.65	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	17,075	792.950	13,539,621.25	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	4,025	4,183.900	16,840,197.50	
TVS MOTOR CO LTD	8,991	2,496.700	22,447,829.70	
PAGE INDUSTRIES LTD	277	42,507.350	11,774,535.95	
TITAN CO LTD	14,492	3,468.250	50,261,879.00	
INDIAN HOTELS CO LTD	32,256	646.200	20,843,827.20	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	580.000	8,325,900.00	
ZOMATO LTD	263,052	227.130	59,747,000.76	
TRENT LTD	7,472	5,620.500	41,996,376.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,442	5,027.200	32,385,222.40	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,328	5,842.200	25,285,041.60	
ITC LTD	122,008	489.900	59,771,719.20	
MARICO LTD	18,008	681.000	12,263,448.00	
NESTLE INDIA LTD	13,199	2,457.650	32,438,522.35	
TATA CONSUMER PRODUC-RIGHTS	832	390.575	324,958.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	21,638	1,194.900	25,855,246.20	
UNITED SPIRITS LTD	10,302	1,409.250	14,518,093.50	
VARUN BEVERAGES LTD	17,210	1,577.400	27,147,054.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	5,865	3,366.550	19,744,815.75	
DABUR INDIA LTD	21,140	633.900	13,400,646.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	16,369	1,439.800	23,568,086.20	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	33,218	2,691.400	89,402,925.20	

APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,981	6,641.000	26,437,821.00	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	32,458	918.050	29,798,066.90	
AUROBINDO PHARMA LTD	11,043	1,399.450	15,454,126.35	
CIPLA LTD	21,693	1,528.900	33,166,427.70	
DIVI'S LABORATORIES LTD	4,834	4,912.350	23,746,299.90	
DR. REDDY'S LABORATORIES	4,591	6,804.150	31,237,852.65	
LUPIN LTD	9,298	1,862.500	17,317,525.00	
MANKIND PHARMA LTD	4,543	2,055.650	9,338,817.95	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	38,994	1,701.600	66,352,190.40	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,991	3,111.150	12,416,599.65	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	16,362	651.450	10,659,024.90	
AXIS BANK LTD	91,881	1,170.000	107,500,770.00	
BANDHAN BANK LTD	26,591	219.770	5,843,904.07	
BANK OF BARODA	38,009	256.250	9,739,806.25	
CANARA BANK	82,629	115.770	9,565,959.33	
HDFC BANK LIMITED	112,586	1,615.550	181,888,312.30	
ICICI BANK LTD	207,767	1,209.450	251,283,798.15	
IDFC FIRST BANK LTD	131,058	76.040	9,965,650.32	
INDUSIND BANK LTD	10,740	1,429.700	15,354,978.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	44,196	1,786.100	78,938,475.60	
PUNJAB NATIONAL BANK	83,349	125.510	10,461,132.99	
STATE BANK OF INDIA	72,455	872.800	63,238,724.00	
UNION BANK OF INDIA	56,109	134.900	7,569,104.10	
YES BANK LTD	625,769	25.710	16,088,520.99	
BAJAJ FINANCE LTD	11,259	6,823.600	76,826,912.40	
BAJAJ FINSERV LTD	14,493	1,642.650	23,806,926.45	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	859	9,675.150	8,310,953.85	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	15,890	1,417.850	22,529,636.50	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,636	4,105.700	14,928,325.20	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	117,174	329.350	38,591,256.90	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,186	1,808.400	7,569,962.40	
POWER FINANCE CORPORATION	61,445	554.700	34,083,541.50	
REC LTD	49,831	642.200	32,001,468.20	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10,068	719.000	7,238,892.00	
SHRIRAM FINANCE LTD	11,734	2,912.050	34,169,994.70	
SUNDARAM FINANCE LTD	2,718	4,343.350	11,805,225.30	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	36,629	697.200	25,537,738.80	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	9,130	1,967.550	17,963,731.50	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	12,502	723.850	9,049,572.70	
PB FINTECH LTD	12,666	1,456.200	18,444,229.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	17,053	1,721.050	29,349,065.65	
HCL TECHNOLOGIES LTD	37,770	1,630.250	61,574,542.50	
INFOSYS LTD	132,055	1,877.150	247,887,043.25	
LTIMINDTREE LTD	3,273	5,672.500	18,566,092.50	

	MPHASIS LTD	2,360	2,915.050	6,879,518.00	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	3,982	4,776.600	19,020,421.20	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	35,970	4,365.350	157,021,639.50	
	TATA ELXSI LTD	1,296	6,925.600	8,975,577.60	
	TECH MAHINDRA LTD	21,364	1,538.050	32,858,900.20	
	WIPRO LTD	49,433	521.500	25,779,309.50	
	BHARTI AIRTEL LTD	91,051	1,470.350	133,876,837.85	
	INDUS TOWERS LTD	32,533	446.800	14,535,744.40	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	4,533	1,907.500	8,646,697.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	12,008	1,832.400	22,003,459.20	
	ADANI POWER LTD	29,195	729.250	21,290,453.75	
	GAIL INDIA LTD	87,099	233.750	20,359,391.25	
	JSW ENERGY LTD	13,899	715.250	9,941,259.75	
	NHPC LTD	120,274	105.490	12,687,704.26	
	NTPC LTD	173,525	406.950	70,615,998.75	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	184,930	349.800	64,688,514.00	
	TATA POWER CO LTD	53,868	444.100	23,922,778.80	
	TORRENT POWER LTD	6,689	1,601.300	10,711,095.70	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,865	7,009.800	20,083,077.00	
	DLF LTD	29,330	879.900	25,807,467.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	5,192	3,181.050	16,516,011.60	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	11,864	1,328.100	15,756,578.40	
	PHOENIX MILLS LTD	4,304	3,699.250	15,921,572.00	
	インド・ルピー小計	6,209,138		4,984,501,647.91 (9,121,638,016)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	658,700	3,230.000	2,127,601,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	65,100	25,000.000	1,627,500,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	278,700	11,925.000	3,323,497,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	303,800	1,300.000	394,940,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	892,351	1,075.000	959,277,325.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	335,100	9,600.000	3,216,960,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	8,225.000	741,895,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	2,440.000	928,324,840.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	858,900	4,540.000	3,899,406,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	39,296,900	55.000	2,161,329,500.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	716,700	2,840.000	2,035,428,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	260,300	5,200.000	1,353,560,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	10,900.000	774,990,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	6,050.000	870,595,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	2,430.000	585,144,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	665,700	1,565.000	1,041,820,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	2,231,900	10,175.000	22,709,582,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,442,400	6,475.000	9,339,540,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	599,600	4,950.000	2,968,020,000.00		

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,765,400	4,670.000	12,914,418,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,927,000	2,880.000	5,549,760,000.00	
	インドネシア・ルピア小計	54,225,012		79,523,589,165.00 (747,521,737)	
ブラジル・ リアル	COSAN SA	42,588	13.380	569,827.44	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	149,900	39.530	5,925,547.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	191,400	36.650	7,014,810.00	
	PRIIO SA	30,400	47.040	1,430,016.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	22.460	601,928.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	11.720	244,948.00	
	GERDAU SA-PREF	50,928	18.030	918,231.84	
	SUZANO SA	31,215	53.420	1,667,505.30	
	VALE SA	136,588	60.220	8,225,329.36	
	WEG SA	65,360	45.860	2,997,409.60	
	CCR SA	46,500	12.170	565,905.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	35,730	42.040	1,502,089.20	
	RUMO SA	47,600	22.190	1,056,244.00	
	LOJAS RENNER S.A.	40,558	13.030	528,470.74	
	VIBRA ENERGIA SA	44,080	23.190	1,022,215.20	
	ATACADAO SA	19,900	9.060	180,294.00	
	RAIA DROGASIL SA	51,280	27.550	1,412,764.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	55,700	9.440	525,808.00	
	AMBEV SA	183,800	11.640	2,139,432.00	
	BRF SA	27,400	21.320	584,168.00	
	JBS SA	29,700	34.560	1,026,432.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	38,000	14.860	564,680.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	213,319	4.120	878,874.28	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	20,200	28.170	569,034.00	
	HYPERA SA	13,000	29.530	383,890.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	59,481	11.240	668,566.44	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	205,736	12.400	2,551,126.40	
	BANCO DO BRASIL S.A.	71,200	26.950	1,918,840.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	195,100	34.360	6,703,636.00	
	ITAUSA SA	211,580	10.250	2,168,695.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	231,600	10.760	2,492,016.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	26,200	34.970	916,214.00	
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	27,300	14.390	392,847.00		
TOTVS SA	22,800	27.520	627,456.00		
TELEFONICA BRASIL S.A.	16,800	47.290	794,472.00		
TIM SA	29,400	16.370	481,278.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	47,305	37.990	1,797,116.95		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	42.410	339,280.00		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	68,508	10.870	744,681.96		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	12,800	87.350	1,118,080.00		

	COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	51,700	10.120	523,204.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,300	32.690	238,637.00	
	ENEVA SA	26,200	12.700	332,740.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	44.260	285,477.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	44,200	32.330	1,428,986.00	
	ブラジル・リアル小計	2,982,506		69,059,202.71 (1,874,128,643)	
チェコ・コ ルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,663	795.500	2,118,416.50	
	MONETA MONEY BANK AS	12,093	104.800	1,267,346.40	
	CEZ AS	6,382	901.000	5,750,182.00	
	チェコ・コルナ小計	21,138		9,135,944.90 (59,277,665)	
韓国・ウォ ン	HD HYUNDAI	2,022	81,600.000	164,995,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,672	104,300.000	278,689,600.00	
	S-OIL CORP	1,775	66,700.000	118,392,500.00	
	ENCHEM CO LTD	519	166,500.000	86,413,500.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	5,063	24,600.000	124,549,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,767	27,200.000	75,262,400.00	
	KOREA ZINC CO LTD	371	485,000.000	179,935,000.00	
	KUM YANG CO LTD	1,245	69,200.000	86,154,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	141,200.000	74,977,200.00	
	LG CHEM LTD	1,909	305,000.000	582,245,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	215,500.000	48,918,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	723	99,600.000	72,010,800.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,913	359,500.000	1,047,223,500.00	
	SKC CO LTD	898	136,100.000	122,217,800.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,210	40,500.000	89,505,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	16,971	18,560.000	314,981,760.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,920	187,500.000	360,000,000.00	
	ECOPRO CO LTD	3,930	96,100.000	377,673,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	616	84,800.000	52,236,800.00	
	GS HOLDINGS	2,131	47,950.000	102,181,450.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,363	318,500.000	434,115,500.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	3,632	30,100.000	109,323,200.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	930	310,000.000	288,300,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	830	204,500.000	169,735,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,607	201,000.000	323,007,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	32,900.000	92,646,400.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,106	57,100.000	177,352,600.00	
	L&F CO LTD	1,068	116,500.000	124,422,000.00	
LG CORP	3,469	84,800.000	294,171,200.00		
LG ENERGY SOLUTION	1,816	333,000.000	604,728,000.00		
POSCO FUTURE M CO LTD	1,173	215,500.000	252,781,500.00		
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,697	50,600.000	85,868,200.00		

SAMSUNG C&T CORP	3,161	150,300.000	475,098,300.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	7,079	28,300.000	200,335,700.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	27,200	11,630.000	316,336,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	960	37,100.000	35,616,000.00	
SK INC	1,385	146,700.000	203,179,500.00	
SK SQUARE CO LTD	3,944	82,100.000	323,802,400.00	
HANJIN KAL CORP	1,262	66,100.000	83,418,200.00	
HMM CO LTD	10,696	17,550.000	187,714,800.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,482	121,400.000	179,914,800.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	21,100.000	134,786,800.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,945	42,900.000	126,340,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2,378	222,000.000	527,916,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	5,491	250,000.000	1,372,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,296	165,500.000	214,488,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	913	163,200.000	149,001,600.00	
KIA CORP	10,562	111,600.000	1,178,719,200.00	
COWAY CO LTD	1,996	60,800.000	121,356,800.00	
LG ELECTRONICS INC	4,419	103,200.000	456,040,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	379,500.000	99,049,500.00	
KT&G CORP	4,383	92,700.000	406,304,100.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	86,900.000	60,308,600.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,133	178,900.000	202,693,700.00	
LG H&H	359	352,500.000	126,547,500.00	
HLB INC	4,671	77,700.000	362,936,700.00	
ALTEOGEN INC	1,692	320,500.000	542,286,000.00	
CELLTRION INC	6,183	209,000.000	1,292,247,000.00	
CELLTRION PHARM INC	857	101,700.000	87,156,900.00	
HANMI PHARM CO LTD	246	304,000.000	74,784,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	696	937,000.000	652,152,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,033	84,500.000	87,288,500.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	902	53,800.000	48,527,600.00	
YUHAN CORP	2,048	97,600.000	199,884,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	11,955	64,000.000	765,120,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	11,154	13,840.000	154,371,360.00	
KAKAOBANK CORP	6,317	21,200.000	133,920,400.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	15,500	89,300.000	1,384,150,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	16,911	59,500.000	1,006,204,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	22,480	15,680.000	352,486,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	72,400.000	99,115,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,907	82,700.000	323,108,900.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	7,620.000	64,442,340.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	13,900.000	74,934,900.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,789	108,300.000	193,748,700.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,227	360,000.000	441,720,000.00	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,201	95,100.000	304,415,100.00	
	POSCO DX CO LTD	1,864	28,800.000	53,683,200.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	1,822	146,600.000	267,105,200.00	
	COSMOAM&T CO LTD	821	130,200.000	106,894,200.00	
	LG DISPLAY CO LTD	11,601	11,310.000	131,207,310.00	
	LG INNOTEK CO LTD	495	245,000.000	121,275,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,356	154,000.000	362,824,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	190,175	81,000.000	15,404,175,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	33,054	63,000.000	2,082,402,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	2,241	330,500.000	740,650,500.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,863	128,700.000	239,768,100.00	
	SK HYNIX INC	21,815	188,900.000	4,120,853,500.00	
	KT CORP	1,784	38,950.000	69,486,800.00	
	LG UPLUS CORP	6,942	10,080.000	69,975,360.00	
	SK TELECOM	2,212	54,600.000	120,775,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	9,785	19,610.000	191,883,850.00	
	HYBE CO LTD	801	172,000.000	137,772,000.00	
	KAKAO CORP	12,106	39,050.000	472,739,300.00	
	KRAFTON INC	1,234	292,500.000	360,945,000.00	
	NAVER CORP	5,285	173,300.000	915,890,500.00	
	NCSOFT CORP	485	173,200.000	84,002,000.00	
	NETMARBLE CORP	678	62,200.000	42,171,600.00	
	韓国・ウォン小計	612,712		49,238,213,530.00 (5,440,822,595)	
マレーシ ア・リン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,400	17.300	179,920.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	105,000	5.910	620,550.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140,100	5.300	742,530.00	
	GAMUDA BHD	84,800	7.920	671,616.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.620	245,756.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,900	10.160	313,944.00	
	MISC BHD	61,600	8.660	533,456.00	
	GENTING BHD	78,200	4.670	365,194.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	124,300	2.570	319,451.00	
	MR DIY GROUP M BHD	136,150	2.080	283,192.00	
	IOI CORP BHD	101,000	3.810	384,810.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	21,300	20.880	444,744.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	108.500	249,550.00	
	PPB GROUP BERHAD	30,140	14.600	440,044.00	
	QL RESOURCES BHD	54,350	6.680	363,058.00	
	SD GUTHRIE BHD	80,400	4.460	358,584.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	85,700	6.220	533,054.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	108,500	4.440	481,740.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	286,100	7.210	2,062,781.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	19.200	435,840.00		



	MALAYAN BANKING BHD	212,100	10.080	2,137,968.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	565,400	4.180	2,363,372.00	
	RHB BANK BHD	48,000	5.660	271,680.00	
	INARI AMERTRON BHD	125,200	3.780	473,256.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	89,500	2.410	215,695.00	
	CELCOMDIGI BHD	123,800	3.760	465,488.00	
	MAXIS BHD	85,300	3.540	301,962.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	6.970	395,199.00	
	PETRONAS GAS BHD	30,700	18.000	552,600.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	104,400	14.100	1,472,040.00	
	YTL CORP BHD	149,000	3.410	508,090.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	108,600	4.610	500,646.00	
	マレーシア・リングgit小計	3,356,440		19,687,810.00 (650,227,332)	
南アフリ カ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	11,192	190.000	2,126,480.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,321	690.570	1,602,812.97	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	16,779	498.700	8,367,687.30	
	GOLD FIELDS LTD	34,879	300.550	10,482,883.45	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	23,472	166.000	3,896,352.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	38,529	88.190	3,397,872.51	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,544	387.000	984,528.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	14,047	136.770	1,921,208.19	
	SASOL LTD	20,736	143.940	2,984,739.84	
	SIBANYE STILLWATER LTD	119,878	19.400	2,325,633.20	
	BIDVEST GROUP LTD	14,536	269.760	3,921,231.36	
	NASPERS LTD-N SHS	7,012	3,470.470	24,334,935.64	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	70,079	20.180	1,414,194.22	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	32,847	59.000	1,937,973.00	
	BID CORP LTD	13,980	444.120	6,208,797.60	
	CLICKS GROUP LTD	9,867	345.290	3,406,976.43	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	21,011	298.000	6,261,278.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	15,681	242.850	3,808,130.85	
	ABSA GROUP LTD	32,536	158.790	5,166,391.44	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,583	2,766.440	9,912,154.52	
	NEDBANK GROUP LTD	19,433	269.810	5,243,217.73	
	STANDARD BANK GROUP LTD	54,772	220.500	12,077,226.00	
	FIRSTRAND LTD	204,749	80.820	16,547,814.18	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,918	479.030	2,355,869.54	
	REMGRO LTD	19,028	136.000	2,587,808.00	
	DISCOVERY LTD	18,855	138.570	2,612,737.35	
OLD MUTUAL LTD	170,915	11.970	2,045,852.55		
OUTSURANCE GROUP LTD	26,578	47.160	1,253,418.48		
SANLAM LTD	70,266	79.780	5,605,821.48		
MTN GROUP LTD	67,043	76.830	5,150,913.69		

	VODACOM GROUP LTD	21,750	100.410	2,183,917.50	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	23,182	135.790	3,147,883.78	
	南アフリカ・ランド小計	1,206,998		165,274,740.80 (1,375,085,842)	
タイ・パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	52,600	142.000	7,469,200.00	
	PTT PCL-NVDR	391,900	31.750	12,442,825.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	52,500	49.500	2,598,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	54,400	18.700	1,017,280.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	27.000	2,122,200.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	28.250	1,175,200.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	31,300	218.000	6,823,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	178,800	57.000	10,191,600.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	348,900	7.750	2,703,975.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	3.680	678,960.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,300	29.250	3,694,275.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	63,391	31.750	2,012,664.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	235,400	8.850	2,083,290.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	15.600	1,725,360.00	
	CP ALL PCL-NVDR	229,200	56.250	12,892,500.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	77,100	29.500	2,274,450.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	154,600	23.500	3,633,100.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	433,400	26.000	11,268,400.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	22,300	242.000	5,396,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,700	132.000	3,128,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	171,100	17.900	3,062,690.00	
	SCB X PCL-NVDR	30,600	103.000	3,151,800.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,077,800	1.690	1,821,482.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	50,200	39.500	1,982,900.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	130,500	99.500	12,984,750.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	49,900	230.000	11,477,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	35,900	83.000	2,979,700.00	
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	474,567	8.950	4,247,374.65		
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	57,500	3.920	225,400.00		
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	27,400	38.500	1,054,900.00		
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	130,000	48.250	6,272,500.00		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	76,200	54.250	4,133,850.00		
	タイ・パーツ小計	5,202,758		148,726,775.90 (632,088,798)	
ポーランド・ズロチ	ORLEN SA	22,272	63.220	1,408,035.84	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	5,950	130.150	774,392.50	
	BUDIMEX	546	616.500	336,609.00	
	LPP SA	48	14,920.000	716,160.00	
	ALLEGRO.EU SA	23,505	35.875	843,241.87	
	DINO POLSKA SA	1,969	338.600	666,703.40	

	BANK PEKAO SA	7,306	160.100	1,169,690.60	
	MBANK SA	477	611.400	291,637.80	
	PKO BANK POLSKI SA	34,078	58.400	1,990,155.20	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,451	521.600	756,841.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	23,952	47.870	1,146,582.24	
	PGE SA	36,813	7.046	259,384.39	
	CD PROJEKT SA	2,415	155.550	375,653.25	
	ポーランド・ズロチ小計	160,782		10,735,087.69 (412,623,492)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	18,299	2,818.000	51,566,582.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,283	10,220.000	53,992,260.00	
	OTP BANK PLC	8,992	18,515.000	166,486,880.00	
	ハンガリー・フォリント小計	32,574		272,045,722.00 (113,494,755)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,780	23.240	64,607.20	
	METLEN ENERGY & METALS SA	4,436	36.380	161,381.68	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	7,358	15.940	117,286.52	
	JUMBO SA	4,834	24.600	118,916.40	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	91,747	1.666	152,850.50	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	97,148	2.070	201,096.36	
	NATIONAL BANK OF GREECE	32,591	8.002	260,793.18	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	40,213	3.768	151,522.58	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,284	15.230	95,705.32	
	PUBLIC POWER CORP	8,551	11.540	98,678.54	
	ユーロ小計	296,065		1,423,428.68 (234,709,155)	
	合計	136,660,056		40,068,413,340 (40,068,413,340)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	19銘柄	2.2%	2.6%
香港・ドル	株式	156銘柄	17.1%	20.8%
台湾・ドル	株式	88銘柄	17.4%	21.1%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	17銘柄	0.7%	0.9%
メキシコ・ペソ	株式	19銘柄	1.4%	1.8%
フィリピン・ペソ	株式	13銘柄	0.5%	0.6%
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.4%	0.5%
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
インド・ルピー	株式	147銘柄	18.8%	22.8%
インドネシア・ルピア	株式	21銘柄	1.5%	1.9%
ブラジル・リアル	株式	45銘柄	3.9%	4.7%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%

韓国・ウォン	株式	98銘柄	11.2%	13.6%
マレーシア・リンギット	株式	32銘柄	1.3%	1.6%
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.8%	3.4%
タイ・バーツ	株式	32銘柄	1.3%	1.6%
ポーランド・ズロチ	株式	13銘柄	0.8%	1.0%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
ユーロ	株式	11銘柄	0.5%	0.6%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	2,412,000.00	83,358,720.00		
		オフショア・人民元小計	2,412,000.00	83,358,720.00 (1,755,442,948)		
投資信託受益証券合計				1,755,442,948 (1,755,442,948)		
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	67,182.00	2,183,616.54		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	132,398.00	2,281,217.54		
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	281,351.00	11,777,352.86		
		ISHARES MSCI UAE ETF	225,837.00	3,360,454.56		
	アメリカ・ドル小計			706,768.00	19,602,641.50 (2,988,226,670)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	574,800.00	6,776,892.00		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	20,875.00	3,464,415.00		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	78,200.00	15,887,112.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	33,660.00	1,992,335.40		
		TRUST FIBRA UNO	117,000.00	2,731,950.00		
	メキシコ・ペソ小計			824,535.00	30,852,704.40 (250,092,022)	
	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	49,300.00	1,580,065.00		
		ENERGISA SA-UNITS	11,000.00	485,650.00		
		KLABIN SA - UNIT	34,430.00	759,181.50		
ブラジル・レアル小計			94,730.00	2,824,896.50 (76,662,041)		
投資証券合計				3,314,980,733 (3,314,980,733)		
合計				5,070,423,681 (5,070,423,681)		

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	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	投資証券	4銘柄	-	6.2%	58.9%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.5%	4.9%
ブラジル・リアル	投資証券	3銘柄	-	0.2%	1.5%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	3.6%	-	34.6%

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)」に記載しております。

## 国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド

### (1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年7月31日現在)

資産の部		
流動資産		
金銭信託		3,158,152
コール・ローン		669,490,262
国債証券		99,040,149,280
地方債証券		11,674,967,200
特殊債券		9,649,739,907
社債券		8,264,364,100
未収入金		401,627,900
未収利息		256,750,350
前払費用		11,244,019
流動資産合計		129,971,491,170
資産合計		129,971,491,170
負債の部		
流動負債		
未払金		707,970,500
未払解約金		15,739,999
流動負債合計		723,710,499
負債合計		723,710,499
純資産の部		
元本等		
元本		99,054,362,910
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		30,193,417,761
元本等合計		129,247,780,671
純資産合計		129,247,780,671
負債純資産合計		129,971,491,170

### (2) 注記表

#### (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
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、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
--	--

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	99,054,362,910口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3048円 (1万口当たりの純資産額13,048円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

#### (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

( 2024年7月31日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,641,952,625円
同期中における追加設定元本額	19,869,892,254円
同期中における一部解約元本額	13,457,481,969円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
三井住友・日本債券インデックス・ファンド	51,101,646,738円
三井住友D S ・国内債券インデックス年金ファンド	1,598,396,956円
日興FWS・日本債インデックス	15,780,704,505円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	1,651,930,690円
国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	25,040,675円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド< 適格機関投資家限定 >	28,896,643,346円
合 計	99,054,362,910円

## ( 3 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

( 単位 : 円 )

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 5 7 2年国債	400,000,000	398,444,000	
	4 5 8 2年国債	540,000,000	538,509,600	
	4 5 9 2年国債	400,000,000	398,740,000	
	4 6 0 2年国債	50,000,000	49,908,500	
	4 6 1 2年国債	270,000,000	269,900,100	
	4 6 2 2年国債	1,090,000,000	1,089,269,700	
	1 4 6 5年国債	1,280,000,000	1,276,019,200	
	1 4 7 5年国債	190,000,000	188,873,300	
	1 4 8 5年国債	660,000,000	654,753,000	
	1 4 9 5年国債	1,570,000,000	1,555,540,300	
	1 5 0 5年国債	690,000,000	682,665,300	
	1 5 1 5年国債	640,000,000	632,256,000	
	1 5 2 5年国債	410,000,000	406,051,700	
	1 5 3 5年国債	770,000,000	759,481,800	
	1 5 4 5年国債	1,610,000,000	1,589,858,900	
	1 5 6 5年国債	1,250,000,000	1,236,475,000	
	1 5 7 5年国債	390,000,000	385,203,000	



158	5年国債	640,000,000	629,849,600	
159	5年国債	20,000,000	19,642,600	
160	5年国債	680,000,000	670,432,400	
161	5年国債	350,000,000	346,405,500	
162	5年国債	150,000,000	148,212,000	
163	5年国債	880,000,000	873,065,600	
164	5年国債	430,000,000	422,285,800	
165	5年国債	380,000,000	374,805,400	
166	5年国債	260,000,000	257,556,000	
167	5年国債	190,000,000	187,989,800	
168	5年国債	750,000,000	748,980,000	
169	5年国債	420,000,000	417,446,400	
170	5年国債	330,000,000	328,983,600	
2	40年国債	132,000,000	136,243,800	
3	40年国債	150,000,000	153,909,000	
4	40年国債	215,000,000	219,233,350	
5	40年国債	222,000,000	215,852,820	
6	40年国債	220,000,000	208,038,600	
7	40年国債	253,000,000	227,047,260	
8	40年国債	295,000,000	243,563,800	
9	40年国債	531,000,000	314,580,330	
10	40年国債	458,000,000	319,413,780	
11	40年国債	375,000,000	248,970,000	
12	40年国債	400,000,000	232,912,000	
13	40年国債	520,000,000	296,363,600	
14	40年国債	510,000,000	309,600,600	
15	40年国債	555,000,000	371,600,250	
16	40年国債	530,000,000	388,590,700	
17	40年国債	190,000,000	180,994,000	
341	10年国債	295,000,000	294,896,750	
342	10年国債	900,000,000	896,049,000	
343	10年国債	577,000,000	573,434,140	
344	10年国債	1,100,000,000	1,092,080,000	
345	10年国債	725,000,000	718,917,250	
346	10年国債	460,000,000	455,570,200	
347	10年国債	105,000,000	103,849,200	
348	10年国債	105,000,000	103,686,450	
349	10年国債	75,000,000	73,938,750	
350	10年国債	305,000,000	300,162,700	
351	10年国債	260,000,000	255,353,800	
352	10年国債	435,000,000	426,391,350	
353	10年国債	70,000,000	68,460,000	
354	10年国債	610,000,000	595,311,200	
355	10年国債	210,000,000	204,384,600	
356	10年国債	1,015,000,000	986,021,750	

357	10年国債	1,040,000,000	1,008,394,400	
358	10年国債	1,010,000,000	977,417,400	
359	10年国債	1,040,000,000	1,004,161,600	
360	10年国債	1,150,000,000	1,107,760,500	
361	10年国債	1,120,000,000	1,075,950,400	
362	10年国債	1,160,000,000	1,111,303,200	
363	10年国債	1,140,000,000	1,088,631,600	
364	10年国債	1,150,000,000	1,094,535,500	
365	10年国債	1,170,000,000	1,109,780,100	
366	10年国債	1,210,000,000	1,152,791,200	
367	10年国債	1,190,000,000	1,129,916,900	
368	10年国債	780,000,000	738,043,800	
369	10年国債	850,000,000	821,882,000	
370	10年国債	790,000,000	761,939,200	
371	10年国債	860,000,000	819,562,800	
372	10年国債	1,160,000,000	1,142,008,400	
373	10年国債	1,160,000,000	1,118,263,200	
374	10年国債	1,180,000,000	1,155,196,400	
375	10年国債	80,000,000	80,321,600	
2	30年国債	150,000,000	164,032,500	
4	30年国債	160,000,000	181,361,600	
5	30年国債	100,000,000	109,452,000	
7	30年国債	180,000,000	199,530,000	
10	30年国債	230,000,000	233,217,700	
11	30年国債	150,000,000	159,478,500	
12	30年国債	230,000,000	252,448,000	
14	30年国債	220,000,000	247,605,600	
15	30年国債	220,000,000	249,684,600	
16	30年国債	175,000,000	198,702,000	
18	30年国債	170,000,000	189,689,400	
19	30年国債	125,000,000	139,512,500	
21	30年国債	142,000,000	158,440,760	
22	30年国債	149,000,000	169,463,660	
23	30年国債	151,000,000	171,685,490	
24	30年国債	135,000,000	153,428,850	
25	30年国債	175,000,000	194,916,750	
26	30年国債	209,000,000	235,093,650	
27	30年国債	206,000,000	233,867,680	
28	30年国債	201,000,000	228,006,360	
29	30年国債	190,000,000	212,923,500	
30	30年国債	270,000,000	298,242,000	
31	30年国債	277,000,000	301,661,310	
32	30年国債	297,000,000	326,673,270	
33	30年国債	380,000,000	400,778,400	
34	30年国債	394,000,000	425,614,560	

35	30年国債	335,000,000	350,895,750	
36	30年国債	365,000,000	380,888,450	
37	30年国債	345,000,000	353,093,700	
38	30年国債	335,000,000	336,407,000	
39	30年国債	240,000,000	244,240,800	
40	30年国債	240,000,000	239,827,200	
41	30年国債	280,000,000	274,789,200	
42	30年国債	290,000,000	283,939,000	
43	30年国債	280,000,000	273,495,600	
44	30年国債	307,000,000	299,143,870	
45	30年国債	352,000,000	330,337,920	
46	30年国債	345,000,000	322,868,250	
47	30年国債	355,000,000	337,310,350	
48	30年国債	355,000,000	324,075,950	
49	30年国債	375,000,000	341,295,000	
50	30年国債	360,000,000	288,666,000	
51	30年国債	337,000,000	239,054,320	
52	30年国債	307,000,000	227,440,950	
53	30年国債	322,000,000	243,081,020	
54	30年国債	260,000,000	204,846,200	
55	30年国債	340,000,000	266,733,400	
56	30年国債	415,000,000	324,177,250	
57	30年国債	385,000,000	299,456,850	
58	30年国債	410,000,000	317,540,900	
59	30年国債	400,000,000	301,104,000	
60	30年国債	270,000,000	212,652,000	
61	30年国債	300,000,000	223,782,000	
62	30年国債	295,000,000	207,744,900	
63	30年国債	285,000,000	194,224,650	
64	30年国債	285,000,000	193,059,000	
65	30年国債	335,000,000	225,743,100	
66	30年国債	385,000,000	257,888,400	
67	30年国債	350,000,000	247,044,000	
68	30年国債	380,000,000	266,710,600	
69	30年国債	370,000,000	265,804,300	
70	30年国債	360,000,000	257,425,200	
71	30年国債	380,000,000	270,457,400	
72	30年国債	360,000,000	255,024,000	
73	30年国債	380,000,000	267,934,200	
74	30年国債	370,000,000	282,761,400	
75	30年国債	410,000,000	338,045,000	
76	30年国債	360,000,000	303,613,200	
77	30年国債	370,000,000	326,920,900	
78	30年国債	360,000,000	302,238,000	
79	30年国債	370,000,000	294,257,300	

8 0	3 0 年国債	330,000,000	304,131,300	
8 1	3 0 年国債	360,000,000	315,810,000	
8 2	3 0 年国債	370,000,000	340,092,900	
8 3	3 0 年国債	40,000,000	40,217,200	
8 4	2 0 年国債	424,000,000	433,798,640	
8 5	2 0 年国債	332,000,000	341,349,120	
8 8	2 0 年国債	329,000,000	340,534,740	
9 0	2 0 年国債	418,000,000	433,620,660	
9 2	2 0 年国債	295,000,000	306,490,250	
9 3	2 0 年国債	242,000,000	251,694,520	
9 7	2 0 年国債	270,000,000	284,218,200	
9 9	2 0 年国債	177,000,000	186,366,840	
1 0 0	2 0 年国債	130,000,000	137,737,600	
1 0 2	2 0 年国債	255,000,000	272,941,800	
1 0 5	2 0 年国債	237,000,000	251,603,940	
1 0 7	2 0 年国債	248,000,000	263,896,800	
1 0 9	2 0 年国債	215,000,000	227,444,200	
1 1 1	2 0 年国債	393,000,000	421,940,520	
1 1 3	2 0 年国債	295,000,000	316,340,300	
1 1 4	2 0 年国債	23,000,000	24,728,910	
1 1 6	2 0 年国債	220,000,000	238,398,600	
1 1 8	2 0 年国債	145,000,000	155,873,550	
1 1 9	2 0 年国債	60,000,000	63,802,200	
1 2 1	2 0 年国債	200,000,000	214,248,000	
1 2 2	2 0 年国債	225,000,000	239,703,750	
1 2 3	2 0 年国債	205,000,000	222,476,250	
1 2 4	2 0 年国債	30,000,000	32,373,900	
1 2 5	2 0 年国債	175,000,000	191,395,750	
1 2 6	2 0 年国債	185,000,000	199,925,800	
1 2 7	2 0 年国債	190,000,000	204,128,400	
1 2 9	2 0 年国債	40,000,000	42,749,600	
1 3 0	2 0 年国債	300,000,000	320,793,000	
1 3 1	2 0 年国債	25,000,000	26,563,750	
1 3 2	2 0 年国債	270,000,000	287,045,100	
1 3 3	2 0 年国債	235,000,000	251,475,850	
1 3 4	2 0 年国債	163,000,000	174,537,140	
1 3 5	2 0 年国債	285,000,000	303,123,150	
1 3 6	2 0 年国債	205,000,000	216,484,100	
1 3 7	2 0 年国債	190,000,000	202,082,100	
1 3 9	2 0 年国債	200,000,000	211,240,000	
1 4 0	2 0 年国債	560,000,000	595,543,200	
1 4 1	2 0 年国債	1,100,000,000	1,169,982,000	
1 4 2	2 0 年国債	730,000,000	782,143,900	
1 4 3	2 0 年国債	240,000,000	253,252,800	
1 4 4	2 0 年国債	285,000,000	298,457,700	

145	20年国債	392,000,000	416,770,480	
146	20年国債	350,000,000	372,067,500	
147	20年国債	290,000,000	305,454,100	
148	20年国債	342,000,000	356,709,420	
149	20年国債	477,000,000	496,666,710	
150	20年国債	535,000,000	551,140,950	
151	20年国債	580,000,000	584,860,400	
152	20年国債	570,000,000	573,511,200	
153	20年国債	592,000,000	600,299,840	
154	20年国債	745,000,000	746,095,150	
155	20年国債	530,000,000	518,340,000	
156	20年国債	540,000,000	491,632,200	
157	20年国債	583,000,000	515,389,490	
158	20年国債	545,000,000	497,465,100	
159	20年国債	538,000,000	494,916,960	
160	20年国債	540,000,000	501,033,600	
161	20年国債	555,000,000	506,254,350	
162	20年国債	595,000,000	540,081,500	
163	20年国債	575,000,000	519,621,750	
164	20年国債	635,000,000	563,441,850	
165	20年国債	585,000,000	516,584,250	
166	20年国債	520,000,000	470,106,000	
167	20年国債	555,000,000	485,020,050	
168	20年国債	455,000,000	389,566,450	
169	20年国債	585,000,000	490,329,450	
170	20年国債	470,000,000	391,726,200	
171	20年国債	495,000,000	410,226,300	
172	20年国債	480,000,000	402,182,400	
173	20年国債	520,000,000	433,279,600	
174	20年国債	575,000,000	476,416,250	
175	20年国債	550,000,000	460,977,000	
176	20年国債	540,000,000	450,138,600	
177	20年国債	530,000,000	431,679,700	
178	20年国債	540,000,000	445,429,800	
179	20年国債	520,000,000	426,524,800	
180	20年国債	540,000,000	465,231,600	
181	20年国債	525,000,000	458,283,000	
182	20年国債	560,000,000	503,988,800	
183	20年国債	510,000,000	481,149,300	
184	20年国債	540,000,000	482,544,000	
185	20年国債	480,000,000	427,224,000	
186	20年国債	390,000,000	370,968,000	
187	20年国債	430,000,000	394,004,700	
188	20年国債	380,000,000	365,788,000	
189	20年国債	180,000,000	181,836,000	

	国債証券 小計		99,040,149,280	
地方債証券	7 9 2 東京都公債	300,000,000	291,341,100	
	7 9 3 東京都公債	200,000,000	193,563,400	
	8 東京都30年	100,000,000	108,719,600	
	1 3 東京都30年	200,000,000	204,163,000	
	6 東京都20年	400,000,000	404,622,000	
	7 東京都20年	100,000,000	102,030,100	
	1 1 東京都20年	100,000,000	104,418,100	
	2 6 - 1 3 北海道公債	100,000,000	100,125,400	
	2 9 - 5 北海道公債	100,000,000	98,924,200	
	3 0 - 1 8 北海道公債	200,000,000	195,108,000	
	2 2 2 神奈川県公債	100,000,000	99,193,000	
	2 3 3 神奈川県公債	100,000,000	98,541,200	
	7 神奈川県20年	200,000,000	208,820,000	
	3 9 5 大阪府公債	200,000,000	200,295,800	
	3 9 7 大阪府公債	100,000,000	100,208,800	
	4 0 7 大阪府公債	100,000,000	99,354,800	
	4 2 5 大阪府公債	200,000,000	197,577,800	
	1 7 0 大阪府5年	300,000,000	299,458,800	
	2 7 - 1 1 京都府公債	200,000,000	200,238,200	
	1 兵庫県公債15年	200,000,000	204,572,600	
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	100,238,500	
	5 兵庫県公債15年	100,000,000	102,546,700	
	9 兵庫県公債20年	200,000,000	215,666,400	
	2 6 - 1 0 静岡県公債	100,000,000	100,115,900	
	8 静岡県15年	100,000,000	100,397,800	
	7 静岡県30年	100,000,000	101,988,400	
	1 静岡県20年	100,000,000	102,049,300	
	2 1 - 1 6 愛知県20年	100,000,000	107,799,200	
	2 2 - 4 愛知県20年	100,000,000	107,500,900	
	2 6 - 1 4 愛知県公債	100,000,000	100,125,800	
	2 6 - 1 8 愛知県公債	100,000,000	100,164,400	
	2 7 - 1 6 愛知県公債	200,000,000	200,196,600	
	2 9 - 1 6 愛知県公債	100,000,000	98,827,400	
	3 0 - 2 広島県公債	200,000,000	196,410,200	
	2 7 - 7 埼玉県公債	400,000,000	400,471,200	
	3 0 - 4 埼玉県公債	100,000,000	98,338,200	
	6 埼玉県20年	100,000,000	106,593,300	
	1 3 埼玉県20年	100,000,000	104,973,600	
	1 4 埼玉県20年	100,000,000	104,044,600	
	3 0 - 6 福岡県公債	100,000,000	97,986,500	
1 - 3 福岡県30年	100,000,000	67,337,000		
2 6 - 5 千葉県公債	200,000,000	200,270,800		
2 7 - 6 千葉県公債	100,000,000	100,117,800		
2 8 - 1 千葉県公債	100,000,000	99,283,600		

2 - 7	千葉県公債	100,000,000	96,236,400	
1 1	群馬県公債	100,000,000	100,115,900	
1 4 0	共同発行地方	100,000,000	100,115,900	
1 4 9	共同発行地方	100,000,000	100,143,600	
1 5 4	共同発行地方	150,000,000	149,996,100	
1 7 0	共同発行地方	400,000,000	395,972,000	
1 7 2	共同発行地方	200,000,000	198,078,000	
1 7 5	共同発行地方	200,000,000	197,719,000	
1 7 6	共同発行地方	100,000,000	98,713,100	
1 7 9	共同発行地方	100,000,000	98,733,900	
1 8 3	共同発行地方	600,000,000	590,088,000	
1 8 5	共同発行地方	200,000,000	196,837,600	
3 0 - 6	大阪市公債	100,000,000	98,352,900	
6	大阪市20年	100,000,000	106,661,500	
4 9 4	名古屋市債	400,000,000	400,440,000	
1	名古屋市15年	200,000,000	204,627,200	
3 3	名古屋市5年	300,000,000	298,116,000	
1	京都市15年	100,000,000	99,957,400	
8	京都市20年	100,000,000	107,758,600	
2 6 - 3	神戸市20年	100,000,000	103,311,100	
2 7 - 1	横浜市公債	100,000,000	100,189,700	
9	横浜市20年	100,000,000	103,481,400	
1 6	横浜市20年	100,000,000	106,961,000	
2 1	横浜市20年	100,000,000	106,986,700	
2 - 7	札幌市公債	100,000,000	95,824,600	
9 1	川崎市公債	100,000,000	98,145,200	
2 - 1	北九州市5年	200,000,000	199,175,400	
2 7 - 5	福岡市公債	100,000,000	100,126,700	
2 0 2 0 - 9	福岡市5年	100,000,000	99,469,100	
2 7 - 1	三重県公債	100,000,000	100,108,100	
2 7 - 2	福井県公債	100,000,000	100,116,600	
3 0 - 2	岡山県公債	100,000,000	97,688,500	
	地方債証券 小計		11,674,967,200	
特殊債券	6 6 日本政策投資CO	100,000,000	99,234,900	
	1 2 4 日本政策投資	200,000,000	192,347,200	
	4 2 政保政策投資C	100,000,000	98,609,300	
	6 0 政保政策投資C	100,000,000	98,736,800	
	4 道路機構	100,000,000	112,584,900	
	2 2 道路機構	200,000,000	219,409,200	
	2 7 道路機構	100,000,000	105,339,900	
	3 7 道路機構	700,000,000	745,313,100	
	1 3 5 道路機構	200,000,000	201,146,600	
	7 4 政保道路機構	100,000,000	105,448,300	
	7 9 政保道路機構	100,000,000	106,524,600	
	9 2 政保道路機構	100,000,000	107,075,800	

9 9	政保道路機構	100,000,000	107,886,900	
1 2 7	政保道路機構	200,000,000	215,303,600	
1 8 5	政保道路機構	100,000,000	106,384,200	
2 1 0	政保道路機構	400,000,000	417,291,200	
2 2 1	政保道路機構	100,000,000	103,288,600	
2 4 6	政保道路機構	100,000,000	99,569,500	
3 3 3	政保道路機構	100,000,000	98,588,300	
3 3 9	政保道路機構	100,000,000	98,604,400	
3 5 4	政保道路機構	200,000,000	196,071,400	
4 3 8	政保道路機構	100,000,000	98,175,900	
4 2	道路債券	100,000,000	101,254,200	
4	地方公共団 2 0 年	100,000,000	106,801,700	
1 8	地方公共団 2 0	200,000,000	211,269,800	
F 2 8 1	地方公共団体	100,000,000	98,734,400	
7 6	政保地方公共団	200,000,000	200,138,000	
4 8	地方公共団 2 0	100,000,000	97,168,800	
1 0 2	地方公共団体	100,000,000	98,465,600	
1 0 6	地方公共団体	300,000,000	294,802,500	
1 1 2	地方公共団体	100,000,000	98,106,300	
2 9	地方公共団 5 年	100,000,000	98,848,100	
3 0	地方公共団 5 年	300,000,000	295,819,800	
1 6	公営企業 2 0 年	100,000,000	102,253,200	
1 8	公営企業 2 0 年	100,000,000	103,740,500	
2 2	公営企業 2 0 年	200,000,000	209,597,600	
9 7	都市再生	200,000,000	201,983,000	
1 1 7	都市再生	100,000,000	99,526,800	
6	福祉医療機構	100,000,000	101,175,200	
3 3	政保中部空港	100,000,000	98,810,400	
2 3 9	政保預金保険	600,000,000	598,393,200	
1 1 7	住宅支援機構	100,000,000	102,427,800	
1 3 0	住宅支援機構	100,000,000	105,440,200	
1 9 0	住宅支援機構	100,000,000	99,073,000	
1 9 9	住宅支援機構	300,000,000	296,994,900	
2 2 2	住宅支援機構	200,000,000	197,013,200	
2 2 6	住宅支援機構	200,000,000	197,104,400	
2 9	住宅機構 R M B S	17,596,000	18,255,850	
3 2	住宅機構 R M B S	16,996,000	17,534,773	
3 7	住宅機構 R M B S	17,088,000	17,576,716	
4 9	住宅機構 R M B S	16,013,000	16,450,154	
5 1	住宅機構 R M B S	17,545,000	17,988,888	
5 5	住宅機構 R M B S	23,439,000	23,823,399	
5 7	住宅機構 R M B S	22,407,000	22,810,326	
5 9	住宅機構 R M B S	23,780,000	24,210,418	
6 7	住宅機構 R M B S	31,268,000	31,149,181	
6 9	住宅機構 R M B S	32,752,000	32,932,136	



7 0	住宅機構 R M B S	28,350,000	28,585,305	
7 3	住宅機構 R M B S	32,187,000	32,428,402	
8 8	住宅機構 R M B S	36,499,000	36,013,563	
1 1 3	住宅機構 R M B S	65,323,000	61,351,361	
1 2 3	住宅機構 R M B S	68,324,000	63,978,593	
1 2 4	住宅機構 R M B S	67,832,000	63,327,955	
1 2 5	住宅機構 R M B S	67,574,000	63,080,329	
1 3 2	住宅機構 R M B S	69,227,000	64,325,728	
1 3 8	住宅機構 R M B S	71,778,000	66,997,585	
1 4 6	住宅機構 R M B S	76,483,000	69,538,343	
1 5 1	住宅機構 R M B S	80,085,000	72,845,316	
1 5 7	住宅機構 R M B S	80,122,000	73,231,508	
1 6 0	住宅機構 R M B S	82,327,000	75,271,576	
1 6 6	住宅機構 R M B S	169,954,000	155,728,850	
1 8 3	住宅機構 R M B S	181,508,000	168,384,970	
1 8 8	住宅機構 R M B S	92,571,000	89,636,499	
1 9 8	住宅機構 R M B S	96,718,000	95,180,183	
8 5	中日本高速道	100,000,000	99,507,900	
7 8	鉄道建設・運	100,000,000	99,716,900	
	特殊債券 小計		9,649,739,907	
社債券	8 6 東日本高速道	200,000,000	197,292,800	
	9 0 中日本高速道	300,000,000	296,756,700	
	1 0 7 中日本高速道	100,000,000	99,588,000	
	6 1 西日本高速道	200,000,000	197,949,000	
	8 4 西日本高速道	200,000,000	197,599,800	
	8 7 西日本高速道	200,000,000	198,881,600	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	98,771,900	
	1 7 アサヒグループHD	100,000,000	98,733,700	
	9 サントリーホールディング	100,000,000	98,761,500	
	3 0 東レ	100,000,000	98,794,300	
	1 2 旭化成	200,000,000	192,841,000	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,328,800	
	2 1 富士フィルムホールデイ	200,000,000	199,043,200	
	1 1 プリヂストン	200,000,000	197,603,000	
	3 2 住友電工	100,000,000	97,718,200	
	1 6 小松製作所	100,000,000	97,995,900	
	7 ジェイテクト	100,000,000	98,128,300	
	2 2 日立製作所	100,000,000	98,755,700	
	3 8 ソニーG	100,000,000	98,953,000	
	9 TDK	100,000,000	96,763,100	
	5 1 住友商事	100,000,000	101,167,600	
	1 三井住友FG劣後	100,000,000	100,038,000	
	1 7 NTTファイナンス	200,000,000	196,425,800	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	197,213,400	
	1 0 1 トヨタファイナンス	200,000,000	197,962,400	

207	オリックス	200,000,000	197,499,200	
2	三菱HCキャピタル	200,000,000	197,066,400	
65	三菱地所	100,000,000	106,014,400	
135	三菱地所	200,000,000	188,639,600	
11	東急	100,000,000	94,532,000	
38	京王電鉄	100,000,000	98,485,900	
126	東日本旅客鉄	200,000,000	196,508,000	
163	東日本旅客鉄	300,000,000	297,136,200	
185	東日本旅客鉄	100,000,000	95,090,100	
13	西日本旅客鉄	100,000,000	104,136,700	
26	西日本旅客鉄	100,000,000	107,129,300	
60	西日本旅客鉄	100,000,000	96,022,800	
32	東海旅客鉄道	100,000,000	104,712,100	
52	東海旅客鉄道	100,000,000	106,333,900	
45	東京地下鉄	200,000,000	190,936,800	
64	阪急阪神HLDG	100,000,000	98,656,500	
15	九州旅客鉄道	200,000,000	196,959,600	
31	KDDI	200,000,000	197,643,400	
546	中部電力	200,000,000	187,829,800	
553	中部電力	100,000,000	98,912,700	
550	関西電力	300,000,000	297,037,500	
560	関西電力	200,000,000	197,873,200	
508	東北電力	200,000,000	195,544,200	
547	東北電力	100,000,000	97,735,000	
496	九州電力	200,000,000	187,007,200	
56	東京電力PG	200,000,000	199,744,400	
66	東京電力PG	100,000,000	95,579,900	
41	大阪瓦斯	300,000,000	283,293,300	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	98,237,300	
	社債券 小計		8,264,364,100	
	合計		128,629,220,487	

## 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。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年7月31日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金	50,197,100
金銭信託	1,075,639
コール・ローン	228,022,546
国債証券	26,732,479,385
派生商品評価勘定	1,218,673,793

未収入金	1,440,000,000
未収利息	184,858,027
前払費用	32,211,955
流動資産合計	29,887,518,445
資産合計	29,887,518,445
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,291,552
未払金	988,163,227
未払解約金	489,751,850
流動負債合計	1,493,206,629
負債合計	1,493,206,629
純資産の部	
元本等	
元本	23,307,816,095
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,086,495,721
元本等合計	28,394,311,816
純資産合計	28,394,311,816
負債純資産合計	29,887,518,445

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	23,307,816,095口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2182円 (1万口当たりの純資産額12,182円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	544,816,015	-	536,459,860	8,356,155
	カナダ・ドル	19,488,060	-	19,210,443	277,617
	オーストラリア・ドル	14,102,881	-	13,867,550	235,331
	シンガポール・ドル	6,010,656	-	5,956,364	54,292
	ニュージーランド・ドル	4,698,354	-	4,665,221	33,133
	イギリス・ポンド	57,932,423	-	57,160,134	772,289
	イスラエル・シケル	5,527,133	-	5,450,728	76,405
	デンマーク・クローネ	231,611	-	220,883	10,728
	ノルウェー・クローネ	150,662	-	139,217	11,445
	メキシコ・ペソ	6,750,624	-	6,633,341	117,283
	オフショア・人民元	99,600,520	-	98,969,310	631,210
	ポーランド・ズロチ	6,483,307	-	6,419,220	64,087
	ユーロ	337,371,164	-	332,719,587	4,651,577
	小計	1,103,163,410	-	1,087,871,858	15,291,552
	売建				
	アメリカ・ドル	13,153,381,601	-	12,539,610,027	613,771,574
	カナダ・ドル	558,482,302	-	525,563,946	32,918,356
	オーストラリア・ドル	362,848,359	-	338,551,898	24,296,461
	シンガポール・ドル	248,146,932	-	238,560,000	9,586,932
	ニュージーランド・ドル	68,895,698	-	63,852,643	5,043,055
	イギリス・ポンド	1,461,831,752	-	1,414,344,891	47,486,861
	イスラエル・シケル	86,615,080	-	83,034,528	3,580,552
	デンマーク・クローネ	72,347,201	-	69,357,262	2,989,939
	ノルウェー・クローネ	43,313,673	-	40,094,496	3,219,177
	スウェーデン・クローナ	43,886,311	-	41,044,570	2,841,741
	メキシコ・ペソ	217,428,374	-	202,378,419	15,049,955
	オフショア・人民元	2,861,566,706	-	2,745,642,801	115,923,905
	ポーランド・ズロチ	155,390,470	-	150,151,820	5,238,650
	ユーロ	8,520,942,935	-	8,184,216,300	336,726,635
	小計	27,855,077,394	-	26,636,403,601	1,218,673,793
合 計		28,958,240,804	-	27,724,275,459	1,203,382,241

## （注）１．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価していません。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（2024年7月31日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	21,733,942,553円
同期中における追加設定元本額	14,353,060,354円
同期中における一部解約元本額	12,779,186,812円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,058,772,370円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,088,281,521円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	785,754,899円
イオン・バランス戦略ファンド	1,175,889,838円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	1,648,719,864円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	805,739,895円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	1,698,346,416円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	500,278,204円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	97,175,055円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	127,986,090円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	336,645,373円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	11,708,796円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	130,283,611円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	323,554,871円

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	163,765,533円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	14,528,793円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	983,593,806円
S M A M ・ ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	7,936,458,586円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	814,038,896円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 <適格機関投資家限定>	440,569,429円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	702,209,706円
S M D A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) <適格機関投資家限定>	463,514,543円
合 計	23,307,816,095円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 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 06/30/25	650,000.00	623,623.00	
		T 0.25 07/31/25	350,000.00	334,656.00	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	562,134.30	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	275,459.40	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	397,719.00	
		T 0.375 01/31/26	570,000.00	535,720.20	
		T 0.375 07/31/27	100,000.00	89,394.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	417,858.20	
		T 0.375 11/30/25	510,000.00	482,194.80	
		T 0.375 12/31/25	500,000.00	471,415.00	
		T 0.5 02/28/26	550,000.00	516,538.00	
		T 0.5 05/31/27	80,000.00	72,184.00	
		T 0.5 06/30/27	310,000.00	279,000.00	
		T 0.5 08/31/27	340,000.00	304,300.00	
		T 0.5 10/31/27	400,000.00	356,100.00	
		T 0.625 03/31/27	120,000.00	109,242.00	
		T 0.625 05/15/30	500,000.00	412,095.00	
		T 0.625 07/31/26	710,000.00	659,618.40	
		T 0.625 08/15/30	750,000.00	613,177.50	
		T 0.625 11/30/27	280,000.00	249,653.60	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	311,293.50	
		T 0.75 01/31/28	460,000.00	409,910.60	
		T 0.75 03/31/26	530,000.00	498,496.80	
		T 0.75 04/30/26	500,000.00	469,165.00	
T 0.75 05/31/26	2,010,000.00	1,881,098.70			
T 0.75 08/31/26	460,000.00	427,358.40			
T 0.875 06/30/26	390,000.00	365,114.10			



T 0.875 09/30/26	540,000.00	502,113.60	
T 0.875 11/15/30	710,000.00	585,941.70	
T 1.125 02/15/31	530,000.00	441,998.80	
T 1.125 02/28/27	30,000.00	27,741.60	
T 1.125 02/29/28	540,000.00	486,653.40	
T 1.125 05/15/40	930,000.00	587,071.80	
T 1.125 08/15/40	210,000.00	131,384.40	
T 1.125 08/31/28	650,000.00	578,207.50	
T 1.125 10/31/26	130,000.00	121,214.60	
T 1.25 03/31/28	460,000.00	415,527.20	
T 1.25 04/30/28	280,000.00	252,408.80	
T 1.25 05/15/50	500,000.00	253,915.00	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	521,860.80	
T 1.25 06/30/28	330,000.00	296,297.10	
T 1.25 08/15/31	620,000.00	513,397.20	
T 1.25 09/30/28	570,000.00	508,713.60	
T 1.25 11/30/26	420,000.00	391,960.80	
T 1.25 12/31/26	850,000.00	792,191.50	
T 1.375 08/15/50	450,000.00	235,701.00	
T 1.375 08/31/26	240,000.00	225,880.80	
T 1.375 10/31/28	500,000.00	447,740.00	
T 1.375 11/15/31	640,000.00	531,187.20	
T 1.375 11/15/40	450,000.00	291,442.50	
T 1.375 12/31/28	510,000.00	454,945.50	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	498,100.20	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	341,502.20	
T 1.625 05/15/26	120,000.00	114,224.40	
T 1.625 05/15/31	230,000.00	196,905.30	
T 1.625 08/15/29	220,000.00	196,009.00	
T 1.625 09/30/26	110,000.00	103,928.00	
T 1.625 11/15/50	140,000.00	78,449.00	
T 1.625 11/30/26	350,000.00	329,455.00	
T 1.75 01/31/29	450,000.00	407,484.00	
T 1.75 08/15/41	210,000.00	142,245.60	
T 1.875 02/15/32	750,000.00	642,562.50	
T 1.875 02/15/41	320,000.00	224,272.00	
T 1.875 02/15/51	390,000.00	233,036.70	
T 1.875 02/28/27	530,000.00	499,657.50	
T 1.875 02/28/29	480,000.00	436,488.00	
T 1.875 06/30/26	200,000.00	190,842.00	
T 1.875 11/15/51	470,000.00	279,043.70	
T 2 02/15/50	570,000.00	354,408.90	
T 2 08/15/51	460,000.00	282,467.60	
T 2 11/15/26	490,000.00	465,661.70	

T 2 11/15/41	170,000.00	119,540.60	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	307,200.00	
T 2.25 02/15/52	300,000.00	195,603.00	
T 2.25 05/15/41	220,000.00	163,026.60	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	170,657.50	
T 2.375 02/15/42	200,000.00	149,018.00	
T 2.375 03/31/29	90,000.00	83,573.10	
T 2.375 04/30/26	50,000.00	48,267.50	
T 2.375 05/15/29	100,000.00	92,712.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	397,300.10	
T 2.375 11/15/49	180,000.00	122,279.40	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	160,461.40	
T 2.5 02/15/46	220,000.00	158,708.00	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	165,455.10	
T 2.625 01/31/26	230,000.00	223,638.20	
T 2.625 05/31/27	180,000.00	172,524.60	
T 2.625 07/31/29	220,000.00	205,858.40	
T 2.625 12/31/25	110,000.00	107,072.90	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	401,032.80	
T 2.75 04/30/27	1,140,000.00	1,097,284.20	
T 2.75 05/31/29	1,000,000.00	942,920.00	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	336,052.50	
T 2.75 08/15/32	580,000.00	526,413.80	
T 2.75 08/15/42	230,000.00	180,745.50	
T 2.75 08/15/47	250,000.00	186,307.50	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	185,975.00	
T 2.875 04/30/29	100,000.00	94,894.00	
T 2.875 05/15/32	850,000.00	780,903.50	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	229,970.00	
T 2.875 05/15/49	590,000.00	445,573.90	
T 2.875 05/15/52	520,000.00	389,864.80	
T 2.875 07/31/25	300,000.00	294,447.00	
T 2.875 08/15/28	300,000.00	286,488.00	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	85,356.70	
T 3 02/15/48	360,000.00	280,080.00	
T 3 02/15/49	370,000.00	286,472.50	
T 3 05/15/45	290,000.00	230,407.90	
T 3 05/15/47	300,000.00	234,726.00	
T 3 07/15/25	610,000.00	599,739.80	
T 3 08/15/52	160,000.00	123,121.60	
T 3 09/30/25	620,000.00	608,127.00	
T 3 11/15/44	220,000.00	175,500.60	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	125,794.50	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	333,824.40	

T 3.125 08/15/44	320,000.00	261,036.80	
T 3.125 08/31/27	430,000.00	417,147.30	
T 3.125 08/31/29	220,000.00	210,645.60	
T 3.125 11/15/28	100,000.00	96,257.00	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	176,891.40	
T 3.25 05/15/42	370,000.00	314,340.90	
T 3.25 06/30/27	100,000.00	97,511.00	
T 3.25 06/30/29	60,000.00	57,847.20	
T 3.375 05/15/33	720,000.00	680,097.60	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	255,069.00	
T 3.375 08/15/42	330,000.00	284,829.60	
T 3.375 11/15/48	300,000.00	248,982.00	
T 3.5 01/31/28	980,000.00	960,243.20	
T 3.5 01/31/30	500,000.00	486,240.00	
T 3.5 02/15/33	1,020,000.00	974,079.60	
T 3.5 02/15/39	50,000.00	45,968.50	
T 3.5 04/30/28	800,000.00	783,328.00	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	238,717.80	
T 3.625 02/15/53	150,000.00	130,513.50	
T 3.625 03/31/28	730,000.00	718,093.70	
T 3.625 03/31/30	940,000.00	919,085.00	
T 3.625 05/15/26	830,000.00	818,570.90	
T 3.625 05/15/53	250,000.00	217,577.50	
T 3.625 05/31/28	400,000.00	393,364.00	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	203,881.20	
T 3.75 12/31/28	800,000.00	789,888.00	
T 3.875 01/15/26	390,000.00	386,205.30	
T 3.875 02/15/43	450,000.00	415,314.00	
T 3.875 05/15/43	370,000.00	340,888.40	
T 3.875 08/15/33	800,000.00	784,040.00	
T 3.875 08/15/40	40,000.00	37,901.20	
T 3.875 09/30/29	200,000.00	198,300.00	
T 3.875 11/30/27	410,000.00	406,658.50	
T 3.875 11/30/29	140,000.00	138,787.60	
T 3.875 12/31/27	260,000.00	257,956.40	
T 3.875 12/31/29	320,000.00	317,097.60	
T 4 01/15/27	1,190,000.00	1,182,645.80	
T 4 01/31/29	890,000.00	887,837.30	
T 4 01/31/31	670,000.00	667,380.30	
T 4 02/15/26	640,000.00	634,912.00	
T 4 02/15/34	900,000.00	889,803.00	
T 4 02/28/30	770,000.00	767,666.90	
T 4 02/29/28	600,000.00	597,678.00	
T 4 06/30/28	370,000.00	368,782.70	

T 4 10/31/29	300,000.00	299,130.00	
T 4 11/15/42	300,000.00	282,426.00	
T 4 11/15/52	380,000.00	354,103.00	
T 4 12/15/25	300,000.00	297,624.00	
T 4.125 02/15/27	750,000.00	747,682.50	
T 4.125 03/31/29	700,000.00	702,072.00	
T 4.125 03/31/31	200,000.00	200,664.00	
T 4.125 07/31/28	170,000.00	170,224.40	
T 4.125 08/15/53	930,000.00	885,964.50	
T 4.125 09/30/27	350,000.00	349,835.50	
T 4.125 10/31/27	470,000.00	469,741.50	
T 4.125 11/15/32	730,000.00	730,919.80	
T 4.25 01/31/26	580,000.00	577,459.60	
T 4.25 02/15/54	490,000.00	477,441.30	
T 4.25 02/28/29	600,000.00	605,118.00	
T 4.25 02/28/31	750,000.00	757,890.00	
T 4.25 03/15/27	750,000.00	750,510.00	
T 4.25 05/15/39	70,000.00	69,772.50	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	138,566.40	
T 4.25 12/31/25	600,000.00	597,222.00	
T 4.375 05/15/34	650,000.00	661,927.50	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	141,050.00	
T 4.375 08/15/43	300,000.00	295,650.00	
T 4.375 11/15/39	80,000.00	80,695.20	
T 4.375 12/15/26	600,000.00	601,260.00	
T 4.5 02/15/36	50,000.00	51,930.50	
T 4.5 04/15/27	1,200,000.00	1,208,484.00	
T 4.5 05/15/27	800,000.00	806,088.00	
T 4.5 05/31/29	520,000.00	530,415.60	
T 4.5 07/15/26	750,000.00	751,650.00	
T 4.5 11/15/25	400,000.00	399,288.00	
T 4.5 11/15/33	530,000.00	544,532.60	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	103,673.00	
T 4.625 03/15/26	900,000.00	901,737.00	
T 4.625 04/30/29	300,000.00	307,365.00	
T 4.625 04/30/31	1,200,000.00	1,239,180.00	
T 4.625 05/15/44	700,000.00	711,697.00	
T 4.625 05/15/54	600,000.00	622,356.00	
T 4.625 06/15/27	570,000.00	576,919.80	
T 4.625 06/30/25	500,000.00	499,085.00	
T 4.625 09/30/30	530,000.00	545,900.00	
T 4.75 07/31/25	170,000.00	169,930.30	
T 4.75 11/15/43	980,000.00	1,013,839.40	

	アメリカ・ドル小計	89,910,000.00	82,530,761.30 (12,580,989,254)	
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	70,000.00	66,398.50	
	CAN 0.5 09/01/25	180,000.00	173,640.60	
	CAN 0.5 12/01/30	200,000.00	169,838.00	
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	131,710.60	
	CAN 1.25 03/01/27	310,000.00	294,326.40	
	CAN 1.25 06/01/30	150,000.00	134,956.50	
	CAN 1.5 06/01/26	20,000.00	19,295.00	
	CAN 1.5 06/01/31	290,000.00	260,457.70	
	CAN 1.5 12/01/31	60,000.00	53,433.60	
	CAN 1.75 12/01/53	270,000.00	192,129.30	
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	57,543.00	
	CAN 2 06/01/32	400,000.00	367,196.00	
	CAN 2 12/01/51	240,000.00	184,077.60	
	CAN 2.25 06/01/29	60,000.00	57,841.80	
	CAN 2.25 12/01/29	200,000.00	192,320.00	
	CAN 2.5 12/01/32	110,000.00	104,460.40	
	CAN 2.75 06/01/33	670,000.00	646,864.90	
	CAN 2.75 09/01/27	10,000.00	9,854.80	
	CAN 2.75 12/01/48	30,000.00	27,307.50	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	197,982.00	
	CAN 3 10/01/25	280,000.00	277,256.00	
	CAN 3.25 09/01/28	280,000.00	280,767.20	
	CAN 3.5 03/01/28	230,000.00	232,254.00	
CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	92,733.30		
CAN 4.5 11/01/25	250,000.00	251,962.50		
CAN 5 06/01/37	210,000.00	247,726.50		
CANADA 2.75 12/01/64	120,000.00	107,768.40		
	カナダ・ドル小計	5,130,000.00	4,832,102.10 (531,676,194)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	200,000.00	190,018.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	140,000.00	129,950.80	
	ACGB 1 11/21/31	240,000.00	192,588.00	
	ACGB 1 12/21/30	360,000.00	297,950.40	
	ACGB 1.25 05/21/32	400,000.00	322,240.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	190,000.00	160,306.80	
	ACGB 1.75 06/21/51	230,000.00	126,095.20	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	165,566.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	60,000.00	47,221.80	
	ACGB 2.75 06/21/35	50,000.00	43,232.50	
	ACGB 2.75 11/21/27	220,000.00	211,824.80	
	ACGB 2.75 11/21/28	140,000.00	133,344.40	
	ACGB 2.75 11/21/29	200,000.00	188,050.00	

	ACGB 3 03/21/47	80,000.00	61,088.00	
	ACGB 3 11/21/33	250,000.00	225,970.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	125,921.90	
	ACGB 3.5 12/21/34	370,000.00	345,395.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	90,000.00	84,480.30	
	ACGB 3.75 05/21/34	150,000.00	143,715.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	130,000.00	130,325.00	
	ACGB 4.75 04/21/27	80,000.00	81,569.60	
	オーストラリア・ドル小計	3,910,000.00	3,406,853.50 (339,492,951)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	40,000.00	38,648.00	
	SIGB 1.875 03/01/50	140,000.00	113,400.00	
	SIGB 1.875 10/01/51	30,000.00	24,000.90	
	SIGB 2.125 06/01/26	190,000.00	186,998.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	250,000.00	232,750.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	170,000.00	158,074.50	
	SIGB 2.625 05/01/28	200,000.00	197,900.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	40,000.00	38,760.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	150,000.00	150,000.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	440,000.00	439,824.00	
	SIGB 3 08/01/72	80,000.00	82,080.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	450,000.00	465,885.00	
	シンガポール・ドル小計	2,180,000.00	2,128,320.40 (241,904,898)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.25 05/15/28	190,000.00	164,908.60	
	NZGB 0.5 05/15/26	70,000.00	65,406.60	
	NZGB 1.75 05/15/41	90,000.00	58,528.80	
	NZGB 2 05/15/32	320,000.00	271,734.40	
	NZGB 2.75 04/15/37	80,000.00	65,692.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	30,000.00	20,568.90	
	NZGB 4.5 05/15/30	80,000.00	81,550.40	
	ニュージーランド・ドル小計	860,000.00	728,389.70 (65,555,073)	
イギリス・ ボンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	190,000.00	125,090.30	
	UKT 0.125 01/30/26	320,000.00	302,784.00	
	UKT 0.125 01/31/28	50,000.00	44,036.00	
	UKT 0.25 07/31/31	120,000.00	93,757.20	
	UKT 0.375 10/22/26	270,000.00	249,320.70	
	UKT 0.375 10/22/30	200,000.00	162,422.00	
	UKT 0.5 01/31/29	600,000.00	517,788.00	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	42,694.40	
	UKT 0.625 07/31/35	120,000.00	83,347.20	
	UKT 0.625 10/22/50	260,000.00	106,191.80	
	UKT 0.875 01/31/46	550,000.00	276,496.00	

UKT 0.875 10/22/29	160,000.00	138,176.00	
UKT 1 01/31/32	170,000.00	138,203.20	
UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	33,028.20	
UKT 1.25 07/22/27	130,000.00	120,390.40	
UKT 1.25 07/31/51	90,000.00	44,239.50	
UKT 1.25 10/22/41	340,000.00	211,208.00	
UKT 1.5 07/22/26	240,000.00	228,549.60	
UKT 1.5 07/22/47	110,000.00	62,536.10	
UKT 1.5 07/31/53	20,000.00	10,255.00	
UKT 1.625 10/22/28	70,000.00	64,137.50	
UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	59,940.40	
UKT 1.75 01/22/49	90,000.00	53,078.40	
UKT 1.75 07/22/57	120,000.00	63,879.60	
UKT 1.75 09/07/37	170,000.00	128,123.90	
UKT 2 09/07/25	30,000.00	29,213.40	
UKT 2.5 07/22/65	120,000.00	76,018.80	
UKT 3.25 01/22/44	90,000.00	75,366.00	
UKT 3.25 01/31/33	550,000.00	521,416.50	
UKT 3.5 01/22/45	120,000.00	103,617.60	
UKT 3.5 07/22/68	140,000.00	114,427.60	
UKT 3.5 10/22/25	100,000.00	98,702.00	
UKT 3.75 01/29/38	450,000.00	426,780.00	
UKT 3.75 03/07/27	100,000.00	98,912.00	
UKT 3.75 07/22/52	40,000.00	34,863.60	
UKT 3.75 10/22/53	380,000.00	329,106.60	
UKT 4 01/22/60	110,000.00	99,682.00	
UKT 4.125 01/29/27	80,000.00	79,898.40	
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	181,657.80	
UKT 4.25 06/07/32	140,000.00	143,416.00	
UKT 4.25 09/07/39	80,000.00	79,132.80	
UKT 4.25 12/07/27	80,000.00	80,802.40	
UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	85,671.90	
UKT 4.375 07/31/54	190,000.00	183,279.70	
UKT 4.5 06/07/28	160,000.00	162,760.00	
UKT 4.5 09/07/34	30,000.00	31,073.70	
UKT 4.5 12/07/42	50,000.00	50,170.00	
UKT 4.625 01/31/34	300,000.00	313,698.00	
UKT 4.75 10/22/43	120,000.00	123,674.40	
UKT 4.75 12/07/30	110,000.00	115,427.40	
UKT 4.75 12/07/38	110,000.00	115,320.70	
UKT 6 12/07/28	100,000.00	108,627.00	
イギリス・ポンド小計	8,800,000.00	7,222,389.70 (1,413,855,008)	
イスラエ	ILGOV 0.5 02/27/26	290,000.00	273,989.10

ル・シュケ ル	ILGOV 1 03/31/30	320,000.00	262,947.20	
	ILGOV 1.3 04/30/32	270,000.00	210,162.60	
	ILGOV 1.5 05/31/37	360,000.00	240,598.80	
	ILGOV 1.75 08/31/25	150,000.00	146,260.50	
	ILGOV 2 03/31/27	90,000.00	84,857.40	
	ILGOV 2.25 09/28/28	480,000.00	439,574.40	
	ILGOV 2.8 11/29/52	170,000.00	106,994.60	
	ILGOV 3.75 03/31/47	200,000.00	159,470.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	110,000.00	114,628.80	
イスラエル・シュケル小計		2,440,000.00	2,039,483.40 (83,052,659)	
デンマ ーク・クロー ネ	DGB 0 11/15/31	390,000.00	332,954.70	
	DGB 0.25 11/15/52	340,000.00	187,227.80	
	DGB 0.5 11/15/27	570,000.00	538,621.50	
	DGB 0.5 11/15/29	670,000.00	613,485.50	
	DGB 1.75 11/15/25	340,000.00	336,195.40	
	DGB 4.5 11/15/39	910,000.00	1,137,754.80	
デンマーク・クローネ小計		3,220,000.00	3,146,239.70 (69,531,897)	
ノル ウェー・ク ローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	336,784.50	
	NGB 1.375 08/19/30	480,000.00	427,104.00	
	NGB 1.5 02/19/26	370,000.00	357,275.70	
	NGB 1.75 02/17/27	290,000.00	277,753.30	
	NGB 1.75 09/06/29	170,000.00	156,903.20	
	NGB 2 04/26/28	390,000.00	370,917.30	
	NGB 2.125 05/18/32	200,000.00	182,072.00	
	NGB 3 08/15/33	620,000.00	597,642.80	
	NGB 3.5 10/06/42	160,000.00	161,600.00	
ノルウェー・クローネ小計		3,070,000.00	2,868,052.80 (39,951,977)	
スウェーデ ン・クロー ナ	SGB 0.125 05/12/31	380,000.00	336,961.20	
	SGB 0.75 05/12/28	710,000.00	679,654.60	
	SGB 0.75 11/12/29	600,000.00	565,158.00	
	SGB 1 11/12/26	420,000.00	410,100.60	
	SGB 1.75 11/11/33	400,000.00	392,396.00	
	SGB 2.25 06/01/32	200,000.00	204,200.00	
	SGB 3.5 03/30/39	290,000.00	339,949.60	
スウェーデン・クローナ小計		3,000,000.00	2,928,420.00 (41,466,427)	
メキシコ・ ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	2,500,000.00	2,243,250.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,300,000.00	3,065,337.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	3,300,000.00	2,854,599.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	2,800,000.00	2,633,512.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	4,400,000.00	3,961,496.00	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,200,000.00	1,784,024.00	



	MBONO 7.75 11/23/34	920,000.00	800,225.20	
	MBONO 8 11/07/47	3,100,000.00	2,543,643.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,500,000.00	3,330,810.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	1,900,000.00	1,692,159.00	
	メキシコ・ペソ小計	27,920,000.00	24,909,055.20 (201,912,801)	
オフショ ア・人民元	CGB 1.85 05/15/27	7,800,000.00	7,830,186.00	
	CGB 2.04 02/25/27	4,300,000.00	4,335,604.00	
	CGB 2.05 04/15/29	1,500,000.00	1,510,875.00	
	CGB 2.18 08/15/26	6,000,000.00	6,065,460.00	
	CGB 2.18 08/25/25	5,600,000.00	5,640,656.00	
	CGB 2.27 05/25/34	2,000,000.00	2,024,380.00	
	CGB 2.28 03/25/31	2,700,000.00	2,744,091.00	
	CGB 2.28 11/25/25	4,800,000.00	4,848,528.00	
	CGB 2.3 05/15/26	6,400,000.00	6,482,112.00	
	CGB 2.35 02/25/34	2,700,000.00	2,744,280.00	
	CGB 2.37 01/15/29	7,700,000.00	7,861,392.00	
	CGB 2.4 07/15/28	3,300,000.00	3,366,726.00	
	CGB 2.44 10/15/27	900,000.00	918,522.00	
	CGB 2.46 02/15/26	3,600,000.00	3,649,032.00	
	CGB 2.48 04/15/27	2,800,000.00	2,856,224.00	
	CGB 2.48 09/25/28	4,300,000.00	4,406,554.00	
	CGB 2.6 09/15/30	5,400,000.00	5,580,846.00	
	CGB 2.62 06/25/30	1,900,000.00	1,964,448.00	
	CGB 2.64 01/15/28	5,400,000.00	5,550,012.00	
	CGB 2.67 05/25/33	11,000,000.00	11,470,800.00	
	CGB 2.69 08/12/26	1,200,000.00	1,226,148.00	
	CGB 2.79 12/15/29	2,800,000.00	2,919,224.00	
	CGB 2.8 03/25/30	6,000,000.00	6,260,160.00	
	CGB 2.8 11/15/32	3,300,000.00	3,474,504.00	
	CGB 2.91 10/14/28	3,500,000.00	3,647,875.00	
	CGB 3 10/15/53	1,300,000.00	1,469,442.00	
	CGB 3.02 05/27/31	2,800,000.00	2,978,948.00	
	CGB 3.03 03/11/26	1,300,000.00	1,331,707.00	
	CGB 3.12 10/25/52	3,100,000.00	3,555,483.00	
	CGB 3.19 04/15/53	4,200,000.00	4,894,848.00	
	CGB 3.69 05/17/28	2,000,000.00	2,155,780.00	
	CGB 3.72 04/12/51	3,100,000.00	3,903,334.00	
	オフショア・人民元小計	124,700,000.00	129,668,181.00 (2,730,669,257)	
ポーラン ド・ズロチ	POLGB 0 04/25/26	400,000.00	368,040.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	520,000.00	468,452.40	
	POLGB 1.25 10/25/30	820,000.00	645,413.80	
	POLGB 1.75 04/25/32	170,000.00	131,323.30	

	POLGB 2.5 07/25/27	240,000.00	222,912.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	45,967.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	480,000.00	425,568.00	
	POLGB 3.75 05/25/27	580,000.00	559,682.60	
	POLGB 6 10/25/33	230,000.00	238,696.30	
	POLGB 7.5 07/25/28	690,000.00	744,986.10	
	ポーランド・ズロチ小計	4,180,000.00	3,851,042.00 (148,022,116)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	120,000.00	110,553.60	
	BGB 0 10/22/31	10,000.00	8,241.50	
	BGB 0.1 06/22/30	290,000.00	250,531.00	
	BGB 0.35 06/22/32	50,000.00	41,506.50	
	BGB 0.4 06/22/40	190,000.00	123,745.10	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	12,667.20	
	BGB 0.8 06/22/27	170,000.00	161,600.30	
	BGB 0.8 06/22/28	220,000.00	205,931.00	
	BGB 0.9 06/22/29	160,000.00	147,809.60	
	BGB 1 06/22/26	40,000.00	38,762.80	
	BGB 1.25 04/22/33	50,000.00	44,167.50	
	BGB 1.4 06/22/53	200,000.00	126,272.00	
	BGB 1.45 06/22/37	20,000.00	16,576.60	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	72,188.00	
	BGB 1.7 06/22/50	30,000.00	21,280.80	
	BGB 1.9 06/22/38	60,000.00	51,687.00	
	BGB 2.75 04/22/39	110,000.00	104,704.60	
	BGB 3 06/22/33	100,000.00	101,348.00	
	BGB 3 06/22/34	140,000.00	141,422.40	
	BGB 3.45 06/22/43	320,000.00	326,272.00	
	BGB 3.5 06/22/55	50,000.00	49,880.00	
	BGB 3.75 06/22/45	100,000.00	106,003.00	
	BGB 4 03/28/32	130,000.00	141,003.20	
	BGB 4.5 03/28/26	150,000.00	154,171.50	
	BGB 5.5 03/28/28	80,000.00	88,019.20	
	BKO 2.9 06/18/26	380,000.00	381,968.40	
	BKO 3.1 09/18/25	140,000.00	140,270.20	
	BTPS 0 04/01/26	60,000.00	57,091.80	
	BTPS 0 08/01/26	200,000.00	188,584.00	
	BTPS 0.25 03/15/28	180,000.00	163,240.20	
	BTPS 0.45 02/15/29	170,000.00	151,283.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	260,000.00	250,364.40	
	BTPS 0.6 08/01/31	50,000.00	41,538.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	120,000.00	114,153.60	
	BTPS 0.9 04/01/31	260,000.00	222,814.80	
	BTPS 0.95 06/01/32	180,000.00	149,794.20	

BTPS 0.95 08/01/30	520,000.00	455,218.40	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	197,584.80	
BTPS 0.95 12/01/31	100,000.00	84,449.00	
BTPS 1.1 04/01/27	130,000.00	123,875.70	
BTPS 1.35 04/01/30	170,000.00	153,817.70	
BTPS 1.45 03/01/36	20,000.00	15,682.00	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	83,772.00	
BTPS 1.6 06/01/26	130,000.00	126,860.50	
BTPS 1.65 03/01/32	20,000.00	17,711.60	
BTPS 1.8 03/01/41	60,000.00	43,906.80	
BTPS 2 02/01/28	190,000.00	183,910.50	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	217,019.00	
BTPS 2.05 08/01/27	160,000.00	155,928.00	
BTPS 2.1 07/15/26	150,000.00	147,567.00	
BTPS 2.15 03/01/72	140,000.00	86,086.00	
BTPS 2.15 09/01/52	100,000.00	67,058.00	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	144,768.60	
BTPS 2.45 09/01/50	80,000.00	58,470.40	
BTPS 2.5 11/15/25	20,000.00	19,861.60	
BTPS 2.5 12/01/32	290,000.00	269,992.90	
BTPS 2.65 12/01/27	240,000.00	237,652.80	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	119,067.00	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	66,646.80	
BTPS 2.8 06/15/29	250,000.00	246,325.00	
BTPS 2.8 12/01/28	20,000.00	19,818.00	
BTPS 2.95 02/15/27	500,000.00	499,680.00	
BTPS 2.95 09/01/38	200,000.00	178,932.00	
BTPS 3 08/01/29	120,000.00	119,354.40	
BTPS 3.1 03/01/40	220,000.00	196,856.00	
BTPS 3.25 03/01/38	350,000.00	325,405.50	
BTPS 3.25 09/01/46	90,000.00	78,698.70	
BTPS 3.4 04/01/28	300,000.00	304,050.00	
BTPS 3.45 03/01/48	10,000.00	8,949.60	
BTPS 3.5 01/15/26	80,000.00	80,451.20	
BTPS 3.5 02/15/31	170,000.00	171,650.70	
BTPS 3.6 09/29/25	220,000.00	221,009.80	
BTPS 3.8 04/15/26	510,000.00	516,482.10	
BTPS 3.85 09/01/49	10,000.00	9,467.60	
BTPS 3.85 12/15/29	410,000.00	423,120.00	
BTPS 4 04/30/35	30,000.00	30,822.30	
BTPS 4 10/30/31	120,000.00	125,005.20	
BTPS 4.05 10/30/37	350,000.00	356,254.50	
BTPS 4.2 03/01/34	200,000.00	209,210.00	
BTPS 4.4 05/01/33	440,000.00	468,890.40	

BTPS 4.45 09/01/43	430,000.00	446,666.80	
BTPS 4.5 03/01/26	130,000.00	132,913.30	
BTPS 4.5 10/01/53	110,000.00	113,995.20	
BTPS 4.75 09/01/28	200,000.00	213,022.00	
BTPS 5 08/01/34	170,000.00	189,176.00	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	244,211.00	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	199,636.20	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	275,612.50	
BTPS 5.75 02/01/33	240,000.00	278,856.00	
BTPS 6 05/01/31	130,000.00	151,217.30	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	210,816.40	
DBR 0 02/15/30	160,000.00	141,852.80	
DBR 0 02/15/31	350,000.00	303,800.00	
DBR 0 02/15/32	190,000.00	161,091.50	
DBR 0 05/15/35	140,000.00	108,701.60	
DBR 0 05/15/36	80,000.00	60,325.60	
DBR 0 08/15/26	220,000.00	209,222.20	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	223,970.00	
DBR 0 08/15/30	260,000.00	228,196.80	
DBR 0 08/15/30	110,000.00	96,561.30	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	171,620.00	
DBR 0 08/15/31	110,000.00	94,426.20	
DBR 0 08/15/50	100,000.00	52,221.00	
DBR 0 08/15/50	170,000.00	88,991.60	
DBR 0 08/15/52	140,000.00	69,686.40	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	204,052.20	
DBR 0 11/15/28	310,000.00	282,078.30	
DBR 0.25 02/15/29	160,000.00	146,612.80	
DBR 0.25 08/15/28	100,000.00	92,439.00	
DBR 0.5 02/15/26	100,000.00	96,770.00	
DBR 0.5 02/15/28	100,000.00	94,051.00	
DBR 1 05/15/38	800,000.00	661,424.00	
DBR 1.25 08/15/48	120,000.00	92,138.40	
DBR 1.7 08/15/32	180,000.00	173,091.60	
DBR 1.8 08/15/53	310,000.00	262,306.50	
DBR 2.1 11/15/29	220,000.00	218,306.00	
DBR 2.2 02/15/34	480,000.00	475,430.40	
DBR 2.3 02/15/33	290,000.00	290,887.40	
DBR 2.3 02/15/33	260,000.00	260,902.20	
DBR 2.5 07/04/44	330,000.00	326,221.50	
DBR 2.5 08/15/46	230,000.00	227,260.70	
DBR 2.6 05/15/41	260,000.00	261,344.20	
DBR 4 01/04/37	140,000.00	163,062.20	
DBR 4.25 07/04/39	90,000.00	109,161.00	

DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	185,609.40	
DBR 4.75 07/04/40	130,000.00	167,453.00	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	177,203.20	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	156,205.40	
DBR 6.5 07/04/27	90,000.00	100,314.90	
FRTR 0 02/25/26	310,000.00	296,648.30	
FRTR 0 02/25/27	800,000.00	746,528.00	
FRTR 0 05/25/32	890,000.00	713,708.80	
FRTR 0 11/25/29	540,000.00	467,839.80	
FRTR 0 11/25/30	750,000.00	630,907.50	
FRTR 0 11/25/31	630,000.00	513,594.90	
FRTR 0.25 11/25/26	150,000.00	141,708.00	
FRTR 0.5 05/25/26	270,000.00	259,197.30	
FRTR 0.5 05/25/29	300,000.00	270,102.00	
FRTR 0.5 05/25/40	290,000.00	190,730.10	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	29,551.20	
FRTR 0.5 06/25/44	150,000.00	88,167.00	
FRTR 0.75 02/25/28	400,000.00	373,676.00	
FRTR 0.75 05/25/28	390,000.00	362,664.90	
FRTR 0.75 05/25/52	180,000.00	93,713.40	
FRTR 0.75 11/25/28	370,000.00	340,629.40	
FRTR 1 11/25/25	200,000.00	195,048.00	
FRTR 1.25 05/25/34	110,000.00	93,761.80	
FRTR 1.25 05/25/36	20,000.00	16,310.60	
FRTR 1.25 05/25/38	140,000.00	109,033.40	
FRTR 1.5 05/25/50	230,000.00	153,387.00	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	76,196.40	
FRTR 1.75 06/25/39	160,000.00	131,931.20	
FRTR 2 11/25/32	230,000.00	214,732.60	
FRTR 2.5 05/25/30	210,000.00	207,120.90	
FRTR 2.5 05/25/43	940,000.00	821,137.00	
FRTR 2.5 09/24/26	580,000.00	576,659.20	
FRTR 2.5 09/24/27	150,000.00	148,981.50	
FRTR 2.75 02/25/29	420,000.00	420,050.40	
FRTR 2.75 02/25/30	250,000.00	249,585.00	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	470,361.90	
FRTR 3 05/25/33	70,000.00	70,276.50	
FRTR 3 05/25/54	90,000.00	80,877.60	
FRTR 3 06/25/49	380,000.00	351,363.20	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	272,874.00	
FRTR 3.25 05/25/55	200,000.00	187,756.00	
FRTR 3.5 04/25/26	240,000.00	242,736.00	
FRTR 3.5 11/25/33	350,000.00	364,413.00	
FRTR 4 04/25/60	60,000.00	65,589.00	

FRTR 4 10/25/38	210,000.00	227,749.20	
FRTR 4.5 04/25/41	280,000.00	321,386.80	
FRTR 4.75 04/25/35	100,000.00	115,201.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	380,766.00	
FRTR 5.75 10/25/32	140,000.00	168,645.40	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	186,433.20	
IRISH 0 10/18/31	50,000.00	41,583.50	
IRISH 0.2 05/15/27	10,000.00	9,372.00	
IRISH 0.2 10/18/30	80,000.00	69,504.80	
IRISH 0.35 10/18/32	110,000.00	91,724.60	
IRISH 0.9 05/15/28	170,000.00	160,294.70	
IRISH 1 05/15/26	30,000.00	29,113.20	
IRISH 1.1 05/15/29	50,000.00	46,869.50	
IRISH 1.35 03/18/31	40,000.00	37,135.20	
IRISH 1.5 05/15/50	100,000.00	72,684.00	
IRISH 1.7 05/15/37	60,000.00	52,533.00	
IRISH 2.4 05/15/30	80,000.00	79,453.60	
IRISH 3 10/18/43	40,000.00	39,935.20	
IRISH GOVT 0.55 04/22/41	60,000.00	41,073.60	
NETHER 0 01/15/26	100,000.00	96,134.00	
NETHER 0 01/15/27	110,000.00	103,483.60	
NETHER 0 01/15/29	110,000.00	98,754.70	
NETHER 0 01/15/38	220,000.00	152,521.60	
NETHER 0 01/15/52	80,000.00	38,767.20	
NETHER 0 07/15/30	340,000.00	294,276.80	
NETHER 0.25 07/15/25	140,000.00	136,400.60	
NETHER 0.25 07/15/29	60,000.00	53,953.20	
NETHER 0.5 01/15/40	340,000.00	244,279.80	
NETHER 0.5 07/15/26	100,000.00	96,105.00	
NETHER 0.5 07/15/32	40,000.00	34,223.60	
NETHER 0.75 07/15/27	190,000.00	180,779.30	
NETHER 0.75 07/15/28	150,000.00	140,545.50	
NETHER 2 01/15/54	90,000.00	76,294.80	
NETHER 2.5 01/15/33	100,000.00	99,640.00	
NETHER 2.5 07/15/33	260,000.00	258,455.60	
NETHER 2.75 01/15/47	80,000.00	79,808.00	
NETHER 3.25 01/15/44	70,000.00	74,773.30	
NETHER 4 01/15/37	110,000.00	124,700.40	
OBL 0 04/10/26	570,000.00	545,889.00	
OBL 0 04/16/27	210,000.00	197,070.30	
OBL 0 10/09/26	410,000.00	388,639.00	
OBL 0 10/10/25	100,000.00	96,723.00	
OBL 1.3 10/15/27	390,000.00	378,023.10	
OBL 1.3 10/15/27	70,000.00	67,867.80	

OBL 2.1 04/12/29	280,000.00	277,956.00	
OBL 2.2 04/13/28	250,000.00	249,077.50	
RAGB 0 02/20/30	70,000.00	60,624.20	
RAGB 0 02/20/31	170,000.00	142,820.40	
RAGB 0 10/20/28	190,000.00	170,730.20	
RAGB 0 10/20/40	180,000.00	110,077.20	
RAGB 0.25 10/20/36	60,000.00	43,428.60	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	100,293.60	
RAGB 0.5 04/20/27	140,000.00	132,392.40	
RAGB 0.7 04/20/71	70,000.00	32,039.00	
RAGB 0.75 02/20/28	80,000.00	75,086.40	
RAGB 0.75 03/20/51	80,000.00	46,581.60	
RAGB 0.75 10/20/26	60,000.00	57,582.00	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	87,680.00	
RAGB 1.5 11/02/86	20,000.00	12,177.60	
RAGB 1.85 05/23/49	190,000.00	148,918.20	
RAGB 2.9 02/20/33	140,000.00	141,100.40	
RAGB 2.9 02/20/34	50,000.00	50,246.50	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	50,203.50	
RAGB 3.2 07/15/39	80,000.00	81,194.40	
RAGB 3.8 01/26/62	20,000.00	23,007.60	
RAGB 4.15 03/15/37	90,000.00	100,872.00	
RAGB 4.85 03/15/26	150,000.00	154,776.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	88,199.20	
RFGB 0 09/15/26	120,000.00	113,462.40	
RFGB 0 09/15/30	50,000.00	42,556.50	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	28,912.40	
RFGB 0.125 04/15/52	60,000.00	28,114.80	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	33,402.00	
RFGB 0.25 09/15/40	70,000.00	45,258.50	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	67,430.30	
RFGB 0.5 04/15/43	10,000.00	6,385.00	
RFGB 0.5 09/15/28	160,000.00	147,076.80	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	44,945.00	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	52,983.60	
RFGB 1.125 04/15/34	100,000.00	85,730.00	
RFGB 1.375 04/15/47	10,000.00	7,279.20	
RFGB 1.5 09/15/32	120,000.00	109,136.40	
RFGB 2.625 07/04/42	10,000.00	9,405.90	
RFGB 2.95 04/15/55	30,000.00	29,080.50	
SPGB 0 01/31/26	300,000.00	287,397.00	
SPGB 0 01/31/27	250,000.00	233,430.00	
SPGB 0.1 04/30/31	310,000.00	258,437.70	
SPGB 0.5 04/30/30	240,000.00	211,356.00	

SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	169,238.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000.00	89,585.00	
SPGB 0.7 04/30/32	140,000.00	118,703.20	
SPGB 0.8 07/30/27	300,000.00	283,467.00	
SPGB 0.8 07/30/29	100,000.00	90,953.00	
SPGB 0.85 07/30/37	160,000.00	118,052.80	
SPGB 1 07/30/42	350,000.00	232,526.00	
SPGB 1 10/31/50	40,000.00	22,164.40	
SPGB 1.2 10/31/40	290,000.00	207,187.60	
SPGB 1.25 10/31/30	170,000.00	154,851.30	
SPGB 1.4 04/30/28	320,000.00	305,158.40	
SPGB 1.4 07/30/28	290,000.00	275,697.20	
SPGB 1.45 04/30/29	420,000.00	396,417.00	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	172,935.00	
SPGB 1.45 10/31/71	90,000.00	44,945.10	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	183,836.40	
SPGB 1.85 07/30/35	20,000.00	17,543.00	
SPGB 1.9 10/31/52	90,000.00	61,326.00	
SPGB 1.95 04/30/26	180,000.00	177,318.00	
SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	200,413.50	
SPGB 2.35 07/30/33	100,000.00	94,705.00	
SPGB 2.5 05/31/27	340,000.00	337,521.40	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	106,639.50	
SPGB 2.8 05/31/26	320,000.00	319,616.00	
SPGB 3.15 04/30/33	200,000.00	201,964.00	
SPGB 3.25 04/30/34	300,000.00	303,306.00	
SPGB 3.45 07/30/43	270,000.00	263,268.90	
SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	119,765.10	
SPGB 3.5 05/31/29	100,000.00	103,297.00	
SPGB 3.55 10/31/33	260,000.00	269,869.60	
SPGB 3.9 07/30/39	560,000.00	586,796.00	
SPGB 4 10/31/54	50,000.00	51,465.50	
SPGB 4.2 01/31/37	130,000.00	142,001.60	
SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	142,007.60	
SPGB 4.7 07/30/41	50,000.00	57,424.00	
SPGB 5.75 07/30/32	70,000.00	83,918.80	
SPGB 6 01/31/29	70,000.00	79,639.70	
$\Sigma$ 一口小計	53,940,000.00	49,999,386.70 (8,244,398,873)	
国債証券合計		26,732,479,385 (26,732,479,385)	
合 計		26,732,479,385 (26,732,479,385)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。



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	202銘柄	44.3%	47.1%
カナダ・ドル	国債証券	27銘柄	1.9%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	21銘柄	1.2%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.9%	0.9%
ニュージーランド・ドル	国債証券	7銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券	52銘柄	5.0%	5.3%
イスラエル・シケル	国債証券	10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.1%	0.1%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.1%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	10銘柄	0.7%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	32銘柄	9.6%	10.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	10銘柄	0.5%	0.6%
ユーロ	国債証券	293銘柄	29.0%	30.8%

### 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)」に記載しております。

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

#### (1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年7月31日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		420,348,745
金銭信託		5,102,683
コール・ローン		1,081,707,620
国債証券		185,930,115,013
派生商品評価勘定		13,739,021
未収入金		1,269,512,257
未収利息		1,541,597,260
前払費用		122,716,268
流動資産合計		190,384,838,867
資産合計		190,384,838,867
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2
未払解約金		2,071,614,616
流動負債合計		2,071,614,618
負債合計		2,071,614,618
純資産の部		
元本等		
元本		81,467,863,209
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		106,845,361,040
元本等合計		188,313,224,249

純資産合計	188,313,224,249
負債純資産合計	190,384,838,867

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,467,863,209口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.3115円 (1万口当たりの純資産額23,115円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
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、当ファンドの信託約款に従い、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>

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	オーストラリア・ドル	101	-	99	2
	小計	101	-	99	2
	売建				
	アメリカ・ドル	655,308,926	-	648,151,577	7,157,349
	オーストラリア・ドル	4,263,978	-	4,211,036	52,942
	イギリス・ポンド	48,151,954	-	47,593,110	558,844
	オフショア・人民元	104,236,920	-	103,561,572	675,348
	ユーロ	475,517,071	-	470,222,533	5,294,538
小計	1,287,478,849	-	1,273,739,828	13,739,021	
合計		1,287,478,950	-	1,273,739,927	13,739,019

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2024年7月31日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	78,792,200,433円
同期中における追加設定元本額	14,618,802,638円
同期中における一部解約元本額	11,943,139,862円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	28,296,838,563円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	961,333,007円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,447,274,883円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,526,946,218円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,922,778円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,272,221円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	21,009,793円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	78,792,485円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	257,528,022円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	213,843,075円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	358,364,894円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,933,489円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	38,612,613円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	64,743,524円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,503,731円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	47,894,217円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	369,925,985円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	264,933,529円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	772,840,364円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	253,619,536円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	143,088,978円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	264,077,790円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	1,280,675,270円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	41,967,391円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	146,240,466円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	118,204,305円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,219,830円

日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	4,343,726,770円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	326,270,496円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	11,657,769円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	6,830,924円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	7,952,286円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	4,255,609円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,244,192円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	828,066円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,300,545円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	15,655,135円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	15,616,579円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,895,419円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	6,146,637,715円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	18,176,913円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,545,497,490円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,402,797,240円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,262,792,597円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	25,374,037円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	64,513,915円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	651,933,074円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	95,549,878円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	787,304,796円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,169,912,566円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,127,212,126円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,288,528,997円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	5,750,101,836円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	267,801,651円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	95,592,430円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	51,708,478円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	25,169,536円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	56,501,585円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	302,108,214円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,575,541円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,582,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,723,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	692,289,548円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	463,151,598円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	597,428,898円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	214,119,065円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	190,709,890円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	200,500,530円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	101,678,026円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	161,992,001円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	299,509,218円

SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)&lt;適格機関投資家限

定&gt;

349,805,410円

合計

81,467,863,209円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 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 06/30/25	2,400,000.00	2,302,608.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	286,848.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,899,720.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	946,950.00	
		T 0.375 01/31/26	2,500,000.00	2,349,650.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,234,850.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,267,488.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,890,960.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,828,490.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,085,760.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,255,750.00	
		T 0.5 06/30/27	2,600,000.00	2,340,000.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	890,250.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,184,840.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,120,950.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	743,232.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	3,924,336.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	3,031,508.00	
		T 0.625 12/31/27	5,600,000.00	4,980,696.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,257,549.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,407,495.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,871,740.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,393,560.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,872,380.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,324,600.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	4,043,823.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,572,213.00	
		T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,753,572.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,849,440.00	
		T 1.125 05/15/40	1,950,000.00	1,230,957.00	
		T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,939,484.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,113,425.00	
T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,449,954.00			
T 1.25 05/15/50	3,100,000.00	1,574,273.00			

T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,699,280.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,693,610.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,305,912.00	
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,677,440.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,919,608.00	
T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,423,174.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,357,010.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	564,702.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,686,440.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,066,902.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,266,775.00	
T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	892,050.00	
T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,180,836.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,835,106.00	
T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	4,044,105.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,775,822.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	10,898,911.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,708,605.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,341,062.50	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	850,320.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,793,120.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	188,260.00	
T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	2,988,216.00	
T 1.75 08/15/41	3,400,000.00	2,303,024.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,160,549.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,357,300.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,540,775.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,312,805.00	
T 1.875 02/15/51	3,800,000.00	2,270,614.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,205,350.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,546,180.00	
T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,381,825.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,959,243.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,740,956.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,208,887.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,780,774.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	950,330.00	
T 2 11/15/41	2,800,000.00	1,968,904.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,190,824.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,108,417.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,908,818.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,223,090.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,971,268.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,331,128.50	



T 2.25 08/15/49	2,200,000.00	1,455,388.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,881,680.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,145,856.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,086,252.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,642,950.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,856,540.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,225,088.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,626,221.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,290,727.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,021,118.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	721,400.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,035,845.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,873,130.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	719,370.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,139,148.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,692,792.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,600,656.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,029,292.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,362,746.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	5,060,652.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,540,048.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,320,088.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	883,476.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,811,962.00	
T 2.75 08/15/42	1,000,000.00	785,850.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,341,414.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,327,988.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	234,783.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,115,850.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,321,290.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,349,465.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,236,647.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	951,600.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,057,294.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,399,168.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,297,320.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	620,776.00	
T 2.875 11/15/46	1,000,000.00	767,850.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,443,650.00	
T 3 02/15/47	1,500,000.00	1,175,670.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,867,200.00	
T 3 02/15/49	2,300,000.00	1,780,775.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	655,904.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	715,059.00	

T 3 05/15/47	1,700,000.00	1,330,114.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,966,360.00	
T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,551,820.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,308,530.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	980,850.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,547,688.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	797,730.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	633,432.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	838,630.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,901,709.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,907,568.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,951,010.00	
T 3.125 08/15/44	700,000.00	571,018.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,585,196.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,791,453.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	842,340.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,869,054.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,892,360.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,195,190.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	425,115.00	
T 3.375 08/15/42	2,000,000.00	1,726,240.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,572,814.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	979,840.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,431,200.00	
T 3.5 02/15/33	6,100,000.00	5,825,378.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	183,874.00	
T 3.5 04/30/28	3,000,000.00	2,937,480.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,428,200.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	265,242.00	
T 3.625 02/15/53	2,700,000.00	2,349,243.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,951,070.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,173,300.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,465,575.00	
T 3.625 05/15/53	2,900,000.00	2,523,899.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,966,820.00	
T 3.625 08/15/43	500,000.00	443,220.00	
T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,261,060.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,950,830.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,327,268.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	1,014,618.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	631,036.00	
T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	987,360.00	
T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,357,136.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,248,431.00	

T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,399,592.00	
T 3.875 05/15/43	2,200,000.00	2,026,904.00	
T 3.875 08/15/33	6,000,000.00	5,880,300.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	473,765.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,280,450.00	
T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,365,416.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,486,395.00	
T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,869,718.00	
T 4 01/31/29	4,100,000.00	4,090,037.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,984,100.00	
T 4 02/15/34	5,100,000.00	5,042,217.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,495,455.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,980,650.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,990,130.00	
T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,192,168.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,595,360.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,882,840.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,422,810.00	
T 4.125 02/15/27	5,500,000.00	5,483,005.00	
T 4.125 03/31/29	3,000,000.00	3,008,880.00	
T 4.125 03/31/31	2,000,000.00	2,006,640.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,989,880.00	
T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	1,001,320.00	
T 4.125 08/15/53	3,100,000.00	2,953,215.00	
T 4.125 08/31/30	1,700,000.00	1,705,066.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,498,075.00	
T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,607,056.00	
T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,285,546.00	
T 4.25 02/15/54	3,500,000.00	3,410,295.00	
T 4.25 02/28/29	2,500,000.00	2,521,325.00	
T 4.25 02/28/31	2,000,000.00	2,021,040.00	
T 4.25 03/15/27	3,900,000.00	3,902,652.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	99,675.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,990,100.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	593,856.00	
T 4.25 12/31/25	5,800,000.00	5,773,146.00	
T 4.375 05/15/34	3,500,000.00	3,564,225.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	906,750.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	300,591.00	
T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	4,000,600.00	
T 4.375 08/15/43	2,000,000.00	1,971,000.00	
T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	1,010,870.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	302,607.00	
T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,923,256.00	

T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,932,205.00	
T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	4,008,400.00	
T 4.5 02/15/44	2,100,000.00	2,100,315.00	
T 4.5 03/31/26	2,500,000.00	2,500,175.00	
T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,059,060.00	
T 4.5 05/31/29	1,500,000.00	1,530,045.00	
T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,908,580.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	306,948.00	
T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,793,236.00	
T 4.5 11/15/33	4,800,000.00	4,931,616.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,036,730.00	
T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,504,825.00	
T 4.625 04/30/29	2,500,000.00	2,561,375.00	
T 4.625 05/15/44	700,000.00	711,697.00	
T 4.625 05/15/54	700,000.00	726,082.00	
T 4.625 05/31/31	2,900,000.00	2,994,917.00	
T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,022,880.00	
T 4.625 09/30/28	2,500,000.00	2,551,350.00	
T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,545,000.00	
T 4.625 10/15/26	2,300,000.00	2,314,536.00	
T 4.625 11/15/26	4,800,000.00	4,833,936.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	944,325.00	
T 4.75 11/15/43	2,200,000.00	2,275,966.00	
T 4.75 11/15/53	3,300,000.00	3,489,486.00	
T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,443,190.00	
T 4.875 11/30/25	1,200,000.00	1,203,744.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	524,000.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	345,248.00	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,024,880.00	
T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,062,220.00	
アメリカ・ドル小計		630,120,000.00	573,629,903.50 (87,444,142,491)
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,604,609.00
	CAN 1 06/01/27	800,000.00	752,632.00
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	379,776.00
	CAN 1.25 06/01/30	1,100,000.00	989,681.00
	CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,508,350.00
	CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,870,176.00
	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	782,749.00
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	671,335.00
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,835,980.00
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,060,433.00
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,538,560.00
	CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,782,445.20

	CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,737,846.00	
	CAN 2.75 09/01/27	2,600,000.00	2,562,248.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,183,325.00	
	CAN 2.75 12/01/55	800,000.00	716,784.00	
	CAN 3 04/01/26	400,000.00	395,964.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	891,180.00	
	CAN 3.25 12/01/33	880,000.00	881,874.40	
	CAN 3.5 03/01/34	300,000.00	307,392.00	
	CAN 3.5 08/01/25	1,300,000.00	1,294,085.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,236,444.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,414,088.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,814,130.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	471,860.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	279,700.00	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	357,519.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	628,649.00	
	カナダ・ドル小計	35,360,000.00	33,949,814.60 (3,735,498,100)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,300,000.00	1,235,117.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	185,644.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	1,300,000.00	1,047,280.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,050,000.00	3,417,066.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	274,120.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,158,962.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,222,351.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	1,600,000.00	1,472,352.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	472,218.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	691,720.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	1,200,000.00	1,155,408.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	190,492.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,692,450.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	916,320.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	813,492.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	774,904.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,733,280.00	
	ACGB 3.5 12/21/34	600,000.00	560,100.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,100,000.00	1,032,537.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,155,375.00	
ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,528,395.00		
	オーストラリア・ドル小計	26,500,000.00	23,729,583.00 (2,364,652,946)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	193,240.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	800,000.00	770,640.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	300,000.00	275,700.00	

	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	791,600.00	
	SIGB 2.625 08/01/32	200,000.00	195,740.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	969,000.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	680,400.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	100,000.00	100,000.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	600,000.00	599,760.00	
	SIGB 3.25 06/01/54	600,000.00	643,380.00	
	SIGB 3.375 05/01/34	200,000.00	207,496.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	414,120.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	892,144.00	
	シンガポール・ドル小計	6,780,000.00	6,733,220.00 (765,297,785)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	186,876.00	
	NZGB 1.5 05/15/31	200,000.00	168,452.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	1,200,000.00	780,384.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	951,070.40	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	342,815.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	954,650.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,110,670.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	720,000.00	733,953.60	
	ニュージーランド・ドル小計	6,040,000.00	5,228,871.00 (470,598,390)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	395,022.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,419,300.00	
	UKT 0.125 01/31/28	2,000,000.00	1,761,440.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,015,703.00	
	UKT 0.375 10/22/26	2,000,000.00	1,846,820.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,100,000.00	893,321.00	
	UKT 0.5 01/31/29	2,050,000.00	1,769,109.00	
	UKT 0.5 10/22/61	1,200,000.00	365,952.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,350,000.00	937,656.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	201,088.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	995,878.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	431,800.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,707,216.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	110,094.00	
	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	833,472.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,400,000.00	688,170.00	
	UKT 1.25 10/22/41	1,200,000.00	745,440.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,047,519.00	
	UKT 1.5 07/22/47	1,000,000.00	568,510.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	824,625.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	262,440.00		
UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,150,032.00		

UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	75,367.00		
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,071,158.00		
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,013,584.00		
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,339,840.00		
UKT 3.25 01/31/33	2,400,000.00	2,275,272.00		
UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,079,350.00		
UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,062,542.00		
UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	690,914.00		
UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	1,043,240.00		
UKT 3.75 03/07/27	300,000.00	296,736.00		
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,045,908.00		
UKT 3.75 10/22/53	1,300,000.00	1,125,891.00		
UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,178,060.00		
UKT 4 10/22/31	100,000.00	100,309.00		
UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,697,841.00		
UKT 4.125 07/22/29	300,000.00	302,181.00		
UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	706,447.00		
UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	512,200.00		
UKT 4.25 07/31/34	450,000.00	456,363.00		
UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	593,496.00		
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	909,027.00		
UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	589,074.00		
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,435,815.00		
UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	856,719.00		
UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,610,376.00		
UKT 4.375 07/31/54	350,000.00	337,620.50		
UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	414,316.00		
UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,053,570.00		
UKT 4.625 01/31/34	1,800,000.00	1,882,188.00		
UKT 4.75 10/22/43	700,000.00	721,434.00		
UKT 4.75 12/07/30	1,000,000.00	1,049,340.00		
UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,048,370.00		
UKT 6 12/07/28	650,000.00	706,075.50		
イギリス・ボンド小計	58,800,000.00	50,251,231.00 (9,837,180,982)		
イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	1,400,000.00	1,150,394.00	
	ILGOV 1.3 04/30/32	1,000,000.00	778,380.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	801,996.00	
	ILGOV 2 03/31/27	1,500,000.00	1,414,290.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,739,982.00	
	ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	483,810.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	2,870,460.00	
	ILGOV 3.75 09/30/27	1,000,000.00	981,950.00	
ILGOV 4 03/30/35	500,000.00	462,110.00		

	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,438,864.00	
イスラエル・シュケル小計		15,900,000.00	14,122,236.00 (575,091,343)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	426,865.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	991,206.00	
	DGB 0.5 11/15/27	6,100,000.00	5,764,195.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,944,510.00	
	DGB 1.75 11/15/25	100,000.00	98,881.00	
	DGB 2.25 11/15/33	1,200,000.00	1,195,752.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,751,960.00	
デンマーク・クローネ小計		22,100,000.00	22,173,369.00 (490,031,455)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	5,200,000.00	4,626,960.00	
	NGB 1.5 02/19/26	1,700,000.00	1,641,537.00	
	NGB 1.75 02/17/27	700,000.00	670,439.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,614,800.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,611,313.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,060,334.00	
	NGB 3.5 10/06/42	2,300,000.00	2,323,000.00	
	NGB 3.625 04/13/34	1,000,000.00	1,012,950.00	
ノルウェー・クローネ小計		22,900,000.00	21,561,333.00 (300,349,370)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	443,370.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,541,862.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,956,106.00	
	SGB 1 11/12/26	6,800,000.00	6,639,724.00	
	SGB 1.75 11/11/33	400,000.00	392,396.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	6,212,872.00	
スウェーデン・クローナ小計		20,900,000.00	21,186,330.00 (299,998,434)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	15,000,000.00	13,459,500.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,648,910.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	8,000,000.00	6,920,240.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	20,691,880.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	29,000,000.00	26,109,860.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	15,656,580.00	
	MBONO 8 11/07/47	13,000,000.00	10,666,890.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	31,000,000.00	29,501,460.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	35,624,400.00	
メキシコ・ペソ小計		195,000,000.00	176,279,720.00 (1,428,923,410)	
オフショア・人民元	CGB 1.99 03/15/26	35,000,000.00	35,266,350.00	
	CGB 2.04 02/25/27	14,000,000.00	14,115,920.00	
	CGB 2.05 04/15/29	25,000,000.00	25,181,250.00	
	CGB 2.18 08/15/26	22,800,000.00	23,048,748.00	



CGB 2.18	08/25/25	39,000,000.00	39,283,140.00		
CGB 2.27	05/25/34	17,000,000.00	17,207,230.00		
CGB 2.28	03/25/31	28,000,000.00	28,457,240.00		
CGB 2.3	05/15/26	17,000,000.00	17,218,110.00		
CGB 2.35	02/25/34	22,000,000.00	22,360,800.00		
CGB 2.37	01/15/29	19,000,000.00	19,398,240.00		
CGB 2.39	11/15/26	72,000,000.00	73,142,640.00		
CGB 2.4	07/15/28	41,000,000.00	41,829,020.00		
CGB 2.46	02/15/26	29,000,000.00	29,394,980.00		
CGB 2.48	04/15/27	9,000,000.00	9,180,720.00		
CGB 2.49	05/25/44	7,000,000.00	7,197,610.00		
CGB 2.5	07/25/27	13,000,000.00	13,285,090.00		
CGB 2.52	08/25/33	11,000,000.00	11,337,810.00		
CGB 2.54	12/25/30	27,000,000.00	27,838,080.00		
CGB 2.55	10/15/28	11,000,000.00	11,304,590.00		
CGB 2.6	09/15/30	32,000,000.00	33,071,680.00		
CGB 2.62	04/15/28	27,000,000.00	27,780,570.00		
CGB 2.62	06/25/30	22,000,000.00	22,746,240.00		
CGB 2.62	09/25/29	19,000,000.00	19,640,870.00		
CGB 2.64	01/15/28	31,500,000.00	32,375,070.00		
CGB 2.67	05/25/33	5,000,000.00	5,214,000.00		
CGB 2.67	11/25/33	15,000,000.00	15,649,200.00		
CGB 2.69	08/12/26	50,000,000.00	51,089,500.00		
CGB 2.8	03/24/29	22,000,000.00	22,883,080.00		
CGB 2.8	03/25/30	15,000,000.00	15,650,400.00		
CGB 2.8	11/15/32	21,000,000.00	22,110,480.00		
CGB 2.88	02/25/33	10,900,000.00	11,554,872.00		
CGB 2.91	10/14/28	21,000,000.00	21,887,250.00		
CGB 3	10/15/53	8,000,000.00	9,042,720.00		
CGB 3.02	05/27/31	38,400,000.00	40,854,144.00		
CGB 3.12	10/25/52	18,000,000.00	20,644,740.00		
CGB 3.19	04/15/53	13,000,000.00	15,150,720.00		
CGB 3.72	04/12/51	38,700,000.00	48,728,718.00		
オフショア・人民元小計		866,300,000.00	902,121,822.00 (18,997,693,237)		
マレーシア・リンギット	MGS 3.502	05/31/27	5,100,000.00	5,114,433.00	
	MGS 3.582	07/15/32	2,500,000.00	2,471,700.00	
	MGS 3.757	05/22/40	1,900,000.00	1,849,137.00	
	MGS 3.9	11/30/26	1,300,000.00	1,316,640.00	
	MGS 3.955	09/15/25	3,200,000.00	3,225,824.00	
	MGS 4.498	04/15/30	4,000,000.00	4,178,920.00	
	MGS 4.504	04/30/29	700,000.00	728,322.00	
	MGS 4.696	10/15/42	2,200,000.00	2,386,934.00	
MGS 4.736	03/15/46	6,700,000.00	7,267,825.00		

マレーシア・リンギット小計		27,600,000.00	28,539,735.00 (942,578,974)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	5,000,000.00	4,732,800.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	7,116,873.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	10,200,000.00	8,028,318.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	4,000,000.00	3,677,400.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	620,620.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,800,000.00	2,905,868.00	
	POLGB 7.5 07/25/28	550,000.00	593,829.50	
ポーランド・ズロチ小計		31,150,000.00	27,675,708.50 (1,063,768,440)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	800,000.00	737,024.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,236,225.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	604,730.00	
	BGB 0.35 06/22/32	1,200,000.00	996,156.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	521,032.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	168,896.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	760,472.00	
	BGB 0.8 06/22/28	700,000.00	655,235.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	831,429.00	
	BGB 1 06/22/26	700,000.00	678,349.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,163,357.00	
	BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	795,015.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,000,000.00	828,830.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	469,222.00	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	780,296.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	861,450.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	368,720.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	383,250.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	202,032.00	
	BGB 3.45 06/22/43	500,000.00	509,800.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	636,018.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	325,392.00	
	BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	766,591.20	
	BGB 4.5 03/28/26	800,000.00	822,248.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,182,630.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,100,240.00	
	BKO 2.5 03/19/26	2,100,000.00	2,093,763.00	
	BKO 3.1 09/18/25	300,000.00	300,579.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,225,796.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,135,760.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.00	1,444,410.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	856,152.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,713,960.00		

BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	715,390.00	
BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,746,227.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,050,504.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	752,704.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,195,674.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,500,000.00	1,429,335.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	770,088.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	313,640.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,171,020.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	997,337.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	923,745.00	
BTPS 2 02/01/28	1,500,000.00	1,451,925.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,282,385.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,461,825.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	983,780.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	882,414.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	425,790.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	550,050.00	
BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,242,496.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,191,696.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	396,088.00	
BTPS 2.7 03/01/47	950,000.00	754,091.00	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	518,364.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	985,300.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,288,170.00	
BTPS 2.95 02/15/27	2,000,000.00	1,998,720.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	894,660.00	
BTPS 3 08/01/29	2,600,000.00	2,586,012.00	
BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	626,360.00	
BTPS 3.25 03/01/38	800,000.00	743,784.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,399,088.00	
BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	677,929.00	
BTPS 3.35 07/01/29	600,000.00	605,346.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	894,960.00	
BTPS 3.45 07/15/31	300,000.00	301,374.00	
BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.00	1,009,710.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,016,800.00	
BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,944,327.00	
BTPS 3.85 07/01/34	600,000.00	609,204.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,041,436.00	
BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,951,475.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,341,600.00	
BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,042,880.00	
BTPS 4 04/30/35	500,000.00	513,705.00	

BTPS 4.1 02/01/29	1,500,000.00	1,562,625.00	
BTPS 4.4 05/01/33	3,000,000.00	3,196,980.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,329,133.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,917,198.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,298,808.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,747,096.00	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,998,090.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,885,453.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,975,230.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,559,062.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,886,252.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	437,264.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,329,870.00	
DBR 0 02/15/32	2,700,000.00	2,289,195.00	
DBR 0 05/15/35	2,000,000.00	1,552,880.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	603,256.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,239,700.00	
DBR 0 08/15/30	2,500,000.00	2,194,200.00	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	171,620.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,974,366.00	
DBR 0 08/15/50	2,000,000.00	1,044,420.00	
DBR 0 08/15/50	2,100,000.00	1,099,308.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,205,763.00	
DBR 0 11/15/28	500,000.00	454,965.00	
DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	284,361.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,099,596.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,386,585.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,096,640.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,504,816.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	1,989,624.00	
DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,322,848.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,266,903.00	
DBR 1.7 08/15/32	2,400,000.00	2,307,888.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,200,000.00	1,015,380.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,500,000.00	1,271,385.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,389,220.00	
DBR 2.2 02/15/34	100,000.00	99,048.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,604,896.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,300,000.00	1,304,511.00	
DBR 2.4 11/15/30	1,100,000.00	1,109,053.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,581,680.00	
DBR 2.5 08/15/46	1,500,000.00	1,482,135.00	
DBR 2.5 08/15/54	500,000.00	493,435.00	
DBR 3.25 07/04/42	800,000.00	878,416.00	

DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,514,149.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	849,030.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,746,912.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	727,698.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,867,745.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,071,585.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,107,520.00	
DBR 6.25 01/04/30	800,000.00	961,264.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,114,610.00	
FRTR 0 02/25/26	2,000,000.00	1,913,860.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,026,476.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,325,568.00	
FRTR 0 11/25/29	3,500,000.00	3,032,295.00	
FRTR 0 11/25/30	4,100,000.00	3,448,961.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,445,690.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,739,688.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	2,975,969.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,701,020.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	854,997.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	36,939.00	
FRTR 0.5 06/25/44	750,000.00	440,835.00	
FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,923,598.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,100,000.00	2,882,721.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,561,890.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,130,108.00	
FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,907,920.00	
FRTR 1 11/25/25	800,000.00	780,192.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,800,000.00	1,534,284.00	
FRTR 1.25 05/25/36	2,750,000.00	2,242,707.50	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	700,929.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,850,000.00	2,624,023.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,600,560.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	507,976.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,226,339.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,530,340.00	
FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,520,774.00	
FRTR 2.5 05/25/30	2,100,000.00	2,071,209.00	
FRTR 2.5 05/25/43	1,100,000.00	960,905.00	
FRTR 2.5 09/24/26	3,100,000.00	3,082,144.00	
FRTR 2.5 09/24/27	1,100,000.00	1,092,531.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,600,000.00	1,600,192.00	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,652,040.50	
FRTR 3 05/25/33	2,200,000.00	2,208,690.00	
FRTR 3 05/25/54	1,300,000.00	1,168,232.00	

FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	877,095.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,820,520.00	
FRTR 3.5 11/25/33	2,400,000.00	2,498,832.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,482,107.10	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,530,410.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,169,040.00	
FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,180,839.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	921,608.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,847,835.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	481,844.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,175,054.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	415,835.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	471,455.00	
IRISH 1 05/15/26	1,000,000.00	970,440.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	468,695.00	
IRISH 1.3 05/15/33	500,000.00	447,990.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	464,190.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	363,420.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	262,665.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	930,061.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	595,902.00	
IRISH 2.6 10/18/34	300,000.00	296,457.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,222,988.00	
NETHER 0 07/15/30	1,900,000.00	1,644,488.00	
NETHER 0.25 07/15/25	930,000.00	906,089.70	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	449,610.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,077,705.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,249,365.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,700,000.00	1,454,503.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	380,588.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,700,000.00	1,592,849.00	
NETHER 2 01/15/54	200,000.00	169,544.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	597,840.00	
NETHER 2.5 07/15/33	800,000.00	795,248.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,294,480.00	
NETHER 3.25 01/15/44	200,000.00	213,638.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,471,535.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	340,092.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	769,097.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	2,011,170.00	
OBL 0 04/16/27	2,200,000.00	2,064,546.00	
OBL 0 10/09/26	2,700,000.00	2,559,330.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,514,798.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	290,787.00	

OBL 2.1 04/12/29	1,000,000.00	992,520.00	
OBL 2.1 04/12/29	600,000.00	595,620.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	597,786.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,607,104.00	
RAGB 0 02/20/30	800,000.00	692,848.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,176,168.00	
RAGB 0 10/20/40	300,000.00	183,462.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	501,468.00	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	661,962.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	563,148.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	524,043.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	575,820.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	115,297.50	
RAGB 0.9 02/20/32	1,000,000.00	876,800.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	979,160.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	518,126.00	
RAGB 1.5 11/02/86	400,000.00	243,552.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	962,710.00	
RAGB 2.9 02/20/33	500,000.00	503,930.00	
RAGB 2.9 02/20/34	300,000.00	301,479.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	502,035.00	
RAGB 3.15 10/20/53	150,000.00	149,986.50	
RAGB 3.2 07/15/39	200,000.00	202,986.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	805,266.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	336,240.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	825,472.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,102,490.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	283,656.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	340,452.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	452,585.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	674,303.00	
RFGB 0.5 09/15/27	500,000.00	469,510.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	275,769.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	719,120.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	706,448.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	363,960.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	752,472.00	
RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	193,718.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	201,310.00	
RFGB 3 09/15/33	400,000.00	406,208.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	302,487.00	
SPGB 0 01/31/27	500,000.00	466,860.00	
SPGB 0.1 04/30/31	1,000,000.00	833,670.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,409,040.00	

SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,184,666.00	
SPGB 0.7 04/30/32	1,400,000.00	1,187,032.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,100,000.00	1,039,379.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	636,671.00	
SPGB 0.85 07/30/37	500,000.00	368,915.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	443,288.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	1,000,216.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,732,670.00	
SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,355,942.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,000,000.00	1,907,240.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,140,816.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,982,085.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,729,350.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	199,756.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,451,340.00	
SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	526,290.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,400,000.00	2,364,240.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	668,045.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,583,840.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	662,935.00	
SPGB 2.5 05/31/27	1,400,000.00	1,389,794.00	
SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,551,120.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	633,427.50	
SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,098,680.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,508,648.00	
SPGB 3.15 04/30/33	2,200,000.00	2,221,604.00	
SPGB 3.45 07/30/43	700,000.00	682,549.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,197,651.00	
SPGB 3.55 10/31/33	1,800,000.00	1,868,328.00	
SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	733,495.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,146,936.00	
SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	811,472.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,722,720.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,634,780.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,644,165.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,704,346.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,198,840.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	529,425.00	
SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,161,649.00	
グーロ小計	370,650,000.00	346,984,715.00	(57,214,309,656)
国債証券合計		185,930,115,013	(185,930,115,013)



合 計		185,930,115,013 (185,930,115,013)	
-----	--	--------------------------------------	--

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

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	240銘柄	46.4%	47.0%
カナダ・ドル	国債証券	28銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	21銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券	13銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	8銘柄	0.2%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券	55銘柄	5.2%	5.3%
イスラエル・シケル	国債証券	10銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	8銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	37銘柄	10.1%	10.2%
マレーシア・リングギット	国債証券	9銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7銘柄	0.6%	0.6%
ユーロ	国債証券	292銘柄	30.4%	30.8%

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)」に記載しております。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年7月31日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		420,798,216
金銭信託		463,535
コール・ローン		98,263,878
国債証券		9,446,796,740
未収利息		114,260,981
前払費用		9,268,646
流動資産合計		10,089,851,996
資産合計		10,089,851,996
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		935,500
未払金		228,271,278
未払解約金		7,189,155
流動負債合計		236,395,933
負債合計		236,395,933
純資産の部		
元本等		
元本		8,760,510,337

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		1,092,945,726
元本等合計		9,853,456,063
純資産合計		9,853,456,063
負債純資産合計		10,089,851,996

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2024年7月31日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,760,510,337口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1248円 ( 1万口当たりの純資産額11,248円 )

## ( 金融商品に関する注記 )

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

## . 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年7月31日現在)
-----	----------------

1.	貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3.	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	77,144,000	-	76,208,500	935,500
	小計	77,144,000	-	76,208,500	935,500
合計		77,144,000	-	76,208,500	935,500

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

( 2024年7月31日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,229,491,385円
同期中における追加設定元本額	4,938,590,685円
同期中における一部解約元本額	407,571,733円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	274,673,087円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	7,292,739,523円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	130,469,373円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	132,298,874円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	342,665,042円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	231,059,622円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	56,922,708円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	7,541,298円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	13,794,930円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	8,049,208円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	9,589,045円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	5,100,295円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,688,636円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	238,685円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	15,705,858円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	90,241,483円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	104,559,413円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	42,173,257円
合計	8,760,510,337円

## ( 3 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 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	ADGB 1.875 09/15/31	1,300,000.00	1,089,244.00	
		ADGB 2.5 04/16/25	700,000.00	686,931.00	
		ADGB 2.5 09/30/29	200,000.00	181,530.00	
		ADGB 3.125 04/16/30	600,000.00	557,046.00	
		ADGB 3.125 09/30/49	1,300,000.00	908,219.00	
		ADGB 3.875 04/16/50	200,000.00	159,580.00	

ADGB 5 04/30/34	300,000.00	306,177.00	
ADGB 5.5 04/30/54	500,000.00	509,340.00	
BRAZIL 2.875 06/06/25	600,000.00	586,188.00	
BRAZIL 3.75 09/12/31	600,000.00	520,830.00	
BRAZIL 3.875 06/12/30	500,000.00	451,575.00	
BRAZIL 4.75 01/14/50	700,000.00	510,027.00	
BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.00	179,214.00	
BRAZIL 6 10/20/33	1,400,000.00	1,374,100.00	
BRAZIL 6.125 01/22/32	600,000.00	595,236.00	
BRAZIL 6.25 03/18/31	300,000.00	302,676.00	
BRAZIL 7.125 05/13/54	300,000.00	295,476.00	
CHILE 2.55 07/27/33	800,000.00	659,600.00	
CHILE 2.75 01/31/27	400,000.00	379,208.00	
CHILE 3.1 05/07/41	200,000.00	148,664.00	
CHILE 3.5 01/25/50	600,000.00	438,930.00	
CHILE 3.5 01/31/34	900,000.00	794,745.00	
CHILE 4.34 03/07/42	600,000.00	523,440.00	
CHILE 4.85 01/22/29	400,000.00	399,992.00	
CHILE 4.95 01/05/36	600,000.00	583,950.00	
CHINA (PEOPLE'S) 1.2 10/21/30	700,000.00	593,649.00	
CHINA (PEOPLE'S) 2.125 12/03/29	300,000.00	272,469.00	
CHINA 0.55 10/21/25	200,000.00	190,430.00	
CHINA 1.25 10/26/26	700,000.00	654,423.00	
COLOM 3.125 04/15/31	800,000.00	643,552.00	
COLOM 7.5 02/02/34	1,400,000.00	1,421,084.00	
COLOM 8 04/20/33	800,000.00	838,864.00	
COLOM 8 11/14/35	300,000.00	312,867.00	
COLOM 8.75 11/14/53	400,000.00	425,248.00	
DOMREP 5.5 02/22/29	500,000.00	489,575.00	
DOMREP 5.875 01/30/60	1,400,000.00	1,202,978.00	
DOMREP 6 02/22/33	1,700,000.00	1,672,222.00	
INDON 3.05 03/12/51	200,000.00	136,710.00	
INDON 3.85 10/15/30	600,000.00	565,164.00	
INDON 4.2 10/15/50	200,000.00	167,300.00	
INDON 4.75 01/08/26	400,000.00	398,740.00	
INDON 5.125 01/15/45	400,000.00	389,120.00	
KSA 2.25 02/02/33	1,600,000.00	1,290,816.00	
KSA 3.625 03/04/28	600,000.00	576,294.00	
KSA 4.75 01/18/28	600,000.00	598,920.00	
KSA 4.875 07/18/33	700,000.00	691,033.00	
KSA 5 01/16/34	1,000,000.00	995,090.00	
KSA 5 01/18/53	800,000.00	707,824.00	

KSA 5.25 01/16/50	600,000.00	559,740.00	
KSA 5.75 01/16/54	800,000.00	783,208.00	
MEX 2.659 05/24/31	1,200,000.00	1,006,668.00	
MEX 3.25 04/16/30	200,000.00	179,226.00	
MEX 4.5 01/31/50	300,000.00	229,560.00	
MEX 4.5 04/22/29	200,000.00	194,018.00	
MEX 4.875 05/19/33	1,000,000.00	938,740.00	
MEX 5 04/27/51	900,000.00	732,042.00	
MEX 6 05/07/36	800,000.00	795,344.00	
MEX 6.338 05/04/53	900,000.00	860,130.00	
MEX 6.35 02/09/35	500,000.00	512,670.00	
MEX 6.4 05/07/54	200,000.00	193,124.00	
OMAN 6 08/01/29	600,000.00	617,640.00	
OMAN 6.25 01/25/31	1,200,000.00	1,253,844.00	
PANAMA 2.252 09/29/32	800,000.00	588,600.00	
PANAMA 4.5 01/19/63	800,000.00	518,752.00	
PANAMA 6.4 02/14/35	1,400,000.00	1,353,408.00	
PERU 2.783 01/23/31	1,000,000.00	866,330.00	
PERU 3 01/15/34	500,000.00	413,570.00	
PERU 5.625 11/18/50	800,000.00	792,472.00	
PHILIP 1.648 06/10/31	200,000.00	162,558.00	
PHILIP 2.65 12/10/45	400,000.00	263,452.00	
PHILIP 2.95 05/05/45	200,000.00	139,360.00	
PHILIP 3.7 02/02/42	200,000.00	162,904.00	
POLAND 4.625 03/18/29	600,000.00	599,484.00	
POLAND 5.125 09/18/34	2,100,000.00	2,101,806.00	
POLAND 5.5 03/18/54	1,200,000.00	1,173,780.00	
QATAR 3.4 04/16/25	400,000.00	395,308.00	
QATAR 3.75 04/16/30	1,000,000.00	961,370.00	
QATAR 4.4 04/16/50	900,000.00	795,537.00	
QATAR 4.75 05/29/34	400,000.00	404,640.00	
REPHUN 5.25 06/16/29	500,000.00	497,925.00	
REPHUN 5.5 03/26/36	1,100,000.00	1,075,514.00	
REPHUN 6.125 05/22/28	200,000.00	205,266.00	
REPHUN 6.25 09/22/32	900,000.00	941,130.00	
SOAF 4.85 09/30/29	800,000.00	746,496.00	
SOAF 7.3 04/20/52	1,300,000.00	1,200,303.00	
TURKEY 6.125 10/24/28	800,000.00	792,048.00	
TURKEY 6.375 10/14/25	400,000.00	401,656.00	
TURKEY 7.125 07/17/32	500,000.00	499,965.00	
TURKEY 7.625 05/15/34	500,000.00	514,535.00	
TURKEY 9.125 07/13/30	1,100,000.00	1,219,427.00	
TURKEY 9.375 01/19/33	1,400,000.00	1,592,822.00	
TURKEY 9.375 03/14/29	200,000.00	220,770.00	

	TURKEY 9.875 01/15/28	1,400,000.00	1,551,928.00	
	UAE 4.857 07/02/34	500,000.00	502,940.00	
	URUGUA 4.375 01/23/31	400,000.00	393,740.00	
	URUGUA 4.975 04/20/55	400,000.00	371,000.00	
	URUGUA 5.75 10/28/34	300,000.00	317,550.00	
	アメリカ・ドル小計	66,100,000.00	61,970,590.00 (9,446,796,740)	
国債証券合計			9,446,796,740 (9,446,796,740)	
合 計			9,446,796,740 (9,446,796,740)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

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 97銘柄	95.9%	100.0%

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）」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年7月31日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	558,152
コール・ローン	118,321,506
投資証券	15,107,449,600
派生商品評価勘定	155,600
未収入金	545,798,339
未収配当金	168,952,773
前払金	70,000
差入委託証拠金	1,863,962
流動資産合計	15,943,169,932

資産合計

15,943,169,932

負債の部

流動負債

未払金	52,596,873
未払解約金	582,065,677
流動負債合計	634,662,550

負債合計

634,662,550

純資産の部

元本等

元本	6,012,035,183
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	9,296,472,199



元本等合計	15,308,507,382
純資産合計	15,308,507,382
負債純資産合計	15,943,169,932

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,012,035,183口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5463円 (1万口当たりの純資産額25,463円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
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、当ファンドの信託約款に従い、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>

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0609月	34,094,400	-	34,250,000	155,600
	小計	34,094,400	-	34,250,000	155,600
合計		34,094,400	-	34,250,000	155,600

## (注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に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。

2) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2024年7月31日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,860,224,915円
同期中における追加設定元本額	3,064,260,249円
同期中における一部解約元本額	1,912,449,981円

## 2024年7月31日現在の元本の内訳

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	64,748,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	145,811,694円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	106,716,271円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,809,271,429円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	32,189,464円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,821,857円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	52,586,537円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	239,482,273円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	158,074,430円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	135,344,078円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,188,113円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,150,716円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	434,318,761円
日興FWS・Jリートインデックス	1,098,306,681円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	180,918,739円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	5,109,432円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	3,166,928円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	4,622,289円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	2,809,158円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	1,480,856円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	327,878円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	17,126,185円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	86,317,241円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	93,614,173円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	35,541,624円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,641,141円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	78,686,240円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	41,912,341円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	66,750,518円
合計	6,012,035,183円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	336	39,849,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	486	41,164,200	
	SOSILA物流リート投資法人	757	87,812,000	
	東海道リート投資法人	259	30,898,700	
	日本アコモデーションファンド投資法人	524	336,408,000	

森ヒルズリート投資法人	1,785	229,551,000	
産業ファンド投資法人	2,779	343,484,400	
アドバンス・レジデンス投資法人	1,492	469,980,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	738	260,883,000	
G L P 投資法人	5,098	669,877,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	764	237,986,000	
コンフォリア・レジ 新	4	1,246,000	
日本プロロジスリート投資法人	2,644	653,332,400	
星野リゾート・リート投資法人	321	166,599,000	
O n e リート投資法人	265	68,635,000	
イオンリート投資法人	1,862	241,315,200	
ヒューリックリート投資法人	1,341	191,360,700	
日本リート投資法人	493	162,690,000	
積水ハウス・リート投資法人	4,561	361,687,300	
トーセイ・リート投資法人	330	46,728,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	374	46,525,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	391	40,116,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,908	724,911,600	
いちごホテルリート投資法人	251	26,606,000	
ラサールロジポート投資法人	1,944	288,100,800	
スターアジア不動産投資法人	2,469	140,239,200	
マリモ地方創生リート投資法人	234	29,788,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	633	267,442,500	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	245	18,718,000	
投資法人みらい	2,090	93,423,000	
三菱地所物流リート投資法人	524	198,334,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	653	94,293,200	
ザイマックス・リート投資法人	260	31,408,000	
タカラレーベン不動産投資法人	856	85,514,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	665	79,467,500	
日本ビルファンド投資法人	1,771	1,025,409,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,559	810,680,000	
日本都市ファンド投資法人	7,646	715,665,600	
オリックス不動産投資法人	3,024	472,046,400	
日本プライムリアルティ投資法人	1,038	338,907,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,543	179,296,600	
東急リアル・エステート投資法人	1,018	154,430,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,121	113,445,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,395	486,843,000	

森トラストリート投資法人	2,926	204,234,800	
インヴィンシブル投資法人	8,363	569,520,300	
フロンティア不動産投資法人	563	244,623,500	
平和不動産リート投資法人	1,113	146,025,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,020	261,324,000	
福岡リート投資法人	785	123,088,000	
KDX不動産投資法人	4,246	656,431,600	
いちごオフィスリート投資法人	1,107	92,766,600	
大和証券オフィス投資法人	644	188,949,600	
阪急阪神リート投資法人	724	96,364,400	
スターツプロシード投資法人	263	51,153,500	
大和ハウスリート投資法人	2,288	553,924,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,576	428,236,800	
大和証券リビング投資法人	2,278	232,128,200	
ジャパンエクセレント投資法人	1,303	155,578,200	
投資証券 小計		15,107,449,600	
合計		15,107,449,600	

## 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）」に記載しております。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年7月31日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金	672,431,286
金銭信託	315,222
コール・ローン	66,823,214
投資証券	39,383,164,308
派生商品評価勘定	866,350
未収配当金	51,168,062

流動資産合計 40,174,768,442

## 資産合計 40,174,768,442

## 負債の部

## 流動負債

派生商品評価勘定	301,752
未払金	34,549,990
未払解約金	95,522,457

流動負債合計 130,374,199

## 負債合計 130,374,199

## 純資産の部

## 元本等

元本 11,269,119,605

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		28,775,274,638
元本等合計		40,044,394,243
純資産合計		40,044,394,243
負債純資産合計		40,174,768,442

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	11,269,119,605口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.5535円 (1万口当たりの純資産額35,535円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

## . 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年7月31日現在)
-----	----------------



1.	貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3.	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年7月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	79,100,000	-	78,932,921	167,079
	オーストラリア・ドル	12,300,000	-	12,215,842	84,158
	香港・ドル	5,400,000	-	5,350,873	49,127
	イギリス・ポンド	12,400,000	-	12,400,197	197
	ユーロ	27,600,000	-	27,599,865	135
	小計	136,800,000	-	136,499,698	300,302
	売建				
	アメリカ・ドル	76,300,000	-	75,500,868	799,132
	オーストラリア・ドル	5,500,000	-	5,434,232	65,768
小計	81,800,000	-	80,935,100	864,900	
合計		218,600,000	-	217,434,798	564,598

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客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。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 2024年7月31日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,956,727,921円
同期中における追加設定元本額	2,436,354,656円
同期中における一部解約元本額	1,123,962,972円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	11,656,239円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,066,046円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	8,047,360円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,832,966,394円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	10,866,200円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	35,891,483円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,588,464円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	167,348,435円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	112,510,735円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	94,715,195円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	132,220,140円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,428,745円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	421,751,542円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	57,305,935円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	1,097,904,767円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	130,895,489円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,043,538円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	1,548,831円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	1,739,469円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	932,773円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	491,038円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	43,351円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	930,300円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	5,264,769円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,873,606円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	2,333,474円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	28,533,260円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	50,222,027円
合計	11,269,119,605円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 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	20,375.00	433,987.50	
		AGREE REALTY CORP	17,601.00	1,226,789.70	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	240,973.20	
		ALEXANDER'S INC	300.00	72,150.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,835.00	3,431,941.70	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	37,714.30	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,429.00	269,276.78	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	14,873.00	244,065.93	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,403.00	2,146,824.42	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	48,007.00	1,436,849.51	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	208,104.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	40,321.00	613,282.41	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15,799.00	190,535.94	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	2,409.37	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,857.00	5,330,161.98	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	31,668.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	175,457.49	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	54,159.00	1,428,714.42	
		BROADSTONE NET LEASE INC	31,774.00	570,978.78	
		BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,415.00	
		BXP INC	26,897.00	1,953,529.11	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,215.00	2,148,044.85	
		CARETRUST REIT INC	24,090.00	647,298.30	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	94,483.20	
		CENTERSPACE	2,600.00	179,452.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	12,827.00	113,903.76	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	28,446.54	
		CLIPPER REALTY INC	800.00	3,176.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	88,472.16	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	20,034.00	582,588.72	
		COUSINS PROPERTIES INC	28,470.00	774,384.00	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	77,355.85	

CUBESMART	40,256.00	1,961,674.88	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	278,254.35	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800.00	103,704.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	58,588.00	8,497,603.52	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	79,772.56	
DOUGLAS EMMETT INC	30,537.00	482,179.23	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,924.00	224,528.40	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,959.00	1,680,977.17	
ELME COMMUNITIES	15,190.00	255,192.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	228,929.76	
EPR PROPERTIES	12,612.00	576,746.76	
EQUINIX INC	17,094.00	13,141,354.38	
EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	350,904.12	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,434.00	2,360,450.70	
EQUITY RESIDENTIAL	62,983.00	4,381,727.31	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	32,895.00	995,402.70	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,550.00	3,243,240.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,227.00	6,234,823.70	
FARMLAND PARTNERS INC	7,194.00	75,105.36	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,176.00	1,500,878.16	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,908.00	1,260,856.32	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	17,953.00	495,323.27	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	27,358.15	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,019.00	2,463,204.75	
GETTY REALTY CORP	10,369.00	312,106.90	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	81,110.48	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	66,781.44	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	120,731.10	
GLOBAL NET LEASE INC	30,518.00	271,610.20	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	69,152.00	1,226,064.96	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	128,507.00	2,806,592.88	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,816.00	607,360.40	
HOST HOTELS & RESORTS INC	130,084.00	2,315,495.20	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	103,906.89	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	42,537.00	793,315.05	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	32,311.10	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,313.00	656,474.28	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	328,688.20	
INVITATION HOMES INC	103,209.00	3,611,282.91	
IRON MOUNTAIN INC	52,925.00	5,360,773.25	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	253,386.96	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	26,180.00	
KILROY REALTY CORP	19,409.00	717,162.55	

KIMCO REALTY CORP	117,891.00	2,597,138.73	
KITE REALTY GROUP TRUST	38,279.00	975,731.71	
LTC PROPERTIES INC	7,251.00	257,337.99	
LXP INDUSTRIAL TRUST	52,073.00	544,683.58	
MACERICH CO/THE	38,484.00	643,837.32	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	19,672.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588.00	487,940.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,016.00	2,969,770.96	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	569,757.24	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,193.00	540,625.88	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	2,275.00	67,112.50	
NETSTREIT CORP	13,768.00	232,266.16	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,980.00	51,710.40	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	154,393.75	
NNN REIT INC	32,073.00	1,478,565.30	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	23,654.24	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	45,355.00	1,656,818.15	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	62,351.52	
ORION OFFICE REIT INC	8,094.00	33,266.34	
PARAMOUNT GROUP INC	23,577.00	121,893.09	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	540,473.86	
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,728.00	107,032.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329.00	284,199.42	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	22,600.00	809,306.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	173,744.46	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,798.00	213,439.48	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	21,274.56	
PRIME US REIT	143,770.00	27,460.07	
PROLOGIS INC	167,586.00	21,130,918.74	
PUBLIC STORAGE	28,551.00	8,690,067.87	
REALTY INCOME CORP	158,136.00	9,230,398.32	
REGENCY CENTERS CORP	30,479.00	2,084,458.81	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	347,728.08	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	39,699.00	1,965,497.49	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	232,391.16	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,529.00	1,083,644.68	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,231.00	723,176.85	
SAFEHOLD INC	10,598.00	245,555.66	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	94,638.60	
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,820.00	220,868.80	
SIMON PROPERTY GROUP INC	59,090.00	9,147,722.90	
SITE CENTERS CORP	32,493.00	520,212.93	
SL GREEN REALTY CORP	11,643.00	778,567.41	
STAG INDUSTRIAL INC	32,025.00	1,306,299.75	

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	89,381.32	
	SUN COMMUNITIES INC	22,550.00	2,869,262.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,745.00	418,117.40	
	TANGER INC	20,789.00	605,375.68	
	TERRENO REALTY CORP	17,748.00	1,222,304.76	
	UDR INC	55,893.00	2,283,229.05	
	UMH PROPERTIES INC	11,316.00	200,632.68	
	UNITI GROUP INC	46,029.00	170,307.30	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	57,966.72	
	URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	422,729.44	
	VENTAS INC	72,232.00	3,962,647.52	
	VERIS RESIDENTIAL INC	16,966.00	271,625.66	
	VICI PROPERTIES INC	188,053.00	5,908,625.26	
	VORNADO REALTY TRUST	27,687.00	817,597.11	
	WELLTOWER INC	108,411.00	12,168,050.64	
	WHITESTONE REIT	12,068.00	169,434.72	
	WP CAREY INC	39,026.00	2,372,780.80	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	252,252.05	
	アメリカ・ドル小計	4,707,555.00	203,116,626.89 (30,963,098,603)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	14,869.00	261,694.40	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	65,604.98	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,788.00	378,252.00	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,187.00	54,147.13	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	6,841.00	22,370.07	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,077.00	689,491.46	
	CHOICE PROPERTIES REIT	30,541.00	430,628.10	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	147,243.76	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,193.00	134,125.87	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,474.00	323,706.46	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,732.00	51,853.36	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,618.00	356,697.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	392,185.60	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	204,549.74	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	144,902.12	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	154,114.07	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	23,094.12	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	26,469.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	34,064.80	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	106,052.94	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	87,314.76	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	15,604.00	80,360.60	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,676.00	448,609.68	
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	38,831.40		

	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	291,960.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	829.00	7,784.31	
	カナダ・ドル小計	287,913.00	4,956,107.73 (545,320,535)	
オーストラ リア・ドル	ABACUS GROUP	50,980.00	56,078.00	
	ABACUS STORAGE KING	145,482.00	183,307.32	
	ARENA REIT	80,503.00	303,496.31	
	BWP TRUST	115,823.00	408,855.19	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	160,667.00	265,903.88	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	265,995.45	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,559.00	83,984.77	
	CHARTER HALL GROUP	83,440.00	989,598.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	134,611.00	461,715.73	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	312,649.26	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	72,491.00	182,677.32	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	91,861.56	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	87,384.93	
	DEXUS/AU	190,461.00	1,304,657.85	
	GDI PROPERTY GROUP	83,204.00	49,090.36	
	GOODMAN GROUP	314,107.00	11,009,450.35	
	GPT GROUP	330,937.00	1,462,741.54	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,361.00	118,859.47	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	60,406.75	
	HMC CAPITAL LTD	53,344.00	411,815.68	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	332,002.00	406,702.45	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	55,080.00	185,068.80	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	318,598.80	
	MIRVAC GROUP	701,595.00	1,452,301.65	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	509,513.48	
	REGION RE LTD	191,819.00	427,756.37	
RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	110,224.51		
SCENTRE GROUP	960,992.00	3,267,372.80		
STOCKLAND	416,620.00	1,849,792.80		
VICINITY CENTRES	664,812.00	1,356,216.48		
WAYPOINT REIT	113,111.00	280,515.28		
	オーストラリア・ドル小計	6,173,891.00	28,274,593.54 (2,817,563,246)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	435,000.00	682,950.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	963,480.00	
	LINK REIT	449,900.00	14,734,225.00	
	PROSPERITY REIT	312,000.00	414,960.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	202,000.00	337,340.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	494,000.00	474,240.00	
	香港・ドル小計	2,151,900.00	17,607,195.00 (343,516,374)	

シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	147,290.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	654,700.00	1,754,596.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	428,155.00	385,339.50	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	140,904.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	956,708.00	1,980,385.56	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	154,763.50	
	EC WORLD REIT	52,800.00	14,784.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,097,413.00	301,788.57	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	119,700.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	221,100.00	490,842.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	527,638.00	519,723.43	
	KEPPEL DC REIT	258,900.00	525,567.00	
	KEPPEL REIT	363,300.00	321,520.50	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	155,890.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	363,300.00	839,223.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	558,250.00	731,307.50	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	446,000.00	575,340.00	
	PARAGON REIT	215,200.00	188,300.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	253,374.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	44,689.00	
STARHILL GLOBAL REIT	195,000.00	94,575.00		
SUNTEC REIT	416,400.00	487,188.00		
シンガポール・ドル小計		7,821,914.00	10,227,091.06 (1,162,411,170)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	165,760.56	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	211,264.00	438,372.80	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	264,918.00	238,426.20	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	269,326.00	331,270.98	
ニュージーランド・ドル小計		898,990.00	1,173,830.54 (105,644,750)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	28,984.32	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,406.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	193,422.23	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	133,239.75	
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,499.00	421,728.12	
	BRITISH LAND CO PLC	162,562.00	661,302.21	
	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	38,270.16	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	65,417.66	
	DERWENT LONDON PLC	20,725.00	475,846.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	91,960.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,900.00	253,807.00	
	HAMMERSON PLC	740,000.00	210,900.00	
	HELICAL PLC	17,000.00	38,505.00	
HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38		



	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	78,722.08	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	141,683.00	901,103.88	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	104,502.00	34,903.66	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	367,037.00	731,504.74	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	37,599.15	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	153,900.00	112,193.10	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	270,348.00	250,612.59	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	71,187.18	
	REGIONAL REIT LTD	15,921.00	21,652.56	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,662.00	335,587.41	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	33,510.85	
	SEGRE PLC	239,847.00	2,189,803.11	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	361,237.00	548,357.76	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	140,004.23	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	113,949.00	92,412.63	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	20,896.77	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	420,000.00	697,620.00	
	UNITE GROUP PLC/THE	80,812.00	773,370.84	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	94,888.80	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	62,727.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	125,302.00	
	イギリス・ポンド小計	5,051,615.00	10,012,248.17 (1,959,997,702)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	172,700.00	
	REIT 1 LTD	36,017.00	515,043.10	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242.00	253,331.58	
	イスラエル・シュケル小計	182,259.00	941,074.68 (38,322,821)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	22,764,750.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	117,960,000.00	
	JR REIT XXVII	36,632.00	145,245,880.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	6,226.00	30,445,140.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	75,051,330.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	46,852,530.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	58,442,540.00	
	SK REITS CO LTD	27,115.00	141,540,300.00	
	韓国・ウォン小計	141,767.00	638,302,470.00 (70,532,423)	
ユーロ	AEDIFICA	9,212.00	555,944.20	
	ALTAREA	723.00	69,841.80	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582.00	78,036.36	
	CARMILA	10,208.00	170,065.28	
	COFINIMMO	6,947.00	418,904.10	
	COVIVIO	8,887.00	420,355.10	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	66,681.60	

	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,912.00	181,580.40	
	GECINA SA	9,405.00	845,979.75	
	HAMBORNER REIT AG	12,897.00	84,475.35	
	ICADE	5,968.00	122,344.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	15,975.22	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	52,295.00	275,594.65	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	57,956.48	
	KLEPIERRE	34,558.00	873,626.24	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	12,639.00	103,134.24	
	MERCIALYS	15,342.00	179,041.14	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	71,325.00	751,765.50	
	MONTEA NV	3,238.00	260,659.00	
	NSI NV	2,966.00	58,904.76	
	RETAIL ESTATES	2,065.00	130,714.50	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,756.00	205,201.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,737.00	1,298,099.36	
	VASTNED RETAIL NV	2,919.00	68,888.40	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	30,825.00	778,023.00	
	WERELDHAVE NV	6,708.00	92,436.24	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,846.00	185,318.20	
	ユーロ小計	461,757.00	8,349,546.27 (1,376,756,684)	
	投資証券合計		39,383,164,308 (39,383,164,308)	
	合 計		39,383,164,308 (39,383,164,308)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

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	77.3%	78.6%
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	1.4%	1.4%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	7.0%	7.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	0.9%	0.9%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	2.9%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	投資証券 35銘柄	4.9%	5.0%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券 27銘柄	3.4%	3.5%

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)」に記載しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年7月31日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	114,823,489
金銭信託	549,913
コール・ローン	116,574,872
投資信託受益証券	12,277,249,184
流動資産合計	12,509,197,458
資産合計	12,509,197,458
負債の部	
流動負債	
未払解約金	17,151,967
流動負債合計	17,151,967
負債合計	17,151,967
純資産の部	
元本等	
元本	7,031,883,415
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,460,162,076
元本等合計	12,492,045,491
純資産合計	12,492,045,491
負債純資産合計	12,509,197,458

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。
-------------------------	---

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年7月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,031,883,415口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7765円 (1万口当たりの純資産額17,765円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年8月1日 至 2024年7月31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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年7月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年8月1日 至 2024年7月31日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## ( その他の注記 )

( 2024年7月31日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,529,203,371円
同期中における追加設定元本額	3,183,810,357円
同期中における一部解約元本額	681,130,313円
2024年7月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	191,249,513円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	6,036,205,275円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	580,671,346円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	334,071円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	17,769,664円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	89,433,089円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	86,562,203円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	29,658,254円
合 計	7,031,883,415円

## ( 3 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	634,440.00	28,860,675.60	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	1,083,160.00	51,677,563.60	
		アメリカ・ドル小計	1,717,600.00	80,538,239.20 (12,277,249,184)	
投資信託受益証券合計				12,277,249,184 (12,277,249,184)	
合 計				12,277,249,184 (12,277,249,184)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通 貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	98.3%	100.0%

## 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】

## 【純資産額計算書】

## 日興FWS・日本株インデックス

2024年7月31日現在

資産総額	13,586,353,433円
負債総額	18,958,745円
純資産総額（ - ）	13,567,394,688円
発行済口数	8,836,978,562口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.5353円 (15,353円)

## 日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

資産総額	1,497,197,264円
負債総額	39,260,586円
純資産総額（ - ）	1,457,936,678円
発行済口数	1,333,030,912口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.0937円 (10,937円)

## 日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）

2024年7月31日現在

資産総額	32,658,933,937円
負債総額	87,773,355円
純資産総額（ - ）	32,571,160,582円
発行済口数	19,542,388,631口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.6667円 (16,667円)

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）

2024年7月31日現在

資産総額	927,799,780円
負債総額	19,938,015円
純資産総額（ - ）	907,861,765円
発行済口数	1,167,988,732口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.7773円 (7,773円)

## 日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）

2024年7月31日現在



資産総額	9,457,749,570円
負債総額	27,726,862円
純資産総額( - )	9,430,022,708円
発行済口数	7,657,838,336口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.2314円 (12,314円)

## 日興FWS・日本債インデックス

2024年7月31日現在

資産総額	20,597,705,780円
負債総額	17,064,697円
純資産総額( - )	20,580,641,083円
発行済口数	22,507,741,814口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	0.9144円 (9,144円)

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

資産総額	419,875,208円
負債総額	10,030,264円
純資産総額( - )	409,844,944円
発行済口数	518,666,016口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	0.7902円 (7,902円)

## 日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

資産総額	10,059,770,606円
負債総額	24,688,479円
純資産総額( - )	10,035,082,127円
発行済口数	8,701,689,127口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.1532円 (11,532円)

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

資産総額	326,408,322円
負債総額	7,282,083円
純資産総額( - )	319,126,239円
発行済口数	457,845,276口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	0.6970円 (6,970円)

## 日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

資産総額	8,265,496,786円
負債総額	23,032,989円
純資産総額( - )	8,242,463,797円
発行済口数	7,489,434,821口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.1005円 (11,005円)

## 日興FWS・Jリートインデックス

2024年7月31日現在

資産総額	2,800,730,300円
負債総額	5,818,656円
純資産総額( - )	2,794,911,644円
発行済口数	3,115,186,991口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	0.8972円 (8,972円)

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

資産総額	215,979,480円
負債総額	3,292,516円
純資産総額( - )	212,686,964円
発行済口数	246,740,137口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	0.8620円 (8,620円)

## 日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

資産総額	3,908,529,045円
負債総額	9,706,510円
純資産総額( - )	3,898,822,535円
発行済口数	2,918,817,210口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.3358円 (13,358円)

## 日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)

2024年7月31日現在

資産総額	359,324,830円
負債総額	7,673,578円

純資産総額( - )	351,651,252円
発行済口数	317,954,124口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.1060円 (11,060円)

日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)

2024年7月31日現在

資産総額	10,750,995,177円
負債総額	27,595,460円
純資産総額( - )	10,723,399,717円
発行済口数	6,064,754,739口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.7682円 (17,682円)

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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また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等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

##### イ 名義書換

該当事項はありません。

##### ロ 受益者名簿

作成しません。

##### ハ 受益者に対する特典

ありません。

##### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

###### (イ) 受益権の譲渡

- a. 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または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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また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。

###### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

##### ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、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。

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金およ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】

##### イ 資本金の額および株式数

	2024年7月31日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

#### ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。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、累積投票によらないものとします。

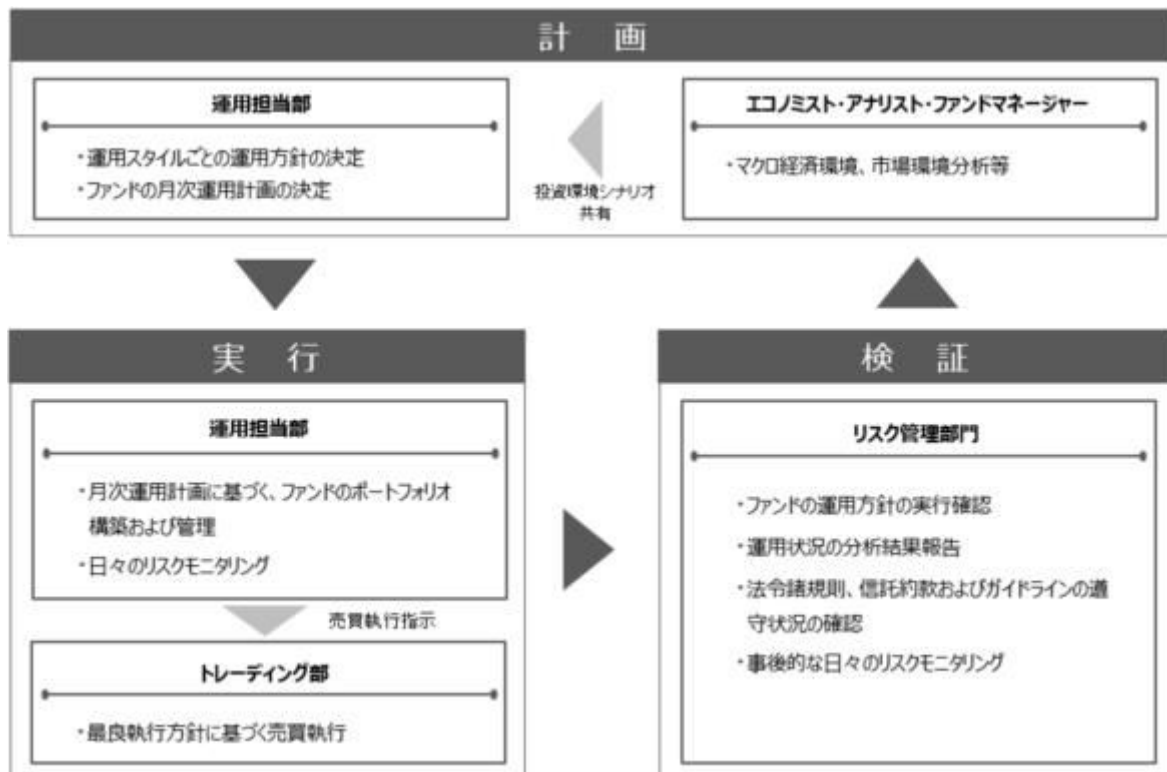
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

#### ニ 投資信託の運用の流れ



#### 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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2024年7月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本 数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	661	12,546,331
単位型株式投資信託	87	653,117
追加型公社債投資信託	1	23,750
単位型公社債投資信託	148	237,970
合 計	897	13,461,169

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

#### （1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金	37,742,400	66,540,261
金銭の信託	12,645,575	23,435,831
顧客分別金信託	300,046	300,051
前払費用	546,900	583,635
未収入金	437,880	193,837
未収委託者報酬	11,563,662	14,480,419
未収運用受託報酬	2,138,030	3,342,186
未収投資助言報酬	344,586	406,420
未収収益	35,477	84,166
その他の流動資産	8,423	43,391
<b>流動資産合計</b>	<b>65,762,982</b>	<b>109,410,202</b>
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	
建物	1,361,305	1,265,924
器具備品	559,057	516,485
土地	710	710
リース資産	4,114	1,782
建設仮勘定	81,240	-

有形固定資産合計	2,006,427	1,784,901
無形固定資産		
ソフトウェア	2,414,295	2,606,617
ソフトウェア仮勘定のれん	508,956	101,101
顧客関連資産	3,045,409	2,740,868
電話加入権	11,445,340	9,332,065
商標権	12,706	12,706
	36	30
無形固定資産合計	17,426,744	14,793,389
投資その他の資産		
投資有価証券	9,222,276	9,976,957
関係会社株式	11,850,598	1,927,221
長期差入保証金	1,388,987	1,361,654
長期前払費用	80,207	44,009
会員権	90,479	90,479
繰延税金資産	-	716,093
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産合計	22,611,799	14,095,666
固定資産合計	42,044,971	30,673,957
資産合計	107,807,953	140,084,160

(単位：千円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	2,564	1,960
顧客からの預り金	11,094	21,728
その他の預り金	128,069	166,944
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	2,013	1,927
未払償還金	1,312	1,253
未払手数料	5,194,011	6,580,971
その他未払金	259,542	642,514
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	6,370,986	7,405,559
未払法人税等	406,770	937,155
賞与引当金	333,009	5,104,541
資産除去債務	1,801,492	2,854,060
その他の流動負債	13,940	-
	73,657	17,443
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
<b>固定負債</b>		
リース債務	1,960	-
繰延税金負債	550,493	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989
固定負債合計	5,580,287	4,941,989
負債合計	20,178,752	28,678,050
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946

利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,391,568	27,075,963
利益剰余金合計	3,675,814	27,360,208
株主資本計	87,771,760	111,456,155
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	142,558	50,045
評価・換算差額等合計	142,558	50,045
純資産合計	87,629,201	111,406,109
負債・純資産合計	107,807,953	140,084,160

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2022年4月1日	(自	2023年4月1日
	至	2023年3月31日)	至	2024年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		61,471,271		69,953,226
運用受託報酬		8,978,419		11,147,187
投資助言報酬		1,273,386		1,302,916
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料		208,222		319,553
その他		22,995		8,758
営業収益計		71,954,296		82,731,642
営業費用				
支払手数料		28,036,456		32,014,851
広告宣伝費		294,588		320,694
調査費				
調査費		3,749,357		4,637,211
委託調査費		11,455,987		12,412,033
営業雑経費				
通信費		61,068		56,291
印刷費		452,951		457,187
協会費		38,701		38,305
諸会費		33,447		30,484
情報機器関連費		5,067,617		5,268,275
販売促進費		29,621		31,339
その他		197,696		253,344
営業費用合計		49,417,495		55,520,019
一般管理費				
給料				
役員報酬		219,872		232,329
給料・手当		7,807,797		8,043,456
賞与		1,042,472		1,073,375
賞与引当金繰入額		1,798,492		2,854,060
交際費		27,713		57,134
寄付金		25,518		26,400
事務委託費		1,727,189		2,022,734
旅費交通費		99,733		166,596
租税公課		352,030		600,468
不動産賃借料		1,268,303		1,249,392
退職給付費用		624,551		712,228
固定資産減価償却費		3,247,869		3,281,572



のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	200,758	215,455
一般管理費合計	18,746,845	20,839,745
営業利益	3,789,956	6,371,877

(単位：千円)

	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		
受取配当金	1,755	11,021,392
受取利息	1,373	2,840
金銭の信託運用益	-	199,056
時効成立分配金・償還金	521	461
原稿・講演料	2,281	2,143
投資有価証券償還益	119,033	5,384
投資有価証券売却益	25,848	12,261
為替差益	5,816	-
雑収入	91,814	129,137
営業外収益合計	248,443	11,372,678
営業外費用		
金銭の信託運用損	454,339	-
投資有価証券償還損	83,598	10,829
投資有価証券売却損	152,691	48,575
為替差損	-	4,701
営業外費用合計	690,629	64,106
経常利益	3,347,770	17,680,450
特別利益		
子会社株式売却益	1	-
特別利益合計	-	14,096,622
特別損失		
固定資産除却損	2	13,203
早期退職費用	3	126,832
支払補償費	4	30,075
特別損失合計	170,111	12,385
税引前当期純利益	3,177,659	31,764,687
法人税、住民税及び事業税	1,622,064	7,802,794
法人税等調整額	541,433	1,314,394
法人税等合計	1,080,631	6,488,400
当期純利益	2,097,028	25,276,287

## (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：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
		その他資本	資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	剰余金	合計	利益準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
当期純利益	2,097,028	2,097,028			2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)			439,697	439,697	439,697
当期変動額合計	443,225	443,225	439,697	439,697	882,923
当期末残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
当期純利益						25,276,287
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	23,684,394
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	27,075,963

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201
当期変動額					
剰余金の配当	1,591,892	1,591,892			1,591,892
当期純利益	25,276,287	25,276,287			25,276,287
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)			92,513	92,513	92,513

当期変動額合計	23,684,394	23,684,394	92,513	92,513	23,776,908
当期末残高	27,360,208	111,456,155	50,045	50,045	111,406,109

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 重要な資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式  
移動平均法による原価法

## その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

(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)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資(金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの)

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) 金銭の信託

運用目的の金銭の信託：時価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産(リース資産を除く)

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～30年
器具備品	4～15年

## (2) 無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア(自社利用分)	5年

## (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び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) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

## (2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

## (3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

## (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	301,463千円	397,568千円
器具備品	1,499,284千円	1,493,885千円
リース資産	7,493千円	9,824千円

## 2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 3 保証債務

前事業年度は、当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

当事業年度は、該当事項はありません。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	12,514千円	- 千円

## (損益計算書関係)

## 1 子会社売却益

日興グローバルラップ株式会社の株式を譲渡したことによる売却益であります。

## 2 固定資産除却損

	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)
建物	2,482千円	9,039千円
器具備品	4,273千円	2,987千円
リース資産	532千円	- 千円
ソフトウェア	5,915千円	358千円

## 3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

## 4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

## (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. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

## 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になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

## 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になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,838,419	320.00	2024年 3月31日	2024年 6月27日

## (リース取引関係)

## オペレーティング・リース取引

## (借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
1年以内	1,161,545	1,161,545
1年超	1,161,545	-
合計	2,323,090	1,161,545

## (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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っており、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかか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、投資信託保有残高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。

なお、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保

を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。  
また、資金調達は行っていません。

### (2)金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

金銭の信託及び投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

#### 信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

金銭の信託、投資有価証券及び子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

#### 市場リスクの管理

金銭の信託及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,645,575	12,645,575	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,182,466	9,182,466	-
資産計	21,828,042	21,828,042	-

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	23,435,831	23,435,831	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,292,678	9,292,678	-
資産計	32,728,510	32,728,510	-

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
その他有価証券		
(1)非上場株式	39,809	40,370
(2)組合出資金等	-	643,909
合計	39,809	684,279

子会社株式 非上場株式	11,850,598	1,927,221
合計	11,850,598	1,927,221

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

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又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。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1)金銭の信託	-	12,645,575	-	12,645,575
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,182,466	-	9,182,466
資産計	-	21,828,042	-	21,828,042

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1)金銭の信託	-	23,435,831	-	23,435,831
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,292,678	-	9,292,678
資産計	-	32,728,510	-	32,728,510

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

#### (1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

#### (2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

前事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

#### 2. その他有価証券

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,038,462	6,295,278	256,815

小計	6,038,462	6,295,278	256,815
合計	9,182,466	9,349,645	167,178

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2024年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,489,939	3,297,367	192,572
小計	3,489,939	3,297,367	192,572
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,802,739	6,025,562	222,822
小計	5,802,739	6,025,562	222,822
合計	9,292,678	9,322,929	30,250

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 684,279千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

### 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：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,675,637	25,848	152,691

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
6,449,143	119,033	83,598

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
801,686	12,261	48,575

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
217,908	5,384	10,829

(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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

#### 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：千円）

	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	5,084,506	5,027,832
勤務費用	429,188	423,516
利息費用	6,502	11,432
数理計算上の差異の発生額	12,781	34,405
退職給付の支払額	479,583	466,321
過去勤務費用の発生額	-	20,064
退職給付債務の期末残高	5,027,832	4,941,989

##### (2) 退職給付債務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：千円）

	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	5,027,832	4,941,989
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989



## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	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	429,188	423,516
利息費用	6,502	11,432
数理計算上の差異の費用処理額	12,781	34,405
過去勤務費用の費用処理額	-	20,064
その他	39,914	67,197
確定給付制度に係る退職給付費用	382,994	447,675

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金であります。

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	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)
割引率	0.230%	0.440%

## 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241,556千円、当事業年度264,552千円であります。

## (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

(単位：千円)

	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		
退職給付引当金	1,539,522	1,513,237
賞与引当金	551,617	873,913
調査費	473,972	558,908
未払金	211,439	176,993
未払事業税	39,995	365,090
ソフトウェア償却	105,506	101,113
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	120,350	109,942
その他	21,158	18,064
繰延税金資産小計	3,178,439	3,832,139
評価性引当額	193,662	198,503
繰延税金資産合計	2,984,776	3,633,635
繰延税金負債		
無形固定資産	3,504,563	2,857,478
資産除去債務	3,201	-
その他有価証券評価差額金	27,506	60,063
繰延税金負債合計	3,535,270	2,917,542
繰延税金資産（負債）の純額	550,493	716,093

## 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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%

## （調整）

受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.0	10.6
のれん償却費	2.9	0.2
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.0	0.1
所得税額控除による税額控除	1.3	-
その他	1.2	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.0	20.4

## （収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

## （セグメント情報等）

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 3.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 4.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 5.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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至2024年3月31日）

## 1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計

外部顧客への 営業収益	69,953,226	11,147,187	1,302,916	328,311	82,731,642
----------------	------------	------------	-----------	---------	------------

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 3.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 4.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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 5.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)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1.関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	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	科目	期末残高
親会社 の子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,279,199	未払 手数料	1,265,651
親会社 の子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	7,030,381	未払 手数料	1,288,749

## (注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

## 1.関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	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	科目	期末残高
親会社 の子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,642,605	未払 手数料	1,630,250
親会社 の子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	135,000,000	証券業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,960,278	未払 手数料	1,200,878

## (注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.親会社に関する注記

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社	㈱三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区	2,344,038,000	銀行業	50.1%	持株会社	子会社株式の売却(売却価格)	24,000,000	-	-
							子会社株式売却益	14,096,622		

(注) 子会社株式の売却及び子会社株式売却益

取引価額については、企業価値を勘案し、両社協議のうえ合理的に決定しております。

#### (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	2,587.21円	3,289.22円
1株当たり当期純利益	61.91円	746.27円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次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)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	2,097,028	25,276,287
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	2,097,028	25,276,287
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

#### 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。

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 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。)または子法人等(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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

## イ 定款の変更、その他の重要事項

## (イ) 定款の変更

該当ありません。

## (ロ) その他の重要事項

該当ありません。

## ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

## 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】

## イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（2024年3月末現在）

(ハ) 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。

## 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

・ 名称 株式会社日本カストディ銀行

・ 資本金の額 51,000百万円（2024年3月末現在）

・ 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。

## ロ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2024年3月末現在	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	135,000	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。

## 2【関係業務の概要】

## イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

## ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受け付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

## 3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当事項はありません。

## 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
2023年10月26日	有価証券届出書
2023年10月26日	有価証券報告書
2024年 4月25日	有価証券届出書
2024年 4月25日	半期報告書

**独立監査人の監査報告書**

2024年6月14日

三井住友DS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 佐藤 栄 裕指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康 治**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DS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39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DS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並びに監査役及び監査役会の責任**

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・日本株インデックスの2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・日本株インデックスの2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立



案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立



案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・日本債インデックスの2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・日本債インデックスの2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立



案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・Jリートインデックスの2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・Jリートインデックスの2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立



案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRL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10月9日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられている日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）の2023年8月1日から2024年7月31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、日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）の2024年7月31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DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

三井住友DS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. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。