

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年11月20日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル経済コア
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル経済コア

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

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

（６）【申込単位】

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

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

（７）【申込期間】

2024年11月21日から2025年 5月20日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込みコース >

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

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

問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

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

- 日本を含む世界^{*}の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)、債券、及び不動産投資信託証券(REIT)、並びに金に分散投資します。
※REITは新興国を含みません。
*コマーシャルペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。
- 各マザーファンドは各投資対象市場の代表的な指数(インデックス)[※]への連動を目指す運用を行います。

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

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



? ファミリーファンド方式とは

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

? DR(預託証券)とは

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

2. 世界経済全体の発展を享受します。

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

基本資産配分比率及び各マザーファンド受益証券の基本組入比率

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

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

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

※3 株式及び債券の地域別構成比は、原則として年1回見直しを行います。

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

ポートフォリオ構築プロセス

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



※基本資産配分比率は、市場動向等に応じて変動幅の範囲で変更する場合があります。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

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

ただし、分配を行わないことがあります。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

（2）【ファンドの沿革】

2017年11月30日

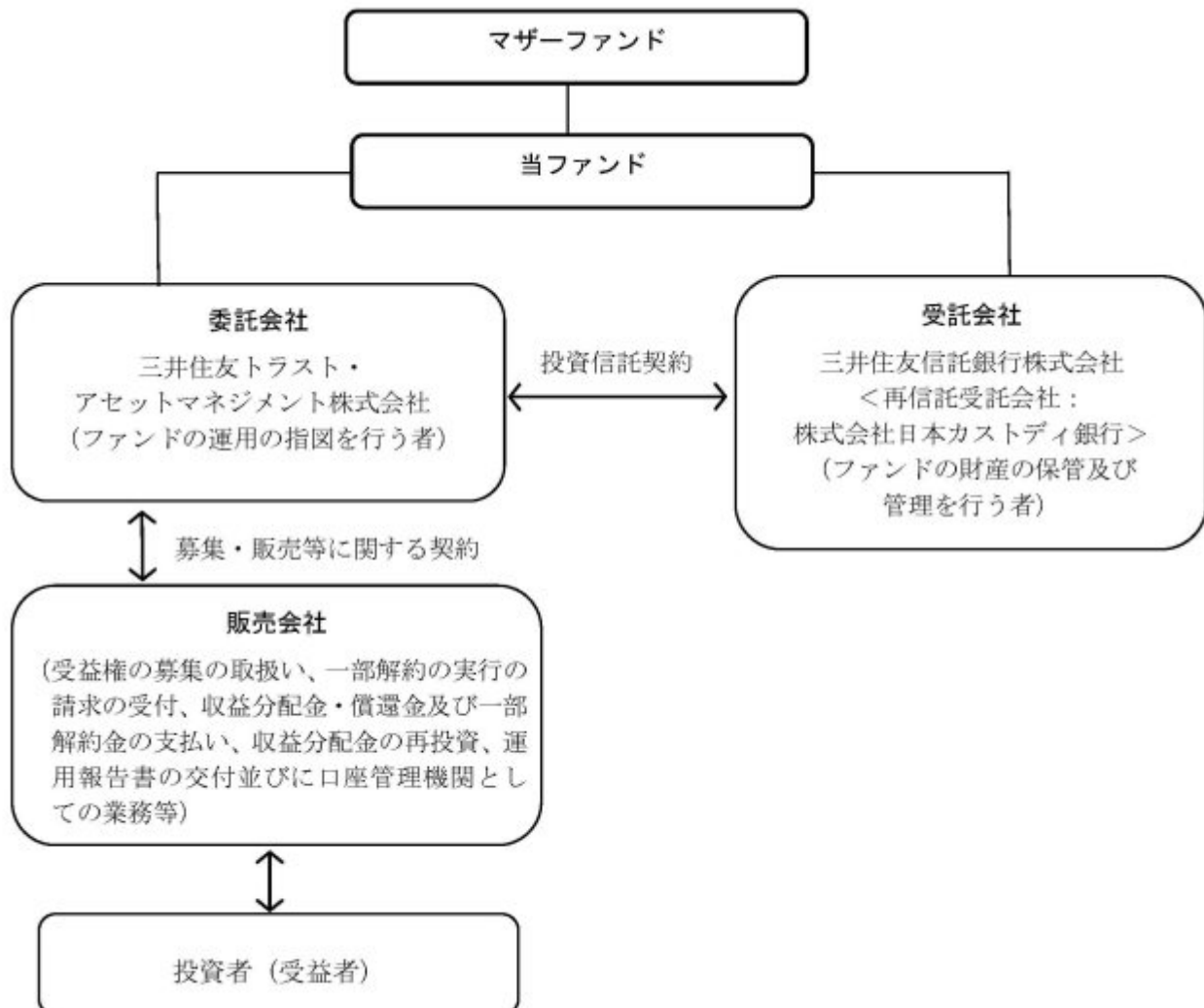
当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2023年11月22日

信託期間の延長（終了日を2027年8月20日から無期限へ変更）

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2024年10月1日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%
------------------	-------------------	--------	------

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREIT インデックス マザーファンド」及び「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」という場合があります。）を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

投資態度

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

REITは新興国を含みません。

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

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

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

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

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

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

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

（参考）マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1．基本方針

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

2．運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引及び金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

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

※2「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

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

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

「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

2025年2月11日付で、上記の次に以下の規定を追加し、上記をに繰り下げる変更を予定しています。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。)のうち不動産投信指数を対象とする先物取引ならびに外国の取引所における当該取引と類似の取引(以下「不動産投信指数先物取引」といいます。)を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

券借入れ)に限り行うことができますものとし、

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

2025年2月11日付で、上記の次に以下の規定を追加する変更を予定しています。

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

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

「ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

<別に定める金現物に投資する上場投資信託証券>（2024年 9月30日現在）

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

(2)投資態度

主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）⁹（「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。

投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。

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

の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

2025年2月11日付で、上記 を以下の内容に変更することを予定しています。

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

3. 運用制限

株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

2025年2月11日付で、上記 を以下の内容に変更することを予定しています。

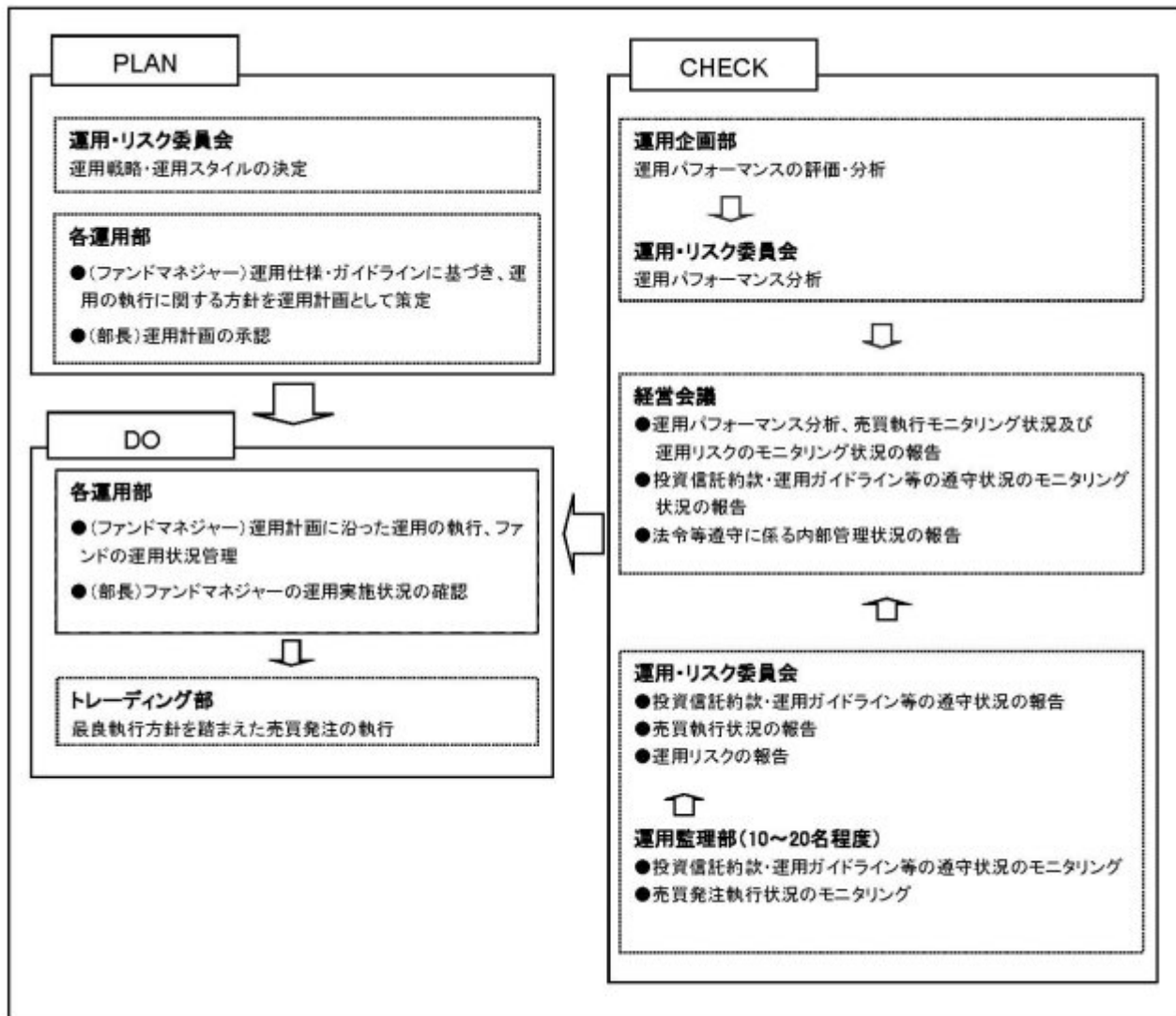
デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

- 9 金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）とはLBMA金価格（円ヘッジベース）です（2024年9月30日現在）。LBMA金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド（ICE Benchmark Administration Limited）によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格（米ドル建て）を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会（London Bullion Market Association）の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

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

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

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

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

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

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

カ．資金の借入れ

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

ヨ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合

には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様はに帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

為替変動リスク

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

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

金利変動リスク

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

債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

リートの価格変動リスク

リートの価格は、不動産市況（不動産稼働率、賃貸料、不動産価格等）、金利変動、社会情勢の変

化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。また、リート及びリートの運用会社の業績、財務状況の変化等により価格が変動し、基準価額の変動要因となります。

信用リスク

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

カントリーリスク

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

流動性リスク

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

有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年10月～2024年9月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての適合性を有するマーケット・ベンチマークで、円建てベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、漏誤又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、修正又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIロクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、漏誤又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan エマージング・マーケット・グローバル・ディバインデックス (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による明示的承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（２）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.605%（税抜 0.55%）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

2024年11月20日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品賃料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま

す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

八．損益通算について

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

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

二．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

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

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

上記は、2024年9月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.67%	0.60%	0.07%

※対象期間は2023年8月22日～2024年8月20日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年9月30日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	23,326,667,708	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		215,939,085	0.92
合計(純資産総額)		23,542,606,793	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3,085,493,797	1.5039	4,640,540,763	1.5796	4,873,846,001	20.70
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	685,542,718	6.5193	4,469,286,733	6.5421	4,484,889,015	19.05
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,248,517,616	3.5553	4,438,899,664	3.5307	4,408,141,146	18.72
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	633,204,116	4.4863	2,840,773,255	4.6656	2,954,277,123	12.55
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	1,237,166,531	2.2889	2,831,871,441	2.2966	2,841,276,655	12.07
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	378,268,400	3.0651	1,159,450,497	3.1754	1,201,153,477	5.10
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	558,630,350	2.0888	1,166,899,028	2.0737	1,158,431,756	4.92
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	296,098,220	2.7747	821,589,290	2.7769	822,235,147	3.49
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	441,225,294	1.3153	580,344,681	1.3200	582,417,388	2.47

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.08
合計	99.08

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末	(2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
第3期計算期間末	(2020年 8月20日)	11,044,987,442	11,044,987,442	10,880	10,880
第4期計算期間末	(2021年 8月20日)	10,716,800,292	10,716,800,292	12,281	12,281
第5期計算期間末	(2022年 8月22日)	11,407,002,963	11,407,002,963	12,927	12,927
第6期計算期間末	(2023年 8月21日)	12,110,129,607	12,110,129,607	13,500	13,500
第7期計算期間末	(2024年 8月20日)	22,415,220,736	22,415,220,736	15,550	15,550
	2023年 9月末日	12,389,610,125		13,525	
	10月末日	12,340,665,567		13,409	
	11月末日	12,899,765,737		14,036	
	12月末日	13,099,474,099		14,129	
	2024年 1月末日	14,358,584,348		14,403	
	2月末日	15,761,847,220		14,746	
	3月末日	17,614,240,834		15,214	
	4月末日	18,402,622,375		15,517	
	5月末日	19,608,565,159		15,634	
	6月末日	21,974,074,966		16,136	
	7月末日	22,217,561,670		15,637	
	8月末日	22,592,274,010		15,460	
	9月末日	23,542,606,793		15,789	

【分配の推移】

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

第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	0
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0
第7期計算期間	2023年 8月22日～2024年 8月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	8.6
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	12.9
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	5.3
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	4.4
第7期計算期間	2023年 8月22日～2024年 8月20日	15.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	3,287,324,947	5,855,394,358	10,151,427,698
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	1,307,931,638	2,732,701,316	8,726,658,020
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,388,526,736	1,290,690,879	8,824,493,877
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	1,225,075,777	1,078,889,688	8,970,679,966
第7期計算期間	2023年 8月22日～2024年 8月20日	6,412,560,519	968,536,784	14,414,703,701

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	661,440,523,950	98.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,507,805,123	1.71
合計(純資産総額)		672,948,329,073	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	11,172,450,000	1.66

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,445,100	3,347.13	31,614,023,088	2,542.50	24,014,166,750	3.57
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,221,000	2,502.31	15,566,877,374	2,777.50	17,278,827,500	2.57
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,312,300	3,179.64	13,711,567,449	3,781.00	16,304,806,300	2.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,656,700	1,626.40	17,332,066,680	1,453.50	15,489,513,450	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	177,800	69,643.48	12,382,612,319	68,360.00	12,154,408,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,315,400	7,778.57	10,231,936,825	8,705.00	11,450,557,000	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,648,600	3,329.13	12,146,663,718	3,045.00	11,109,987,000	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,609,600	3,326.78	12,008,351,632	2,952.50	10,657,344,000	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,263,600	7,265.08	9,180,155,361	7,678.00	9,701,920,800	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	1,596,000	5,895.22	9,408,782,840	5,977.00	9,539,292,000	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	376,000	34,923.45	13,131,218,689	25,290.00	9,509,040,000	1.41
日本	株式	三井物産	卸売業	2,816,000	3,970.25	11,180,234,940	3,178.00	8,949,248,000	1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,708,500	5,348.30	9,137,584,960	5,231.00	8,937,163,500	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	1,121,700	8,241.53	9,244,534,650	7,636.00	8,565,301,200	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	53,005,500	151.83	8,048,084,028	146.80	7,781,207,400	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	879,000	8,912.16	7,833,793,698	8,427.00	7,407,333,000	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	1,552,400	5,452.19	8,463,993,600	4,709.00	7,310,251,600	1.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,362,000	3,116.27	7,360,645,282	2,936.00	6,934,832,000	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	349,800	18,642.05	6,520,991,356	19,785.00	6,920,793,000	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	3,138,200	1,329.27	4,171,516,308	2,117.50	6,645,138,500	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,577,100	4,110.00	6,481,895,644	4,103.00	6,470,841,300	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,209,800	1,725.66	7,264,715,972	1,507.50	6,346,273,500	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,310,700	4,285.47	5,616,978,414	4,594.00	6,021,355,800	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	28,482,000	187.48	5,339,924,580	187.20	5,331,830,400	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	105,700	40,382.22	4,268,400,930	47,420.00	5,012,294,000	0.74
日本	株式	富士通	電気機器	1,651,300	2,263.84	3,738,285,364	2,935.50	4,847,391,150	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,965,700	2,669.35	5,247,153,430	2,303.50	4,527,989,950	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,587,200	2,942.93	4,671,033,137	2,806.50	4,454,476,800	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,063,100	4,385.25	4,661,964,538	4,179.00	4,442,694,900	0.66
日本	株式	ダイキン工業	機械	214,200	22,719.61	4,866,541,104	20,075.00	4,300,065,000	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.27
		建設業	2.19
		食料品	3.22
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.71
		医薬品	4.57
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.85
		非鉄金属	0.79
		金属製品	0.50
		機械	5.44
		電気機器	17.38
		輸送用機器	7.09
		精密機器	2.39
		その他製品	2.47
		電気・ガス業	1.35
		陸運業	2.35
		海運業	0.79
		空運業	0.38
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.43
		卸売業	7.25
		小売業	4.44
		銀行業	7.29
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	2.99
その他金融業	1.19		
不動産業	1.92		
サービス業	4.67		
	小計	98.29	
合計		98.29	

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	422円		11,109,762,500	11,172,450,000	1.66

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	570,702,119,170	84.80
地方債証券	日本	34,234,679,100	5.09
特殊債券	日本	35,961,440,148	5.34
	国際機関	298,305,000	0.04
	小計	36,259,745,148	5.39
社債券	日本	29,568,031,000	4.39
	フランス	1,393,940,000	0.21
	オーストラリア	99,805,000	0.01
	韓国	99,418,000	0.01
小計	31,161,194,000	4.63	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		632,801,622	0.09
合計(純資産総額)		672,990,539,040	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.46	6,469,413,300	98.95	6,501,474,900	0.100	2028/3/20	0.97
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	6,180,000,000	96.25	5,948,424,400	98.28	6,073,827,600	0.600	2033/12/20	0.90
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	6,120,000,000	94.75	5,798,873,400	96.44	5,902,372,800	0.200	2032/9/20	0.88
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,900,000,000	99.42	5,865,783,200	99.53	5,872,447,000	0.005	2026/3/20	0.87
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	99.31	5,859,467,000	99.46	5,868,258,000	0.100	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	5,700,000,000	101.76	5,800,738,700	102.24	5,827,908,000	1.100	2034/6/20	0.87
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,850,000,000	98.75	5,776,891,400	98.99	5,790,973,500	0.005	2027/6/20	0.86
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	5,880,000,000	96.22	5,658,174,000	98.28	5,779,040,400	0.500	2033/3/20	0.86

日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	99.08	5,697,387,500	99.32	5,711,360,000	0.100	2027/3/20	0.85
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	5,580,000,000	96.07	5,360,970,000	97.38	5,433,859,800	0.100	2030/12/20	0.81
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	5,540,000,000	95.18	5,273,166,500	97.17	5,383,495,000	0.400	2033/6/20	0.80
日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	5,360,000,000	98.21	5,264,388,100	100.33	5,377,956,000	0.800	2033/9/20	0.80
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	5,320,000,000	97.65	5,195,287,100	99.78	5,308,296,000	0.800	2034/3/20	0.79
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,325,000,000	98.29	5,234,346,200	98.82	5,262,591,000	0.100	2028/6/20	0.78
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,370,000,000	96.34	5,173,458,000	97.56	5,239,401,600	0.100	2030/9/20	0.78
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,400,000,000	95.20	5,140,800,000	97.00	5,238,162,000	0.200	2032/3/20	0.78
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	5,160,000,000	99.68	5,143,853,000	99.78	5,148,699,600	0.100	2025/12/20	0.77
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	98.65	5,090,494,800	99.06	5,111,599,200	0.100	2027/12/20	0.76
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	5,260,000,000	95.63	5,030,397,400	96.99	5,101,674,000	0.100	2031/6/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,170,000,000	96.55	4,991,806,000	98.56	5,095,552,000	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	5,100,000,000	98.91	5,044,894,900	99.16	5,057,313,000	0.100	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	5,030,000,000	100.00	5,030,000,000	100.02	5,031,207,200	0.300	2025/12/20	0.75
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,120,000,000	95.06	4,867,072,000	96.75	4,953,702,400	0.100	2031/9/20	0.74
日本	国債証券	第148回利付国債（5年）	4,960,000,000	99.21	4,920,816,000	99.40	4,930,339,200	0.005	2026/6/20	0.73
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	99.20	4,841,057,600	99.39	4,850,427,200	0.100	2026/12/20	0.72
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	99.56	4,739,056,000	99.67	4,744,339,600	0.100	2026/3/20	0.70
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	4,800,000,000	97.32	4,671,385,800	98.06	4,706,880,000	0.100	2029/9/20	0.70
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	4,790,000,000	94.93	4,547,587,400	96.72	4,633,271,200	0.200	2032/6/20	0.69
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	4,767,000,000	94.73	4,515,849,100	96.50	4,600,441,020	0.100	2031/12/20	0.68
日本	国債証券	第149回利付国債（5年）	4,580,000,000	99.09	4,538,322,000	99.27	4,546,840,800	0.005	2026/9/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.80
地方債証券	5.09
特殊債券	5.39
社債券	4.63
合計	99.91

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	534,552,020,291	69.74
	イギリス	28,508,147,884	3.72
	カナダ	24,723,718,957	3.23
	スイス	22,512,476,746	2.94
	フランス	21,118,878,997	2.76
	ドイツ	17,949,847,322	2.34
	アイルランド	13,789,799,456	1.80
	オーストラリア	13,752,851,513	1.79
	オランダ	13,482,063,072	1.76
	デンマーク	6,739,023,228	0.88
	スウェーデン	6,731,170,491	0.88
	スペイン	5,412,077,796	0.71
	イタリア	4,281,776,138	0.56
	香港	3,046,582,363	0.40
	シンガポール	2,205,378,641	0.29
	フィンランド	2,044,026,893	0.27
	ベルギー	1,604,908,703	0.21
	イスラエル	1,494,727,941	0.20
	ジャージー	1,235,753,150	0.16
	ノルウェー	1,124,906,897	0.15
	ケイマン	1,061,834,662	0.14
	バミューダ	919,995,930	0.12
	キュラソー	665,698,034	0.09
	ニュージーランド	533,651,835	0.07
	リベリア	518,969,020	0.07
	ルクセンブルク	389,317,107	0.05
	オーストリア	376,325,140	0.05
	ポルトガル	322,470,301	0.04
	パナマ	190,024,642	0.02
	マン島	74,765,738	0.01
	小計	731,363,188,888	95.41
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	63,812,200	0.01
	香港	58,212,693	0.01
	小計	122,024,893	0.02

投資証券	アメリカ	12,686,333,199	1.66
	オーストラリア	1,006,977,186	0.13
	フランス	309,609,998	0.04
	イギリス	244,276,399	0.03
	シンガポール	221,072,854	0.03
	香港	174,226,591	0.02
	ベルギー	50,154,293	0.01
	カナダ	27,900,985	0.00
	小計	14,720,551,505	1.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		20,312,720,382	2.65
合計(純資産総額)		766,518,485,668	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	15,498,470,859	2.02
	買建	カナダ	517,839,852	0.07
	買建	ドイツ	2,660,497,148	0.35
	買建	イギリス	1,120,047,096	0.15
	買建	オーストラリア	570,511,305	0.07

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,628,534,884	0.21

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,155,407	27,216.34	31,445,961,048	32,512.46	37,565,131,612	4.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	560,017	61,369.07	34,367,726,341	61,091.29	34,212,163,528	4.46
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,951,142	16,255.37	31,716,538,166	17,327.42	33,808,260,816	4.41

アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	742,859	25,977.08	19,297,309,216	26,828.95	19,930,132,985	2.60
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	173,814	68,641.42	11,930,840,144	80,979.29	14,075,334,799	1.84
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	465,895	25,135.04	11,710,293,290	23,400.58	10,902,214,850	1.42
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	400,960	25,380.47	10,176,555,622	23,591.84	9,459,384,848	1.23
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	350,741	20,252.81	7,103,492,267	24,648.04	8,645,079,495	1.13
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	227,655	25,378.50	5,777,542,903	37,175.45	8,463,178,390	1.10
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	64,074	115,822.27	7,421,196,144	125,286.96	8,027,637,104	1.05
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	105,044	58,015.68	6,094,199,621	65,294.69	6,858,815,742	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	227,765	28,557.93	6,504,497,773	30,044.66	6,843,123,124	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,000	72,161.01	5,267,754,243	83,047.45	6,062,463,887	0.79
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	355,800	16,404.92	5,836,870,708	16,530.98	5,881,725,744	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,853	38,693.52	4,831,002,402	39,275.01	4,903,603,335	0.64
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	65,849	63,659.87	4,191,938,933	70,457.23	4,639,538,612	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,206	23,317.69	4,365,212,438	24,770.79	4,637,240,794	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	78,650	47,029.84	3,698,897,320	57,024.91	4,485,009,714	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,163	116,361.98	4,091,636,502	126,404.54	4,444,762,931	0.58
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	190,885	20,669.26	3,945,452,082	23,036.62	4,397,345,590	0.57
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	255,486	19,582.30	5,003,003,655	17,029.17	4,350,714,527	0.57
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	350,884	9,323.23	3,271,374,904	11,386.99	3,995,515,897	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,059	22,328.98	3,127,375,296	27,802.37	3,893,973,078	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,693	142,469.52	4,515,286,800	120,736.33	3,826,496,792	0.50
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,177	92,756.63	3,170,143,555	100,960.06	3,450,512,159	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	324,600	8,859.76	2,875,880,364	10,246.58	3,326,042,043	0.43
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	200,889	17,968.28	3,609,629,885	16,226.97	3,259,820,520	0.43

アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	131,290	17,854.88	2,344,167,413	24,084.26	3,162,022,522	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	558,243	5,615.24	3,134,673,570	5,623.56	3,139,314,122	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	76,856	38,444.00	2,954,652,772	39,484.82	3,034,645,879	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.96
		素材	3.66
		資本財	7.00
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.69
		耐久消費財・アパレル	1.30
		消費者サービス	1.89
		メディア・娯楽	6.17
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.73
		生活必需品流通・小売り	1.74
		食品・飲料・タバコ	3.07
		家庭用品・パーソナル用品	1.58
		ヘルスケア機器・サービス	4.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.58
		銀行	5.40
		金融サービス	6.62
		保険	3.08
		エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.04
		ソフトウェア・サービス	9.50
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.38		
電気通信サービス	1.17		
公益事業	2.71		
半導体・半導体製造装置	8.75		
不動産管理・開発	0.28		
	小計	95.41	
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.92
合計			97.35

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	375	アメリカドル	107,098,630	15,286,187,460	108,585,937.5	15,498,470,859	2.02
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	17	カナダドル	4,866,244.5	513,729,431	4,905,180	517,839,852	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	38	スイスフラン	4,589,066	778,810,390	4,663,740	791,483,315	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	230	ユーロ	11,284,346	1,799,063,283	11,723,100	1,869,013,833	0.24
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	28	オーストラリアドル	5,740,871	566,796,194	5,778,500	570,511,305	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	70	イギリスポンド	5,862,457.5	1,119,905,256	5,863,200	1,120,047,096	0.15

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	9,380,000.00	1,359,000,800	1,338,578,634	0.17
	ユーロ	買建	1,100,000.00	178,718,100	175,354,630	0.02
	イギリスポンド	買建	600,000.00	116,995,200	114,601,620	0.01

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	162,451,816,837	45.33
	中国	38,468,325,877	10.73
	フランス	26,864,518,346	7.50
	イタリア	24,514,619,105	6.84
	ドイツ	21,304,906,293	5.94
	イギリス	19,185,384,690	5.35
	スペイン	15,997,924,905	4.46
	カナダ	6,789,129,903	1.89
	ベルギー	5,656,139,981	1.58
	オランダ	4,765,828,235	1.33
	オーストラリア	4,710,421,934	1.31

	オーストリア	4,074,470,882	1.14
	メキシコ	2,590,006,415	0.72
	マレーシア	1,893,221,177	0.53
	ポーランド	1,876,405,503	0.52
	フィンランド	1,818,973,910	0.51
	アイルランド	1,706,971,005	0.48
	シンガポール	1,450,719,763	0.40
	イスラエル	1,079,389,570	0.30
	ニュージーランド	966,432,601	0.27
	デンマーク	933,877,651	0.26
	スウェーデン	564,684,219	0.16
	ノルウェー	548,561,435	0.15
	小計	350,212,730,237	97.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,201,226,115	2.29
合計(純資産総額)		358,413,956,352	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,703,437,966	0.48
	買建	ドイツ	1,496,088,728	0.42

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,889,176,502	1.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	15,500,000	13,263.29	2,055,810,992	13,738.87	2,129,526,014	1.500	2026/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	12,689.95	2,043,083,214	13,082.93	2,106,352,182	0.375	2027/7/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	13,432.23	2,041,699,126	13,707.37	2,083,521,237	2.625	2029/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	14,131.10	1,999,551,534	14,723.77	2,083,413,499	4.375	2028/8/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,047.25	1,778,340,217	13,925.65	1,898,066,520	3.375	2033/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	13,336.70	1,763,112,135	13,945.72	1,843,624,782	2.875	2028/8/15	0.51

アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	12,518.14	1,614,840,806	13,382.88	1,726,392,668	2.750	2032/8/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	14,080.63	1,633,354,087	14,566.26	1,689,686,811	4.000	2034/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1% 07/31/28	13,000,000	12,392.43	1,611,016,314	12,996.51	1,689,546,868	1.000	2028/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	13,522.35	1,663,249,661	13,724.93	1,688,167,504	1.625	2026/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,345.81	1,560,125,482	13,869.06	1,621,293,461	2.375	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	13,609.86	1,506,612,357	14,439.14	1,598,413,525	3.875	2033/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,198.62	1,478,245,685	14,072.00	1,576,064,804	3.500	2033/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	12,357.57	1,486,616,215	13,034.98	1,568,108,639	1.125	2028/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,427.32	1,437,556,935	12,268.92	1,543,430,863	1.375	2031/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	10,550,000	13,534.77	1,427,918,470	14,607.52	1,541,093,722	4.250	2054/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,391.53	1,442,267,864	13,822.50	1,488,684,158	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	11,805.05	1,383,552,244	12,647.77	1,482,319,065	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	13,418.85	1,396,902,301	14,061.97	1,463,851,222	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	13,026.90	1,406,905,216	13,528.12	1,461,037,804	0.625	2026/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,151.73	1,415,173,531	14,493.50	1,449,350,672	4.500	2026/7/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,256.15	1,345,110,652	12,068.76	1,442,217,938	0.625	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,363.09	1,344,327,483	13,965.79	1,404,959,071	2.875	2028/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	9,270,000	14,220.59	1,318,248,809	15,122.68	1,401,873,318	4.500	2033/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	14,197.45	1,351,597,567	14,568.49	1,386,920,784	4.625	2026/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	10,980,000	11,887.61	1,305,259,951	12,624.91	1,386,215,615	1.625	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	12,682.61	1,280,944,604	13,537.60	1,367,298,199	2.875	2032/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,365.15	1,267,214,782	12,184.45	1,358,567,150	0.875	2030/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/29	10,200,000	12,861.92	1,311,916,479	13,269.70	1,353,510,260	1.750	2029/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	13,922.86	1,280,903,623	14,691.15	1,351,586,201	4.125	2030/8/31	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.71
合計	97.71

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 5YR NOTE	買建	44	アメリカドル	4,847,920.11	691,943,637	4,851,000	692,383,230	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	28	アメリカドル	3,212,359.75	458,500,106	3,212,562.64	458,529,065	0.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	31	アメリカドル	3,884,274.3	554,402,471	3,871,125	552,525,671	0.15
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	15	ユーロ	1,604,116.5	255,744,294	1,607,025	256,207,996	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	21	ユーロ	2,511,534.1	400,413,882	2,519,370	401,663,159	0.11

ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	EURO-BUND	買建	39	ユーロ	5,239,701.9	835,365,673	5,257,590	838,217,573	0.23
-----	-----------------------	-----------	----	----	-----	-------------	-------------	-----------	-------------	------

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	13,030,000.00	1,859,249,985	1,855,797,750	0.52
	カナダドル	買建	1,420,000.00	149,437,921	149,646,700	0.04
	ユーロ	買建	7,520,000.00	1,192,962,684	1,197,033,600	0.33
	イギリスポンド	買建	1,190,000.00	224,355,016	226,837,800	0.06
	オフショア人民元	買建	22,520,000.00	455,105,917	459,860,652	0.13

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	インド	42,057,037,886	18.96
	台湾	37,725,152,325	17.01
	ケイマン	34,699,306,570	15.65
	韓国	22,809,333,968	10.29
	中国	21,058,924,803	9.50
	ブラジル	8,875,260,709	4.00
	サウジアラビア	8,078,116,396	3.64
	南アフリカ	6,328,368,277	2.85
	メキシコ	3,648,012,039	1.64
	インドネシア	3,563,849,075	1.61
	マレーシア	3,211,363,375	1.45
	タイ	3,165,575,616	1.43
	アラブ首長国連邦	2,488,630,635	1.12
	香港	1,862,606,307	0.84
	ポーランド	1,750,015,704	0.79
	カタール	1,635,848,672	0.74
	クウェート	1,437,520,107	0.65
	トルコ	1,333,706,492	0.60
	フィリピン	1,240,111,212	0.56
	ギリシャ	997,800,953	0.45
	チリ	915,409,906	0.41
	バミューダ	752,190,437	0.34
アメリカ	701,608,879	0.32	

	ハンガリー	535,429,683	0.24
	イギリス	300,755,028	0.14
	ルクセンブルク	263,599,542	0.12
	チェコ	251,689,733	0.11
	コロンビア	165,452,191	0.07
	エジプト	118,027,884	0.05
	シンガポール	81,771,483	0.04
	ペルー	74,215,946	0.03
	ロシア	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	212,126,691,833	95.65
投資信託受益証券	ブラジル	341,953,684	0.15
	メキシコ	125,409,638	0.06
	小計	467,363,322	0.21
投資証券	メキシコ	205,090,919	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,972,614,611	4.05
合計(純資産総額)		221,771,760,685	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,006,137,397	4.06

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		867,795,907	0.39
	売建		1,558,157	0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	4,408,389	2,628.52	11,587,543,206	4,513.59	19,897,704,590	8.97
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,168,800	5,668.15	6,624,935,947	8,042.38	9,399,940,757	4.24

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	857,794	7,736.44	6,636,278,777	7,023.47	6,024,699,003	2.72
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,735,288	1,500.97	4,105,607,892	1,882.92	5,150,342,157	2.32
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	552,888	4,074.21	2,252,582,745	5,219.60	2,885,856,416	1.30
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	904,050	2,072.39	1,873,546,759	3,023.70	2,733,577,793	1.23
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	124,381	15,538.56	1,932,702,630	19,322.78	2,403,387,620	1.08
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	762,664	2,633.82	2,008,724,269	2,997.37	2,285,988,863	1.03
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	931,368	1,636.98	1,524,634,594	2,234.11	2,080,783,219	0.94
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	97,741	14,516.93	1,418,899,888	20,107.72	1,965,348,661	0.89
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	598,702	2,403.39	1,438,917,097	3,261.31	1,952,554,017	0.88
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,259,248	456.89	1,032,236,981	862.09	1,947,692,279	0.88
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	16,601,620	82.59	1,371,130,604	110.03	1,826,780,839	0.82
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	277,804	4,262.41	1,184,114,574	5,687.13	1,579,909,129	0.71
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	457,159	1,776.81	812,286,560	2,967.27	1,356,517,615	0.61
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	444,911	1,863.49	829,088,852	2,792.24	1,242,298,291	0.56
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	354,607	2,761.34	979,190,897	3,357.49	1,190,589,811	0.54
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	161,114	5,848.33	942,249,049	7,368.47	1,187,164,562	0.54
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	32,598	27,127.39	884,298,712	35,193.38	1,147,233,873	0.52
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,704,200	303.57	820,928,034	403.22	1,090,391,580	0.49
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,178,000	692.71	816,017,477	892.78	1,051,697,196	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,091,515	69.61	841,760,661	86.52	1,046,190,525	0.47
ブラジル	株式	VALE SA	素材	621,587	1,830.40	1,137,758,034	1,678.68	1,043,450,491	0.47
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	10,195,000	86.51	882,048,544	101.17	1,031,479,125	0.47
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	500,000	2,136.98	1,068,494,300	1,979.66	989,832,550	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	14,349,200	52.24	749,668,552	68.52	983,208,619	0.44
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	187,000	4,426.25	827,709,906	5,066.44	947,425,402	0.43
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	421,633	1,772.53	747,357,956	2,175.37	917,210,520	0.41
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	338,630	3,247.29	1,099,632,318	2,678.34	906,968,306	0.41
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	165,233	2,806.58	463,739,819	5,441.30	899,083,232	0.41

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.60
		素材	6.29
		資本財	4.66
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	3.76
		耐久消費財・アパレル	1.14
		消費者サービス	2.72
		メディア・娯楽	6.18
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.45
		生活必需品流通・小売り	1.20
		食品・飲料・タバコ	2.97
		家庭用品・パーソナル用品	0.72
		ヘルスケア機器・サービス	0.85
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.58
		銀行	16.41
		金融サービス	2.65
		保険	2.90
		ソフトウェア・サービス	2.46
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.55
電気通信サービス	2.72		
公益事業	2.77		
半導体・半導体製造装置	11.85		
不動産管理・開発	1.40		
		小計	95.65
投資信託受益証券			0.21
投資証券			0.09
合計			95.95

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	1,058	アメリカドル	59,049,222	8,428,095,455	63,099,120	9,006,137,397	4.06

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	6,080,901.72	883,352,176	867,795,907	0.39
	ブラジルリアル	売建	59,367.68	1,587,776	1,558,157	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	マレーシア	15,475,670,675	10.03
	インドネシア	15,129,878,457	9.81
	中国	14,959,227,604	9.69
	メキシコ	14,788,693,209	9.58
	タイ	14,786,053,777	9.58
	南アフリカ	13,541,617,990	8.78
	ブラジル	12,551,664,753	8.13
	ポーランド	11,710,666,575	7.59
	チェコ	8,474,052,860	5.49
	コロンビア	5,862,875,090	3.80
	ルーマニア	5,728,674,058	3.71
	インド	4,453,221,328	2.89
	ハンガリー	4,282,825,998	2.78
	ペルー	3,036,537,288	1.97
	チリ	2,734,693,420	1.77
	ドミニカ共和国	374,615,184	0.24
ウルグアイ	270,497,349	0.18	
	小計	148,161,465,615	96.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,141,332,485	3.98
合計(純資産総額)		154,302,798,100	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,921,852,320	1.25

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	86,500,000	2,123.57	1,836,888,733	2,270.96	1,964,383,953	0.000	2026/1/1	1.27
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000	2,588.04	1,767,636,851	2,515.52	1,718,102,779	10.000	2027/1/1	1.11
南アフリ カ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	195,700,000	867.69	1,698,076,375	876.83	1,715,969,667	10.500	2026/12/21	1.11
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	220,000,000	677.87	1,491,325,440	773.57	1,701,858,649	8.875	2035/2/28	1.10
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	210,100,000	747.60	1,570,717,285	806.62	1,694,711,837	8.000	2030/1/31	1.10
マレーシ ア	国債証券	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000	3,807.84	1,664,026,403	3,835.01	1,675,903,732	4.893	2038/6/8	1.09
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,003.72	1,562,903,347	2,143.01	1,671,551,806	0.000	2026/7/1	1.08
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	68,000,000	2,266.81	1,541,436,206	2,416.61	1,643,297,749	0.000	2025/7/1	1.06
メキシコ	国債証券	MBONO 7% 09/03/26	225,600,000	680.04	1,534,192,787	694.14	1,565,990,705	7.000	2026/9/3	1.01
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	198,500,000	705.30	1,400,031,038	783.30	1,554,862,232	8.250	2032/3/31	1.01
マレーシ ア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000	3,464.38	1,489,685,232	3,504.21	1,506,812,021	3.733	2028/6/15	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000	649.10	1,368,320,403	675.76	1,424,506,700	7.750	2031/5/29	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000	639.49	1,342,946,700	669.01	1,404,922,984	5.500	2027/3/4	0.91
南アフリ カ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000	637.98	1,194,944,581	732.73	1,372,409,802	9.000	2040/1/31	0.89
コロンビ ア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	47,600,000,000	2.63	1,254,772,458	2.82	1,345,914,308	7.250	2034/10/18	0.87
マレーシ ア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	41,200,000	3,235.33	1,332,957,623	3,261.50	1,343,738,468	2.632	2031/4/15	0.87
南アフリ カ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000	605.87	1,143,280,524	700.79	1,322,408,939	8.750	2048/2/28	0.86
ポーラン ド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000	3,269.59	1,271,872,099	3,377.70	1,313,927,183	2.750	2029/10/25	0.85
ポーラン ド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000	3,883.38	1,258,217,657	3,948.04	1,279,166,886	6.000	2033/10/25	0.83
コロンビ ア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000	2.28	1,235,098,949	2.35	1,272,005,707	7.250	2050/10/26	0.82
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,516.62	1,293,546,832	2,441.05	1,254,703,473	10.000	2029/1/1	0.81
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	64,500,000	1,886.29	1,216,661,525	1,910.96	1,232,572,444	0.000	2027/7/1	0.80
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	657.57	1,152,733,714	688.29	1,206,581,073	5.750	2026/3/5	0.78
マレーシ ア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000	3,504.88	1,188,155,361	3,497.62	1,185,693,686	3.955	2025/9/15	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	193,000,000	596.27	1,150,814,422	610.56	1,178,383,623	7.750	2042/11/13	0.76
ポーラン ド	国債証券	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000	4,042.42	1,152,092,013	4,076.41	1,161,779,484	7.500	2028/7/25	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 05/26/33	176,000,000	633.39	1,114,782,931	651.41	1,146,487,558	7.500	2033/5/26	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000	689.69	1,066,272,253	707.90	1,094,420,340	8.500	2029/5/31	0.71
インドネ シア	国債証券	INDOGB 6.375% 04/15/32	115,000,000,000	0.92	1,061,122,913	0.94	1,088,654,400	6.375	2032/4/15	0.71

メキシコ	国債証券	MBONO 8% 11/07/47	175,700,000	610.04	1,071,856,855	618.69	1,087,045,765	8.000	2047/11/7	0.70
------	------	-------------------	-------------	--------	---------------	--------	---------------	-------	-----------	------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.02
合計	96.02

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	メキシコペソ	買建	40,580,000.00	292,483,452	292,435,712	0.19
	チェココルナ	買建	26,180,000.00	165,872,342	165,651,332	0.11
	ハンガリーフォリント	買建	212,350,000.00	85,228,658	85,009,012	0.06
	ポーランドズロチ	買建	6,170,000.00	229,260,583	229,321,624	0.15
	マレーシアリングット	買建	8,770,000.00	297,724,125	304,099,750	0.20
	タイバーツ	買建	65,180,000.00	282,777,860	287,117,900	0.19
	南アフリカランド	買建	31,770,000.00	258,506,906	264,167,550	0.17
	オフショア人民元	買建	14,400,000.00	292,480,280	294,049,440	0.19

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

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

J - R E I Tインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	106,819,158,400	96.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,505,803,708	3.18
合計(純資産総額)		110,324,962,108	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	3,488,242,500	3.16

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	62,345	121,061.54	7,547,581,820	131,800	8,217,071,000	7.45
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	10,979	558,537.09	6,132,178,782	571,000	6,269,009,000	5.68
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	53,847	96,944.2	5,220,154,665	96,600	5,201,620,200	4.71
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	34,214	163,951.73	5,609,444,490	142,900	4,889,180,600	4.43
日本	投資証券	GLP投資法人	35,902	135,417.86	4,861,772,188	132,700	4,764,195,400	4.32
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	18,620	272,292.6	5,070,088,342	246,200	4,584,244,000	4.16
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	29,903	160,312.29	4,793,818,512	151,200	4,521,333,600	4.10
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	16,030	268,229.29	4,299,715,634	235,500	3,775,065,000	3.42
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	58,889	59,199.3	3,486,187,772	62,100	3,657,006,900	3.31
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	10,504	325,019.76	3,414,007,571	336,500	3,534,596,000	3.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	23,909	149,152.77	3,566,093,676	138,100	3,301,832,900	2.99
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	21,297	169,347.41	3,606,591,961	153,600	3,271,219,200	2.97
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,266	69,208.41	2,717,537,707	71,500	2,807,519,000	2.54
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	7,310	345,274.25	2,523,954,831	348,500	2,547,535,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	32,118	78,385.25	2,517,577,672	76,000	2,440,968,000	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	3,691	611,075.81	2,255,480,840	638,000	2,354,858,000	2.13
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	19,570	133,284.1	2,608,370,015	119,600	2,340,572,000	2.12
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	7,181	280,906.15	2,017,187,104	274,100	1,968,312,100	1.78
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	13,684	149,886.81	2,051,051,108	143,300	1,960,917,200	1.78
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,457	462,942.64	2,063,335,382	424,500	1,891,996,500	1.71
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,412	317,208.07	1,716,730,097	324,000	1,753,488,000	1.59
日本	投資証券	イオンリート投資法人	13,111	141,540.11	1,855,732,402	131,300	1,721,474,300	1.56
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	5,195	397,042.48	2,062,635,724	327,000	1,698,765,000	1.54
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,966	450,359.22	1,786,124,694	425,500	1,687,533,000	1.53
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	12,569	138,047.26	1,735,116,019	127,300	1,600,033,700	1.45
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	15,786	108,142.36	1,707,135,445	97,100	1,532,820,600	1.39
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,691	377,684.21	1,394,032,449	369,000	1,361,979,000	1.23
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	20,602	72,853.36	1,500,924,924	65,200	1,343,250,400	1.22
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	4,428	321,235.87	1,422,432,446	302,500	1,339,470,000	1.21
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	9,445	150,418.95	1,420,707,037	139,000	1,312,855,000	1.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.82
合計	96.82

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	2,031	円	3,556,654,500	3,488,242,500	3.16

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	98,669,442,735	77.63
	オーストラリア	9,411,469,804	7.40
	イギリス	5,984,576,190	4.71
	シンガポール	4,101,379,134	3.23
	フランス	2,385,942,967	1.88
	カナダ	1,797,536,362	1.41
	ベルギー	1,246,829,578	0.98
	香港	1,153,987,649	0.91
	スペイン	638,022,421	0.50
	ガーンジー	326,205,274	0.26
	韓国	223,984,609	0.18
	オランダ	181,360,834	0.14
	イスラエル	127,074,244	0.10
	ニュージーランド	108,929,421	0.09
	アイルランド	51,881,315	0.04
	ドイツ	38,991,795	0.03
イタリア	13,818,013	0.01	
	小計	126,461,432,345	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		638,785,668	0.50
合計(純資産総額)		127,100,218,013	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建		171,231,648	0.13

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	525,068	14,932.60	7,840,631,168	17,925.46	9,412,085,799	7.41
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	53,821	108,594.08	5,844,642,219	125,986.34	6,780,711,004	5.33
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	328,165	12,468.87	4,091,849,648	18,155.25	5,957,919,585	4.69
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	89,372	35,852.75	3,204,232,214	50,903.22	4,549,323,221	3.58
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	494,190	7,258.49	3,587,076,192	8,953.45	4,424,706,889	3.48
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	173,941	16,744.61	2,912,574,557	23,937.24	4,163,668,907	3.28
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	174,703	18,600.98	3,249,647,175	23,002.36	4,018,582,487	3.16
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	990,280	2,320.21	2,297,659,262	3,547.36	3,512,888,474	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	120,434	17,368.73	2,091,785,927	25,296.03	3,046,503,028	2.40
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	592,178	4,038.33	2,391,412,280	4,727.21	2,799,354,264	2.20
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	165,882	8,779.65	1,456,386,905	16,660.87	2,763,738,918	2.17
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,317	24,126.47	1,937,765,915	32,147.07	2,581,956,856	2.03
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	233,639	6,152.84	1,437,543,983	9,111.88	2,128,891,279	1.67
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	192,937	7,770.99	1,499,312,433	10,557.73	2,036,978,316	1.60
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	322,173	4,487.74	1,445,828,790	4,995.54	1,609,431,330	1.27
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	36,361	30,095.27	1,094,294,373	42,048.25	1,528,916,709	1.20
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	88,040	13,787.41	1,213,843,694	17,273.18	1,520,731,172	1.20
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,185	17,270.91	1,143,075,205	22,518.51	1,490,387,723	1.17
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	66,422	16,445.39	1,092,336,143	19,408.42	1,289,146,432	1.01
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	399,611	2,312.21	923,987,527	3,225.69	1,289,024,403	1.01
イギリス	投資証券	SEGO PLC	763,252	1,511.82	1,153,900,680	1,681.82	1,283,658,675	1.01
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	381,211	2,556.90	974,721,492	3,277.08	1,249,259,249	0.98
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,168	6,438.49	999,047,888	7,243.54	1,123,966,778	0.88
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	124,429	7,792.87	969,660,113	8,954.88	1,114,246,788	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	169,958	4,638.72	788,388,423	6,421.42	1,091,372,159	0.86
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	106,091	9,282.01	984,738,361	10,099.57	1,071,473,990	0.84
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,954,315	256.22	756,964,430	362.33	1,070,463,838	0.84
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	60,612	12,575.21	762,208,869	17,657.12	1,070,233,861	0.84
香港	投資証券	LINK REIT	1,455,600	720.17	1,048,279,715	732.04	1,065,563,974	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	400,398	2,346.95	939,714,335	2,587.69	1,036,107,863	0.82

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.50
合計	99.50

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,200,000.00	171,803,600	171,231,648	0.13

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	36,417,523,009	99.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		248,604,496	0.68
合計(純資産総額)		36,666,127,505	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		36,399,591,316	99.27

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	5,093,826	6,431.58	32,761,389,394	7,149.34	36,417,523,009	99.32

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.32
合計	99.32

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	256,151,695.00	36,536,185,259	36,399,591,316	99.27

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

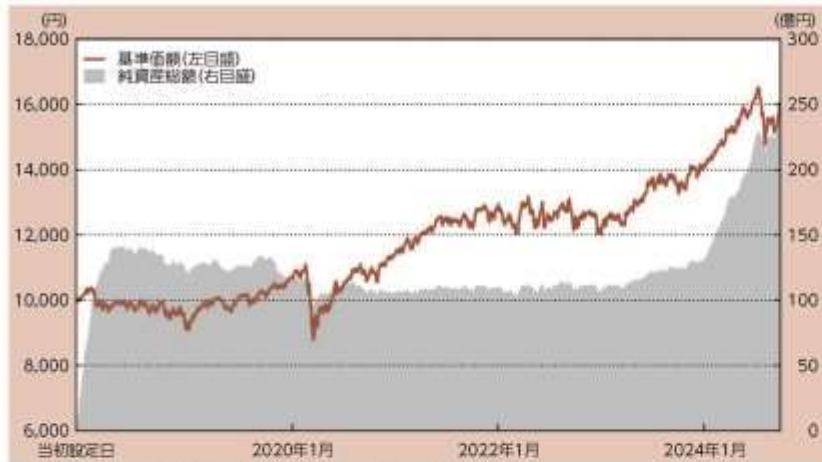
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2017年11月30日
 作成基準日：2024年9月30日

基準価額・純資産の推移

基準価額 15,789円

純資産総額 235.43億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年8月	0円
2021年8月	0円
2022年8月	0円
2023年8月	0円
2024年8月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
ゴールドマザーファンド (海昏ヘッジあり)	20.7%	iSHARES GOLD TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	-	-	-	20.6%
外国株式インデックス マザーファンド	19.1%	APPLE INC MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア/ソフトウェア ソフトウェア・サービス	-	-	0.9% 0.9%
外国債券インデックス マザーファンド	18.7%	T 1.5% 08/15/26 T 0.375% 07/31/27	アメリカ	国債	-	1.500% 0.375%	2026/08/15 2027/07/31	0.1% 0.1%
新興国株式インデックス マザーファンド	12.5%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC TENCENT HOLDINGS LTD	台湾 ケイマン島	株式	半導体・半導体製造装置 メディア・娯楽	-	-	1.1% 0.5%
新興国債券インデックス マザーファンド	12.1%	BLTN 0% 01/01/26 SAG8 10.5% 12/21/26	ブラジル 南アメリカ	国債	-	0.000% 10.500%	2026/01/01 2026/12/21	0.2% 0.1%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.1%	PROLOGIS INC EQUINIX INC	アメリカ	投資証券 投資証券	-	-	-	0.4% 0.3%
J-REITインデックス マザーファンド	4.9%	日本ビルファンド投資法人 ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.4% 0.3%
国内株式インデックス マザーファンド	3.5%	トヨタ自動車 ソニーグループ	日本	株式	輸送用機器 電気機器	-	-	0.1% 0.1%
国内債券インデックス マザーファンド	2.5%	第350回利付国債(10年) 第373回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100% 0.600%	2028/03/20 2033/12/20	0.0% 0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)


※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】
1【申込（販売）手続等】
< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込単位 >

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

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファン

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

ます。

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

(イ) 国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(ロ) 外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

(ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。（2017年11月30日設定）

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとします。

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

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

の内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2023年8月22日から2024年8月20日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【グローバル経済コア】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2023年 8月21日現在)	第7期 (2024年 8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,480,117	234,352,009
親投資信託受益証券	11,989,215,183	20,130,375,976
未収入金	71,988,712	2,112,546,691
未収利息	-	1,398
流動資産合計	12,187,684,012	22,477,276,074
資産合計	12,187,684,012	22,477,276,074
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,597,879	3,413,980
未払受託者報酬	3,155,344	5,283,012
未払委託者報酬	50,485,413	52,830,108
未払利息	298	-
その他未払費用	315,471	528,238
流動負債合計	77,554,405	62,055,338
負債合計	77,554,405	62,055,338
純資産の部		
元本等		
元本	8,970,679,966	14,414,703,701
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	3,139,449,641	8,000,517,035
(分配準備積立金)	2,276,579,520	4,028,580,185
元本等合計	12,110,129,607	22,415,220,736
純資産合計	12,110,129,607	22,415,220,736
負債純資産合計	12,187,684,012	22,477,276,074

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自 至	2022年 8月23日 2023年 8月21日	自 至	2023年 8月22日 2024年 8月20日
営業収益				
受取利息		300		77,355
有価証券売買等損益		618,212,365		2,151,487,568
営業収益合計		618,212,665		2,151,564,923
営業費用				
支払利息		65,894		23,789
受託者報酬		6,211,943		8,884,034
委託者報酬		99,390,861		99,189,031
その他費用		621,073		888,286
営業費用合計		106,289,771		108,985,140
営業利益又は営業損失（ ）		511,922,894		2,042,579,783
経常利益又は経常損失（ ）		511,922,894		2,042,579,783
当期純利益又は当期純損失（ ）		511,922,894		2,042,579,783
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（ ）		3,479,329		90,838,148
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,582,509,086		3,139,449,641
剰余金増加額又は欠損金減少額		354,465,066		3,266,189,398
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		354,465,066		3,266,189,398
剰余金減少額又は欠損金増加額		312,926,734		356,863,639
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		312,926,734		356,863,639
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,139,449,641		8,000,517,035

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第6期 (2023年8月21日現在)	第7期 (2024年8月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,970,679,966口	14,414,703,701口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3500円 (13,500円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5550円 (15,550円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2022年8月23日 至 2023年8月21日			第7期 自 2023年8月22日 至 2024年8月20日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	235,805,020円	費用控除後の配当等収益額	A	404,655,836円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	279,597,203円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,547,085,799円
収益調整金額	C	862,870,121円	収益調整金額	C	3,971,936,850円
分配準備積立金額	D	1,761,177,297円	分配準備積立金額	D	2,076,838,550円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,139,449,641円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,000,517,035円
当ファンドの期末残存口数	F	8,970,679,966口	当ファンドの期末残存口数	F	14,414,703,701口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,499円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,550円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第7期 自 2023年8月22日 至 2024年8月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第7期 (2024年8月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

第7期 (2024年 8月20日現在)	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第6期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日	第7期 自 2023年 8月22日 至 2024年 8月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,824,493,877円	8,970,679,966円
期中追加設定元本額	1,225,075,777円	6,412,560,519円
期中一部解約元本額	1,078,889,688円	968,536,784円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第6期 (2023年 8月21日現在)	第7期 (2024年 8月20日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	667,120,842	1,932,875,687
合計	667,120,842	1,932,875,687

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	508,919,573	1,062,878,528	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	363,469,497	1,113,343,416	
	新興国株式インデックス マザーファンド	617,677,478	2,773,371,876	
	国内株式インデックス マザーファンド	287,915,276	799,166,431	
	外国株式インデックス マザーファンド	670,213,757	4,371,737,315	
	国内債券インデックス マザーファンド	416,637,410	547,961,521	
	外国債券インデックス マザーファンド	1,191,482,278	4,237,387,573	
	新興国債券インデックス マザーファンド	1,191,430,346	2,728,613,778	
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	1,660,070,195	2,495,915,538	
合計		6,907,815,810	20,130,375,976	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,538,302,654
株式	667,204,811,630
派生商品評価勘定	105,514,750
未収入金	25,116,000
未収配当金	801,920,123
未収利息	27,075
前払金	29,450,000
差入委託証拠金	630,034,985
流動資産合計	673,335,177,217
資産合計	673,335,177,217
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	135,070,900
未払解約金	541,404,515
流動負債合計	676,475,415
負債合計	676,475,415
純資産の部	
元本等	
元本	242,335,778,336
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	430,322,923,466
元本等合計	672,658,701,802
純資産合計	672,658,701,802
負債純資産合計	673,335,177,217

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

2024年 8月20日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,335,778,336口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,7757円 (27,757円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	242,361,014,552円
期中追加設定元本額	35,820,747,900円
期中一部解約元本額	35,845,984,116円
期末元本額	242,335,778,336円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	271,173,327円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,244,490,699円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,155,836円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,536,637,219円
世界経済インデックスファンド	6,514,615,653円
日本株式インデックス・オープン	2,771,471,667円
DCマイセクション25	4,870,958,242円
DCマイセクション50	16,619,791,731円
DCマイセクション75	18,562,800,351円
DC日本株式インデックス・オープン	6,026,929,686円
DCマイセクションS25	3,054,415,237円
DCマイセクションS50	9,801,892,983円
DCマイセクションS75	9,060,299,602円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,622,726,678円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,490,270円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	555,092,172円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	456,741,886円
DC世界経済インデックスファンド	3,603,965,131円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	385,140,786円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,324,370円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,080,617円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,804,284円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	94,832,631円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,891,172円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,186,808円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	54,250,942円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,667,663円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,165,717円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	378,372,712円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	282,193,225円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,940,885,078円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,135,416円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,034,381円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	289,475,355円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	163,551,776円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	214,342,321円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	16,687,279円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	361,173,663円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,477,537,987円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,861,513,089円
コア投資戦略ファンド（安定型）	526,088,837円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	681,143,478円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	418,657,995円
コア投資戦略ファンド（切替型）	434,167,482円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,306,752円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,670,351円
SMT インデックスバランス・オープン	46,600,245円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	16,499,180,351円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	189,957,492円

区分	2024年 8月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	55,288,786円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	258,694,265円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	41,831,158円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,538,455円
グローバル経済コア	287,915,276円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	34,623,669円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,992,213,012円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	32,397,076円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	404,162,936円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	129,749,321円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	66,252,287円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	69,894,450円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	30,832,017円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	39,015,117円
10資産分散投資ファンド	112,246,882円
グローバル10資産バランスファンド	45,965,316円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,028,441円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	35,080円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	34,978円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	37,585円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	37,585円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	50,628円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,495円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	17,859円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	14,076円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,051,029,705円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	235,013,203円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,678,449円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,062,874円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	50,614,170,662円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,910,931円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	226,977,840円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		15,014,242,056
合計		15,014,242,056

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益(円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,186,410,000	うち1年超	29,450,000
			-	
合計		5,186,410,000	-	29,450,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	10,300	3,915.00	40,324,500	
ニッスイ	248,800	864.80	215,162,240	
マルハニチロ	36,900	3,148.00	116,161,200	
雪国まいたけ	21,200	1,007.00	21,348,400	
カネコ種苗	7,000	1,375.00	9,625,000	
サカタのタネ	28,300	3,460.00	97,918,000	
ホクト	19,900	1,876.00	37,332,400	
ホクリヨウ	900	953.00	857,700	
住石ホールディングス	35,200	1,003.00	35,305,600	
日鉄鉱業	10,000	4,400.00	44,000,000	
三井松島ホールディングス	14,700	4,880.00	71,736,000	
I N P E X	752,100	2,160.00	1,624,536,000	
石油資源開発	28,800	5,720.00	164,736,000	
K & O エナジーグループ	11,300	3,410.00	38,533,000	
ショーボンドホールディングス	33,900	5,543.00	187,907,700	
ミライト・ワン	75,100	2,012.50	151,138,750	
タマホーム	15,600	4,165.00	64,974,000	
サンヨーホームズ	600	718.00	430,800	
日本アクア	2,700	824.00	2,224,800	
ファーストコーポレーション	1,500	766.00	1,149,000	
ベステラ	1,300	879.00	1,142,700	
キャンディル	1,000	613.00	613,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,100	1,079.00	1,186,900	
第一カッター興業	7,200	1,493.00	10,749,600	
安藤・間	144,200	1,151.00	165,974,200	
東急建設	77,900	738.00	57,490,200	
コムシスホールディングス	79,400	3,094.00	245,663,600	
ビーアールホールディングス	36,500	351.00	12,811,500	
高松コンストラクショングループ	18,500	2,894.00	53,539,000	
東建コーポレーション	6,300	11,340.00	71,442,000	
ソネック	600	928.00	556,800	
ヤマウラ	12,600	1,179.00	14,855,400	
オリエンタル白石	92,100	363.00	33,432,300	
大成建設	159,400	6,268.00	999,119,200	
大林組	622,500	1,879.00	1,169,677,500	
清水建設	493,600	918.20	453,223,520	

飛島建設	17,900	1,328.00	23,771,200
長谷工コーポレーション	159,700	1,775.00	283,467,500
松井建設	16,200	792.00	12,830,400
銭高組	600	3,640.00	2,184,000
鹿島建設	385,900	2,610.50	1,007,391,950
不動テトラ	12,000	2,318.00	27,816,000
大末建設	1,500	1,651.00	2,476,500
鉄建建設	12,500	2,375.00	29,687,500
西松建設	33,200	4,759.00	157,998,800
三井住友建設	129,600	379.00	49,118,400
大豊建設	6,000	3,555.00	21,330,000
佐田建設	2,400	870.00	2,088,000
ナカノフドー建設	2,700	499.00	1,347,300
奥村組	28,200	4,590.00	129,438,000
東鉄工業	21,600	3,330.00	71,928,000
イチケン	900	2,505.00	2,254,500
富士ピー・エス	1,700	433.00	736,100
浅沼組	64,300	708.00	45,524,400
戸田建設	235,600	988.80	232,961,280
熊谷組	28,700	3,380.00	97,006,000
北野建設	700	3,595.00	2,516,500
植木組	1,100	1,610.00	1,771,000
矢作建設工業	23,700	1,557.00	36,900,900
ピーエス・コンストラクション	22,100	977.00	21,591,700
日本ハウスホールディングス	37,200	338.00	12,573,600
新日本建設	24,400	1,496.00	36,502,400
東亜道路工業	33,400	1,333.00	44,522,200
日本道路	20,400	1,618.00	33,007,200
東亜建設工業	52,500	914.00	47,985,000
日本国土開発	49,500	482.00	23,859,000
若築建設	6,000	3,560.00	21,360,000
東洋建設	43,800	1,419.00	62,152,200
五洋建設	246,800	646.30	159,506,840
世紀東急工業	22,400	1,648.00	36,915,200
福田組	6,600	5,480.00	36,168,000
住友林業	150,400	5,804.00	872,921,600
日本基礎技術	2,300	678.00	1,559,400
巴コーポレーション	4,700	962.00	4,521,400
大和ハウス工業	481,400	4,424.00	2,129,713,600
ライト工業	32,100	2,116.00	67,923,600
積水ハウス	527,900	3,566.00	1,882,491,400
日特建設	16,600	1,040.00	17,264,000

北陸電気工事	11,900	1,119.00	13,316,100
ユアテック	38,300	1,371.00	52,509,300
日本リーテック	13,600	1,110.00	15,096,000
四電工	7,300	3,765.00	27,484,500
中電工	27,000	3,190.00	86,130,000
関電工	109,000	2,015.00	219,635,000
きんでん	121,000	3,049.00	368,929,000
東京エネシス	16,200	1,146.00	18,565,200
トーエネック	5,800	4,770.00	27,666,000
住友電設	16,600	3,590.00	59,594,000
日本電設工業	32,700	1,831.00	59,873,700
エクシオグループ	170,100	1,524.50	259,317,450
新日本空調	11,300	3,695.00	41,753,500
九電工	37,600	6,377.00	239,775,200
三機工業	37,600	2,225.00	83,660,000
日揮ホールディングス	172,200	1,294.50	222,912,900
中外炉工業	5,700	2,799.00	15,954,300
ヤマト	3,100	958.00	2,969,800
太平電業	11,000	5,100.00	56,100,000
高砂熱学工業	46,600	5,240.00	244,184,000
三晃金属工業	500	4,065.00	2,032,500
朝日工業社	16,200	1,248.00	20,217,600
明星工業	33,700	1,256.00	42,327,200
大気社	20,100	4,720.00	94,872,000
ダイダン	22,900	3,015.00	69,043,500
日比谷総合設備	12,600	3,435.00	43,281,000
フィル・カンパニー	3,500	644.00	2,254,000
テスホールディングス	37,500	296.00	11,100,000
インフロニア・ホールディングス	200,600	1,207.00	242,124,200
東洋エンジニアリング	25,600	707.00	18,099,200
レイズネクスト	25,200	1,774.00	44,704,800
ニッポン	52,300	2,227.00	116,472,100
日清製粉グループ本社	161,600	1,873.00	302,676,800
日東富士製粉	3,100	7,050.00	21,855,000
昭和産業	16,400	3,040.00	49,856,000
鳥越製粉	3,300	707.00	2,333,100
中部飼料	24,200	1,493.00	36,130,600
フィード・ワン	25,500	865.00	22,057,500
東洋精糖	700	1,420.00	994,000
日本甜菜製糖	10,200	2,635.00	26,877,000
D M三井製糖ホールディングス	17,300	3,195.00	55,273,500
塩水港精糖	4,900	263.00	1,288,700

ウェルネオシュガー	8,700	2,200.00	19,140,000
森永製菓	73,100	2,759.00	201,682,900
中村屋	4,400	3,185.00	14,014,000
江崎グリコ	50,000	4,179.00	208,950,000
名糖産業	6,900	1,984.00	13,689,600
井村屋グループ	10,400	2,450.00	25,480,000
不二家	12,000	2,608.00	31,296,000
山崎製パン	117,000	2,837.00	331,929,000
第一屋製パン	800	635.00	508,000
モロゾフ	5,600	4,495.00	25,172,000
亀田製菓	10,000	4,400.00	44,000,000
寿スピリッツ	82,600	1,680.00	138,768,000
カルビー	80,000	3,060.00	244,800,000
森永乳業	61,000	3,293.00	200,873,000
六甲バター	12,800	1,405.00	17,984,000
ヤクルト本社	249,700	2,956.50	738,238,050
明治ホールディングス	214,200	3,477.00	744,773,400
雪印メグミルク	42,300	2,615.00	110,614,500
プリマハム	23,500	2,252.00	52,922,000
日本ハム	75,200	5,314.00	399,612,800
林兼産業	1,300	460.00	598,000
丸大食品	17,600	1,729.00	30,430,400
S Foods	19,300	2,668.00	51,492,400
柿安本店	6,800	2,596.00	17,652,800
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	3,900.00	104,130,000
サッポロホールディングス	57,500	7,282.00	418,715,000
アサヒグループホールディングス	437,400	5,377.00	2,351,899,800
キリンホールディングス	727,900	2,098.50	1,527,498,150
宝ホールディングス	117,800	1,111.50	130,934,700
オエノンホールディングス	56,600	396.00	22,413,600
養命酒製造	5,700	2,338.00	13,326,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,200	2,120.00	261,184,000
ライフドリンク カンパニー	3,500	7,570.00	26,495,000
サントリー食品インターナショナル	123,000	5,163.00	635,049,000
ダイトーグループホールディングス	19,800	2,712.00	53,697,600
伊藤園	59,200	3,523.00	208,561,600
キーコーヒー	19,600	2,099.00	41,140,400
ユニカフェ	1,200	929.00	1,114,800
日清オイリオグループ	24,600	5,030.00	123,738,000
不二製油グループ本社	40,700	3,125.00	127,187,500
かどや製油	500	3,640.00	1,820,000
J - オイルミルズ	20,000	1,929.00	38,580,000

キッコーマン	579,000	1,748.50	1,012,381,500
味の素	410,700	5,410.00	2,221,887,000
ブルドックソース	9,300	1,946.00	18,097,800
キューピー	93,900	3,655.00	343,204,500
ハウス食品グループ本社	60,200	2,829.00	170,305,800
カゴメ	75,200	3,164.00	237,932,800
アリアケジャパン	17,400	4,685.00	81,519,000
ピエトロ	500	1,786.00	893,000
エバラ食品工業	4,200	2,836.00	11,911,200
やまみ	500	4,235.00	2,117,500
ニチレイ	80,100	4,074.00	326,327,400
東洋水産	88,300	9,700.00	856,510,000
イトアンドホールディングス	8,300	1,975.00	16,392,500
大冷	500	1,930.00	965,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,630.00	13,040,000
日清食品ホールディングス	184,300	3,836.00	706,974,800
一正蒲鉾	1,600	734.00	1,174,400
フジッコ	17,900	1,696.00	30,358,400
ロック・フィールド	21,300	1,510.00	32,163,000
日本たばこ産業	1,061,900	4,121.00	4,376,089,900
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,312.00	27,744,000
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,339.00	27,366,300
なとり	11,000	2,072.00	22,792,000
イフジ産業	700	1,397.00	977,900
ファーマフーズ	23,200	966.00	22,411,200
ユーグレナ	108,600	516.00	56,037,600
紀文食品	15,200	1,161.00	17,647,200
ピックルスホールディングス	10,200	1,036.00	10,567,200
ミヨシ油脂	1,500	1,442.00	2,163,000
理研ビタミン	15,100	2,625.00	39,637,500
片倉工業	16,500	2,130.00	35,145,000
ゲンゼ	12,700	5,280.00	67,056,000
東洋紡	77,200	986.00	76,119,200
ユニチカ	58,700	331.00	19,429,700
富士紡ホールディングス	7,900	4,480.00	35,392,000
倉敷紡績	12,700	4,650.00	59,055,000
シキボウ	12,800	1,067.00	13,657,600
日本毛織	45,900	1,290.00	59,211,000
トーア紡コーポレーション	1,600	413.00	660,800
帝国繊維	20,300	2,331.00	47,319,300
帝人	171,100	1,351.50	231,241,650
東レ	1,191,500	755.30	899,939,950

住江織物	800	2,131.00	1,704,800
日本フェルト	2,900	489.00	1,418,100
イチカワ	700	1,676.00	1,173,200
日東製網	400	1,442.00	576,800
アツギ	2,700	745.00	2,011,500
ダイニック	1,200	795.00	954,000
セーレン	34,500	2,329.00	80,350,500
ソトー	1,300	680.00	884,000
東海染工	400	774.00	309,600
小松マテーレ	25,800	704.00	18,163,200
ワコールホールディングス	33,200	4,221.00	140,137,200
ホギメディカル	23,500	4,280.00	100,580,000
T S Iホールディングス	53,400	882.00	47,098,800
マツオカコーポレーション	1,200	1,501.00	1,801,200
ワールド	25,100	2,025.00	50,827,500
三陽商会	8,400	2,350.00	19,740,000
ナイガイ	1,500	230.00	345,000
オンワードホールディングス	104,900	535.00	56,121,500
ルックホールディングス	5,700	2,655.00	15,133,500
ゴールドウイン	31,500	8,669.00	273,073,500
デサント	30,600	4,350.00	133,110,000
キング	1,500	726.00	1,089,000
ヤマトインターナショナル	3,100	367.00	1,137,700
特種東海製紙	9,500	3,530.00	33,535,000
王子ホールディングス	740,500	584.70	432,970,350
日本製紙	100,300	934.00	93,680,200
三菱製紙	5,200	570.00	2,964,000
北越コーポレーション	87,400	1,570.00	137,218,000
中越パルプ工業	1,500	1,322.00	1,983,000
大王製紙	78,500	877.00	68,844,500
阿波製紙	1,000	489.00	489,000
レンゴー	161,900	964.90	156,217,310
トーモク	10,300	2,446.00	25,193,800
ザ・パック	13,200	3,715.00	49,038,000
北の達人コーポレーション	74,900	174.00	13,032,600
クラレ	259,100	1,851.50	479,723,650
旭化成	1,202,600	1,014.00	1,219,436,400
共和レザー	2,200	718.00	1,579,600
巴川コーポレーション	1,100	786.00	864,600
レゾナック・ホールディングス	159,500	3,559.00	567,660,500
住友化学	1,319,200	421.50	556,042,800
住友精化	8,400	5,210.00	43,764,000

日産化学	82,900	4,946.00	410,023,400
ラサ工業	6,900	2,677.00	18,471,300
クレハ	36,800	2,845.00	104,696,000
多木化学	6,900	4,060.00	28,014,000
テイカ	14,600	1,643.00	23,987,800
石原産業	29,500	1,473.00	43,453,500
片倉コープアグリ	900	1,049.00	944,100
日本曹達	20,700	5,060.00	104,742,000
東ソー	237,300	1,893.00	449,208,900
トクヤマ	57,400	2,830.00	162,442,000
セントラル硝子	19,000	3,570.00	67,830,000
東亜合成	85,500	1,577.50	134,876,250
大阪ソーダ	12,400	8,450.00	104,780,000
関東電化工業	34,400	973.00	33,471,200
デンカ	64,600	2,221.50	143,508,900
信越化学工業	1,594,200	6,233.00	9,936,648,600
日本カーバイド工業	9,400	1,746.00	16,412,400
堺化学工業	13,500	2,690.00	36,315,000
第一稀元素化学工業	19,400	814.00	15,791,600
エア・ウォーター	167,700	1,944.50	326,092,650
日本酸素ホールディングス	172,500	4,694.00	809,715,000
日本化学工業	6,500	2,820.00	18,330,000
東邦アセチレン	4,000	361.00	1,444,000
日本パーカラライジング	79,200	1,218.00	96,465,600
高压ガス工業	25,800	910.00	23,478,000
チタン工業	500	857.00	428,500
四国化成ホールディングス	20,100	1,988.00	39,958,800
戸田工業	4,000	1,816.00	7,264,000
ステラ ケミファ	9,600	3,900.00	37,440,000
保土谷化学工業	5,600	5,370.00	30,072,000
日本触媒	103,500	1,670.00	172,845,000
大日精化工業	12,400	3,165.00	39,246,000
カネカ	43,800	3,856.00	168,892,800
三菱瓦斯化学	129,800	2,763.50	358,702,300
三井化学	146,600	3,672.00	538,315,200
東京応化工業	84,800	3,840.00	325,632,000
大阪有機化学工業	14,900	3,370.00	50,213,000
三菱ケミカルグループ	1,299,600	868.40	1,128,572,640
KHネオケム	32,100	2,106.00	67,602,600
ダイセル	220,600	1,323.00	291,853,800
住友ベークライト	49,800	3,938.00	196,112,400
積水化学工業	354,000	2,190.00	775,260,000

日本ゼオン	121,900	1,204.00	146,767,600
アイカ工業	44,900	3,336.00	149,786,400
UBE	84,600	2,689.50	227,531,700
積水樹脂	26,500	2,408.00	63,812,000
タキロンシーアイ	45,300	869.00	39,365,700
旭有機材	11,800	4,205.00	49,619,000
ニチバン	9,600	1,929.00	18,518,400
リケンテクノス	33,300	933.00	31,068,900
大倉工業	8,200	2,597.00	21,295,400
積水化成成品工業	24,900	417.00	10,383,300
群栄化学工業	4,200	2,792.00	11,726,400
タイガースポリマー	1,700	778.00	1,322,600
ミライアル	1,300	1,333.00	1,732,900
ダイキアクシス	1,600	685.00	1,096,000
ダイキョーニシカワ	39,200	700.00	27,440,000
竹本容器	1,400	816.00	1,142,400
森六ホールディングス	9,200	2,457.00	22,604,400
恵和	11,500	1,210.00	13,915,000
日本化薬	135,800	1,285.50	174,570,900
カーリット	19,200	1,177.00	22,598,400
日本精化	11,800	2,387.00	28,166,600
扶桑化学工業	18,900	4,085.00	77,206,500
トリケミカル研究所	21,600	3,610.00	77,976,000
ADEKA	62,000	3,035.00	188,170,000
日油	161,000	2,158.50	347,518,500
新日本理化	5,300	198.00	1,049,400
ハリマ化成グループ	13,800	910.00	12,558,000
花王	432,900	6,436.00	2,786,144,400
第一工業製薬	7,100	3,035.00	21,548,500
石原ケミカル	8,000	2,430.00	19,440,000
日華化学	1,500	1,251.00	1,876,500
ニイタカ	800	1,872.00	1,497,600
三洋化成工業	10,900	4,040.00	44,036,000
有機合成薬品工業	3,100	277.00	858,700
大日本塗料	19,700	1,097.00	21,610,900
日本ペイントホールディングス	786,600	915.20	719,896,320
関西ペイント	153,600	2,590.50	397,900,800
神東塗料	3,200	137.00	438,400
中国塗料	36,500	1,889.00	68,948,500
日本特殊塗料	2,700	1,205.00	3,253,500
藤倉化成	20,500	510.00	10,455,000
太陽ホールディングス	31,000	3,535.00	109,585,000

D I C	63,200	3,044.00	192,380,800
サカティンクス	39,500	1,624.00	64,148,000
a r t i e n c e	31,600	3,490.00	110,284,000
富士フィルムホールディングス	990,600	3,602.00	3,568,141,200
資生堂	371,700	3,553.00	1,320,650,100
ライオン	226,500	1,433.50	324,687,750
高砂香料工業	13,400	4,570.00	61,238,000
マンダム	38,400	1,211.00	46,502,400
ミルボン	28,600	3,059.00	87,487,400
ファンケル	75,000	2,796.00	209,700,000
コーセー	36,200	8,804.00	318,704,800
コタ	18,000	1,624.00	29,232,000
シーボン	500	1,323.00	661,500
ポーラ・オルビスホールディングス	91,200	1,453.00	132,513,600
ノエビアホールディングス	15,900	5,580.00	88,722,000
アジュバンホールディングス	900	853.00	767,700
新日本製薬	10,200	1,697.00	17,309,400
I - n e	5,900	1,901.00	11,215,900
アクシージア	11,700	873.00	10,214,100
エステー	13,700	1,515.00	20,755,500
アグロ カネショウ	6,200	1,345.00	8,339,000
コニシ	51,400	1,161.00	59,675,400
長谷川香料	34,000	3,155.00	107,270,000
小林製薬	46,600	5,461.00	254,482,600
荒川化学工業	15,100	1,366.00	20,626,600
メック	14,700	3,980.00	58,506,000
日本高純度化学	4,000	3,250.00	13,000,000
タカラバイオ	47,900	1,061.00	50,821,900
J C U	19,700	3,570.00	70,329,000
新田ゼラチン	2,600	903.00	2,347,800
O A T アグリオ	7,300	1,910.00	13,943,000
デクセリアルズ	44,000	6,440.00	283,360,000
アース製薬	16,200	5,090.00	82,458,000
北興化学工業	15,900	1,394.00	22,164,600
大成ラミック	5,100	2,675.00	13,642,500
クミアイ化学工業	70,700	766.00	54,156,200
日本農薬	32,600	632.00	20,603,200
アキレス	11,200	1,477.00	16,542,400
有沢製作所	31,200	1,517.00	47,330,400
日東電工	114,300	11,550.00	1,320,165,000
レック	22,800	1,280.00	29,184,000
三光合成	22,400	617.00	13,820,800

きもと	6,300	253.00	1,593,900
藤森工業	14,100	4,240.00	59,784,000
前澤化成工業	11,500	1,787.00	20,550,500
未来工業	6,400	3,420.00	21,888,000
ウェブロックホールディングス	1,400	625.00	875,000
J S P	12,500	2,007.00	25,087,500
エフピコ	33,700	2,670.00	89,979,000
天馬	11,800	2,656.00	31,340,800
信越ポリマー	38,400	1,539.00	59,097,600
東リ	8,500	380.00	3,230,000
ニフコ	53,200	3,476.00	184,923,200
バルカー	14,900	3,455.00	51,479,500
ユニ・チャーム	370,800	5,100.00	1,891,080,000
ショーエイコーポレーション	1,200	575.00	690,000
協和キリン	215,000	3,140.00	675,100,000
武田薬品工業	1,575,300	4,364.00	6,874,609,200
アステラス製薬	1,561,300	1,712.00	2,672,945,600
住友ファーマ	132,000	614.00	81,048,000
塩野義製薬	216,500	6,624.00	1,434,096,000
わかもと製薬	4,000	246.00	984,000
日本新薬	46,600	3,494.00	162,820,400
中外製薬	557,200	6,933.00	3,863,067,600
科研製薬	30,500	3,977.00	121,298,500
エーザイ	216,500	5,910.00	1,279,515,000
ロート製薬	172,400	3,191.00	550,128,400
小野薬品工業	364,100	2,150.00	782,815,000
久光製薬	39,600	4,078.00	161,488,800
持田製薬	19,900	3,300.00	65,670,000
参天製薬	314,000	1,814.00	569,596,000
扶桑薬品工業	6,300	2,257.00	14,219,100
日本ケミファ	400	1,648.00	659,200
ツムラ	56,000	3,948.00	221,088,000
キッセイ薬品工業	29,500	3,510.00	103,545,000
生化学工業	30,200	867.00	26,183,400
栄研化学	30,700	2,240.00	68,768,000
鳥居薬品	9,600	3,480.00	33,408,000
J C R ファーマ	60,200	604.00	36,360,800
東和薬品	27,400	2,803.00	76,802,200
富士製薬工業	13,100	1,367.00	17,907,700
ゼリア新薬工業	24,700	2,217.00	54,759,900
ネクセラファーマ	83,500	1,702.00	142,117,000
第一三共	1,550,600	5,860.00	9,086,516,000

杏林製薬	38,600	1,631.00	62,956,600
大幸薬品	40,300	424.00	17,087,200
ダイト	13,500	2,354.00	31,779,000
大塚ホールディングス	444,300	8,350.00	3,709,905,000
ペプチドリーム	86,300	2,326.50	200,776,950
セルソース	11,800	1,491.00	17,593,800
あすか製薬ホールディングス	18,300	2,302.00	42,126,600
サワイグループホールディングス	40,700	6,444.00	262,270,800
日本コークス工業	180,600	104.00	18,782,400
ニチレキ	23,100	2,412.00	55,717,200
ユシロ化学工業	9,200	1,754.00	16,136,800
ビーピー・カストロール	1,800	898.00	1,616,400
富士石油	51,900	405.00	21,019,500
MORESCO	1,400	1,277.00	1,787,800
出光興産	924,300	1,079.00	997,319,700
ENEOSホールディングス	2,817,900	755.10	2,127,796,290
コスモエネルギーホールディングス	52,800	8,101.00	427,732,800
横浜ゴム	90,000	3,295.00	296,550,000
TOYO TIRE	102,300	2,150.00	219,945,000
ブリヂストン	521,000	5,888.00	3,067,648,000
住友ゴム工業	174,600	1,493.50	260,765,100
藤倉コンポジット	17,100	1,233.00	21,084,300
オカモト	8,300	4,880.00	40,504,000
フコク	9,300	1,850.00	17,205,000
ニッタ	18,100	3,695.00	66,879,500
住友理工	27,600	1,425.00	39,330,000
三ツ星ベルト	20,600	4,195.00	86,417,000
バンドー化学	26,400	1,762.00	46,516,800
日東紡績	22,500	6,150.00	138,375,000
AGC	173,200	4,657.00	806,592,400
日本板硝子	84,900	375.00	31,837,500
石塚硝子	700	2,510.00	1,757,000
日本山村硝子	1,400	1,544.00	2,161,600
日本電気硝子	66,100	3,499.00	231,283,900
オハラ	8,500	1,332.00	11,322,000
住友大阪セメント	29,600	3,928.00	116,268,800
太平洋セメント	102,000	3,559.00	363,018,000
日本ヒューム	15,600	1,205.00	18,798,000
日本コンクリート工業	34,600	355.00	12,283,000
三谷セキサン	7,500	5,450.00	40,875,000
アジアパイルホールディングス	25,300	832.00	21,049,600
東海カーボン	164,200	887.60	145,743,920

日本カーボン	10,200	4,485.00	45,747,000
東洋炭素	12,500	6,060.00	75,750,000
ノリタケ	19,700	3,880.00	76,436,000
TOTO	117,500	4,661.00	547,667,500
日本碍子	207,000	1,925.50	398,578,500
日本特殊陶業	149,100	4,269.00	636,507,900
MARUWA	6,600	41,000.00	270,600,000
品川リフラクトリーズ	21,900	1,700.00	37,230,000
黒崎播磨	14,500	2,275.00	32,987,500
ヨータイ	10,400	1,753.00	18,231,200
東京窯業	4,100	430.00	1,763,000
ニッカトー	1,700	544.00	924,800
フジミインコーポレーテッド	47,900	2,652.00	127,030,800
クニミネ工業	1,100	1,034.00	1,137,400
エーアンドエーマテリアル	800	1,204.00	963,200
ニチアス	45,000	5,320.00	239,400,000
ニチハ	22,300	3,515.00	78,384,500
日本製鉄	842,100	3,234.00	2,723,351,400
神戸製鋼所	368,300	1,755.50	646,550,650
中山製鋼所	41,900	850.00	35,615,000
合同製鐵	10,200	4,385.00	44,727,000
JFEホールディングス	509,300	1,951.00	993,644,300
東京製鐵	51,500	1,944.00	100,116,000
共英製鋼	20,900	1,736.00	36,282,400
大和工業	34,500	7,195.00	248,227,500
東京鐵鋼	8,100	5,120.00	41,472,000
大阪製鐵	8,400	2,867.00	24,082,800
淀川製鋼所	19,000	5,720.00	108,680,000
中部鋼鈹	12,000	2,389.00	28,668,000
丸一鋼管	55,800	3,406.00	190,054,800
モリ工業	4,600	5,330.00	24,518,000
大同特殊鋼	115,400	1,400.00	161,560,000
日本高周波鋼業	1,600	407.00	651,200
日本冶金工業	13,400	4,380.00	58,692,000
山陽特殊製鋼	18,100	1,921.00	34,770,100
愛知製鋼	10,600	3,210.00	34,026,000
日本金属	1,000	695.00	695,000
大平洋金属	15,600	1,380.00	21,528,000
新日本電工	109,400	285.00	31,179,000
栗本鐵工所	8,500	4,225.00	35,912,500
虹技	500	1,080.00	540,000
三菱製鋼	13,600	1,442.00	19,611,200

日亜銅業	4,100	305.00	1,250,500
日本精線	14,500	1,118.00	16,211,000
エンビプロ・ホールディングス	18,100	480.00	8,688,000
シンニッタン	5,000	215.00	1,075,000
新家工業	900	5,080.00	4,572,000
大紀アルミニウム工業所	23,600	1,116.00	26,337,600
日本軽金属ホールディングス	53,800	1,627.00	87,532,600
三井金属鉱業	53,400	4,737.00	252,955,800
三菱マテリアル	131,100	2,637.50	345,776,250
住友金属鉱山	212,400	4,156.00	882,734,400
D O W Aホールディングス	45,400	4,959.00	225,138,600
古河機械金属	24,500	1,585.00	38,832,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,900	2,498.00	79,686,200
東邦チタニウム	38,200	1,224.00	46,756,800
U A C J	25,800	4,950.00	127,710,000
C Kサンエツ	4,600	3,295.00	15,157,000
古河電気工業	61,100	3,782.00	231,080,200
住友電気工業	685,200	2,394.50	1,640,711,400
フジクラ	216,100	4,123.00	890,980,300
S W C C	20,600	5,070.00	104,442,000
カナレ電気	1,000	1,458.00	1,458,000
平河ヒューテック	12,000	1,392.00	16,704,000
リョービ	19,800	1,967.00	38,946,600
アーレスティ	4,900	674.00	3,302,600
A R Eホールディングス	69,000	1,829.00	126,201,000
稲葉製作所	10,200	1,668.00	17,013,600
宮地エンジニアリンググループ	9,200	4,355.00	40,066,000
トーカロ	52,800	1,844.00	97,363,200
アルファC o	1,400	1,196.00	1,674,400
S U M C O	348,600	1,813.00	632,011,800
川田テクノロジーズ	13,000	2,621.00	34,073,000
R S Technologies	14,000	3,500.00	49,000,000
ジェイテックコーポレーション	700	1,498.00	1,048,600
信和	2,500	771.00	1,927,500
東洋製罐グループホールディングス	105,000	2,339.00	245,595,000
ホッカンホールディングス	8,900	1,682.00	14,969,800
コロナ	10,200	952.00	9,710,400
横河ブリッジホールディングス	28,600	2,635.00	75,361,000
駒井ハルテック	700	1,646.00	1,152,200
高田機工	300	3,340.00	1,002,000
三和ホールディングス	182,400	3,219.00	587,145,600
文化シャッター	47,900	1,728.00	82,771,200

三協立山	23,000	730.00	16,790,000
アルインコ	14,000	1,006.00	14,084,000
東洋シャッター	900	803.00	722,700
L I X I L	285,900	1,701.50	486,458,850
日本フィルコン	2,600	509.00	1,323,400
ノーリツ	25,800	1,870.00	48,246,000
長府製作所	20,500	2,032.00	41,656,000
リンナイ	87,600	3,260.00	285,576,000
ダイニチ工業	2,000	639.00	1,278,000
日東精工	26,500	567.00	15,025,500
三洋工業	500	2,754.00	1,377,000
岡部	32,700	755.00	24,688,500
ジーテクト	23,300	1,675.00	39,027,500
東プレ	32,300	1,871.00	60,433,300
高周波熱錬	27,100	1,041.00	28,211,100
東京製網	11,900	1,113.00	13,244,700
サンコール	20,300	379.00	7,693,700
モリテック スチール	3,500	200.00	700,000
パイオラックス	22,100	2,379.00	52,575,900
エイチワン	18,800	1,001.00	18,818,800
日本発條	162,000	1,720.00	278,640,000
中央発條	13,600	1,131.00	15,381,600
アドバネクス	500	875.00	437,500
立川ブラインド工業	8,300	1,264.00	10,491,200
日本ドライケミカル	900	2,676.00	2,408,400
日本製鋼所	49,400	4,448.00	219,731,200
三浦工業	74,800	3,307.00	247,363,600
タクマ	60,600	1,596.00	96,717,600
ツガミ	38,300	1,424.00	54,539,200
オークマ	15,700	6,459.00	101,406,300
芝浦機械	16,900	3,725.00	62,952,500
アマダ	271,700	1,532.50	416,380,250
アイダエンジニアリング	41,500	781.00	32,411,500
F U J I	84,400	2,448.00	206,611,200
牧野フライス製作所	19,800	5,780.00	114,444,000
オーエスジー	79,000	2,011.00	158,869,000
ダイジェット工業	400	751.00	300,400
旭ダイヤモンド工業	41,400	880.00	36,432,000
D M G 森精機	113,100	3,611.00	408,404,100
ソディック	47,300	760.00	35,948,000
ディスコ	86,300	45,830.00	3,955,129,000
日東工器	8,300	2,436.00	20,218,800

日進工具	16,600	790.00	13,114,000
パンチ工業	3,900	451.00	1,758,900
富士ダイス	13,300	776.00	10,320,800
豊和工業	2,100	822.00	1,726,200
リケンNPR	19,500	2,417.00	47,131,500
東洋機械金属	3,200	680.00	2,176,000
エンシュウ	1,000	640.00	640,000
島精機製作所	28,500	1,498.00	42,693,000
オプトラン	29,500	1,836.00	54,162,000
イワキポンプ	12,000	2,850.00	34,200,000
フリュー	16,900	1,011.00	17,085,900
ヤマシンフィルタ	42,600	456.00	19,425,600
日阪製作所	19,600	1,026.00	20,109,600
やまびこ	29,300	2,289.00	67,067,700
野村マイクロ・サイエンス	24,300	3,010.00	73,143,000
平田機工	8,600	4,970.00	42,742,000
P E G A S U S	19,800	520.00	10,296,000
マルマエ	7,800	1,607.00	12,534,600
タツモ	12,800	3,400.00	43,520,000
ナブテスコ	112,500	2,431.50	273,543,750
三井海洋開発	22,700	2,930.00	66,511,000
レオン自動機	20,700	1,424.00	29,476,800
S M C	53,700	67,390.00	3,618,843,000
ホソカワミクロン	12,500	4,490.00	56,125,000
ユニオンツール	7,900	5,680.00	44,872,000
瑞光	12,900	1,131.00	14,589,900
オイレス工業	24,300	2,170.00	52,731,000
日精エー・エス・ビー機械	6,100	4,980.00	30,378,000
サトーホールディングス	24,600	2,028.00	49,888,800
技研製作所	16,900	1,712.00	28,932,800
日本エアーテック	8,400	1,161.00	9,752,400
カワタ	1,200	870.00	1,044,000
日精樹脂工業	13,300	917.00	12,196,100
オカダアイヨン	1,300	2,099.00	2,728,700
ワイエイシイホールディングス	8,400	2,055.00	17,262,000
小松製作所	840,200	4,154.00	3,490,190,800
住友重機械工業	106,100	3,431.00	364,029,100
日立建機	71,400	3,537.00	252,541,800
日工	26,600	718.00	19,098,800
巴工業	7,000	4,100.00	28,700,000
井関農機	16,800	983.00	16,514,400
T O W A	19,900	7,730.00	153,827,000

丸山製作所	700	2,275.00	1,592,500
北川鉄工所	7,100	1,341.00	9,521,100
ローツェ	9,400	23,090.00	217,046,000
タカキタ	1,300	444.00	577,200
クボタ	937,100	2,050.50	1,921,523,550
荏原実業	8,600	3,565.00	30,659,000
三菱化工機	6,300	3,545.00	22,333,500
月島ホールディングス	24,300	1,356.00	32,950,800
帝国電機製作所	12,300	2,560.00	31,488,000
新東工業	36,300	1,009.00	36,626,700
澁谷工業	16,800	3,715.00	62,412,000
アイチ コーポレーション	24,800	1,144.00	28,371,200
小森コーポレーション	44,200	1,140.00	50,388,000
鶴見製作所	13,700	3,660.00	50,142,000
日本ギア工業	1,500	455.00	682,500
酒井重工業	3,500	4,810.00	16,835,000
荏原製作所	368,000	2,027.00	745,936,000
石井鐵工所	500	8,350.00	4,175,000
西島製作所	15,400	2,900.00	44,660,000
北越工業	18,000	1,924.00	34,632,000
ダイキン工業	214,000	18,075.00	3,868,050,000
オルガノ	21,500	6,760.00	145,340,000
トーヨーカネツ	6,100	3,950.00	24,095,000
栗田工業	100,300	5,946.00	596,383,800
椿本チエイン	24,600	6,000.00	147,600,000
大同工業	1,700	785.00	1,334,500
木村化工機	13,600	729.00	9,914,400
アネスト岩田	27,700	1,333.00	36,924,100
ダイフク	302,500	2,726.00	824,615,000
サムコ	4,300	3,995.00	17,178,500
加藤製作所	2,000	1,255.00	2,510,000
油研工業	700	2,201.00	1,540,700
タダノ	103,200	990.90	102,260,880
フジテック	41,900	4,650.00	194,835,000
C K D	49,600	3,070.00	152,272,000
平和	53,000	2,056.00	108,968,000
理想科学工業	14,300	3,420.00	48,906,000
S A N K Y O	172,600	1,982.50	342,179,500
日本金銭機械	21,700	938.00	20,354,600
マースグループホールディングス	9,100	3,545.00	32,259,500
フクシマガリレイ	11,700	5,470.00	63,999,000
オーイズミ	1,500	356.00	534,000

ダイコク電機	8,800	3,250.00	28,600,000
竹内製作所	32,500	4,435.00	144,137,500
アマノ	50,900	4,198.00	213,678,200
J U K I	27,800	421.00	11,703,800
ジャノメ	18,200	785.00	14,287,000
マックス	25,200	3,485.00	87,822,000
グローリー	43,000	2,537.00	109,091,000
新晃工業	18,100	4,095.00	74,119,500
大和冷機工業	27,500	1,442.00	39,655,000
セガサミーホールディングス	160,100	2,409.50	385,760,950
T P R	22,800	2,285.00	52,098,000
ツバキ・ナカシマ	44,200	724.00	32,000,800
ホシザキ	115,400	4,645.00	536,033,000
大豊工業	15,500	649.00	10,059,500
日本精工	331,900	749.40	248,725,860
N T N	388,800	268.60	104,431,680
ジェイテクト	159,500	1,011.50	161,334,250
不二越	13,200	3,100.00	40,920,000
日本トムソン	48,800	520.00	25,376,000
T H K	103,400	2,716.50	280,886,100
ユーシン精機	14,200	664.00	9,428,800
前澤給装工業	12,900	1,298.00	16,744,200
イーグル工業	19,800	1,993.00	39,461,400
前澤工業	2,400	1,355.00	3,252,000
P I L L A R	16,600	4,500.00	74,700,000
キッツ	60,000	1,059.00	63,540,000
マキタ	204,400	4,596.00	939,422,400
三井E & S	89,000	1,212.00	107,868,000
日立造船	158,200	933.00	147,600,600
三菱重工業	3,134,600	1,865.00	5,846,029,000
I H I	133,500	5,768.00	770,028,000
スター精密	30,200	1,984.00	59,916,800
日清紡ホールディングス	134,800	995.10	134,139,480
イビデン	93,500	5,348.00	500,038,000
コニカミノルタ	400,900	405.80	162,685,220
ブラザー工業	239,600	2,744.00	657,462,400
ミネベアミツミ	311,900	3,090.00	963,771,000
日立製作所	4,305,600	3,510.00	15,112,656,000
三菱電機	1,963,500	2,390.00	4,692,765,000
富士電機	109,000	8,469.00	923,121,000
東洋電機製造	1,400	1,119.00	1,566,600
安川電機	194,700	4,848.00	943,905,600

シンフォニアテクノロジー	19,800	3,850.00	76,230,000
明電舎	33,200	3,380.00	112,216,000
オリジン	900	1,236.00	1,112,400
山洋電気	7,800	7,360.00	57,408,000
デンヨー	13,700	2,568.00	35,181,600
PHCホールディングス	33,700	1,138.00	38,350,600
KOKUSAI ELECTRIC	93,600	4,070.00	380,952,000
ソシオネクスト	130,800	3,252.00	425,361,600
東芝テック	22,900	3,365.00	77,058,500
芝浦メカトロニクス	10,200	8,250.00	84,150,000
マブチモーター	78,800	2,200.50	173,399,400
ニデック	395,800	6,169.00	2,441,690,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,800	391.00	4,613,800
トレックス・セミコンダクター	9,300	1,677.00	15,596,100
東光高岳	10,900	1,791.00	19,521,900
ダブル・スコープ	51,300	433.00	22,212,900
ダイヘン	17,000	6,550.00	111,350,000
ヤーマン	35,100	853.00	29,940,300
JVCケンウッド	141,700	1,189.00	168,481,300
ミマキエンジニアリング	17,200	1,547.00	26,608,400
I - P E X	10,100	1,876.00	18,947,600
大崎電気工業	38,400	655.00	25,152,000
オムロン	136,900	5,489.00	751,444,100
日東工業	24,200	3,195.00	77,319,000
I D E C	26,500	2,711.00	71,841,500
正興電機製作所	1,400	1,267.00	1,773,800
不二電機工業	900	1,044.00	939,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	70,000	2,726.00	190,820,000
サクサ	900	2,399.00	2,159,100
メルコホールディングス	5,700	3,005.00	17,128,500
テクノメディカ	4,500	1,816.00	8,172,000
日本電気	235,400	12,765.00	3,004,881,000
富士通	1,649,400	2,551.50	4,208,444,100
沖電気工業	81,000	1,015.00	82,215,000
岩崎通信機	1,800	1,591.00	2,863,800
電気興業	7,200	2,175.00	15,660,000
サンケン電気	16,700	7,194.00	120,139,800
ナカヨ	600	1,167.00	700,200
アイホン	9,700	2,833.00	27,480,100
ルネサスエレクトロニクス	1,365,700	2,488.00	3,397,861,600
セイコーエプソン	230,000	2,650.00	609,500,000
ワコム	126,300	660.00	83,358,000

アルバック	39,300	8,304.00	326,347,200
アクセル	9,100	1,222.00	11,120,200
E I Z O	13,100	4,440.00	58,164,000
日本信号	40,800	969.00	39,535,200
京三製作所	37,500	542.00	20,325,000
能美防災	24,300	2,194.00	53,314,200
ホーチキ	13,500	2,240.00	30,240,000
星和電機	2,000	534.00	1,068,000
エレコム	43,000	1,427.00	61,361,000
パナソニック ホールディングス	2,117,600	1,159.50	2,455,357,200
シャープ	302,200	961.20	290,474,640
アンリツ	126,200	1,138.00	143,615,600
富士通ゼネラル	50,800	1,862.50	94,615,000
ソニーグループ	1,242,300	13,270.00	16,485,321,000
T D K	283,800	9,964.00	2,827,783,200
帝国通信工業	7,900	2,344.00	18,517,600
タムラ製作所	71,400	637.00	45,481,800
アルプスアルパイン	160,200	1,501.00	240,460,200
池上通信機	1,200	712.00	854,400
日本電波工業	21,700	1,164.00	25,258,800
鈴木	9,700	1,622.00	15,733,400
メイコー	17,800	5,360.00	95,408,000
日本トリム	4,100	3,525.00	14,452,500
フォスター電機	13,300	1,611.00	21,426,300
S M K	4,800	2,313.00	11,102,400
ヨコオ	16,000	1,671.00	26,736,000
ホシデン	40,900	1,988.00	81,309,200
ヒロセ電機	26,100	18,120.00	472,932,000
日本航空電子工業	42,900	2,401.00	103,002,900
T O A	20,400	930.00	18,972,000
マクセル	39,700	1,574.00	62,487,800
古野電気	23,400	1,821.00	42,611,400
スミダコーポレーション	24,400	934.00	22,789,600
アイコム	6,900	2,736.00	18,878,400
リオン	7,500	2,158.00	16,185,000
横河電機	196,100	3,743.00	734,002,300
新電元工業	6,900	2,581.00	17,808,900
アズビル	122,100	4,491.00	548,351,100
東亜ディーケーケー	2,000	841.00	1,682,000
日本光電工業	152,400	1,947.00	296,722,800
チノー	7,400	2,230.00	16,502,000
共和電業	3,900	400.00	1,560,000

日本電子材料	10,900	2,967.00	32,340,300
堀場製作所	33,600	10,135.00	340,536,000
アドバンテスト	508,500	6,660.00	3,386,610,000
小野測器	2,100	602.00	1,264,200
エスベック	14,300	2,524.00	36,093,200
キーエンス	177,500	67,930.00	12,057,575,000
日置電機	9,300	7,830.00	72,819,000
シスメックス	459,500	2,723.00	1,251,218,500
日本マイクロニクス	29,300	5,160.00	151,188,000
メガチップス	13,800	4,140.00	57,132,000
O B A R A G R O U P	11,100	4,070.00	45,177,000
澤藤電機	600	1,039.00	623,400
原田工業	2,000	536.00	1,072,000
コーセル	19,100	1,198.00	22,881,800
イリソ電子工業	16,400	2,580.00	42,312,000
オブテックスグループ	32,700	1,678.00	54,870,600
千代田インテグレ	6,200	3,490.00	21,638,000
レーザーテック	81,400	29,625.00	2,411,475,000
スタンレー電気	113,700	2,787.00	316,881,900
ウシオ電機	78,600	2,074.00	163,016,400
岡谷電機産業	3,700	238.00	880,600
ヘリオス テクノ ホールディング	4,100	920.00	3,772,000
エノモト	1,200	1,422.00	1,706,400
日本セラミック	16,400	2,501.00	41,016,400
遠藤照明	1,800	1,229.00	2,212,200
古河電池	13,200	1,385.00	18,282,000
山一電機	16,000	2,910.00	46,560,000
図研	14,800	3,455.00	51,134,000
日本電子	44,500	6,334.00	281,863,000
カシオ計算機	128,200	1,165.00	149,353,000
ファナック	858,800	4,165.00	3,576,902,000
日本シイエムケイ	42,100	459.00	19,323,900
エンプラス	5,200	8,700.00	45,240,000
大真空	26,800	618.00	16,562,400
ローム	321,700	1,733.00	557,506,100
浜松ホトニクス	142,500	3,928.00	559,740,000
三井ハイテック	78,800	1,052.50	82,937,000
新光電気工業	62,800	5,730.00	359,844,000
京セラ	1,102,800	1,698.50	1,873,105,800
太陽誘電	86,500	3,727.00	322,385,500
村田製作所	1,585,400	2,957.50	4,688,820,500
双葉電子工業	34,200	539.00	18,433,800

北陸電気工業	1,600	1,379.00	2,206,400
ニチコン	46,800	996.00	46,612,800
日本ケミコン	19,100	1,300.00	24,830,000
K O A	27,000	1,247.00	33,669,000
市光工業	32,500	450.00	14,625,000
小糸製作所	184,000	2,064.00	379,776,000
ミツバ	33,300	1,026.00	34,165,800
S C R E E Nホールディングス	60,700	11,675.00	708,672,500
キャノン電子	16,900	2,185.00	36,926,500
キャノン	885,200	4,828.00	4,273,745,600
リコー	445,000	1,371.50	610,317,500
象印マホービン	53,100	1,496.00	79,437,600
M U T O Hホールディングス	600	2,392.00	1,435,200
東京エレクトロン	375,600	28,405.00	10,668,918,000
イノテック	12,000	1,517.00	18,204,000
トヨタ紡織	74,700	1,904.00	142,228,800
芦森工業	800	2,376.00	1,900,800
ユニプレス	31,900	1,222.00	38,981,800
豊田自動織機	151,400	11,605.00	1,756,997,000
モリタホールディングス	31,200	1,804.00	56,284,800
三櫻工業	27,100	834.00	22,601,400
デンソー	1,464,200	2,282.00	3,341,304,400
東海理化電機製作所	50,000	1,970.00	98,500,000
川崎重工業	144,900	5,013.00	726,383,700
名村造船所	55,300	1,709.00	94,507,700
日本車輛製造	5,800	2,173.00	12,603,400
三菱ロジスネクスト	28,300	1,343.00	38,006,900
近畿車輛	500	1,537.00	768,500
日産自動車	2,335,100	447.80	1,045,657,780
いすゞ自動車	498,300	2,107.50	1,050,167,250
トヨタ自動車	9,430,400	2,687.00	25,339,484,800
日野自動車	266,900	459.70	122,693,930
三菱自動車工業	692,300	415.20	287,442,960
エフテック	2,700	552.00	1,490,400
レシップホールディングス	1,800	592.00	1,065,600
G M B	800	1,222.00	977,600
ファルテック	800	474.00	379,200
武蔵精密工業	43,400	2,115.00	91,791,000
日産車体	18,000	987.00	17,766,000
新明和工業	51,100	1,317.00	67,298,700
極東開発工業	29,300	2,620.00	76,766,000
トピー工業	14,400	2,011.00	28,958,400

ティラド	3,900	3,495.00	13,630,500
曙ブレーキ工業	108,300	140.00	15,162,000
タチエス	32,800	1,920.00	62,976,000
NOK	69,000	2,218.00	153,042,000
フタバ産業	47,600	725.00	34,510,000
カヤバ	16,800	4,595.00	77,196,000
大同メタル工業	34,800	525.00	18,270,000
プレス工業	70,900	606.00	42,965,400
ミクニ	4,900	368.00	1,803,200
太平洋工業	40,700	1,402.00	57,061,400
アイシン	136,900	5,054.00	691,892,600
マツダ	587,000	1,253.00	735,511,000
今仙電機製作所	2,500	563.00	1,407,500
本田技研工業	4,205,000	1,578.00	6,635,490,000
スズキ	1,303,800	1,711.50	2,231,453,700
S U B A R U	550,400	2,753.50	1,515,526,400
安永	1,700	493.00	838,100
ヤマハ発動機	767,000	1,281.50	982,910,500
T B K	4,300	300.00	1,290,000
エクセディ	29,000	3,055.00	88,595,000
豊田合成	50,800	2,509.00	127,457,200
愛三工業	29,500	1,404.00	41,418,000
盟和産業	600	1,042.00	625,200
日本プラスト	3,300	388.00	1,280,400
ヨロズ	16,700	1,121.00	18,720,700
エフ・シー・シー	31,500	2,271.00	71,536,500
シマノ	77,500	28,640.00	2,219,600,000
テイ・エス テック	63,200	1,875.00	118,500,000
ジャムコ	10,700	1,332.00	14,252,400
テルモ	989,300	2,673.50	2,644,893,550
クリエートメディック	1,200	984.00	1,180,800
日機装	45,900	1,017.00	46,680,300
日本エム・ディ・エム	14,100	749.00	10,560,900
島津製作所	235,800	4,793.00	1,130,189,400
J M S	16,400	512.00	8,396,800
長野計器	12,900	2,804.00	36,171,600
ブイ・テクノロジー	9,300	2,862.00	26,616,600
東京計器	13,600	2,975.00	40,460,000
愛知時計電機	7,700	1,994.00	15,353,800
インターアクション	10,700	1,324.00	14,166,800
オーバル	3,400	396.00	1,346,400
東京精密	36,400	8,583.00	312,421,200

マニー	71,000	2,007.00	142,497,000
ニコン	256,600	1,573.50	403,760,100
トプコン	86,300	1,538.00	132,729,400
オリンパス	1,016,100	2,594.50	2,636,271,450
理研計器	25,100	4,075.00	102,282,500
タムロン	24,400	4,170.00	101,748,000
H O Y A	349,400	19,650.00	6,865,710,000
シード	2,300	512.00	1,177,600
ノーリツ鋼機	16,800	3,995.00	67,116,000
A & Dホロンホールディングス	25,900	2,506.00	64,905,400
朝日インテック	216,300	2,450.00	529,935,000
シチズン時計	163,300	932.00	152,195,600
リズム	900	3,950.00	3,555,000
大研医器	3,300	528.00	1,742,400
メニコン	61,000	1,372.50	83,722,500
シンシア	400	411.00	164,400
松風	8,000	5,100.00	40,800,000
セイコーグループ	24,700	4,290.00	105,963,000
ニプロ	147,900	1,286.00	190,199,400
K Y O R I T S U	5,700	158.00	900,600
中本パックス	1,300	1,624.00	2,111,200
パラマウントベッドホールディングス	36,900	2,556.00	94,316,400
トランザクション	11,700	1,851.00	21,656,700
粧美堂	1,000	515.00	515,000
ニホンフラッシュ	16,600	887.00	14,724,200
前田工織	31,600	1,515.00	47,874,000
永大産業	4,500	221.00	994,500
アートネイチャー	16,000	806.00	12,896,000
フルヤ金属	16,900	4,160.00	70,304,000
バンダイナムコホールディングス	481,800	3,010.00	1,450,218,000
アイフィスジャパン	1,100	575.00	632,500
S H O E I	49,900	2,270.00	113,273,000
フランスベッドホールディングス	22,900	1,203.00	27,548,700
パイロットコーポレーション	27,800	4,191.00	116,509,800
萩原工業	11,900	1,515.00	18,028,500
フジシールインターナショナル	35,900	2,293.00	82,318,700
タカラトミー	80,800	3,249.00	262,519,200
広済堂ホールディングス	57,400	477.00	27,379,800
エステールホールディングス	900	635.00	571,500
タカノ	1,400	840.00	1,176,000
プロネクサス	18,400	1,230.00	22,632,000
ホクシン	2,900	110.00	319,000

ウッドワン	1,400	811.00	1,135,400
TOPPANホールディングス	211,500	4,189.00	885,973,500
大日本印刷	184,000	4,995.00	919,080,000
共同印刷	5,000	3,520.00	17,600,000
NISSHA	30,400	2,004.00	60,921,600
光村印刷	300	1,507.00	452,100
TAKARA & COMPANY	10,500	2,834.00	29,757,000
アシックス	655,300	2,523.50	1,653,649,550
ツツミ	4,100	2,209.00	9,056,900
ローランド	13,100	3,805.00	49,845,500
小松ウオール工業	7,200	2,986.00	21,499,200
ヤマハ	108,100	3,301.00	356,838,100
河合楽器製作所	5,400	2,789.00	15,060,600
クリナップ	17,400	722.00	12,562,800
ピジョン	113,000	1,555.50	175,771,500
キングジム	15,700	867.00	13,611,900
リンテック	35,600	3,100.00	110,360,000
イトーキ	35,400	1,325.00	46,905,000
任天堂	1,120,500	8,149.00	9,130,954,500
三菱鉛筆	24,600	2,242.00	55,153,200
タカラスタANDARD	36,300	1,570.00	56,991,000
コクヨ	88,700	2,460.00	218,202,000
ナカバヤシ	19,100	527.00	10,065,700
グローブライド	15,900	1,951.00	31,020,900
オカムラ	53,400	1,933.00	103,222,200
美津濃	17,600	8,660.00	152,416,000
東京電力ホールディングス	1,599,800	716.00	1,145,456,800
中部電力	654,000	1,760.00	1,151,040,000
関西電力	685,300	2,496.00	1,710,508,800
中国電力	308,300	995.30	306,850,990
北陸電力	181,500	984.70	178,723,050
東北電力	467,200	1,281.50	598,716,800
四国電力	165,300	1,279.00	211,418,700
九州電力	409,100	1,532.00	626,741,200
北海道電力	171,500	1,046.50	179,474,750
沖縄電力	45,300	1,068.00	48,380,400
電源開発	145,800	2,472.50	360,490,500
エフオン	12,900	390.00	5,031,000
イーレックス	31,600	875.00	27,650,000
レノバ	47,400	1,007.00	47,731,800
東京瓦斯	345,500	3,564.00	1,231,362,000
大阪瓦斯	353,700	3,488.00	1,233,705,600

東邦瓦斯	76,800	4,334.00	332,851,200
北海道瓦斯	10,600	3,115.00	33,019,000
広島ガス	37,500	385.00	14,437,500
西部ガスホールディングス	18,500	1,911.00	35,353,500
静岡ガス	40,500	1,047.00	42,403,500
メタウォーター	21,300	1,773.00	37,764,900
SBSホールディングス	15,800	2,546.00	40,226,800
東武鉄道	194,900	2,499.00	487,055,100
相鉄ホールディングス	63,500	2,420.50	153,701,750
東急	497,600	1,739.00	865,326,400
京浜急行電鉄	219,600	1,147.50	251,991,000
小田急電鉄	293,500	1,604.00	470,774,000
京王電鉄	85,300	3,587.00	305,971,100
京成電鉄	114,400	4,477.00	512,168,800
富士急行	21,900	2,764.00	60,531,600
東日本旅客鉄道	978,100	2,739.00	2,679,015,900
西日本旅客鉄道	421,000	2,746.50	1,156,276,500
東海旅客鉄道	683,600	3,336.00	2,280,489,600
西武ホールディングス	214,700	2,742.50	588,814,750
鴻池運輸	30,200	2,394.00	72,298,800
西日本鉄道	47,400	2,422.50	114,826,500
ハマキョウレックス	15,100	4,550.00	68,705,000
サカイ引越センター	19,700	2,601.00	51,239,700
近鉄グループホールディングス	177,200	3,432.00	608,150,400
阪急阪神ホールディングス	236,300	4,240.00	1,001,912,000
南海電気鉄道	79,000	2,380.00	188,020,000
京阪ホールディングス	97,700	2,878.00	281,180,600
神戸電鉄	4,800	2,681.00	12,868,800
名古屋鉄道	182,800	1,748.50	319,625,800
山陽電気鉄道	13,300	2,008.00	26,706,400
アルプス物流	14,100	5,750.00	81,075,000
ヤマトホールディングス	215,300	1,657.50	356,859,750
山九	42,800	4,564.00	195,339,200
丸運	2,200	556.00	1,223,200
丸全昭和運輸	10,900	4,840.00	52,756,000
センコーグループホールディングス	93,800	1,165.00	109,277,000
トナミホールディングス	3,900	5,890.00	22,971,000
ニッコンホールディングス	54,600	3,695.00	201,747,000
日本石油輸送	400	2,778.00	1,111,200
福山通運	16,200	3,825.00	61,965,000
セイノーホールディングス	99,600	2,266.00	225,693,600
神奈川中央交通	5,000	3,250.00	16,250,000

A Z - C O M丸和ホールディングス	45,300	1,120.00	50,736,000
九州旅客鉄道	125,300	3,816.00	478,144,800
S Gホールディングス	297,500	1,564.50	465,438,750
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,100	7,260.00	479,886,000
日本郵船	459,000	5,045.00	2,315,655,000
商船三井	384,900	4,986.00	1,919,111,400
川崎汽船	427,100	2,118.00	904,597,800
N Sユナイテッド海運	9,600	4,790.00	45,984,000
飯野海運	65,400	1,256.00	82,142,400
共栄タンカー	1,000	1,185.00	1,185,000
乾汽船	21,100	1,138.00	24,011,800
日本航空	435,200	2,362.50	1,028,160,000
A N Aホールディングス	482,100	2,829.00	1,363,860,900
パスコ	700	1,583.00	1,108,100
トランコム	5,100	6,700.00	34,170,000
日新	13,500	4,175.00	56,362,500
三菱倉庫	42,300	4,810.00	203,463,000
三井倉庫ホールディングス	16,600	5,230.00	86,818,000
住友倉庫	47,300	2,612.00	123,547,600
澁澤倉庫	8,100	2,866.00	23,214,600
東陽倉庫	1,000	1,356.00	1,356,000
日本トランスシティ	35,600	865.00	30,794,000
ケイヒン	700	2,032.00	1,422,400
中央倉庫	9,500	1,291.00	12,264,500
川西倉庫	700	1,110.00	777,000
安田倉庫	12,100	1,527.00	18,476,700
ファイズホールディングス	600	901.00	540,600
東洋埠頭	1,100	1,284.00	1,412,400
上組	81,800	3,266.00	267,158,800
サンリツ	900	758.00	682,200
キムラユニティー	1,800	1,580.00	2,844,000
キューソー流通システム	11,800	1,860.00	21,948,000
東海運	2,200	308.00	677,600
エーアイティー	11,100	1,736.00	19,269,600
内外トランスライン	7,100	2,620.00	18,602,000
日本コンセプト	6,400	1,683.00	10,771,200
N E C ネットズエスアイ	69,400	2,615.00	181,481,000
クロスキャット	11,300	1,164.00	13,153,200
システナ	269,400	374.00	100,755,600
デジタルアーツ	11,300	4,410.00	49,833,000
日鉄ソリューションズ	60,700	3,500.00	212,450,000
キューブシステム	9,400	988.00	9,287,200

コア	7,900	1,870.00	14,773,000
手間いらず	3,000	3,525.00	10,575,000
ラクーンホールディングス	13,300	577.00	7,674,100
ソリトンシステムズ	9,200	1,084.00	9,972,800
ソフトクリエイトホールディングス	14,600	1,562.00	22,805,200
T I S	188,100	3,312.00	622,987,200
テクミラホールディングス	1,800	338.00	608,400
グリー	59,700	458.00	27,342,600
G M Oペパボ	2,200	1,383.00	3,042,600
コーエーテクモホールディングス	111,500	1,441.00	160,671,500
三菱総合研究所	8,700	4,330.00	37,671,000
電算	500	1,399.00	699,500
A G S	1,600	890.00	1,424,000
ファインデックス	14,100	967.00	13,634,700
ブレインパッド	14,800	910.00	13,468,000
K L a b	42,500	201.00	8,542,500
ポルトトゥウィンホールディングス	30,400	423.00	12,859,200
ネクソン	390,800	3,058.00	1,195,066,400
アイスタイル	59,500	482.00	28,679,000
エムアップホールディングス	21,800	1,214.00	26,465,200
エイチーム	11,800	668.00	7,882,400
エニグモ	22,700	337.00	7,649,900
テクノスジャパン	3,400	687.00	2,335,800
コロプラ	60,500	577.00	34,908,500
ブロードリーフ	71,500	734.00	52,481,000
クロス・マーケティンググループ	1,800	656.00	1,180,800
デジタルハーツホールディングス	11,100	839.00	9,312,900
メディアドゥ	8,000	1,501.00	12,008,000
じげん	51,900	546.00	28,337,400
ブイキューブ	24,500	242.00	5,929,000
エンカレッジ・テクノロジー	900	606.00	545,400
サイバーリンクス	1,500	741.00	1,111,500
フィックスターズ	17,900	1,577.00	28,228,300
C A R T A H O L D I N G S	10,100	1,358.00	13,715,800
オブティム	18,300	628.00	11,492,400
セレス	8,000	1,378.00	11,024,000
S H I F T	11,800	11,860.00	139,948,000
ティーガイア	18,600	3,670.00	68,262,000
セック	2,700	4,210.00	11,367,000
テクマトリックス	32,500	2,201.00	71,532,500
プロシップ	8,600	1,353.00	11,635,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,200	2,945.00	130,169,000

GMOペイメントゲートウェイ	40,600	8,731.00	354,478,600
ザッパラス	900	356.00	320,400
システムリサーチ	12,200	1,416.00	17,275,200
インターネットイニシアティブ	85,100	2,724.00	231,812,400
さくらインターネット	22,200	3,270.00	72,594,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,750.00	14,850,000
SRAホールディングス	9,100	4,265.00	38,811,500
システムインテグレータ	1,200	349.00	418,800
朝日ネット	19,100	660.00	12,606,000
eBASE	25,100	595.00	14,934,500
アバントグループ	22,500	1,780.00	40,050,000
アドソル日進	7,500	1,838.00	13,785,000
ODKソリューションズ	800	606.00	484,800
フリービット	7,800	1,216.00	9,484,800
コムチュア	25,700	1,579.00	40,580,300
アステリア	14,000	537.00	7,518,000
アイル	10,000	2,838.00	28,380,000
マークラインズ	10,500	2,920.00	30,660,000
メディカル・データ・ビジョン	21,300	529.00	11,267,700
gumi	29,000	319.00	9,251,000
ショーケース	900	253.00	227,700
モバイルファクトリー	800	746.00	596,800
テラスカイ	7,700	2,328.00	17,925,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,300	1,742.00	16,200,600
PCIホールディングス	1,600	1,103.00	1,764,800
アイビーシー	600	545.00	327,000
ネオジャパン	5,900	1,875.00	11,062,500
PR TIMES	3,600	1,725.00	6,210,000
ラクス	84,200	2,267.50	190,923,500
ランドコンピュータ	1,900	702.00	1,333,800
ダブルスタンダード	5,400	1,573.00	8,494,200
オープンドア	10,400	720.00	7,488,000
アカツキ	8,700	2,130.00	18,531,000
ベネフィットジャパン	200	1,085.00	217,000
Ubicomホールディングス	5,700	1,287.00	7,335,900
カナミックネットワーク	22,400	493.00	11,043,200
ノムラシステムコーポレーション	4,300	123.00	528,900
チェンジホールディングス	39,100	1,196.00	46,763,600
シンクロ・フード	2,500	493.00	1,232,500
オークネット	8,200	2,306.00	18,909,200
キャピタル・アセット・プランニング	800	790.00	632,000
セグエグループ	3,500	629.00	2,201,500

エイトレッド	600	1,474.00	884,400
マクロミル	34,900	797.00	27,815,300
ビーグリー	700	1,404.00	982,800
オロ	7,500	2,269.00	17,017,500
ユーザーローカル	7,500	1,839.00	13,792,500
テモナ	900	195.00	175,500
ニーズウェル	4,200	324.00	1,360,800
マネーフォワード	43,500	5,153.00	224,155,500
サインポスト	1,500	553.00	829,500
Sun Asterisk	12,700	623.00	7,912,100
プラスアルファ・コンサルティング	22,500	1,654.00	37,215,000
電算システムホールディングス	7,900	2,624.00	20,729,600
Appier Group	54,200	1,488.00	80,649,600
ビジョナル	21,000	8,740.00	183,540,000
ソルクシーズ	3,100	288.00	892,800
フェイス	1,100	414.00	455,400
プロトコーポレーション	19,500	1,419.00	27,670,500
ハイマックス	5,600	1,332.00	7,459,200
野村総合研究所	385,400	4,784.00	1,843,753,600
CEホールディングス	1,800	476.00	856,800
日本システム技術	16,500	1,675.00	27,637,500
インテージホールディングス	20,100	1,508.00	30,310,800
東邦システムサイエンス	8,300	1,634.00	13,562,200
ソースネクスト	81,500	214.00	17,441,000
シンプレクス・ホールディングス	27,100	2,402.00	65,094,200
HEROZ	7,000	1,136.00	7,952,000
ラクスル	43,100	1,135.00	48,918,500
メルカリ	86,900	2,185.00	189,876,500
I P S	5,100	2,125.00	10,837,500
F I G	4,500	286.00	1,287,000
システムサポート	6,900	1,758.00	12,130,200
イーソル	12,000	754.00	9,048,000
東海ソフト	600	1,245.00	747,000
ウイングアーク1st	18,500	2,707.00	50,079,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,000	877.00	5,262,000
サーバーワークス	3,600	2,730.00	9,828,000
東名	400	2,823.00	1,129,200
ヴィッツ	400	823.00	329,200
トビラシステムズ	1,100	762.00	838,200
Sansan	58,500	2,077.00	121,504,500
Link-Uグループ	800	539.00	431,200
ギフティ	15,600	1,160.00	18,096,000

メドレー	19,600	3,170.00	62,132,000
ベース	8,700	3,110.00	27,057,000
J M D C	30,400	3,755.00	114,152,000
フォーカスシステムズ	11,900	1,143.00	13,601,700
クレスコ	29,200	1,227.00	35,828,400
フジ・メディア・ホールディングス	171,000	1,742.00	297,882,000
オービック	59,500	25,130.00	1,495,235,000
ジャストシステム	25,600	3,310.00	84,736,000
T D C ソフト	33,300	1,184.00	39,427,200
L I N E ヤフー	2,534,400	380.50	964,339,200
トレンドマイクロ	93,500	8,488.00	793,628,000
I D ホールディングス	12,000	1,291.00	15,492,000
日本オラクル	34,100	12,720.00	433,752,000
アルファシステムズ	4,700	2,804.00	13,178,800
フューチャー	44,300	1,720.00	76,196,000
C A C H o l d i n g s	10,900	1,786.00	19,467,400
トーセ	1,100	660.00	726,000
オービックビジネスコンサルタント	25,000	6,349.00	158,725,000
アイティフォー	22,800	1,354.00	30,871,200
東計電算	5,000	4,240.00	21,200,000
エクスネット	500	1,429.00	714,500
大塚商会	201,800	3,459.00	698,026,200
サイボウズ	24,500	1,662.00	40,719,000
電通総研	17,300	5,760.00	99,648,000
A C C E S S	18,500	1,230.00	22,755,000
デジタルガレージ	28,400	2,940.00	83,496,000
E M システムズ	29,700	558.00	16,572,600
ウェザーニューズ	5,500	5,540.00	30,470,000
C I J	44,400	410.00	18,204,000
ビジネスエンジニアリング	4,200	4,200.00	17,640,000
日本エンタープライズ	4,100	123.00	504,300
WOWOW	13,400	1,099.00	14,726,600
スカラ	16,500	504.00	8,316,000
インテリジェント ウェイブ	2,000	957.00	1,914,000
A N Y C O L O R	25,500	2,424.00	61,812,000
I M A G I C A G R O U P	17,800	492.00	8,757,600
ネットワンシステムズ	69,300	3,163.00	219,195,900
システムソフト	62,200	66.00	4,105,200
アルゴグラフィックス	16,300	5,010.00	81,663,000
マーベラス	28,900	615.00	17,773,500
エイベックス	30,300	1,368.00	41,450,400
B I P R O G Y	58,200	4,568.00	265,857,600

都築電気	9,400	2,221.00	20,877,400
TBSホールディングス	89,500	4,006.00	358,537,000
日本テレビホールディングス	157,600	2,329.00	367,050,400
朝日放送グループホールディングス	16,700	660.00	11,022,000
テレビ朝日ホールディングス	43,200	1,975.00	85,320,000
スカパーJSATホールディングス	138,300	847.00	117,140,100
テレビ東京ホールディングス	12,800	3,670.00	46,976,000
日本BS放送	1,400	905.00	1,267,000
ビジョン	26,600	1,234.00	32,824,400
スマートバリュー	1,100	312.00	343,200
U-NEXT HOLDINGS	20,000	5,430.00	108,600,000
ワイヤレスゲート	1,900	268.00	509,200
日本通信	175,300	176.00	30,852,800
クロップス	500	939.00	469,500
日本電信電話	52,945,600	152.00	8,047,731,200
KDDI	1,309,200	4,737.00	6,201,680,400
ソフトバンク	2,843,700	1,967.00	5,593,557,900
光通信	17,600	28,765.00	506,264,000
エムティーアイ	12,200	1,039.00	12,675,800
GMOインターネットグループ	58,000	2,501.50	145,087,000
ファイバーゲート	9,600	1,098.00	10,540,800
アйдママーケティングコミュニケーション	1,100	223.00	245,300
KADOKAWA	94,100	2,907.00	273,548,700
学研ホールディングス	32,600	1,017.00	33,154,200
ゼンリン	30,400	887.00	26,964,800
昭文社ホールディングス	1,700	375.00	637,500
インプレスホールディングス	3,900	145.00	565,500
アイネット	10,800	1,608.00	17,366,400
松竹	9,300	10,140.00	94,302,000
東宝	99,000	5,327.00	527,373,000
東映	29,400	4,075.00	119,805,000
NTTデータグループ	465,400	2,083.00	969,428,200
ピー・シー・エー	10,200	2,026.00	20,665,200
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,921.00	13,447,000
DTS	35,200	4,055.00	142,736,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,300	5,053.00	410,808,900
シーイーシー	22,500	1,853.00	41,692,500
カブコン	318,400	3,125.00	995,000,000
アイ・エス・ビー	8,400	1,469.00	12,339,600
SCSK	124,600	2,772.50	345,453,500
NSW	7,900	2,926.00	23,115,400
アイネス	13,900	1,549.00	21,531,100

T K C	31,800	3,730.00	118,614,000
富士ソフト	49,200	8,930.00	439,356,000
N S D	62,800	3,085.00	193,738,000
コナミグループ	66,700	12,200.00	813,740,000
福井コンピュータホールディングス	11,000	2,643.00	29,073,000
J B C Cホールディングス	11,800	4,170.00	49,206,000
ミロク情報サービス	16,200	1,781.00	28,852,200
ソフトバンクグループ	878,000	8,528.00	7,487,584,000
リョーサン菱洋ホールディングス	35,300	2,636.00	93,050,800
高千穂交易	7,400	3,975.00	29,415,000
オルパヘルスケアホールディングス	700	1,885.00	1,319,500
伊藤忠食品	4,200	7,070.00	29,694,000
エレマテック	16,900	1,781.00	30,098,900
あらた	28,700	3,450.00	99,015,000
トーメンデバイス	2,700	6,160.00	16,632,000
東京エレクトロン デバイス	18,700	4,020.00	75,174,000
円谷フィールズホールディングス	30,300	1,844.00	55,873,200
双日	209,100	3,460.00	723,486,000
アルフレッサ ホールディングス	188,500	2,327.50	438,733,750
横浜冷凍	47,200	987.00	46,586,400
ラサ商事	9,600	1,553.00	14,908,800
アルコニックス	24,700	1,410.00	34,827,000
神戸物産	145,300	4,064.00	590,499,200
ハイパー	900	332.00	298,800
あい ホールディングス	30,100	2,661.00	80,096,100
ディーブイエックス	1,100	962.00	1,058,200
ダイワボウホールディングス	83,100	2,563.50	213,026,850
マクニカホールディングス	44,400	5,686.00	252,458,400
ラクト・ジャパン	8,000	3,080.00	24,640,000
グリムス	7,900	2,507.00	19,805,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,400	1,297.00	36,834,800
八洲電機	15,200	1,568.00	23,833,600
メディアスホールディングス	10,900	799.00	8,709,100
レスター	16,000	2,897.00	46,352,000
ジオリーブグループ	900	1,122.00	1,009,800
大光	2,100	599.00	1,257,900
O C H Iホールディングス	900	1,408.00	1,267,200
T O K A Iホールディングス	102,000	974.00	99,348,000
黒谷	1,100	680.00	748,000
C o m i n i x	800	862.00	689,600
三洋貿易	19,300	1,443.00	27,849,900
ビューティガレージ	5,900	1,474.00	8,696,600

ウイン・パートナーズ	12,200	1,149.00	14,017,800
ミタチ産業	1,100	1,116.00	1,227,600
シップヘルスケアホールディングス	67,500	2,157.00	145,597,500
明治電機工業	7,000	1,411.00	9,877,000
デリカフーズホールディングス	1,800	556.00	1,000,800
スターティアホールディングス	1,100	2,024.00	2,226,400
コメダホールディングス	46,000	2,664.00	122,544,000
ピーバンドットコム	500	379.00	189,500
アセンテック	7,200	539.00	3,880,800
富士興産	1,100	1,544.00	1,698,400
協栄産業	400	2,374.00	949,600
フルサト・マルカホールディングス	15,000	2,231.00	33,465,000
ヤマエグループホールディングス	16,500	1,778.00	29,337,000
小野建	18,900	1,507.00	28,482,300
南陽	1,700	1,052.00	1,788,400
佐島電機	13,100	2,011.00	26,344,100
エコートレーディング	800	940.00	752,000
伯東	10,800	5,010.00	54,108,000
コンドーテック	14,400	1,266.00	18,230,400
中山福	2,200	367.00	807,400
ナガイレーベン	23,700	2,517.00	59,652,900
三菱食品	17,300	4,965.00	85,894,500
松田産業	14,300	3,070.00	43,901,000
第一興商	72,700	1,611.50	117,156,050
メディバルホールディングス	190,900	2,547.50	486,317,750
S P K	8,300	2,179.00	18,085,700
萩原電気ホールディングス	8,100	3,495.00	28,309,500
アズワン	58,200	3,050.00	177,510,000
スズデン	6,600	1,900.00	12,540,000
尾家産業	1,000	1,915.00	1,915,000
シモジマ	12,600	1,235.00	15,561,000
ドウシシャ	17,400	2,195.00	38,193,000
小津産業	900	1,609.00	1,448,100
高速	11,200	2,337.00	26,174,400
たけびし	7,200	2,492.00	17,942,400
リックス	4,700	2,854.00	13,413,800
丸文	16,800	1,121.00	18,832,800
ハピネット	16,000	3,840.00	61,440,000
橋本総業ホールディングス	7,400	1,180.00	8,732,000
日本ライフライン	50,300	1,122.00	56,436,600
タカショー	16,400	492.00	8,068,800
I D O M	49,700	1,124.00	55,862,800

進和	11,500	2,581.00	29,681,500
エスケイジャパン	1,000	715.00	715,000
ダイترون	8,100	2,775.00	22,477,500
シークス	26,800	1,169.00	31,329,200
田中商事	1,200	665.00	798,000
オーハシテクニカ	9,800	1,795.00	17,591,000
白銅	5,300	2,474.00	13,112,200
ダイコー通産	400	1,114.00	445,600
伊藤忠商事	1,262,200	7,169.00	9,048,711,800
丸紅	1,557,500	2,480.00	3,862,600,000
高島	2,700	1,227.00	3,312,900
長瀬産業	83,900	3,161.00	265,207,900
蝶理	11,800	3,440.00	40,592,000
豊田通商	493,500	2,703.50	1,334,177,250
三共生興	26,000	594.00	15,444,000
兼松	78,500	2,427.00	190,519,500
ツカモトコーポレーション	600	1,218.00	730,800
三井物産	2,812,900	3,083.00	8,672,170,700
日本紙パルプ商事	9,000	6,320.00	56,880,000
カメイ	20,000	2,074.00	41,480,000
東都水産	400	6,300.00	2,520,000
OUGホールディングス	600	2,587.00	1,552,200
スターゼン	13,000	2,721.00	35,373,000
山善	56,900	1,416.00	80,570,400
椿本興業	11,700	1,863.00	21,797,100
住友商事	1,136,400	3,373.00	3,833,077,200
内田洋行	7,600	7,250.00	55,100,000
三菱商事	3,605,500	3,024.00	10,903,032,000
第一実業	17,700	2,303.00	40,763,100
キャノンマーケティングジャパン	43,500	4,378.00	190,443,000
西華産業	7,400	4,165.00	30,821,000
佐藤商事	13,000	1,451.00	18,863,000
東京産業	17,100	744.00	12,722,400
ユアサ商事	14,700	5,190.00	76,293,000
神鋼商事	4,700	7,370.00	34,639,000
トルク	2,900	212.00	614,800
阪和興業	33,700	5,200.00	175,240,000
正栄食品工業	12,500	4,775.00	59,687,500
カナデン	14,100	1,428.00	20,134,800
RYODEN	15,200	2,571.00	39,079,200
岩谷産業	42,800	8,473.00	362,644,400
ナイス	1,300	1,929.00	2,507,700

ニチモウ	1,300	1,905.00	2,476,500
極東貿易	11,200	1,602.00	17,942,400
アステナホールディングス	35,400	501.00	17,735,400
三愛オブリ	43,800	2,006.00	87,862,800
稲畑産業	37,100	3,350.00	124,285,000
G S I クレオス	10,100	2,004.00	20,240,400
明和産業	22,200	679.00	15,073,800
クワザワホールディングス	1,500	686.00	1,029,000
ワキタ	31,100	1,596.00	49,635,600
東邦ホールディングス	50,700	4,643.00	235,400,100
サンゲツ	43,200	2,851.00	123,163,200
ミツウロコグループホールディングス	24,000	1,674.00	40,176,000
シナネンホールディングス	5,200	5,260.00	27,352,000
伊藤忠エネクス	46,600	1,614.00	75,212,400
サンリオ	152,500	3,802.00	579,805,000
サンワテクノス	9,600	2,009.00	19,286,400
新光商事	25,200	930.00	23,436,000
トーヨー	7,300	2,865.00	20,914,500
三信電気	7,600	2,053.00	15,602,800
東陽テクニカ	17,300	1,528.00	26,434,400
モスフードサービス	27,600	3,445.00	95,082,000
加賀電子	17,100	5,110.00	87,381,000
ソーダニッカ	19,800	1,153.00	22,829,400
立花エレテック	12,500	2,658.00	33,225,000
フォーバル	7,400	1,430.00	10,582,000
P A L T A C	25,100	4,397.00	110,364,700
三谷産業	32,800	333.00	10,922,400
西本Wismettacホールディングス	11,400	1,412.00	16,096,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,656.00	796,800
コア商事ホールディングス	13,900	628.00	8,729,200
K P P グループホールディングス	48,600	688.00	33,436,800
ヤマタネ	8,300	3,005.00	24,941,500
丸紅建材リース	300	2,909.00	872,700
泉州電業	12,900	5,100.00	65,790,000
トラスコ中山	39,400	2,248.00	88,571,200
オートバックスセブン	65,400	1,522.50	99,571,500
モリト	14,900	1,365.00	20,338,500
加藤産業	23,200	4,220.00	97,904,000
北恵	1,000	877.00	877,000
イエローハット	29,800	2,524.00	75,215,200
J K ホールディングス	14,400	1,022.00	14,716,800
日伝	12,300	3,495.00	42,988,500

北沢産業	2,500	401.00	1,002,500
杉本商事	9,100	2,649.00	24,105,900
因幡電機産業	48,700	3,845.00	187,251,500
東テク	18,800	2,379.00	44,725,200
ミスミグループ本社	283,600	2,699.00	765,436,400
アルテック	2,200	233.00	512,600
タキヒヨー	900	1,246.00	1,121,400
蔵王産業	700	2,506.00	1,754,200
スズケン	67,100	5,120.00	343,552,000
ジェコス	11,200	935.00	10,472,000
サンエー	14,400	4,945.00	71,208,000
カワチ薬品	14,800	2,669.00	39,501,200
エービーシー・マート	82,300	2,884.50	237,394,350
ハードオフコーポレーション	8,500	2,019.00	17,161,500
アスクル	45,500	2,179.00	99,144,500
ゲオホールディングス	21,300	1,567.00	33,377,100
アダストリア	22,800	3,525.00	80,370,000
くら寿司	22,100	3,700.00	81,770,000
キャンドウ	6,800	3,950.00	26,860,000
I Kホールディングス	2,200	367.00	807,400
パルグループホールディングス	37,000	2,196.00	81,252,000
エディオン	74,500	1,815.00	135,217,500
サーラコーポレーション	39,900	814.00	32,478,600
ワッツ	2,200	717.00	1,577,400
ハローズ	8,600	4,280.00	36,808,000
あみやき亭	4,600	5,530.00	25,438,000
大黒天物産	5,800	11,610.00	67,338,000
ハニーズホールディングス	16,900	1,529.00	25,840,100
ファーマライズホールディングス	1,500	605.00	907,500
アルペン	15,700	2,133.00	33,488,100
ハブ	1,700	761.00	1,293,700
クオールホールディングス	26,100	1,429.00	37,296,900
ジinzホールディングス	14,400	4,890.00	70,416,000
ビックカメラ	112,600	1,699.00	191,307,400
D C Mホールディングス	97,500	1,417.00	138,157,500
Monotaro	266,300	2,458.50	654,698,550
東京一番フーズ	1,800	513.00	923,400
きちりホールディングス	1,100	833.00	916,300
J．フロント リテイリング	215,700	1,527.50	329,481,750
ドトール・日レスホールディングス	33,500	2,166.00	72,561,000
マツキヨココカラ&カンパニー	341,700	2,191.00	748,664,700
ブロンコビリー	11,100	3,475.00	38,572,500

Z O Z O	119,700	4,637.00	555,048,900
トレジャー・ファクトリー	13,100	1,789.00	23,435,900
物語コーポレーション	31,500	3,380.00	106,470,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,000	2,407.00	748,577,000
H a m e e	7,900	1,064.00	8,405,600
マーケットエンタープライズ	700	938.00	656,600
ウエルシアホールディングス	97,600	1,986.00	193,833,600
クリエイトSDホールディングス	26,700	3,295.00	87,976,500
丸善CHIホールディングス	5,800	326.00	1,890,800
ミサワ	1,400	613.00	858,200
ティーライフ	800	1,222.00	977,600
チムニー	1,200	1,335.00	1,602,000
シュッピン	17,200	1,371.00	23,581,200
オイシックス・ラ・大地	25,500	1,228.00	31,314,000
ネクステージ	43,100	1,953.00	84,174,300
ジョイフル本田	52,300	2,097.00	109,673,100
エターナルホスピタリティグループ	7,100	3,495.00	24,814,500
ホットランド	14,500	2,196.00	31,842,000
すかいらーくホールディングス	256,900	2,169.50	557,344,550
SFPホールディングス	9,100	2,112.00	19,219,200
綿半ホールディングス	14,800	1,775.00	26,270,000
ヨシックスホールディングス	4,900	3,015.00	14,773,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,900	888.00	46,975,200
B E E N O S	11,300	2,885.00	32,600,500
あさひ	17,700	1,525.00	26,992,500
日本調剤	12,700	1,251.00	15,887,700
コスモス薬品	16,000	13,840.00	221,440,000
トーエル	2,200	818.00	1,799,600
セブン&アイ・ホールディングス	1,901,500	1,933.00	3,675,599,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	127,100	1,087.00	138,157,700
ツルハホールディングス	39,500	8,643.00	341,398,500
サンマルクホールディングス	15,300	2,058.00	31,487,400
フェリシモ	1,300	922.00	1,198,600
トリドールホールディングス	52,800	3,605.00	190,344,000
T O K Y O B A S E	21,500	264.00	5,676,000
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,160.00	1,276,000
J Mホールディングス	14,300	2,900.00	41,470,000
サツドラホールディングス	2,000	804.00	1,608,000
アレンザホールディングス	14,400	1,135.00	16,344,000
串カツ田中ホールディングス	5,900	1,479.00	8,726,100
パロックジャパンリミテッド	15,100	794.00	11,989,400

クスリのアオキホールディングス	56,600	3,119.00	176,535,400
力の源ホールディングス	12,100	1,200.00	14,520,000
FOOD & LIFE COMPANIES	100,300	2,469.00	247,640,700
メディカルシステムネットワーク	21,200	438.00	9,285,600
はるやまホールディングス	2,500	576.00	1,440,000
ノジマ	54,700	1,624.00	88,832,800
カッパ・クリエイト	29,500	1,791.00	52,834,500
ライトオン	3,000	409.00	1,227,000
良品計画	223,800	2,683.50	600,567,300
パリミキホールディングス	5,900	331.00	1,952,900
アドヴァングループ	16,500	918.00	15,147,000
アルビス	6,300	2,711.00	17,079,300
コナカ	4,800	249.00	1,195,200
ハウス オブ ローゼ	700	1,542.00	1,079,400
G - 7ホールディングス	20,700	1,512.00	31,298,400
イオン北海道	55,600	904.00	50,262,400
コジマ	36,500	1,031.00	37,631,500
ヒマラヤ	1,800	916.00	1,648,800
コーナン商事	23,100	3,720.00	85,932,000
エコス	7,100	2,131.00	15,130,100
ワタミ	19,800	894.00	17,701,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	379,300	3,533.00	1,340,066,900
西松屋チェーン	37,100	2,359.00	87,518,900
ゼンショーホールディングス	95,700	6,893.00	659,660,100
幸楽苑ホールディングス	13,900	1,241.00	17,249,900
ハークスレイ	1,700	732.00	1,244,400
サイゼリヤ	27,800	4,860.00	135,108,000
V Tホールディングス	74,000	497.00	36,778,000
魚力	6,700	2,469.00	16,542,300
フジ・コーポレーション	9,100	2,245.00	20,429,500
ユナイテッドアローズ	22,200	2,161.00	47,974,200
ハイデイ日高	28,000	2,762.00	77,336,000
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	106.00	519,400
コロワイド	80,700	2,076.50	167,573,550
壱番屋	74,500	1,041.00	77,554,500
PLANT	1,100	1,510.00	1,661,000
スギホールディングス	113,600	2,618.00	297,404,800
薬王堂ホールディングス	9,300	2,609.00	24,263,700
スクロール	28,300	994.00	28,130,200
ヨンドシーホールディングス	18,000	1,898.00	34,164,000
木曽路	28,600	2,554.00	73,044,400

S R S ホールディングス	31,300	1,285.00	40,220,500
千趣会	38,000	304.00	11,552,000
リテールパートナーズ	28,100	1,450.00	40,745,000
上新電機	18,700	2,769.00	51,780,300
日本瓦斯	99,700	2,338.50	233,148,450
ロイヤルホールディングス	33,100	2,361.00	78,149,100
いなげや	18,300	1,214.00	22,216,200
チヨダ	18,400	889.00	16,357,600
ライフコーポレーション	19,700	3,535.00	69,639,500
リンガーハット	24,200	2,269.00	54,909,800
MrMaxHD	24,200	699.00	16,915,800
AOKIホールディングス	40,600	1,253.00	50,871,800
オークワ	27,100	887.00	24,037,700
コメリ	29,000	3,500.00	101,500,000
青山商事	40,400	1,401.00	56,600,400
しまむら	44,100	7,654.00	337,541,400
はせがわ	2,900	335.00	971,500
高島屋	119,600	2,380.00	284,648,000
松屋	31,900	912.00	29,092,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	95,800	2,208.00	211,526,400
近鉄百貨店	8,200	2,252.00	18,466,400
丸井グループ	124,700	2,386.00	297,534,200
アクシアル リテイリング	51,600	952.00	49,123,200
イオン	636,600	3,533.00	2,249,107,800
イズミ	33,300	3,417.00	113,786,100
平和堂	31,400	2,327.00	73,067,800
フジ	28,900	1,947.00	56,268,300
ヤオコー	22,300	9,245.00	206,163,500
ゼビオホールディングス	25,800	1,236.00	31,888,800
ケースホールディングス	126,300	1,569.50	198,227,850
Olympicグループ	2,400	499.00	1,197,600
日産東京販売ホールディングス	6,700	474.00	3,175,800
シルバーライフ	5,500	887.00	4,878,500
Genky DrugStores	16,600	3,605.00	59,843,000
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,285.00	1,156,500
ブックオフグループホールディングス	13,900	1,333.00	18,528,700
ギフトホールディングス	9,400	2,588.00	24,327,200
アインホールディングス	25,900	5,378.00	139,290,200
Genki Global Dining	10,700	3,820.00	40,874,000
ヤマダホールディングス	578,400	447.80	259,007,520
アークランズ	56,100	1,764.00	98,960,400
ニトリホールディングス	68,400	20,175.00	1,379,970,000

グルメ杵屋	15,500	1,130.00	17,515,000
愛眼	3,000	165.00	495,000
ケーユーホールディングス	9,100	1,065.00	9,691,500
吉野家ホールディングス	69,300	3,099.00	214,760,700
松屋フーズホールディングス	8,900	5,500.00	48,950,000
サガミホールディングス	28,400	1,654.00	46,973,600
王将フードサービス	14,000	7,850.00	109,900,000
ミニストップ	13,700	1,685.00	23,084,500
アークス	34,600	2,531.00	87,572,600
パローホールディングス	36,000	2,248.00	80,928,000
ベルク	9,400	6,030.00	56,682,000
大庄	11,600	1,160.00	13,456,000
ファーストリテイリング	105,600	44,150.00	4,662,240,000
サンドラッグ	63,500	4,145.00	263,207,500
サックスパー ホールディングス	16,400	812.00	13,316,800
ヤマザワ	1,100	1,267.00	1,393,700
やまや	900	2,998.00	2,698,200
ベルーナ	45,700	733.00	33,498,100
いよぎんホールディングス	208,000	1,381.50	287,352,000
しずおかフィナンシャルグループ	385,000	1,335.00	513,975,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,200	1,593.50	234,563,200
楽天銀行	81,100	3,155.00	255,870,500
京都フィナンシャルグループ	220,000	2,489.50	547,690,000
島根銀行	1,100	512.00	563,200
じもとホールディングス	3,300	307.00	1,013,100
めぶきフィナンシャルグループ	810,000	577.00	467,370,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	4,500.00	100,800,000
九州フィナンシャルグループ	338,300	795.40	269,083,820
ゆうちょ銀行	1,920,700	1,395.00	2,679,376,500
富山第一銀行	55,500	1,324.00	73,482,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	929,900	851.90	792,181,810
西日本フィナンシャルホールディングス	97,800	1,798.00	175,844,400
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,859.00	29,000,400
第四北越フィナンシャルグループ	27,400	5,520.00	151,248,000
ひろぎんホールディングス	248,800	1,162.50	289,230,000
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,493.00	37,145,700
十六フィナンシャルグループ	22,700	4,430.00	100,561,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,100	5,200.00	88,920,000
プロクレアホールディングス	20,000	1,858.00	37,160,000
あいちフィナンシャルグループ	35,900	2,547.00	91,437,300
あおぞら銀行	125,600	2,523.00	316,888,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,640,100	1,544.00	16,428,314,400

りそなホールディングス	2,021,500	1,054.00	2,130,661,000
三井住友トラスト・ホールディングス	622,100	3,651.00	2,271,287,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,224,000	10,000.00	12,240,000,000
千葉銀行	487,100	1,236.00	602,055,600
群馬銀行	339,200	933.40	316,609,280
武蔵野銀行	24,400	3,010.00	73,444,000
千葉興業銀行	41,300	1,130.00	46,669,000
筑波銀行	76,700	285.00	21,859,500
七十七銀行	50,900	4,285.00	218,106,500
秋田銀行	11,700	2,313.00	27,062,100
山形銀行	19,400	1,135.00	22,019,000
岩手銀行	11,000	2,502.00	27,522,000
東邦銀行	138,300	281.00	38,862,300
東北銀行	1,800	1,195.00	2,151,000
ふくおかフィナンシャルグループ	152,200	3,937.00	599,211,400
スルガ銀行	130,800	1,143.00	149,504,400
八十二銀行	375,100	981.70	368,235,670
山梨中央銀行	19,600	1,826.00	35,789,600
大垣共立銀行	33,300	2,055.00	68,431,500
福井銀行	15,600	1,990.00	31,044,000
清水銀行	7,000	1,540.00	10,780,000
富山銀行	600	1,721.00	1,032,600
滋賀銀行	29,100	3,595.00	104,614,500
南都銀行	26,300	3,380.00	88,894,000
百五銀行	164,400	598.00	98,311,200
紀陽銀行	62,500	1,791.00	111,937,500
ほくほくフィナンシャルグループ	108,200	1,854.50	200,656,900
山陰合同銀行	109,400	1,347.00	147,361,800
鳥取銀行	1,300	1,333.00	1,732,900
百十四銀行	17,200	2,840.00	48,848,000
四国銀行	25,600	1,045.00	26,752,000
阿波銀行	24,500	2,647.00	64,851,500
大分銀行	10,500	3,120.00	32,760,000
宮崎銀行	10,500	3,030.00	31,815,000
佐賀銀行	10,200	2,451.00	25,000,200
琉球銀行	37,200	1,117.00	41,552,400
セブン銀行	547,900	282.40	154,726,960
みずほフィナンシャルグループ	2,359,300	3,091.00	7,292,596,300
高知銀行	1,300	870.00	1,131,000
山口フィナンシャルグループ	171,400	1,765.50	302,606,700
名古屋銀行	11,100	7,400.00	82,140,000
北洋銀行	264,800	459.00	121,543,200

大光銀行	1,200	1,544.00	1,852,800
愛媛銀行	23,500	1,114.00	26,179,000
トマト銀行	1,300	1,257.00	1,634,100
京葉銀行	72,000	810.00	58,320,000
栃木銀行	87,300	302.00	26,364,600
北日本銀行	5,700	2,610.00	14,877,000
東和銀行	32,100	638.00	20,479,800
福島銀行	3,900	280.00	1,092,000
大東銀行	1,600	717.00	1,147,200
トモニホールディングス	165,400	400.00	66,160,000
フィデアホールディングス	18,100	1,537.00	27,819,700
池田泉州ホールディングス	242,400	373.00	90,415,200
F P G	62,400	2,319.00	144,705,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,400	1,224.00	34,761,600
マーキュリアホールディングス	1,700	843.00	1,433,100
S B Iホールディングス	280,700	3,584.00	1,006,028,800
ジャフコ グループ	52,100	1,934.50	100,787,450
大和証券グループ本社	1,354,100	1,109.00	1,501,696,900
野村ホールディングス	2,939,400	849.90	2,498,196,060
岡三証券グループ	153,500	667.00	102,384,500
丸三証券	58,200	1,003.00	58,374,600
東洋証券	46,500	440.00	20,460,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207,600	543.00	112,726,800
光世証券	1,000	463.00	463,000
水戸証券	48,100	458.00	22,029,800
いちよし証券	32,800	726.00	23,812,800
松井証券	86,100	804.00	69,224,400
マネックスグループ	171,300	681.00	116,655,300
極東証券	24,000	1,498.00	35,952,000
岩井コスモホールディングス	19,900	2,087.00	41,531,300
アイザワ証券グループ	25,300	2,394.00	60,568,200
マネーパートナーズグループ	4,100	218.00	893,800
スパークス・グループ	19,500	1,399.00	27,280,500
かんぽ生命保険	178,000	2,851.00	507,478,000
F P パートナー	7,700	2,915.00	22,445,500
S O M P Oホールディングス	788,800	3,347.00	2,640,113,600
アニコム ホールディングス	59,400	622.00	36,946,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	1,174,000	3,365.00	3,950,510,000
第一生命ホールディングス	821,900	4,165.00	3,423,213,500
東京海上ホールディングス	1,706,600	5,578.00	9,519,414,800
T & Dホールディングス	469,300	2,425.50	1,138,287,150
アドバンスクリエイト	13,500	949.00	12,811,500

N E X Y Z . G r o u p	2,000	631.00	1,262,000
全国保証	45,800	5,827.00	266,876,600
あんしん保証	4,300	188.00	808,400
イントラスト	2,200	723.00	1,590,600
日本モーゲージサービス	3,400	400.00	1,360,000
C a s a	2,100	839.00	1,761,900
S B I アルヒ	17,500	865.00	15,137,500
プレミアグループ	29,900	1,951.00	58,334,900
ネットプロテクションズホールディングス	61,300	302.00	18,512,600
クレディセゾン	111,000	3,275.00	363,525,000
芙蓉総合リース	16,100	11,540.00	185,794,000
みずほリース	146,900	1,035.00	152,041,500
東京センチュリー	131,000	1,520.50	199,185,500
日本証券金融	64,600	1,890.00	122,094,000
アイフル	259,100	342.00	88,612,200
リコーリース	16,700	5,150.00	86,005,000
イオンフィナンシャルサービス	100,800	1,363.00	137,390,400
アコム	313,500	380.80	119,380,800
ジャックス	18,800	4,015.00	75,482,000
オリエントコーポレーション	57,600	975.00	56,160,000
オリックス	1,048,400	3,478.00	3,646,335,200
三菱H C キャピタル	779,400	1,050.00	818,370,000
九州リースサービス	2,100	1,049.00	2,202,900
日本取引所グループ	450,800	3,453.00	1,556,612,400
イー・ギャランティ	28,900	1,401.00	40,488,900
アサックス	2,400	740.00	1,776,000
N E C キャピタルソリューション	8,700	3,885.00	33,799,500
r o b o t h o m e	52,400	159.00	8,331,600
大東建託	64,100	17,350.00	1,112,135,000
サムティホールディングス	34,300	2,641.00	90,586,300
いちご	179,100	382.00	68,416,200
日本駐車場開発	211,100	205.00	43,275,500
スター・マイカ・ホールディングス	19,100	602.00	11,498,200
S R E ホールディングス	7,700	4,395.00	33,841,500
A D ワークスグループ	9,500	210.00	1,995,000
ヒューリック	408,100	1,440.00	587,664,000
野村不動産ホールディングス	97,500	4,148.00	404,430,000
三重交通グループホールディングス	38,500	529.00	20,366,500
ディア・ライフ	30,500	942.00	28,731,000
地主	15,700	2,042.00	32,059,400
プレサンスコーポレーション	23,400	1,849.00	43,266,600
ハウスコム	1,200	1,044.00	1,252,800

J P M C	10,600	1,212.00	12,847,200
サンセイランディック	1,800	962.00	1,731,600
フージャースホールディングス	27,000	1,051.00	28,377,000
オープンハウスグループ	64,200	5,511.00	353,806,200
東急不動産ホールディングス	526,100	1,029.00	541,356,900
飯田グループホールディングス	167,800	2,170.50	364,209,900
イーランド	1,000	1,446.00	1,446,000
ムゲンエステート	3,300	1,342.00	4,428,600
A n d D oホールディングス	10,600	1,075.00	11,395,000
シーアールイー	8,200	1,476.00	12,103,200
ケイアイスター不動産	8,600	3,495.00	30,057,000
グッドコムアセット	15,000	834.00	12,510,000
ジェイ・エス・ビー	7,500	2,747.00	20,602,500
ロードスターキャピタル	10,200	2,417.00	24,653,400
テンポイノベーション	1,800	913.00	1,643,400
フェイスネットワーク	1,400	1,603.00	2,244,200
霞ヶ関キャピタル	7,200	14,460.00	104,112,000
パーク24	136,600	1,684.00	230,034,400
パラカ	5,800	1,877.00	10,886,600
三井不動産	2,425,100	1,499.50	3,636,437,450
三菱地所	1,097,100	2,396.50	2,629,200,150
平和不動産	28,500	4,060.00	115,710,000
東京建物	153,000	2,443.50	373,855,500
京阪神ビルディング	33,000	1,577.00	52,041,000
住友不動産	252,900	4,808.00	1,215,943,200
テーオーシー	32,100	641.00	20,576,100
レオパレス21	174,900	506.00	88,499,400
スターツコーポレーション	25,300	3,300.00	83,490,000
フジ住宅	22,900	722.00	16,533,800
空港施設	25,700	575.00	14,777,500
明和地所	13,100	992.00	12,995,200
ゴールドクレスト	14,500	2,870.00	41,615,000
エスリード	8,400	4,355.00	36,582,000
日神グループホールディングス	29,300	501.00	14,679,300
日本エスコン	32,700	1,033.00	33,779,100
M I R A R T Hホールディングス	90,900	514.00	46,722,600
A V A N T I A	2,800	819.00	2,293,200
イオンモール	90,900	2,003.00	182,072,700
毎日コムネット	2,100	733.00	1,539,300
ファースト住建	2,100	1,054.00	2,213,400
カチタス	47,300	1,800.00	85,140,000
トーセイ	29,300	2,322.00	68,034,600

穴吹興産	1,200	2,025.00	2,430,000
サンフロンティア不動産	26,200	1,811.00	47,448,200
FJネクストホールディングス	18,900	1,188.00	22,453,200
インテリックス	900	689.00	620,100
ランドビジネス	1,400	207.00	289,800
サンネクスタグループ	1,800	998.00	1,796,400
グランディハウス	17,400	580.00	10,092,000
日本空港ビルディング	61,900	5,227.00	323,551,300
明豊ファシリティワークス	2,200	859.00	1,889,800
LIFULL	45,900	150.00	6,885,000
MIXI	39,200	2,819.00	110,504,800
ジェイエシーリクルートメント	66,200	702.00	46,472,400
日本M&Aセンターホールディングス	291,000	660.80	192,292,800
メンバーズ	6,500	837.00	5,440,500
中広	900	514.00	462,600
UTグループ	23,800	2,847.00	67,758,600
アイティメディア	7,100	1,705.00	12,105,500
ケアネット	37,700	589.00	22,205,300
E・Jホールディングス	10,800	1,703.00	18,392,400
オープンアップグループ	54,900	1,868.00	102,553,200
コシダカホールディングス	54,800	916.00	50,196,800
アルトナー	1,700	1,819.00	3,092,300
パソナグループ	22,200	2,346.00	52,081,200
CDS	1,300	1,826.00	2,373,800
リンクアンドモチベーション	44,700	592.00	26,462,400
エス・エム・エス	64,000	2,139.00	136,896,000
サニーサイドアップグループ	1,600	531.00	849,600
パーソルホールディングス	1,857,900	279.10	518,539,890
リニカル	3,000	383.00	1,149,000
クックパッド	50,900	194.00	9,874,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	775.00	2,247,500
学情	9,400	1,766.00	16,600,400
スタジオアリス	9,200	2,085.00	19,182,000
エプコ	1,300	798.00	1,037,400
NJS	4,500	3,890.00	17,505,000
総合警備保障	304,900	996.80	303,924,320
カカクコム	118,500	2,359.50	279,600,750
アイロムグループ	7,400	2,770.00	20,498,000
セントケア・ホールディング	13,500	757.00	10,219,500
サイネックス	900	756.00	680,400
ルネサンス	14,400	1,029.00	14,817,600
ディップ	28,000	2,933.00	82,124,000

デジタルホールディングス	9,500	981.00	9,319,500
新日本科学	16,700	1,152.00	19,238,400
キャリアデザインセンター	800	1,692.00	1,353,600
エムスリー	360,700	1,392.50	502,274,750
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	415.00	1,286,500
ウェルネット	3,700	804.00	2,974,800
ワールドホールディングス	7,300	1,940.00	14,162,000
ディー・エヌ・エー	65,000	1,746.00	113,490,000
博報堂D Yホールディングス	232,800	1,224.50	285,063,600
ぐるなび	34,500	345.00	11,902,500
タカミヤ	25,200	427.00	10,760,400
ファンコミュニケーションズ	26,000	404.00	10,504,000
ライク	6,900	1,390.00	9,591,000
A o b a - B B T	2,000	311.00	622,000
エスプール	58,300	313.00	18,247,900
W D Bホールディングス	9,400	1,689.00	15,876,600
ティア	3,000	449.00	1,347,000
C D G	500	1,676.00	838,000
アドウェイズ	22,800	367.00	8,367,600
バリューコマース	16,200	1,115.00	18,063,000
インフォマート	172,900	279.00	48,239,100
J Pホールディングス	46,900	676.00	31,704,400
エコナックホールディングス	4,800	115.00	552,000
C Lホールディングス	4,500	1,020.00	4,590,000
プレステージ・インターナショナル	85,600	719.00	61,546,400
アミューズ	11,200	1,504.00	16,844,800
ドリームインキュベータ	5,800	2,214.00	12,841,200
クイック	12,800	2,042.00	26,137,600
T A C	2,900	173.00	501,700
電通グループ	197,300	4,310.00	850,363,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	8,900	862.00	7,671,800
イオンファンタジー	6,600	2,338.00	15,430,800
シーティーエス	22,700	830.00	18,841,000
H . U . グループホールディングス	53,500	2,634.50	140,945,750
アルプス技研	15,900	2,418.00	38,446,200
日本空調サービス	19,800	994.00	19,681,200
オリエンタルランド	965,500	4,040.00	3,900,620,000
ダスキン	39,900	3,662.00	146,113,800
明光ネットワークジャパン	22,400	725.00	16,240,000
ファルコホールディングス	8,200	2,403.00	19,704,600
ラウンドワン	172,300	800.00	137,840,000
リゾートトラスト	79,300	2,519.00	199,756,700

ビー・エム・エル	22,500	2,721.00	61,222,500
リソー教育	90,800	243.00	22,064,400
早稲田アカデミー	10,200	1,545.00	15,759,000
ユー・エス・エス	409,500	1,322.50	541,563,750
東京個別指導学院	22,100	398.00	8,795,800
サイバーエージェント	403,400	983.30	396,663,220
楽天グループ	1,283,800	908.00	1,165,690,400
クリーク・アンド・リバー社	9,300	1,472.00	13,689,600
SBIグローバルアセットマネジメント	36,000	612.00	22,032,000
テー・オー・ダブリュー	36,300	326.00	11,833,800
山田コンサルティンググループ	8,000	2,340.00	18,720,000
セントラルスポーツ	6,900	2,445.00	16,870,500
フルキャストホールディングス	15,100	1,454.00	21,955,400
エン・ジャパン	29,800	2,484.00	74,023,200
リソルホールディングス	400	4,595.00	1,838,000
テクノプロ・ホールディングス	106,000	2,913.50	308,831,000
アトラグループ	1,500	145.00	217,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	943.00	9,147,100
Keeper 技研	11,300	3,710.00	41,923,000
ファーストロジック	1,500	636.00	954,000
三機サービス	800	1,018.00	814,400
Gunosy	14,700	923.00	13,568,100
デザインワン・ジャパン	2,500	126.00	315,000
イー・ガーディアン	8,800	1,890.00	16,632,000
リブセンス	3,000	185.00	555,000
ジャパンマテリアル	55,900	1,804.00	100,843,600
ベクトル	22,000	930.00	20,460,000
ウチヤマホールディングス	2,200	321.00	706,200
チャーム・ケア・コーポレーション	15,300	1,415.00	21,649,500
キャリアリンク	6,800	2,433.00	16,544,400
I B J	14,300	593.00	8,479,900
アサンテ	9,100	1,711.00	15,570,100
バリューHR	16,500	1,659.00	27,373,500
M&Aキャピタルパートナーズ	14,800	2,089.00	30,917,200
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,005.00	7,437,000
E R Iホールディングス	1,200	1,988.00	2,385,600
アビスト	700	3,395.00	2,376,500
シグマクシス・ホールディングス	24,000	1,457.00	34,968,000
ウィルグループ	15,500	958.00	14,849,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,000	140.00	840,000
メドピア	14,900	629.00	9,372,100
レアジョブ	1,200	396.00	475,200

リクルートホールディングス	1,314,000	8,463.00	11,120,382,000
エラン	24,400	829.00	20,227,600
土木管理総合試験所	2,400	306.00	734,400
日本郵政	1,907,200	1,423.00	2,713,945,600
ベルシステム24ホールディングス	19,700	1,525.00	30,042,500
鎌倉新書	16,000	412.00	6,592,000
S MN	1,400	286.00	400,400
グローバルキッズCOMPANY	1,000	713.00	713,000
エアトリ	13,500	1,305.00	17,617,500
アトラエ	13,500	897.00	12,109,500
ストライク	9,000	3,905.00	35,145,000
ソラスト	50,600	527.00	26,666,200
セラク	5,700	1,257.00	7,164,900
インソース	39,800	928.00	36,934,400
ベikalレント・コンサルティング	134,100	4,498.00	603,181,800
Orchestra Holdings	4,200	1,000.00	4,200,000
アイモバイル	23,600	442.00	10,431,200
キャリアインデックス	2,300	194.00	446,200
MS - Japan	8,500	1,039.00	8,831,500
船場	1,000	1,216.00	1,216,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,200	2,875.00	170,200,000
フルテック	700	1,126.00	788,200
GameWith	2,400	214.00	513,600
MS&Consulting	800	520.00	416,000
エル・ティー・エス	2,500	1,847.00	4,617,500
ミダックホールディングス	11,200	1,674.00	18,748,800
キュービーネットホールディングス	10,600	1,114.00	11,808,400
オープングループ	25,700	230.00	5,911,000
スプリックス	1,400	769.00	1,076,600
マネジメントソリューションズ	9,100	1,345.00	12,239,500
プロレド・パートナーズ	4,800	525.00	2,520,000
テノ・ホールディングス	900	408.00	367,200
フロンティア・マネジメント	5,600	1,079.00	6,042,400
コプロ・ホールディングス	1,400	1,624.00	2,273,600
ギークス	900	442.00	397,800
アンビスホールディングス	39,100	2,546.00	99,548,600
カーブスホールディングス	50,100	768.00	38,476,800
フォーラムエンジニアリング	25,000	1,049.00	26,225,000
Fast Fitness Japan	6,400	1,300.00	8,320,000
ダイレクトマーケティングミックス	23,000	213.00	4,899,000
ポピンズ	3,500	1,265.00	4,427,500
LITALICO	14,400	1,206.00	17,366,400

コンフィデンス・インターワークス	400	1,769.00	707,600
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	533.00	1,225,900
リログループ	91,500	1,820.50	166,575,750
東祥	13,000	669.00	8,697,000
I D & Eホールディングス	11,100	3,830.00	42,513,000
ビーウィズ	3,800	1,897.00	7,208,600
T R Eホールディングス	35,000	1,609.00	56,315,000
人・夢・技術グループ	7,600	1,766.00	13,421,600
N I S S Oホールディングス	16,000	764.00	12,224,000
大栄環境	33,200	2,990.00	99,268,000
日本管財ホールディングス	19,200	2,605.00	50,016,000
M & A総研ホールディングス	19,800	2,785.00	55,143,000
エイチ・アイ・エス	58,400	1,744.00	101,849,600
ラックランド	8,300	2,240.00	18,592,000
共立メンテナンス	57,300	2,402.00	137,634,600
イチネンホールディングス	19,400	1,744.00	33,833,600
建設技術研究所	9,400	4,460.00	41,924,000
スペース	13,400	1,121.00	15,021,400
燦ホールディングス	16,900	1,150.00	19,435,000
スバル興業	7,100	2,970.00	21,087,000
東京テアトル	1,400	1,109.00	1,552,600
タナベコンサルティンググループ	8,000	1,102.00	8,816,000
ナガワ	5,700	7,410.00	42,237,000
東京都競馬	13,400	4,095.00	54,873,000
カナモト	28,300	2,687.00	76,042,100
ニシオホールディングス	15,100	4,000.00	60,400,000
トランス・コスモス	20,400	3,390.00	69,156,000
乃村工藝社	79,800	838.00	66,872,400
藤田観光	8,100	8,690.00	70,389,000
K N T - C Tホールディングス	10,900	1,269.00	13,832,100
トーカイ	16,200	2,223.00	36,012,600
セコム	185,800	10,205.00	1,896,089,000
セントラル警備保障	9,900	2,674.00	26,472,600
丹青社	35,500	925.00	32,837,500
メイテックグループホールディングス	62,200	3,339.00	207,685,800
応用地質	17,100	2,288.00	39,124,800
船井総研ホールディングス	36,600	2,185.00	79,971,000
進学会ホールディングス	1,800	225.00	405,000
オオバ	2,800	1,014.00	2,839,200
いであ	1,100	2,292.00	2,521,200
学究社	7,400	1,980.00	14,652,000
イオンディライト	19,600	3,985.00	78,106,000

ナック	15,800	561.00	8,863,800	
ダイセキ	37,300	3,645.00	135,958,500	
ステップ	6,700	1,934.00	12,957,800	
合計	289,706,800		667,204,811,630	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年 8月20日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	833,114,346
国債証券	561,815,050,790
地方債証券	34,699,363,683
特殊債券	36,839,225,105
社債券	30,837,843,000
未収利息	1,590,656,475
前払費用	93,988,947
流動資産合計	666,709,242,346
資産合計	666,709,242,346
負債の部	
流動負債	
未払解約金	656,329,287
流動負債合計	656,329,287
負債合計	656,329,287
純資産の部	
元本等	
元本	506,435,479,611
剰余金	
剰余金又は欠損金()	159,617,433,448
元本等合計	666,052,913,059
純資産合計	666,052,913,059
負債純資産合計	666,709,242,346

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2024年 8月20日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	506,435,479,611口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 98,906,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3152円 (1万口当たり純資産額) (13,152円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	479,700,304,301円
期中追加設定元本額	81,517,063,190円
期中一部解約元本額	54,781,887,880円
期末元本額	506,435,479,611円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,126,552,566円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,858,300円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,033,248,478円
世界経済インデックスファンド	8,931,958,270円
D C マイセレクション 2 5	29,343,817,507円
D C マイセレクション 5 0	36,660,697,491円
D C マイセレクション 7 5	12,451,072,255円
D C 日本債券インデックス・オープン	398,434,364円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,373,179,602円
D C 日本債券インデックス・オープン P	60,267,801,319円
D C マイセレクション S 2 5	18,400,434,494円
D C マイセレクション S 5 0	22,042,417,333円
D C マイセレクション S 7 5	6,037,634,761円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	347,584,840円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,063,800,263円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,274,852,749円
D C 世界経済インデックスファンド	6,721,540,444円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,266,068円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	22,699,080円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	8,589,478円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,267,636円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	53,305,359円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	89,759,737円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	28,733,225円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	24,607,138円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,733,481,659円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	747,934,773円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,274,182,762円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	66,063,141円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	43,531,869円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	890,968,821円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	990,717,155円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,335,344,216円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	93,366,033円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	6,009,377,995円
日本債券ファンド・シリーズ 1	17,526,144,179円
分散投資コア戦略ファンド A	19,153,562,574円
分散投資コア戦略ファンド S	27,595,445,922円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	344,733,358円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,239,590,084円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,170,299円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,312,674円
S M T インデックスバランス・オープン	66,171,234円
S M T 世界経済インデックス・オープン	65,380,908円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	164,081,825円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	244,883,980円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	22,637,524円
グローバル経済コア	416,637,410円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	56,965,328円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	42,614,644円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 3 0	211,812,744円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 4 0	107,729,503円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 5 0	32,638,257円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 6 0	24,687,606円

区分	2024年 8月20日現在
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,222,149,484円
10資産分散投資ファンド	469,522,711円
グローバル10資産バランスファンド	633,343,210円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	185,414円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	154,544円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	142,071円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	142,071円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	216,483円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	210,850円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	234,291円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	279,544円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	106,107,163,897円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	58,882,787円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,094,047円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	550,249,733円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,827,880,790
地方債証券	307,451,517
特殊債券	315,035,359
社債券	218,532,000
合計	6,668,899,666

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第452回利付国債（2年）	4,180,000,000	4,169,675,400	
	第453回利付国債（2年）	1,410,000,000	1,406,164,800	
	第454回利付国債（2年）	1,910,000,000	1,906,351,900	
	第455回利付国債（2年）	1,550,000,000	1,544,761,000	
	第456回利付国債（2年）	1,100,000,000	1,097,228,000	
	第457回利付国債（2年）	2,720,000,000	2,712,329,600	
	第458回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,487,616,000	
	第459回利付国債（2年）	30,000,000	29,944,500	
	第460回利付国債（2年）	2,300,000,000	2,299,011,000	
	第461回利付国債（2年）	2,850,000,000	2,853,249,000	
	第462回利付国債（2年）	1,580,000,000	1,581,595,800	
	第463回利付国債（2年）	2,730,000,000	2,732,347,800	

第145回利付国債（5年）	5,210,000,000	5,200,986,700	
第146回利付国債（5年）	4,660,000,000	4,648,862,600	
第147回利付国債（5年）	4,310,000,000	4,289,656,800	
第148回利付国債（5年）	4,960,000,000	4,930,190,400	
第149回利付国債（5年）	4,580,000,000	4,547,298,800	
第150回利付国債（5年）	4,290,000,000	4,255,251,000	
第151回利付国債（5年）	3,250,000,000	3,220,100,000	
第152回利付国債（5年）	690,000,000	685,328,700	
第153回利付国債（5年）	4,710,000,000	4,661,157,300	
第154回利付国債（5年）	5,100,000,000	5,055,681,000	
第155回利付国債（5年）	3,070,000,000	3,060,390,900	
第156回利付国債（5年）	3,490,000,000	3,467,594,200	
第157回利付国債（5年）	2,460,000,000	2,441,771,400	
第158回利付国債（5年）	3,220,000,000	3,184,773,200	
第159回利付国債（5年）	1,250,000,000	1,234,687,500	
第160回利付国債（5年）	1,730,000,000	1,715,329,600	
第161回利付国債（5年）	2,840,000,000	2,826,595,200	
第162回利付国債（5年）	1,710,000,000	1,700,389,800	
第163回利付国債（5年）	4,240,000,000	4,233,173,600	
第164回利付国債（5年）	1,750,000,000	1,731,030,000	
第165回利付国債（5年）	2,510,000,000	2,493,459,100	
第166回利付国債（5年）	1,540,000,000	1,536,396,400	
第167回利付国債（5年）	1,160,000,000	1,156,357,600	
第168回利付国債（5年）	1,410,000,000	1,418,206,200	
第169回利付国債（5年）	1,780,000,000	1,782,385,200	
第170回利付国債（5年）	2,130,000,000	2,141,054,700	
第1回利付国債（40年）	740,000,000	806,814,600	
第2回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,077,256,400	
第3回利付国債（40年）	730,000,000	758,550,300	
第4回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,063,897,300	
第5回利付国債（40年）	1,050,000,000	1,035,268,500	
第6回利付国債（40年）	1,630,000,000	1,563,398,200	
第7回利付国債（40年）	1,460,000,000	1,329,184,000	
第8回利付国債（40年）	1,310,000,000	1,097,347,700	
第9回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,362,373,200	
第10回利付国債（40年）	2,140,000,000	1,514,349,600	
第11回利付国債（40年）	1,915,000,000	1,292,414,350	
第12回利付国債（40年）	1,430,000,000	847,704,000	
第13回利付国債（40年）	2,230,000,000	1,297,347,100	
第14回利付国債（40年）	2,110,000,000	1,306,912,900	
第15回利付国債（40年）	2,950,000,000	2,014,555,000	
第16回利付国債（40年）	2,680,000,000	2,005,122,400	

第17回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,038,146,100	
第340回利付国債(10年)	4,830,000,000	4,837,293,300	
第341回利付国債(10年)	5,030,000,000	5,031,307,800	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,744,672,800	
第343回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,654,292,400	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,869,497,000	
第345回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,851,208,000	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,711,072,500	
第347回利付国債(10年)	3,840,000,000	3,810,393,600	
第348回利付国債(10年)	4,340,000,000	4,302,285,400	
第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,109,896,400	
第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	6,498,124,200	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	5,325,000,000	5,259,768,750	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,172,302,800	
第353回利付国債(10年)	4,415,000,000	4,348,421,800	
第354回利付国債(10年)	4,420,000,000	4,346,672,200	
第355回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,485,866,300	
第356回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,704,816,000	
第357回利付国債(10年)	3,830,000,000	3,749,455,100	
第358回利付国債(10年)	3,370,000,000	3,295,051,200	
第359回利付国債(10年)	4,065,000,000	3,969,513,150	
第360回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,292,403,800	
第361回利付国債(10年)	5,580,000,000	5,428,000,800	
第362回利付国債(10年)	4,550,000,000	4,415,775,000	
第363回利付国債(10年)	4,920,000,000	4,763,248,800	
第364回利付国債(10年)	5,120,000,000	4,942,694,400	
第365回利付国債(10年)	4,947,000,000	4,761,586,440	
第366回利付国債(10年)	5,600,000,000	5,416,040,000	
第367回利付国債(10年)	4,710,000,000	4,541,900,100	
第368回利付国債(10年)	5,330,000,000	5,124,155,400	
第369回利付国債(10年)	5,170,000,000	5,078,594,400	
第370回利付国債(10年)	5,880,000,000	5,761,518,000	
第371回利付国債(10年)	5,540,000,000	5,366,044,000	
第372回利付国債(10年)	5,360,000,000	5,362,251,200	
第373回利付国債(10年)	5,780,000,000	5,662,377,000	
第374回利付国債(10年)	5,320,000,000	5,289,410,000	
第375回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,671,881,600	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	122,690,700	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	176,464,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	132,172,800	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	125,959,900	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,383,500	

第6回利付国債(30年)	580,000,000	653,207,600
第7回利付国債(30年)	380,000,000	426,861,600
第8回利付国債(30年)	850,000,000	924,043,500
第9回利付国債(30年)	240,000,000	253,224,000
第10回利付国債(30年)	160,000,000	164,712,000
第11回利付国債(30年)	260,000,000	280,571,200
第12回利付国債(30年)	190,000,000	211,629,600
第13回利付国債(30年)	400,000,000	442,060,000
第14回利付国債(30年)	750,000,000	855,615,000
第15回利付国債(30年)	340,000,000	391,248,200
第16回利付国債(30年)	400,000,000	460,432,000
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,290,211,400
第18回利付国債(30年)	505,000,000	571,624,650
第19回利付国債(30年)	630,000,000	712,813,500
第20回利付国債(30年)	660,000,000	760,663,200
第21回利付国債(30年)	960,000,000	1,086,470,400
第22回利付国債(30年)	300,000,000	345,975,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	495,609,400
第24回利付国債(30年)	780,000,000	898,848,600
第25回利付国債(30年)	530,000,000	598,730,400
第26回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,836,188,900
第27回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,578,514,000
第28回利付国債(30年)	1,830,000,000	2,106,531,300
第29回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,012,525,400
第30回利付国債(30年)	1,970,000,000	2,210,064,200
第31回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,502,963,200
第32回利付国債(30年)	1,950,000,000	2,175,829,500
第33回利付国債(30年)	2,410,000,000	2,581,158,200
第34回利付国債(30年)	2,045,000,000	2,240,992,800
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,634,280,800
第36回利付国債(30年)	2,310,000,000	2,445,135,000
第37回利付国債(30年)	2,455,000,000	2,552,905,400
第38回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,417,619,300
第39回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,860,624,000
第40回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,309,517,700
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,305,244,700
第42回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,521,049,500
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,378,741,000
第44回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,226,223,600
第45回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,524,016,000
第46回利付国債(30年)	1,860,000,000	1,765,605,000
第47回利付国債(30年)	1,620,000,000	1,561,437,000
第48回利付国債(30年)	1,720,000,000	1,594,130,400

第49回利付国債（30年）	1,820,000,000	1,681,862,000	
第50回利付国債（30年）	1,860,000,000	1,516,699,800	
第51回利付国債（30年）	1,920,000,000	1,387,123,200	
第52回利付国債（30年）	1,810,000,000	1,364,848,600	
第53回利付国債（30年）	1,550,000,000	1,191,113,000	
第54回利付国債（30年）	1,880,000,000	1,506,820,000	
第55回利付国債（30年）	1,600,000,000	1,277,040,000	
第56回利付国債（30年）	1,780,000,000	1,414,744,000	
第57回利付国債（30年）	1,630,000,000	1,290,096,100	
第58回利付国債（30年）	2,050,000,000	1,615,707,500	
第59回利付国債（30年）	1,450,000,000	1,109,960,500	
第60回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,287,613,600	
第61回利付国債（30年）	1,530,000,000	1,159,847,100	
第62回利付国債（30年）	1,135,000,000	812,296,800	
第63回利付国債（30年）	1,460,000,000	1,010,407,600	
第64回利付国債（30年）	1,620,000,000	1,114,446,600	
第65回利付国債（30年）	1,225,000,000	838,365,500	
第66回利付国債（30年）	1,515,000,000	1,030,684,800	
第67回利付国債（30年）	1,475,000,000	1,056,704,750	
第68回利付国債（30年）	1,670,000,000	1,190,659,900	
第69回利付国債（30年）	1,680,000,000	1,226,097,600	
第70回利付国債（30年）	1,920,000,000	1,394,860,800	
第71回利付国債（30年）	1,470,000,000	1,063,001,100	
第72回利付国債（30年）	1,810,000,000	1,302,801,800	
第73回利付国債（30年）	1,830,000,000	1,312,183,200	
第74回利付国債（30年）	2,110,000,000	1,638,815,900	
第75回利付国債（30年）	1,700,000,000	1,423,597,000	
第76回利付国債（30年）	1,810,000,000	1,549,233,300	
第77回利付国債（30年）	2,010,000,000	1,802,648,400	
第78回利付国債（30年）	1,400,000,000	1,193,010,000	
第79回利付国債（30年）	1,350,000,000	1,090,678,500	
第80回利付国債（30年）	2,270,000,000	2,122,132,200	
第81回利付国債（30年）	1,300,000,000	1,156,818,000	
第82回利付国債（30年）	1,520,000,000	1,416,123,200	
第83回利付国債（30年）	460,000,000	468,436,400	
第81回利付国債（20年）	390,000,000	397,320,300	
第82回利付国債（20年）	600,000,000	611,910,000	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	297,000,600	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	480,720,700	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	298,198,300	
第86回利付国債（20年）	510,000,000	526,019,100	
第87回利付国債（20年）	1,790,000,000	1,843,413,600	

第88回利付国債(20年)	420,000,000	435,048,600
第89回利付国債(20年)	350,000,000	361,903,500
第90回利付国債(20年)	630,000,000	654,154,200
第91回利付国債(20年)	450,000,000	468,184,500
第92回利付国債(20年)	880,000,000	915,613,600
第93回利付国債(20年)	120,000,000	125,026,800
第94回利付国債(20年)	610,000,000	637,108,400
第95回利付国債(20年)	830,000,000	874,986,000
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,667,274,000
第97回利付国債(20年)	900,000,000	950,040,000
第98回利付国債(20年)	440,000,000	463,126,400
第99回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,489,538,100
第100回利付国債(20年)	480,000,000	510,566,400
第101回利付国債(20年)	715,000,000	765,579,100
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,268,547,200
第103回利付国債(20年)	400,000,000	428,508,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	170,195,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,259,307,800
第106回利付国債(20年)	680,000,000	728,429,600
第107回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,177,605,000
第108回利付国債(20年)	840,000,000	892,122,000
第109回利付国債(20年)	920,000,000	979,395,200
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,180,883,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,049,006,500
第112回利付国債(20年)	990,000,000	1,065,952,800
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,182,347,400
第114回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,385,262,000
第115回利付国債(20年)	700,000,000	762,587,000
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,814,612,400
第117回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,153,665,800
第118回利付国債(20年)	660,000,000	716,482,800
第119回利付国債(20年)	460,000,000	494,012,400
第120回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,136,992,700
第121回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,753,342,200
第122回利付国債(20年)	750,000,000	807,307,500
第123回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,974,924,000
第124回利付国債(20年)	760,000,000	829,198,000
第125回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,371,626,000
第126回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,191,468,100
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,108,464,600
第128回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,763,386,200
第129回利付国債(20年)	740,000,000	800,620,800
第130回利付国債(20年)	2,055,000,000	2,225,544,450

第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,388,285,100	
第132回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,325,005,200	
第133回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,962,528,700	
第134回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,237,356,000	
第135回利付国債（20年）	130,000,000	140,111,400	
第136回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,327,469,600	
第137回利付国債（20年）	1,390,000,000	1,499,295,700	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,414,228,900	
第139回利付国債（20年）	480,000,000	513,974,400	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,686,635,300	
第141回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,294,968,000	
第142回利付国債（20年）	1,215,000,000	1,321,251,750	
第143回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,735,165,800	
第144回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,232,592,800	
第145回利付国債（20年）	2,275,000,000	2,454,998,000	
第146回利付国債（20年）	2,670,000,000	2,880,769,800	
第147回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,930,320,400	
第148回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,498,060,000	
第149回利付国債（20年）	2,950,000,000	3,118,297,500	
第150回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,499,294,700	
第151回利付国債（20年）	2,205,000,000	2,257,920,000	
第152回利付国債（20年）	2,420,000,000	2,472,199,400	
第153回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,418,878,500	
第154回利付国債（20年）	2,835,000,000	2,882,911,500	
第155回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,384,208,000	
第156回利付国債（20年）	2,690,000,000	2,488,922,500	
第157回利付国債（20年）	2,900,000,000	2,606,317,000	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,550,900,000	
第159回利付国債（20年）	2,720,000,000	2,543,308,800	
第160回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,272,099,800	
第161回利付国債（20年）	2,520,000,000	2,336,292,000	
第162回利付国債（20年）	1,650,000,000	1,523,412,000	
第163回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,160,613,500	
第164回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,140,062,600	
第165回利付国債（20年）	2,310,000,000	2,075,119,200	
第166回利付国債（20年）	2,150,000,000	1,976,452,000	
第167回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,081,149,200	
第168回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,516,479,600	
第169回利付国債（20年）	2,160,000,000	1,843,300,800	
第170回利付国債（20年）	2,530,000,000	2,146,021,900	
第171回利付国債（20年）	2,060,000,000	1,737,774,800	
第172回利付国債（20年）	1,750,000,000	1,491,840,000	

	第173回利付国債（20年）	2,600,000,000	2,204,514,000
	第174回利付国債（20年）	2,360,000,000	1,990,117,200
	第175回利付国債（20年）	2,210,000,000	1,884,246,000
	第176回利付国債（20年）	2,180,000,000	1,848,836,200
	第177回利付国債（20年）	2,230,000,000	1,848,201,700
	第178回利付国債（20年）	2,460,000,000	2,063,743,200
	第179回利付国債（20年）	2,825,000,000	2,356,954,000
	第180回利付国債（20年）	2,300,000,000	2,014,386,000
	第181回利付国債（20年）	2,690,000,000	2,387,375,000
	第182回利付国債（20年）	2,260,000,000	2,068,148,600
	第183回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,387,262,600
	第184回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,253,997,600
	第185回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,245,317,600
	第186回利付国債（20年）	2,200,000,000	2,125,882,000
	第187回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,889,848,800
	第188回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,319,503,500
	第189回利付国債（20年）	820,000,000	840,582,000
	国債証券合計	582,677,000,000	561,815,050,790
地方債証券	第2回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,227,000
	第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	70,767,000
	第6回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,589,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	111,684,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	108,261,000
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	103,394,000
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	99,589,000
	第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	212,674,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,676,000
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,432,000
	第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	71,808,000
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	214,796,000
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	213,984,000
	第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,072,000
	第38回東京都公募公債（20年）	200,000,000	164,600,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,013,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,398,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,229,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	296,109,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	194,776,000
	第830回東京都公募公債	300,000,000	288,828,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,759,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,468,000

平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,500,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	197,106,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	195,828,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,266,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	97,682,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	230,360,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,292,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	216,150,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,763,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,147,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	103,646,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	99,781,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,373,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,229,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,726,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	206,920,480	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	216,340,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	323,772,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	107,272,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,176,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,184,120	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,370,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	197,090,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,524,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,104,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	154,737,600	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	175,566,300	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	192,770,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	108,084,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	107,608,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	90,142,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	91,899,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	136,136,070	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	105,809,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,250,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,529,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,449,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	434,576,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	89,893,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	293,121,000	

第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	93,485,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	77,232,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,134,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,545,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,257,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,313,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,241,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	301,940,000	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	163,376,400	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	108,138,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,014,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,770,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,354,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,634,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	273,531,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,876,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	76,027,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	194,684,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,361,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	141,370,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,286,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	107,348,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	215,470,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	125,422,854	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,247,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	379,255,500	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,896,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	98,788,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	105,526,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	107,027,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	81,333,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	552,276,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	216,388,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	182,376,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	216,150,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	181,040,000	

第23回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	89,583,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	400,000,000	400,584,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,278,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,523,000	
第28回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	166,290,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,254,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,064,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,893,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,946,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,711,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,507,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,644,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,855,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,386,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	105,754,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	101,833,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,139,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	76,027,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	90,299,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	292,548,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,631,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	90,008,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン ボンド・10年)	100,000,000	98,540,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	98,290,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	214,054,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,825,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,134,000	
第20回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	91,782,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,282,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,262,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	291,828,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	97,268,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	127,290,800	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	99,118,000	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,154,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	290,910,000	
令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	289,974,000	

令和6年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	301,836,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,446,000	
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	100,529,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	214,868,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	98,246,000	
第30回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,915,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,182,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,179,000	
第153回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,730,000	
第154回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,250,000	
第156回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,084,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,471,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,716,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,586,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,084,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,147,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,385,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,512,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,476,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	588,493,689	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,216,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,577,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,500,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,014,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,758,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,449,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,560,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,067,000	
第255回共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,745,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,968,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	98,088,170	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,154,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,196,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,290,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	194,164,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	217,060,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	70,406,000	
第19回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,552,000	
第19回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	101,344,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	600,000,000	544,452,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	92,731,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	193,350,000	

第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	114,531,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,205,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,591,000	
第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	98,465,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,432,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	292,476,000	
第528回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	100,915,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,766,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	194,486,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	99,696,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	124,641,600	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	214,046,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,836,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	107,228,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	71,174,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	70,549,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	323,265,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,375,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,381,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,920,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,040,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	206,716,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	292,503,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,672,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	102,596,000	
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	101,918,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	99,774,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	195,656,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	107,428,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	177,994,000	
第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	105,666,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,366,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	97,010,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,170,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,478,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	107,828,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	105,128,000	

	2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	98,871,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,340,600	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,495,500	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	536,041,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	298,848,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	194,552,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	288,237,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,478,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	97,732,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,175,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,181,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,829,000	
	地方債証券合計	35,077,030,000	34,699,363,683	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	92,634,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	62,785,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,265,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,266,000	
	第109回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	64,070,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	53,153,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	133,081,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,386,000	
	第21回道路債券	100,000,000	115,324,000	
	第28回道路債券	200,000,000	232,116,000	
	第33回道路債券	200,000,000	233,696,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,517,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,593,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,038,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,236,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,866,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,556,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,038,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,211,000	

第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,228,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,305,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,530,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,953,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,117,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,688,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,249,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,887,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,063,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	543,408,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,032,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	73,319,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,988,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,339,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,834,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,232,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,358,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	165,102,000	
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,069,000	
第261回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	140,000,000	140,082,600	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,914,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,675,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	72,924,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	247,000,000	244,794,290	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,500,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	111,163,360	
	205,000,000	203,558,850	

第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,310,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,283,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,300,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,530,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	284,481,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,300,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,326,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,177,000	
第331回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,158,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	118,914,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,586,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	270,519,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	211,571,100	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,441,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,153,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	271,956,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	116,292,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	338,166,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	102,599,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	346,971,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	230,394,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	113,555,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	216,136,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	213,016,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	140,146,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,847,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	538,715,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,604,000	

第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,818,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	529,295,000	
第43回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,244,000	
第45回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,753,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,500,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,325,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,058,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,688,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	199,924,650	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,786,000	
第86回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	249,552,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,165,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,265,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	249,180,250	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	356,092,100	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,237,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,189,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,033,100	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	154,316,760	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,876,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,120,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,789,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,403,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,525,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,744,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	196,250,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,839,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,682,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,840,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,634,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,191,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,253,000	
F246回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,101,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,114,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,102,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	199,098,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,349,000	

第 2 8 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,655,000	
第 3 0 回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	298,422,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	107,840,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,484,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,325,900	
第 4 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	116,188,020	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,235,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,786,600	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,901,860	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	201,540,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	109,484,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	60,766,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	126,782,000	
第 1 9 1 回都市再生債券	100,000,000	86,503,000	
第 1 7 回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	299,028,000	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	97,332,000	
第 2 3 回政府保証中部国際空港債券	104,000,000	103,443,600	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	81,537,000	80,569,155	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,503,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	56,832,000	56,248,903	
第 4 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	104,432,000	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	98,532,000	97,183,096	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	112,197,000	110,203,259	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	39,922,000	39,302,809	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	141,534,000	139,096,784	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	96,858,000	95,247,251	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,800,000	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,787,000	13,106,547	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,308,000	12,634,900	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,954,000	14,436,389	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,226,000	16,794,072	
第 2 9 回政府保証住宅金融支援機構債券	600,000,000	594,726,000	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,086,000	17,735,438	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,373,000	18,001,207	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,274,000	37,552,295	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,317,000	16,822,990	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,792,000	17,297,271	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,368,000	16,871,316	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,542,000	16,011,368	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,746,000	33,613,441	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,385,000	17,853,525	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,280,000	23,841,979	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,063,000	22,594,277	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,201,000	22,752,472	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,626,000	48,618,049	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,922,000	60,478,675	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,023,000	31,237,989	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,426,000	97,830,926	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,535,000	33,037,991	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,194,000	28,656,099	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,022,000	27,265,468	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,927,000	32,465,289	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	163,428,000	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,947,000	83,696,840	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,352,000	114,221,409	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,871,000	32,940,029	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,291,000	34,342,779	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,244,000	35,147,431	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,683,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,763,000	110,274,535	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,095,000	37,777,668	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,662,000	79,197,984	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,678,000	44,887,313	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,700,000	47,573,082	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	308,298,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,024,000	47,157,647	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,615,000	148,220,221	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,276,000	99,434,802	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,605,000	48,593,058	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,401,000	52,187,729	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,539,000	56,129,201	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,988,000	61,382,465	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,119,000	60,353,932	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,888,000	61,271,791	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,273,000	61,961,700	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,605,000	62,105,629	

第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,214,000	124,260,970	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,656,000	63,787,429	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	271,676,000	256,250,236	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,328,000	63,307,845	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,192,000	63,172,574	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,030,000	63,940,716	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,880,000	130,116,672	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	136,000,000	127,757,040	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,766,000	131,414,981	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,883,000	65,547,458	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,972,000	129,972,173	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,133,000	65,678,853	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,758,000	132,280,060	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,816,000	132,298,728	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,409,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,023,000	67,545,330	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,342,000	67,090,016	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,526,000	66,549,936	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,030,000	136,905,545	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,383,000	68,652,533	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,370,000	67,847,440	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,380,000	138,663,894	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,957,000	69,459,638	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	230,301,000	209,253,791	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,758,000	141,509,258	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,368,000	73,098,721	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,156,000	73,577,597	

第158回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,097,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	163,924,000	151,054,326	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,153,000	76,484,129	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,438,000	153,868,824	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,654,000	155,515,035	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,890,000	77,140,210	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,056,000	156,102,929	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,272,000	155,094,619	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,654,000	78,810,245	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,743,000	79,300,450	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,011,000	236,738,644	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,932,000	79,505,399	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,523,000	81,206,574	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,096,000	81,646,491	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,569,000	83,079,725	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,334,000	83,860,665	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,846,000	169,258,713	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,397,000	87,693,992	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,526,000	179,084,328	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,300,000	90,592,434	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,948,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,552,000	90,823,088	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,417,000	91,496,682	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,944,000	187,318,149	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,354,000	94,450,044	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,357,000	94,746,874	
第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,885,000	100,243,587	

第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,394,000	
第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	61,651,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	71,533,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	280,698,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,857,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,476,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,670,000	
い第876号商工債	400,000,000	395,604,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,721,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,335,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,157,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,732,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	395,408,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,734,000	
第411回信金中金債（5年）	200,000,000	198,462,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	99,947,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,109,000	
第20回アングス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	298,677,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,780,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,225,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	195,066,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	486,110,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,907,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,152,000	
第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,758,000	
第114回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,417,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,610,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,266,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,353,000	
第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	399,552,000	
第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,516,000	
第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,526,000	
第107回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,374,000	
第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,274,000	
第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,600,000	
第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,526,000	
第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,112,000	
第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,524,000	
第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,729,000	
第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,402,000	
第91回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,725,000	
	100,000,000	99,159,000	

	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券			
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	186,160,000	
	特殊債券合計	37,698,450,000	36,839,225,105	
社債券	第27回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,826,000	
	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	200,000,000	200,520,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,225,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,354,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,296,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,900,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債（2023）	100,000,000	99,498,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（2023）	400,000,000	400,140,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,726,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,802,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,284,000	
	第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,447,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,309,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,664,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,666,000	
	第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,630,000	
	第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,382,000	
	第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,278,000	
	第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	199,048,000	
	第7回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,554,000	
	第8回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,249,000	
	第9回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,726,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,353,000	
	第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,435,000	
	第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,707,000	
	第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,908,000	
	第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,552,000	

第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,742,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,140,000	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,558,000	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,787,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,515,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,403,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,627,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,566,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,630,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	78,995,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,587,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,672,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,588,000	
第2回株式会社A D E K A無担保社債	100,000,000	99,488,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	285,213,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,692,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,924,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	299,451,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,508,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	200,000,000	200,370,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,501,000	
第2回サワイグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,630,000	
第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,994,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,031,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,007,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,397,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,004,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,599,000	
第20回住友大阪セメント株式会社無担保社債	100,000,000	100,463,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,272,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	98,907,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,679,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	98,957,000	
第17回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	100,390,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,343,000	

第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,140,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,638,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,952,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,360,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,097,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,640,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,446,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,217,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,608,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,394,000	
第39回ソニーグループ株式会社無担保社債	500,000,000	497,110,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,724,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,964,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,996,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,275,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,932,000	
第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,240,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,332,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,698,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	192,192,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	100,648,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,789,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,227,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	199,924,000	
第9回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,443,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	83,143,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,152,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,481,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	107,564,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	195,470,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,983,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,720,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	193,644,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,321,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,412,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,912,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,034,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	100,000,000	96,622,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,935,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,302,000	

第 8 8 回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,302,000	
第 4 1 回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,850,000	
第 9 回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,700,000	
第 1 6 回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,982,000	
第 1 8 回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	389,132,000	
第 2 5 回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,017,000	
第 2 6 回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,576,000	
第 3 0 回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	300,510,000	
第 3 4 回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,039,000	
第 3 4 回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,763,000	
第 5 7 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,235,000	
第 7 8 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,676,000	
第 8 6 回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	300,369,000	
第 4 1 回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,185,000	
第 4 4 回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,226,000	
第 1 7 回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	98,990,000	
第 3 2 回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,099,000	
第 3 5 回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,849,000	
第 3 8 回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,880,000	
第 3 9 回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,223,000	
第 8 0 回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,681,000	
第 2 1 2 回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,637,000	
第 3 6 回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	198,642,000	
第 4 2 回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,400,000	
第 5 2 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,936,000	
第 5 6 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,906,000	
第 6 4 回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,472,000	
第 3 1 回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,505,000	
第 3 9 回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,405,000	
第 3 回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,712,000	

第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,180,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,026,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	197,722,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,126,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	197,384,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	189,566,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,674,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	83,462,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,477,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,744,000	
第17回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	86,863,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,686,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,504,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,230,000	
第89回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,841,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,077,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,528,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,690,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	70,973,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,665,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,589,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,894,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	214,118,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,595,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,032,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,720,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	69,857,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,125,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,451,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,358,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	61,529,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,237,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	66,432,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	78,982,000	

第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,116,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,489,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,476,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,983,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	69,574,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	58,366,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	48,741,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	62,507,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,371,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	142,796,000	
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,084,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,517,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,174,000	
第32回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,012,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,902,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	169,310,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,374,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,315,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	91,080,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	81,570,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,390,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,341,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,650,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,171,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,023,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,488,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,108,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,130,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,224,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,954,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,732,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,762,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	291,039,000	
第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,929,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,118,000	
第323回北陸電力株式会社社債	100,000,000	89,933,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,596,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	178,806,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,999,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,421,000	

第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	194,596,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,572,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,920,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,157,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,176,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,602,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,626,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,773,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,210,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,732,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,217,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,152,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,026,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	92,256,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,407,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	87,094,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,724,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	89,231,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,161,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,519,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,154,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,170,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,080,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,742,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,396,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,523,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,928,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	265,935,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,293,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	93,693,000	
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,294,000	
第75回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,622,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,545,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	198,944,000	
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	99,946,000	
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	98,378,000	

第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	70,210,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,192,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,488,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	81,846,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	197,716,000	
社債券合計	32,000,000,000	30,837,843,000	
合計		664,191,482,578	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	18,220,611,193
コール・ローン	1,094,592,696
株式	714,947,136,014
投資信託受益証券	123,687,834
投資証券	13,843,803,132
派生商品評価勘定	668,414,257
未収入金	1,407,845
未収配当金	785,925,903
未収利息	6,530
差入委託証拠金	7,323,407,552
流動資産合計	757,008,992,956
資産合計	757,008,992,956
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,026,208
前受金	633,542,937
未払解約金	791,439,986
流動負債合計	1,462,009,131
負債合計	1,462,009,131
純資産の部	
元本等	
元本	115,829,191,319
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	639,717,792,506
元本等合計	755,546,983,825
純資産合計	755,546,983,825
負債純資産合計	757,008,992,956

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 8月20日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,829,191,319口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
	6,5229円 (65,229円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	113,463,591,898円
期中追加設定元本額	13,209,906,164円
期中一部解約元本額	10,844,306,743円
期末元本額	115,829,191,319円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,400,556,329円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,302,007円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,612,404,669円
世界経済インデックスファンド	14,716,189,098円
外国株式インデックス・オープン	874,353,827円
D C マイセレクション 2 5	516,171,227円

区分	2024年 8月20日現在
DCマイセレクション50	2,988,839,435円
DCマイセレクション75	3,933,335,873円
DC外国株式インデックス・オープン	13,280,155,820円
DCマイセレクションS25	323,659,114円
DCマイセレクションS50	1,778,811,783円
DCマイセレクションS75	1,916,291,586円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	12,789,445円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	125,584,978円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	103,278,201円
DC世界経済インデックスファンド	8,445,451,224円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	848,808,266円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,832,407円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,714,147円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	12,074,168円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	5,186,390円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	22,984,679円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	5,864,170円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	17,234,457円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	103,978,958円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	104,286,659円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	822,671,614円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	55,675,476円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	12,028,670円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	87,919,280円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	28,393,592円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	699,973,311円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	682,103,768円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,145,868,715円
コア投資戦略ファンド（安定型）	106,117,974円
コア投資戦略ファンド（成長型）	263,824,942円
分散投資コア戦略ファンドA	1,373,514,140円
分散投資コア戦略ファンドS	6,645,092,841円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,541,165,379円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	969,778,276円
コア投資戦略ファンド（切替型）	84,277,565円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	424,856,823円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,394,463円
SMT インデックスバランス・オープン	102,989,425円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	65,295,576円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	4,910,751,747円
SMT 世界経済インデックス・オープン	267,398,153円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,249,766,282円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	202,205,583円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,527,233円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,751,052,424円
グローバル経済コア	670,213,757円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,829,459円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,855,294円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	86,147,365円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,143,797円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	167,453,849円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	187,098,038円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	83,486,975円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	104,885,862円
10資産分散投資ファンド	59,698,844円
グローバル10資産バランスファンド	18,513,234円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,406,642円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,933円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,941円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	24,654円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	24,654円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	32,690円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	14,732円

区分	2024年 8月20日現在
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	11,713円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	1,502円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	43,650,845円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	343,606,449円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	675,477,050円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,459,443,175円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	112,449,619円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	36,019,960円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	73,520,946円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	81,823,674円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	148,051,885円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	156,318,641円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	155,645,401円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	144,550,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	143,116,935円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	46,287,493円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	99,558,131円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	27,655,669,769
投資信託受益証券	1,293,908
投資証券	1,502,540,764
合計	29,156,916,625

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	26,137,905,102	-	26,771,448,039	633,542,937
合計		26,137,905,102	-	26,771,448,039	633,542,937

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	521,249,265	-	519,094,377	2,154,888

	アメリカドル	343,917,600	-	341,744,837	2,172,763
	ユーロ	97,678,112	-	97,690,031	11,919
	スイスフラン	79,653,553	-	79,659,509	5,956
	合計	521,249,265	-	519,094,377	2,154,888

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	33,009	29.32	967,823.88	
	BAKER HUGHES CO	77,332	35.16	2,718,993.12	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	186.09	3,368,042.91	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	74.18	629,194.76	
	CHEVRON CORP	135,746	146.83	19,931,585.18	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	153.40	736,320.00	
	CONOCOPHILLIPS	90,345	111.74	10,095,150.30	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	24.50	1,336,377.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	45.19	2,271,068.64	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	195.84	2,598,209.28	
	EOG RESOURCES INC	45,763	128.24	5,868,647.12	
	EQT CORPORATION	43,539	33.72	1,468,135.08	
	EXXON MOBIL	346,986	118.53	41,128,250.58	
	HALLIBURTON CO	70,302	31.85	2,239,118.70	
	HESS CORP	21,602	138.18	2,984,964.36	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	49.04	658,558.16	
	KINDER MORGAN INC	160,038	21.36	3,418,411.68	
	MARATHON OIL CORP	39,344	28.38	1,116,582.72	
	MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	178.90	4,935,493.20	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	57.39	2,835,410.34	
	ONEOK INC	43,535	88.40	3,848,494.00	
	OVINTIV INC	20,398	43.62	889,760.76	
	PHILLIPS 66	32,264	139.34	4,495,665.76	
	SCHLUMBERGER	110,287	45.36	5,002,618.32	
TARGA RESOURCES CORP	17,298	144.49	2,499,388.02		
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	842.30	1,346,837.70		
VALERO ENERGY CORP	26,282	148.22	3,895,518.04		

WILLIAMS COS	97,655	45.02	4,396,428.10
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	274.17	4,792,217.43
ALBEMARLE CORP	8,403	82.78	695,600.34
AMCOR PLC	110,292	10.62	1,171,301.04
AVERY DENNISON CORP	6,638	213.26	1,415,619.88
BALL CORP	25,896	63.67	1,648,798.32
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	129.71	1,113,171.22
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,872	81.14	1,044,434.08
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	12.70	546,100.00
CORTEVA INC	51,757	54.31	2,810,922.67
CRH PLC	52,103	84.98	4,427,712.94
CROWN HOLDINGS INC	9,940	89.13	885,952.20
DOW INC	56,967	53.65	3,056,279.55
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	80.14	2,734,296.66
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	97.60	862,003.20
ECOLAB INC	20,345	242.21	4,927,762.45
FREEMONT-MCMORAN INC	110,698	44.25	4,898,386.50
INT'L PAPER CO	25,191	47.63	1,199,847.33
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	98.91	1,909,655.37
LINDE PLC	37,432	458.58	17,165,566.56
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	96.96	1,914,475.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	534.51	2,681,636.67
MOSAIC CO/THE	27,732	27.95	775,109.40
NEWMONT CORPORATION	86,194	51.19	4,412,270.86
NUCOR CORP	18,727	144.07	2,697,998.89
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,221	197.01	1,225,599.21
PPG INDUSTRIES INC	17,495	123.25	2,156,258.75
RELIANCE INC	4,126	280.19	1,156,063.94
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	116.27	1,215,719.12
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,426	356.00	6,559,656.00
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	43.49	1,777,001.40
STEEL DYNAMICS INC	11,618	116.06	1,348,385.08
VULCAN MATERIALS CO	10,153	244.29	2,480,276.37
WESTLAKE CORP	2,222	147.04	326,722.88
3 M COMPANY	43,663	127.08	5,548,694.04
AECOM	10,456	97.62	1,020,714.72
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	94.95	1,393,771.05
ALLEGION PLC	7,721	132.85	1,025,734.85
AMETEK INC	17,753	164.67	2,923,386.51
AXON ENTERPRISE INC	5,367	373.07	2,002,266.69
BOEING CO	44,809	179.64	8,049,488.76
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	163.31	1,555,037.82

CARLISLE COS INC	3,456	408.13	1,410,497.28
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	68.64	4,260,004.32
CATERPILLAR	38,627	344.65	13,312,795.55
CNH INDUSTRIAL NV	54,445	9.96	542,272.20
CUMMINS INC	10,453	301.32	3,149,697.96
DEERE&CO	20,534	372.91	7,657,333.94
DOVER CORP	10,657	181.70	1,936,376.90
EATON CORP	30,932	297.05	9,188,350.60
EMCOR GROUP INC	3,640	368.54	1,341,485.60
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	103.84	4,569,998.40
FASTENAL CO	44,011	66.55	2,928,932.05
FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	206.75	3,361,755.00
FORTIVE CORP	25,894	70.56	1,827,080.64
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	77.05	794,385.50
GE VERNOVA INC	20,868	185.40	3,868,927.20
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	295.60	5,367,800.40
GENERAL ELECTRIC CO	85,192	170.93	14,561,868.56
GRACO INC	13,378	80.82	1,081,209.96
GRAINGER (WW) INC	3,363	958.14	3,222,224.82
HEICO CORP	3,640	238.91	869,632.40
HEICO CORP-CLASS A	5,700	186.27	1,061,739.00
HONEYWELL INTL INC	51,027	199.04	10,156,414.08
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	96.37	3,049,917.76
HUBBELL INC	4,458	375.72	1,674,959.76
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	270.90	929,999.70
IDEX CORP	5,916	199.18	1,178,348.88
ILLINOIS TOOL WORKS	22,812	242.66	5,535,559.92
INGERSOLL-RAND INC	31,562	90.95	2,870,563.90
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	37.46	475,742.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	70.53	3,818,564.73
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	230.48	3,383,907.36
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	578.14	1,460,381.64
LOCKHEED MARTIN CORP	16,743	558.39	9,349,123.77
MASCO CORP	18,934	76.77	1,453,563.18
NORDSON CORP	4,121	239.65	987,597.65
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,696	504.87	5,400,089.52
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	92.66	2,846,237.22
OWENS CORNING	6,460	162.58	1,050,266.80
PACCAR INC	40,380	95.97	3,875,268.60
PARKER HANNIFIN CORP	9,881	586.50	5,795,206.50
PENTAIR PLC	14,383	84.89	1,220,972.87
QUANTA SERVICES INC	11,573	268.10	3,102,721.30

ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	265.20	2,245,183.20
RTX CORP	102,848	118.35	12,172,060.80
SMITH (A.O.) CORP	9,016	80.70	727,591.20
SNAP-ON INC	4,000	277.36	1,109,440.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	97.35	1,226,415.30
TEXTRON	13,876	88.62	1,229,691.12
TORO CO	8,812	89.49	788,585.88
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	346.99	6,245,820.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,240	1,308.24	5,546,937.60
UNITED RENTALS INC	5,364	719.90	3,861,543.60
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	78.88	2,287,914.40
WABTEC CORP	13,304	160.97	2,141,544.88
WATSCO INC	2,656	476.39	1,265,291.84
XYLEM INC	19,668	134.38	2,642,985.84
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	264.65	8,447,363.35
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	148.71	1,374,080.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	209.27	2,017,362.80
CINTAS CORP	7,043	772.98	5,444,098.14
COPART INC	69,100	51.59	3,564,869.00
DAYFORCE INC	10,668	55.57	592,820.76
EQUIFAX INC	9,160	295.07	2,702,841.20
JACOBS SOLUTIONS INC	8,836	148.05	1,308,169.80
LEIDOS HOLDINGS	9,314	150.14	1,398,403.96
PAYCHEX INC	24,118	125.21	3,019,814.78
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	158.90	672,941.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	152.01	520,330.23
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	204.96	3,372,616.80
ROLLINS INC	25,466	49.13	1,251,144.58
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	73.27	1,128,504.54
TRANSUNION	15,741	93.61	1,473,515.01
VERALTO CORP	17,691	109.58	1,938,579.78
VERISK ANALYTICS INC	10,738	269.18	2,890,454.84
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	182.70	3,612,892.50
WASTE MANAGEMENT INC	30,660	206.59	6,334,049.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	101.05	845,485.35
CSX CORP	152,551	33.64	5,131,815.64
DELTA AIR LINES INC	15,193	40.47	614,860.71
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	121.30	1,489,564.00
FEDEX CORP	17,725	288.42	5,112,244.50
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.33	633,912.12
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	175.34	1,007,854.32
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	53.91	734,415.93

NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	241.17	4,336,718.94
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,712	200.16	2,944,753.92
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	26.73	361,737.09
U-HAUL HOLDING CO	6,606	66.11	436,722.66
UBER TECHNOLOGIES INC	144,319	74.18	10,705,583.42
UNION PACIFIC CORP	46,736	246.07	11,500,327.52
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	128.95	7,165,364.65
APTIV PLC	21,896	70.99	1,554,397.04
FORD MOTOR COMPANY	290,990	10.72	3,119,412.80
GENERAL MOTORS CO	89,296	45.76	4,086,184.96
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	13.53	694,576.08
TESLA INC	221,215	222.72	49,269,004.80
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	963.22	2,025,651.66
DR HORTON INC	22,973	181.45	4,168,450.85
GARMIN LTD	11,170	175.91	1,964,914.70
LENNAR CORP-CL A	18,864	175.47	3,310,066.08
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	259.12	2,233,355.28
NIKE B	94,445	83.28	7,865,379.60
NVR INC	247	8,854.82	2,187,140.54
PULTE GROUP INC	16,747	125.18	2,096,389.46
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	119.14	4,149,288.78
BOOKING HOLDINGS INC	2,619	3,702.01	9,695,564.19
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	36.80	646,208.00
CARNIVAL CORPORATION	71,810	15.60	1,120,236.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	104,450	52.64	5,498,248.00
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	149.68	1,378,103.76
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	432.84	1,232,728.32
DOORDASH INC - A	21,857	129.56	2,831,792.92
DRAFTKINGS INC	32,654	34.41	1,123,624.14
EXPEDIA GROUP INC	9,628	135.46	1,304,208.88
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	214.55	4,212,689.25
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	146.67	555,439.29
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	40.85	1,248,580.25
MARRIOTT INTL A	19,516	225.15	4,394,027.40
MCDONALD'S CORP	55,965	287.55	16,092,735.75
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	40.07	619,562.34
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,429	161.43	2,974,993.47
STARBUCKS CORP	88,273	92.30	8,147,597.90
WYNN RESORTS LTD	6,702	76.60	513,373.20
YUM BRANDS INC	22,162	136.69	3,029,323.78
ALPHABET INC-CL A	455,214	166.67	75,870,517.38
ALPHABET INC-CL C	394,786	168.40	66,481,962.40

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	355.06	2,553,591.52
COMCAST CORP-CL A	309,993	40.26	12,480,318.18
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	149.67	2,953,438.11
FOX CORP - CLASS A	21,544	39.70	855,296.80
FOX CORP- CLASS B	10,345	36.88	381,523.60
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	31.36	894,104.96
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	78.81	1,212,018.99
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	96.53	1,121,002.89
MATCH GROUP INC	22,730	36.58	831,463.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	169,631	529.28	89,782,295.68
NETFLIX INC	33,607	688.53	23,139,427.71
NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.82	931,385.78
OMNICOM GROUP	14,048	96.91	1,361,391.68
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	11.07	359,863.56
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	31.77	1,454,017.59
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	40.86	1,434,717.18
ROKU INC	9,122	61.96	565,199.12
SEA LTD-ADR	28,338	82.23	2,330,233.74
SNAP INC - A	72,602	9.50	689,719.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	150.50	1,936,483.50
THE WALT DISNEY CO	142,615	90.82	12,952,294.30
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	102.64	3,446,959.12
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	7.63	1,353,661.19
AMAZON.COM	724,185	178.22	129,064,250.70
AUTOZONE INC	1,368	3,172.18	4,339,542.24
BATH & BODY WORKS INC	13,452	34.26	460,865.52
BEST BUY COMPANY INC	15,285	85.04	1,299,836.40
BURLINGTON STORES INC	5,108	264.45	1,350,810.60
CARMAX INC	10,695	80.31	858,915.45
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	226.60	1,121,670.00
EBAY	41,952	56.68	2,377,839.36
ETSY INC	10,294	54.88	564,934.72
GENUINE PARTS CO	9,903	138.68	1,373,348.04
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	34.79	243,530.00
HOME DEPOT	77,067	363.07	27,980,715.69
LKQ CORP	19,286	41.12	793,040.32
LOWES COMPANIES	44,328	243.21	10,781,012.88
MERCADOLIBRE INC	3,573	2,028.00	7,246,044.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,121.50	5,133,105.50
POOL CORP	2,664	345.59	920,651.76
ROSS STORES INC	25,425	147.40	3,747,645.00
TJX COMPANIES INC	88,680	112.49	9,975,613.20

TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	263.94	2,070,873.24
ULTA BEAUTY INC	3,920	377.06	1,478,075.20
WILLIAMS-SONOMA INC	8,920	140.37	1,252,100.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	20.92	523,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,237	872.35	29,866,646.95
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	122.09	1,988,479.83
DOLLAR TREE INC	16,318	100.51	1,640,122.18
KROGER CO	50,664	52.76	2,673,032.64
SYSCO CORP	40,090	76.91	3,083,321.90
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,264	144.63	5,100,232.32
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	10.85	559,501.95
WALMART INC	342,809	73.72	25,271,879.48
ALTRIA GROUP INC	132,873	51.32	6,819,042.36
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	59.68	2,424,082.24
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	44.89	632,140.98
BUNGE GLOBAL SA	11,604	96.25	1,116,885.00
CAMPBELL SOUP CO	15,869	49.97	792,973.93
CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	41.56	543,147.64
COCA-COLA CO	316,878	68.98	21,858,244.44
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	77.15	1,187,647.10
CONAGRA BRANDS INC	33,324	31.09	1,036,043.16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	242.96	3,189,092.96
GENERAL MILLS INC	43,531	69.82	3,039,334.42
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	197.17	2,157,434.14
HORMEL FOODS CORP	23,338	32.68	762,685.84
JM SMUCKER CO	7,850	120.93	949,300.50
KELLANOVA	23,448	80.26	1,881,936.48
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	35.62	2,890,669.86
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	35.36	2,438,567.04
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	62.93	747,356.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	78.16	1,414,070.72
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	54.04	792,712.76
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	70.89	7,474,003.59
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	46.60	2,719,016.80
PEPSICO INC	107,105	173.82	18,616,991.10
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	118.45	14,093,536.35
TYSON FOODS INC	23,306	62.47	1,455,925.82
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	100.16	1,937,695.36
CLOROX COMPANY	9,570	149.18	1,427,652.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	101.85	6,308,385.30
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	92.85	1,745,580.00
KENVUE INC	148,093	21.64	3,204,732.52

KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	143.46	3,855,774.42
PROCTER & GAMBLE CO	181,466	168.42	30,562,503.72
ABBOTT LABORATORIES	133,298	111.90	14,916,046.20
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	240.01	1,260,772.53
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	36.46	1,515,860.96
BECTON DICKINSON & CO	22,142	235.90	5,223,297.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	78.68	8,821,680.28
CARDINAL HEALTH	19,151	109.79	2,102,588.29
CENCORA INC	14,462	238.85	3,454,248.70
CENTENE CORP	40,934	78.30	3,205,132.20
COOPER COS INC/THE	12,923	95.22	1,230,528.06
CVS HEALTH CORP	99,034	58.80	5,823,199.20
DAVITA INC	4,627	152.17	704,090.59
DEXCOM INC	28,772	77.69	2,235,296.68
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,930	68.26	3,066,921.80
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	543.39	9,907,086.48
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	85.59	2,824,298.82
HCA HEALTHCARE INC	15,457	374.21	5,784,163.97
HENRY SCHEIN INC	8,755	69.82	611,274.10
HOLOGIC INC	18,875	81.35	1,535,481.25
HUMANA INC	9,013	353.25	3,183,842.25
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	496.99	3,302,001.56
INSULET CORP	5,246	195.92	1,027,796.32
INTUITIVE SURGICAL INC	27,718	482.16	13,364,510.88
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	226.16	1,480,895.68
MCKESSON CORP	10,179	548.40	5,582,163.60
MEDTRONIC PLC	102,632	84.82	8,705,246.24
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	346.18	1,573,388.10
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	151.12	1,311,570.48
RESMED INC	10,920	231.30	2,525,796.00
SOLVENTUM CORP	10,915	59.45	648,896.75
STERIS PLC	8,172	233.57	1,908,734.04
STRYKER CORP	26,379	341.06	8,996,821.74
TELEFLEX INC	3,934	238.00	936,292.00
THE CIGNA GROUP	21,946	342.33	7,512,774.18
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,401	578.78	41,325,470.78
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	227.52	1,062,973.44
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	194.28	2,426,751.48
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	111.77	1,704,939.58
ABBVIE INC	136,294	196.87	26,832,199.78
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	140.51	3,061,853.41
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	274.48	2,646,810.64

AMGEN	41,885	327.97	13,737,023.45
AVANTOR INC	49,647	25.41	1,261,530.27
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	326.33	604,689.49
BIO-TECHNE CORP	12,980	74.99	973,370.20
BIOGEN INC	10,740	206.06	2,213,084.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	92.76	1,371,271.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	155,274	49.30	7,655,008.20
CATALENT INC	13,739	59.41	816,233.99
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	204.02	857,700.08
DANAHER CORP	54,787	271.27	14,862,069.49
ELI LILLY & CO	62,575	921.81	57,682,260.75
EXACT SCIENCES CORP	12,208	58.97	719,905.76
GILEAD SCIENCES INC	96,270	74.45	7,167,301.50
ILLUMINA INC	11,423	135.90	1,552,385.70
INCYTE CORP	15,212	63.26	962,311.12
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	243.11	3,363,669.96
JOHNSON & JOHNSON	187,239	159.63	29,888,961.57
MERCK & CO	195,618	114.42	22,382,611.56
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,434.79	2,334,403.33
MODERNA INC	25,884	89.96	2,328,524.64
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	148.24	999,434.08
PFIZER	432,739	28.80	12,462,883.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	1,196.88	9,966,419.76
REPLIGEN CORP	4,353	153.82	669,578.46
REVVITY INC	8,524	120.24	1,024,925.76
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	27.49	826,981.67
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	18.29	1,685,258.89
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,526	607.60	17,939,997.60
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	348.58	1,261,162.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	488.05	9,700,481.80
VIATRIS INC	89,720	11.83	1,061,387.60
WATERS CORP	4,749	340.26	1,615,894.74
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	301.68	1,739,788.56
ZOETIS INC	35,994	184.48	6,640,173.12
BANK OF AMERICA CORP	549,785	39.67	21,809,970.95
CITIGROUP	146,698	62.03	9,099,676.94
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	41.60	1,644,115.20
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	41.07	2,235,029.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	2,023.50	1,550,001.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	14.03	1,600,991.36
JPMORGAN CHASE & CO	222,518	215.45	47,941,503.10
KEY CORP	71,223	16.70	1,189,424.10

M & T BANK CORP	13,791	164.40	2,267,240.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	174.50	5,502,508.50
REGIONS FINL CORP	70,810	21.76	1,540,825.60
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	42.95	4,567,388.90
US BANCORP	117,317	43.66	5,122,060.22
WELLS FARGO & CO	273,850	56.45	15,458,832.50
ALLY FINANCIAL INC	21,529	42.77	920,795.33
AMERICAN EXPRESS	45,006	254.05	11,433,774.30
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	435.34	3,402,617.44
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	29,517	111.61	3,294,392.37
ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	144.58	2,131,253.78
BANK NEW YORK CO	56,329	65.74	3,703,068.46
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	448.77	45,459,054.69
BLACKROCK INC	11,583	870.21	10,079,642.43
BLACKSTONE INC	55,334	134.65	7,450,723.10
BLOCK INC	42,352	66.88	2,832,501.76
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	142.93	4,301,764.21
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	41.50	650,263.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	204.59	1,801,005.77
CME GROUP INC	27,997	208.87	5,847,733.39
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,368	204.46	2,937,681.28
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	28.37	546,094.13
CORPAY INC	4,988	294.82	1,470,562.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	136.63	2,594,193.81
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	41.02	1,147,862.66
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	413.04	1,300,249.92
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	79.16	3,599,405.20
FISERV INC	46,319	167.91	7,777,423.29
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	22.73	592,571.10
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	62.52	269,836.32
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	109.90	2,280,315.10
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,012	504.68	12,623,056.16
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	157.27	6,939,066.94
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	164.09	855,401.17
KKR & CO INC	47,919	120.18	5,758,905.42
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	221.43	1,215,650.70
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	235.20	754,286.40
MASTERCARD INC-CLASS A	64,241	466.98	29,999,262.18
MOODY'S CORP	12,577	470.08	5,912,196.16
MORGAN STANLEY	93,827	101.75	9,546,897.25
MSCI INC	5,952	560.53	3,336,274.56
NASDAQ INC	29,020	69.97	2,030,529.40

NORTHERN TRUST CORP	15,902	87.18	1,386,336.36
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	69.43	5,504,826.98
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	109.41	1,999,467.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	115.93	1,795,291.98
ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	20.28	946,427.04
S&P GLOBAL INC	24,501	495.74	12,146,125.74
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	65.58	7,679,090.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	66.98	639,659.00
STATE STREET CORP	22,335	81.01	1,809,358.35
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	47.63	1,390,605.48
TOAST INC-CLASS A	31,526	24.90	784,997.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	116.33	1,054,066.13
VISA INC-CLASS A SHARES	122,188	266.47	32,559,436.36
AFLAC	43,196	105.21	4,544,651.16
ALLSTATE CORP	20,722	180.62	3,742,807.64
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	129.24	816,667.56
AMERICAN INT'L GROUP	50,875	74.43	3,786,626.25
AON PLC	15,249	334.38	5,098,960.62
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	103.00	3,062,911.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,294	286.55	4,669,045.70
ASSURANT INC	4,726	188.75	892,032.50
BROWN & BROWN INC	20,155	102.52	2,066,290.60
CHUBB LTD	30,987	274.03	8,491,367.61
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	131.32	1,458,965.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	478.53	1,036,495.98
EVEREST GROUP LTD	3,288	378.74	1,245,297.12
FNF GROUP	20,461	57.43	1,175,075.23
HARTFORD FINANCIAL SVCS	21,873	111.19	2,432,058.87
LOEWS CORP	16,402	79.37	1,301,826.74
MARKEL GROUP INC	1,007	1,557.47	1,568,372.29
MARSH & MCLENNAN COS	38,224	223.18	8,530,832.32
METLIFE INC	48,925	73.25	3,583,756.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	78.16	1,448,773.76
PROGRESSIVE CORP	45,236	237.78	10,756,216.08
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,649	115.77	3,085,154.73
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	218.95	3,754,335.65
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	282.40	2,184,928.80
WR BERKLEY CORP	21,540	57.40	1,236,396.00
WEYERHAEUSER CO	52,615	30.18	1,587,920.70
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	329.44	15,929,412.32
ADOBE INC	34,893	563.12	19,648,946.16
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	101.65	1,167,348.60

ANSYS INC	6,794	326.93	2,221,162.42
APPROVIN CORP-CLASS A	12,260	85.81	1,052,091.90
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	213.42	510,927.48
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	159.00	1,818,324.00
AUTODESK INC	17,030	251.11	4,276,403.30
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.28	744,797.64
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,140	281.96	5,960,634.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	187.25	1,321,610.50
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	84.07	1,939,242.69
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,006	75.99	2,812,085.94
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	22.16	272,568.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,478	266.78	4,662,780.84
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	281.41	872,371.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	117.21	2,435,623.80
DOCUSIGN INC	14,969	57.19	856,077.11
DYNATRACE INC	22,028	49.93	1,099,858.04
EPAM SYSTEMS INC	4,768	202.29	964,518.72
FAIR ISAAC CORP	2,026	1,753.70	3,552,996.20
FORTINET INC	49,270	74.77	3,683,917.90
GARTNER INC	5,859	485.00	2,841,615.00
GEN DIGITAL INC	43,555	25.48	1,109,781.40
GODADDY INC - CLASS A	11,388	163.94	1,866,948.72
HUBSPOT INC	3,646	497.26	1,813,009.96
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,082	194.73	13,841,797.86
INTUIT INC	21,468	663.30	14,239,724.40
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	259.74	1,219,219.56
MICROSOFT CORP	546,006	421.53	230,157,909.18
MICROSTRATEGY INC-CL A	12,190	135.35	1,649,916.50
MONDAY.COM LTD	2,838	270.00	766,260.00
MONGODB INC	5,325	256.95	1,368,258.75
OKTA INC	11,505	97.93	1,126,684.65
ORACLE CORP	126,564	137.92	17,455,706.88
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	32.50	4,774,867.50
PALO ALTO NETWORKS INC	25,444	343.36	8,736,451.84
PTC INC	9,741	176.34	1,717,727.94
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	549.88	4,649,785.28
SALESFORCE INC	74,662	265.38	19,813,801.56
SAMSARA INC-CL A	13,283	40.34	535,836.22
SERVICENOW INC	15,986	832.88	13,314,419.68
SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	131.42	3,093,363.96
SYNOPSYS INC	11,896	558.22	6,640,585.12
TWILIO INC - A	12,842	61.88	794,662.96

TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	579.58	1,935,217.62
UIPATH INC - CLASS A	28,419	12.16	345,575.04
UNITY SOFTWARE INC	16,437	16.72	274,826.64
VERISIGN INC	6,723	182.81	1,229,031.63
WIX.COM LTD	5,010	171.13	857,361.30
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	232.63	3,822,576.16
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	59.82	1,248,383.58
ZSCALER INC	7,204	195.50	1,408,382.00
AMPHENOL CORPORATION	91,720	66.35	6,085,622.00
APPLE INC	1,134,924	225.89	256,367,982.36
ARISTA NETWORKS INC	20,702	352.06	7,288,346.12
CDW CORP/DE	9,823	219.20	2,153,201.60
CISCO SYSTEMS	312,372	49.98	15,612,352.56
CORNING	66,604	40.61	2,704,788.44
DELL TECHNOLOGIES -C	20,331	111.87	2,274,428.97
F5 INC	4,851	196.36	952,566.61
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	18.88	1,839,516.16
HP INC	77,024	34.60	2,665,030.40
JABIL INC	9,340	107.46	1,003,676.40
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	38.99	987,265.79
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	138.50	1,916,563.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	422.44	5,558,887.96
NETAPP INC	15,191	131.70	2,000,654.70
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	61.96	1,479,295.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	103.96	1,512,410.08
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,216	623.62	2,629,181.92
TE CONNECTIVITY LTD	23,161	150.51	3,485,962.11
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	419.42	1,392,474.40
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	55.89	990,259.02
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	65.10	1,678,929.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	347.02	1,444,297.24
AT&T INC	548,004	19.49	10,680,597.96
T-MOBILE US INC	41,896	197.58	8,277,811.68
VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	40.74	13,128,668.70
AES CORP	54,375	17.37	944,493.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	57.67	1,198,267.26
AMEREN CORPORATION	20,898	82.51	1,724,293.98
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	97.54	3,971,828.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	141.57	2,048,234.76
ATMOS ENERGY CORP	11,302	129.41	1,462,591.82
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	26.04	1,236,014.64
CMS ENERGY CORP	23,697	66.53	1,576,561.41

CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	100.41	2,778,846.75
CONSTELLATION ENERGY	23,831	192.78	4,594,140.18
DOMINION ENERGY INC	62,863	56.29	3,538,558.27
DTE ENERGY COMPANY	15,851	123.27	1,953,952.77
DUKE ENERGY CORP	60,351	112.72	6,802,764.72
EDISON INTL	30,900	83.89	2,592,201.00
ENERGY CORP	16,181	118.39	1,915,668.59
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	39.72	810,248.28
EVERGY INC	18,475	58.93	1,088,731.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	65.84	1,807,308.00
EXELON CORP	81,573	37.61	3,067,960.53
FIRSTENERGY CORP	39,425	42.86	1,689,755.50
NEXTERA ENERGY INC	160,662	79.35	12,748,529.70
NISOURCE INC	32,351	32.13	1,039,437.63
NRG ENERGY INC	13,109	82.34	1,079,395.06
PG&E CORP	164,187	18.57	3,048,952.59
PPL CORPORATION	58,459	31.38	1,834,443.42
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	80.88	3,256,714.08
SEMPRA	49,744	80.87	4,022,797.28
SOUTHERN CO	86,109	86.94	7,486,316.46
VISTRA CORP	24,594	80.74	1,985,719.56
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	90.14	2,113,512.58
XCEL ENERGY INC	41,562	60.15	2,499,954.30
ADVANCED MICRO DEVICES	124,711	155.28	19,365,124.08
ANALOG DEVICES	37,792	225.95	8,539,102.40
APPLIED MATERIALS	64,814	210.94	13,671,865.16
BROADCOM INC	340,170	167.71	57,049,910.70
ENPHASE ENERGY INC	9,617	119.71	1,151,251.07
ENTEGRIS INC	12,389	114.59	1,419,655.51
FIRST SOLAR INC	7,921	228.38	1,808,997.98
INTEL CORP	328,277	21.52	7,064,521.04
KLA CORP	10,294	820.45	8,445,712.30
LAM RESEARCH CORP	10,237	881.28	9,021,663.36
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	49.52	543,630.56
MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	71.04	4,812,888.96
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	82.03	3,340,097.54
MICRON TECHNOLOGY	85,302	108.63	9,266,356.26
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	917.21	3,587,208.31
NVIDIA CORP	1,933,750	130.00	251,387,500.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	258.24	4,986,614.40
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	77.72	2,487,894.92
QORVO INC	8,678	112.34	974,886.52

	QUALCOMM	85,755	174.26	14,943,666.30
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	108.05	1,214,698.10
	TERADYNE INC	12,318	133.98	1,650,365.64
	TEXAS INSTRUMENTS	71,015	200.66	14,249,869.90
	CBRE GROUP INC-A	22,995	112.50	2,586,937.50
	COSTAR GROUP INC	33,027	74.91	2,474,052.57
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.58	353,346.00
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	55.60	656,580.40
	アメリカドル 小計	28,536,177		3,723,460,346.06 (545,300,767,680)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	38,058	25.22	959,822.76
	CAMECO CORP	31,793	56.21	1,787,084.53
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,204	49.90	8,243,679.60
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	26.60	2,960,393.80
	ENBRIDGE	166,986	53.35	8,908,703.10
	IMPERIAL OIL	16,202	103.50	1,676,907.00
	KEYERA CORP	18,607	39.66	737,953.62
	MEG ENERGY CORP	13,934	27.57	384,160.38
	PARKLAND CORP	7,149	36.16	258,507.84
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	52.68	2,420,171.88
	SUNCOR ENERGY	98,973	56.40	5,582,077.20
	TC ENERGY CORP	82,559	61.19	5,051,785.21
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	62.42	1,561,061.78
	AGNICO EAGLE MINES	40,306	110.26	4,444,139.56
	BARRICK GOLD CORP	133,727	27.55	3,684,178.85
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	77.41	721,616.02
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	16.77	1,094,527.59
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	168.10	2,629,252.10
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	17.88	927,024.36
	KINROSS GOLD CORP	108,451	12.78	1,386,003.78
	LUNDIN MINING CORP	38,990	13.17	513,498.30
	NUTRIEN LTD	37,152	64.58	2,399,276.16
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	28.74	644,235.84
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	67.27	2,380,416.22
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	116.42	408,052.10
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	82.52	3,052,497.32
	CAE INC	25,999	24.02	624,495.98
	STANTEC INC	9,001	112.37	1,011,442.37
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	122.24	637,237.12
	WSP GLOBAL INC	9,951	222.84	2,217,480.84
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	27.20	886,148.80
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,609	56.62	713,921.58

RB GLOBAL INC	14,445	113.35	1,637,340.75
THOMSON REUTERS CORP	11,495	223.39	2,567,868.05
AIR CANADA	13,805	15.71	216,876.55
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	155.04	6,548,424.48
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	108.60	7,941,375.00
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	200.82	1,172,186.34
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	56.36	1,141,515.44
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	93.99	288,549.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	57.96	569,167.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	97.62	2,252,386.26
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	151.29	682,771.77
DOLLARAMA INC	22,000	134.62	2,961,640.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,865	81.77	4,731,621.05
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	37.59	260,498.70
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	171.19	2,210,576.47
METRO INC	18,840	83.24	1,568,241.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	214.94	1,123,276.44
SAPUTO INC	20,898	29.83	623,387.34
BANK MONTREAL	56,278	117.83	6,631,236.74
BANK NOVA SCOTIA	97,216	64.96	6,315,151.36
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,075	72.55	5,156,491.25
NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	117.87	3,258,634.02
ROYAL BANK OF CANADA	109,143	153.77	16,782,919.11
TORONTO-DOMINION BANK	136,393	81.00	11,047,833.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	55.33	1,604,625.33
BROOKFIELD CORP	104,769	64.01	6,706,263.69
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.20	293,567.00
ONEX CORP	6,603	90.95	600,542.85
TMX GROUP LTD	23,425	42.13	986,895.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,493	1,540.93	2,300,608.49
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	43.09	1,025,024.92
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	100.68	702,444.36
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	254.09	3,367,962.95
MANULIFE FINANCIAL CORP	135,007	35.88	4,844,051.16
POWER CORP OF CANADA	43,577	39.10	1,703,860.70
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	71.62	3,123,634.68
CGI INC - CL A	16,084	149.20	2,399,732.80
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	4,217.04	6,549,063.12
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	137.01	956,877.84
OPEN TEXT CORP	20,463	44.24	905,283.12
SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	102.47	9,645,501.10
BCE INC	6,203	46.84	290,548.52

	QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.00	501,600.00
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	54.48	1,518,956.88
	TELUS CORP	32,908	21.84	718,710.72
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	33.52	817,720.40
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	38.48	434,631.60
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	33.01	340,795.24
	EMERA INC	25,484	50.15	1,278,022.60
	FORTIS INC	35,547	60.08	2,135,663.76
	HYDRO ONE LTD	29,579	44.57	1,318,336.03
	NORTHLAND POWER INC	17,854	22.46	401,000.84
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	237.97	640,139.30
	カナダドル 小計	3,197,926		216,709,787.06 (23,274,631,130)
ユーロ	ENI	151,339	14.61	2,212,273.50
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	19.44	771,029.28
	NESTE OIL OYJ	32,766	20.22	662,528.52
	OMV AG	12,549	39.40	494,430.60
	REPSOL SA	89,536	12.83	1,149,194.56
	TENARIS SA	40,648	12.85	522,326.80
	TOTALENERGIES SE	167,596	62.92	10,545,140.32
	AIR LIQUIDE	44,628	165.40	7,381,471.20
	AKZO NOBEL	12,357	54.10	668,513.70
	ARCELORMITTAL	29,208	20.68	604,021.44
	ARKEMA	4,369	80.15	350,175.35
	BASF SE	70,406	43.08	3,033,090.48
	COVESTRO AG	14,454	54.30	784,852.20
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	115.50	1,583,158.50
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.31	309,674.47
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	91.26	982,413.90
	OCI NV	7,248	26.23	190,115.04
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.29	476,298.85
	SYENSQO SA	5,356	70.50	377,598.00
	SYMRISE AG	10,018	112.75	1,129,529.50
	UMICORE	17,605	11.20	197,176.00
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	30.55	1,292,998.20
	VOESTALPINE AG	7,152	21.50	153,768.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,256	40.62	700,938.72
	AIRBUS SE	46,092	138.52	6,384,663.84
	ALSTOM	24,388	17.83	434,838.04
	BOUYGUES ORD	16,606	31.88	529,399.28
	BRENTAG SE	9,500	64.22	610,090.00
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	34.29	1,346,842.62

DASSAULT AVIATION SA	2,130	191.10	407,043.00
EIFFAGE	5,924	92.00	545,008.00
FERROVIAL SE	37,026	36.64	1,356,632.64
GEA GROUP AG	13,382	40.68	544,379.76
IMCD NV	4,641	140.80	653,452.80
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	82.10	1,017,875.80
KNORR-BREMSE AG	5,022	73.40	368,614.80
KONE OYJ-B	26,369	46.68	1,230,904.92
LEGRAND SA	19,340	96.94	1,874,819.60
LEONARDO SPA	31,340	22.44	703,269.60
METSO CORPORATION	51,970	9.36	486,647.08
MTU AERO ENGINES AG	3,962	268.90	1,065,381.80
PRYSMIAN SPA	21,155	61.30	1,296,801.50
RATIONAL AG	483	906.50	437,839.50
REXEL SA	17,411	22.61	393,662.71
RHEINMETALL AG	3,203	551.20	1,765,493.60
SAFRAN SA	26,619	196.50	5,230,633.50
SAINT-GOBAIN	36,177	76.44	2,765,369.88
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	223.75	9,431,062.50
SIEMENS	58,485	164.26	9,606,746.10
SIEMENS ENERGY AG	47,513	25.41	1,207,305.33
THALES SA	6,657	148.65	989,563.05
VINCI S.A.	39,327	106.00	4,168,662.00
WARTSILA OYJ	41,917	18.73	785,314.99
BUREAU VERITAS SA	25,073	29.04	728,119.92
RANDSTAD NV	10,680	42.56	454,540.80
TELEPERFORMANCE	4,734	106.10	502,277.40
WOLTERS KLUWER	19,155	151.10	2,894,320.50
ADP	2,382	115.80	275,835.60
AENA SME SA	5,508	175.70	967,755.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.60	254,192.85
DHL GROUP	74,810	38.24	2,860,734.40
GETLINK	21,115	16.07	339,318.05
INPOST SA	15,470	16.12	249,376.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	82.72	2,036,318.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	76.75	383,059.25
CONTINENTAL AG	8,168	60.02	490,243.36
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	68.92	706,705.68
FERRARI NV	10,026	419.20	4,202,899.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,436	60.70	3,850,565.20
MICHELIN	49,034	35.13	1,722,564.42
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	40.33	473,675.85

RENAULT SA	17,081	41.76	713,302.56
STELLANTIS NV	166,407	14.73	2,451,507.92
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	96.30	1,476,086.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	103.70	257,798.20
ADIDAS AG	12,783	217.60	2,781,580.80
HERMES INTERNATIONAL	2,420	2,153.00	5,210,260.00
KERING	5,534	261.00	1,444,374.00
LVMH	21,429	674.50	14,453,860.50
MONCLER SPA	18,908	54.36	1,027,838.88
PUMA SE	9,220	37.47	345,473.40
SEB SA	2,282	91.40	208,574.80
ACCOR	14,436	35.54	513,055.44
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	58.66	2,157,045.52
DELIVERY HERO SE	13,414	21.47	287,998.58
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	35.94	291,401.52
SODEXO	6,173	87.45	539,828.85
BOLLORE SE	31,761	5.90	187,548.70
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	81.50	393,400.50
PUBLICIS GROUPE	17,217	94.42	1,625,629.14
SCOUT24 SE	7,536	66.90	504,158.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	22.43	1,476,477.18
VIVENDI SE	61,243	9.73	595,894.39
D'IETEREN GROUP	2,217	212.20	470,447.40
INDITEX	87,257	47.50	4,144,707.50
PROSUS	112,590	33.49	3,771,202.05
ZALANDO SE	17,664	23.90	422,169.60
CARREFOUR	39,746	14.21	564,790.66
JERONIMO MARTINS	21,861	16.75	366,171.75
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.04	362,297.32
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.17	2,139,053.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,097	55.08	3,750,782.76
DANONE (GROUPE)	51,810	60.72	3,145,903.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	8.14	275,915.72
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	67.55	642,535.60
HEINEKEN NV	23,160	79.76	1,847,241.60
JDE PEET'S BV	7,000	20.90	146,300.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	89.60	977,804.80
LOTUS BAKERIES	38	10,960.00	416,480.00
PERNOD-RICARD	15,339	123.90	1,900,502.10
REMY COINTREAU	1,032	71.25	73,530.00
BEIERSDORF AG	7,430	124.25	923,177.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	70.60	619,868.00

HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,880	77.90	925,452.00
LOREAL	18,546	385.70	7,153,192.20
AMPLIFON SPA	11,650	29.14	339,481.00
BIOMERIEUX	3,044	99.15	301,812.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	64.05	219,691.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	101.00	209,070.00
ESSILORLUXOTTICA	22,901	211.60	4,845,851.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	34.34	583,264.90
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	32.08	1,080,743.12
KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	26.44	1,762,120.24
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	51.50	1,110,700.50
ARGENX SE	4,935	474.30	2,340,670.50
BAYER	78,462	29.08	2,282,067.27
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	52.20	533,484.00
GRIFOLS SA	27,685	8.69	240,804.13
IPSEN	3,532	106.70	376,864.40
MERCK KGAA	10,703	169.80	1,817,369.40
ORION OYJ-CLASS B	10,139	46.63	472,781.57
QIAGEN N.V.	16,526	42.35	699,876.10
RECORDATI SPA	6,099	50.40	307,389.60
SANOFI	87,091	98.34	8,564,528.94
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	241.40	440,313.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	174.25	449,913.50
UCB (GROUPE)	9,389	154.30	1,448,722.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	26,474	15.29	404,787.46
AIB GROUP PLC	145,826	5.26	767,773.89
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	9.40	4,219,650.60
BANCO BPM SPA	118,197	6.00	709,654.78
BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.90	803,517.60
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.28	5,240,687.83
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	10.22	903,665.05
BNP PARIBAS	81,615	61.36	5,007,896.40
CAIXABANK	275,085	5.34	1,470,054.24
COMMERZBANK AG	81,889	12.77	1,046,131.97
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	13.56	1,181,916.72
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	47.73	1,211,196.48
FINECOBANK SPA	41,585	14.68	610,675.72
ING GROEP NV-CVA	256,546	15.88	4,076,002.84
INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.61	4,138,380.55
KBC GROEP NV	18,057	69.70	1,258,572.90
MEDIOBANCA	33,860	14.78	500,450.80
NORDEA BANK ABP	236,636	10.58	2,503,608.88

SOCIETE GENERALE	53,019	21.06	1,116,580.14
UNICREDIT SPA	116,219	36.67	4,261,750.73
ADYEN NV	1,609	1,313.60	2,113,582.40
AMUNDI SA	4,626	66.85	309,248.10
DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	14.14	1,991,189.52
DEUTSCHE BOERSE	14,123	195.20	2,756,809.60
EDENRED	20,131	37.98	764,575.38
EURAZEO SA	3,357	71.60	240,361.20
EURONEXT NV	6,480	94.80	614,304.00
EXOR NV	7,825	96.30	753,547.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	67.70	576,465.50
NEXI SPA	48,458	6.08	294,624.64
SOFINA	1,238	216.20	267,655.60
AEGON LTD	101,846	5.82	593,558.48
AGEAS	11,086	44.06	488,449.16
ALLIANZ SE-REG	30,116	269.70	8,122,285.20
ASR NEDERLAND NV	11,959	45.99	549,994.41
AXA SA	136,349	33.44	4,559,510.56
GENERALI	84,111	23.45	1,972,402.95
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	247.40	1,102,167.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	462.90	4,820,640.60
NN GROUP NV	22,941	43.55	999,080.55
POSTE ITALIANE SPA	24,923	12.41	309,419.04
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.99	1,358,080.68
TALANX AG	5,053	76.30	385,543.90
BECHTLE AG	7,659	39.54	302,836.86
CAPGEMINI SA	12,235	181.75	2,223,711.25
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	34.20	1,694,507.40
NEMETSCHKE SE	5,455	90.50	493,677.50
SAP SE	81,129	197.24	16,001,883.96
NOKIA OYJ	396,129	3.74	1,481,522.46
CELLNEX TELECOM SA	34,475	34.36	1,184,561.00
DEUTSCHE TELEKOM	253,485	25.22	6,392,891.70
ELISA A	10,227	43.82	448,147.14
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.65	323,493.75
KPN (KON.)	290,883	3.58	1,043,397.32
ORANGE	153,281	10.31	1,581,093.51
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.23	201,287.52
TELEFONICA	373,259	4.13	1,542,679.44
ACCIONA SA	2,181	122.50	267,172.50
E.ON SE	166,881	12.24	2,043,457.84
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	14.23	309,530.96

	ELIA GROUP SA/NV	987	96.20	94,949.40
	ENDESA	25,972	18.37	477,235.50
	ENEL	640,374	6.59	4,220,705.03
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.76	887,248.60
	ENGIE	146,393	15.53	2,274,215.25
	FORTUM OYJ	32,550	14.56	474,090.75
	IBERDROLA SA	460,303	12.55	5,776,802.65
	REDEIA CORP SA	30,678	16.80	515,390.40
	RWE STAMM	52,507	31.37	1,647,144.59
	SNAM SPA	147,559	4.40	650,587.63
	TERNA SPA	95,819	7.68	735,889.92
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.71	1,429,212.51
	VERBUND AG	6,430	77.75	499,932.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	608.40	2,345,990.40
	ASML HOLDING NV	30,793	829.40	25,539,714.20
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	121.95	775,236.15
	INFINEON TECHNOLOGIES	96,562	31.56	3,047,496.72
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	27.92	1,403,985.12
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	84.22	444,260.50
	VONOVIA SE	61,810	29.67	1,833,902.70
	ユーロ 小計	14,206,931		391,999,973.88 (63,625,515,760)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.42	5,814,111.25
	SHELL PLC-NEW	491,663	28.13	13,830,480.19
	ANGLO AMERICAN PLC	101,769	22.35	2,274,537.15
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	18.80	561,292.80
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	39.22	428,439.28
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.31	287,121.24
	GLENCORE PLC	793,369	4.15	3,294,068.08
	MONDI PLC	37,918	14.79	560,807.22
	RIO TINTO PLC REG	88,047	48.24	4,247,827.51
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	52.98	1,765,134.66
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	13.39	3,214,229.33
	BUNZL PLC	29,337	32.24	945,824.88
	DCC PLC	6,622	53.20	352,290.40
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.07	513,264.81
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	5.00	3,179,545.00
	SMITHS GROUP PLC	26,476	17.81	471,537.56
	SPIRAX GROUP PLC	5,514	74.95	413,274.30
	EXPERIAN PLC	68,159	35.96	2,450,997.64
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	47.70	662,553.00
	RELX PLC	145,542	35.40	5,152,186.80

RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.83	878,258.22
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.54	405,539.08
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	52.20	362,894.40
BURBERRY GROUP PLC	29,776	7.02	209,206.17
PERSIMMON PLC	25,686	16.81	431,781.66
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.63	432,734.40
COMPASS GROUP PLC	129,701	23.83	3,090,774.83
ENTAIN PLC	49,630	6.41	318,128.30
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	159.60	2,081,503.20
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	74.88	1,035,815.04
PEARSON	55,305	10.44	577,384.20
WHITBREAD PLC	17,434	28.28	493,033.52
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.28	600,565.05
INFORMA PLC	110,598	8.25	912,875.89
MPP PLC	85,821	7.13	612,075.37
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.28	266,494.01
KINGFISHER PLC	153,717	2.81	432,252.20
NEXT PLC	8,464	99.80	844,707.20
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.84	421,568.07
TESCO PLC	525,585	3.41	1,794,347.19
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	24.76	637,322.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	27.81	4,393,423.80
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.26	489,589.60
DIAGEO	174,682	24.82	4,335,607.24
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	21.73	1,488,026.94
HALEON PLC	530,525	3.72	1,973,553.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	42.63	2,413,753.23
UNILEVER PLC	193,307	47.35	9,153,086.45
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.76	807,020.17
ASTRAZENECA	120,005	130.50	15,660,652.50
GSK PLC	319,416	15.99	5,107,461.84
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	20.38	365,005.80
BARCLAYS	1,129,529	2.29	2,586,621.41
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,446,594	6.63	9,599,597.78
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.59	2,859,423.48
NATWEST GROUP PLC	506,122	3.52	1,781,549.44
STANDARD CHARTERED PLC	161,358	7.62	1,229,547.96
3I GROUP PLC	74,757	31.91	2,385,495.87
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	11.01	364,199.79
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	35,214	99.76	3,512,948.64
M&G PLC	131,539	2.11	278,336.52
SCHRODERS PLC	39,932	3.48	138,963.36

	WISE PLC - A	49,048	7.20	353,145.60
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	29.33	476,759.15
	AVIVA PLC	193,334	5.06	979,430.04
	LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.32	1,158,813.20
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.56	283,820.56
	PRUDENTIAL	212,226	6.59	1,399,418.24
	SAGE GROUP PLC	76,660	10.27	787,298.20
	HALMA PLC	31,069	25.55	793,812.95
	BT GROUP PLC	464,863	1.45	676,840.52
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.75	1,242,516.33
	CENTRICA PLC	453,631	1.29	588,813.03
	NATIONAL GRID PLC	371,439	9.87	3,668,331.56
	SEVERN TRENT PLC	17,468	25.65	448,054.20
	SSE PLC	81,692	18.98	1,550,514.16
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.03	507,570.30
	イギリスポンド 小計	20,715,648		153,097,786.36 (29,114,606,032)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	12.96	225,478.08
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	711.00	408,114.00
	GIVAUDAN-REG	742	4,192.00	3,110,464.00
	HOLCIM LTD	38,804	79.44	3,082,589.76
	SIG GROUP AG	26,203	17.78	465,889.34
	SIKA AG-BR	12,257	259.90	3,185,594.30
	ABB LTD	124,889	47.81	5,970,943.09
	GEBERIT AG-REG	2,530	527.80	1,335,334.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	227.00	464,896.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	231.20	714,870.40
	VAT GROUP AG	1,956	434.20	849,295.20
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	28.44	422,504.64
	SGS SA	12,959	93.98	1,217,886.82
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	258.00	975,498.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	135.55	5,554,161.25
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	183.05	454,513.15
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	36.50	143,737.00
	AVOLTA AG	7,820	32.92	257,434.40
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,386.00	388,080.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,200.00	873,600.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	11,050.00	906,100.00
	NESTLE SA - REGISTERED	205,438	90.18	18,526,398.84
	ALCON INC	38,399	82.94	3,184,813.06
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	293.10	1,139,279.70
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	127.00	1,084,580.00

	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	82.00	151,700.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	553.60	3,064,729.60	
	NOVARTIS	152,401	100.20	15,270,580.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	303.80	672,917.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,075	283.20	15,314,040.00	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	37.76	1,150,094.08	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	92.85	230,917.95	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	50.52	772,400.28	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,212.00	2,211,900.00	
	UBS GROUP AG	249,657	26.21	6,543,509.97	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	161.50	688,636.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	132.40	391,242.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	674.80	1,429,901.20	
	SWISS RE LTD	24,330	109.95	2,675,083.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	483.10	5,526,664.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	59.45	306,167.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	78.56	943,191.36	
	SWISSCOM	1,856	532.00	987,392.00	
	BKW AG	1,744	159.20	277,644.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	90.85	515,937.15	
	スイスフラン 小計	1,161,275		114,066,703.62 (19,375,370,276)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	311.20	6,924,822.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	415.60	2,237,174.80	
	SCA SV CELLULOSA B	34,763	139.90	4,863,343.70	
	ALFA LAVAL AB	25,134	458.80	11,531,479.20	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	313.00	23,780,801.00	
	ATLAS COPCO A	207,097	183.70	38,043,718.90	
	ATLAS COPCO B	114,624	161.55	18,517,507.20	
	BEIJER REF AB	26,868	170.10	4,570,246.80	
	EPIROC AB-A	53,479	195.00	10,428,405.00	
	EPIROC AB-B	28,804	178.00	5,127,112.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	70.80	2,740,809.60	
	INDUTRADE AB	22,644	308.40	6,983,409.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	300.40	4,206,200.80	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	313.80	5,638,986.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	49.25	6,050,264.00	
	SAAB AB-B	25,552	243.25	6,215,524.00	
	SANDVIK AB	87,594	213.20	18,675,040.80	
	SKANSKA B	25,507	201.60	5,142,211.20	
	SKF AB-B	21,050	191.75	4,036,337.50	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	389.00	6,478,017.00	

	VOLVO AB-A SHS	13,514	268.40	3,627,157.60	
	VOLVO B	124,872	264.10	32,978,695.20	
	SECURITAS B	28,375	114.70	3,254,612.50	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	28.81	1,435,861.59	
	EVOLUTION AB	13,186	1,041.50	13,733,219.00	
	HENNES & MAURITZ B	40,961	162.55	6,658,210.55	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	298.60	14,772,936.40	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	205.50	3,657,078.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	311.80	4,469,653.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	155.75	17,789,453.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	104.25	12,586,728.00	
	SWEDBANK AB-A	71,421	213.50	15,248,383.50	
	EQT AB	31,471	336.70	10,596,285.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	358.60	4,237,934.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	356.80	3,984,742.40	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	297.35	38,220,774.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	544.00	3,960,320.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	74.12	15,912,748.68	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	104.35	17,958,530.65	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	111.30	5,204,610.60	
	TELIA CO AB	123,760	31.20	3,861,312.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	80.94	4,589,298.00	
	SAGAX AB-B	17,402	274.00	4,768,148.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,467,327		435,698,105.47 (6,195,627,059)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	29,320	263.00	7,711,160.00	
	EQUINOR ASA	66,436	293.30	19,485,678.80	
	NORSK HYDRO	100,517	59.28	5,958,647.76	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	303.90	3,798,142.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,304	1,096.00	5,813,184.00	
	MOWI ASA	31,968	191.90	6,134,659.20	
	ORKLA	39,191	91.65	3,591,855.15	
	SALMAR ASA	5,423	638.50	3,462,585.50	
	DNB BANK ASA	71,795	223.00	16,010,285.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	184.40	3,425,045.60	
	TELENOR ASA	51,193	129.10	6,609,016.30	
	ノルウェークローネ 小計	432,219		82,000,259.51 (1,138,983,604)	
デンマークク ローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	442.40	13,321,548.80	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,806.00	2,118,530.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	83,415	160.75	13,408,961.25	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	10,670.00	2,336,730.00	

	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	10,860.00	3,323,160.00
	DSV A/S	12,386	1,264.00	15,655,904.00
	PANDORA A/S	6,512	1,093.50	7,120,872.00
	CARLSBERG AS-B	6,810	765.00	5,209,650.00
	COLOPLAST-B	9,737	934.40	9,098,252.80
	DEMANT A/S	8,512	274.60	2,337,395.20
	GENMAB A/S	4,878	1,862.00	9,082,836.00
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	914.90	231,496,232.10
	DANSKE BANK A/S	53,617	206.30	11,061,187.10
	TRYG A/S	29,772	151.80	4,519,389.60
	ORSTED A/S	12,910	380.20	4,908,382.00
	デンマーククローネ 小計	512,970		334,999,030.85 (7,286,228,920)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	30.54	630,009.66
	SANTOS	224,634	7.81	1,754,391.54
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	26.28	3,709,027.80
	BHP GROUP LTD	388,318	39.73	15,427,874.14
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.89	691,575.30
	FORTESCUE LTD	137,312	17.01	2,335,677.12
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	30,758	50.71	1,559,738.18
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	44.20	636,877.80
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	14.44	1,280,568.08
	ORICA LTD	38,288	18.42	705,264.96
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	2.88	603,316.80
	RIO TINTO LTD	28,272	109.82	3,104,831.04
	SOUTH32 LTD	346,773	2.96	1,026,448.08
	REECE LTD	16,814	26.04	437,836.56
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	38.48	486,002.40
	BRAMBLES LTD	108,007	15.71	1,696,789.97
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	28.63	1,270,484.88
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.43	410,197.13
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.04	513,400.00
	TRANSURBAN GROUP	224,973	13.43	3,021,387.39
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	54.41	2,514,286.10
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.94	899,144.22
	CAR GROUP LTD	29,334	36.45	1,069,224.30
	REA GROUP LTD	3,586	215.84	774,002.24
	SEEK LTD	28,001	21.83	611,261.83
	WESFARMERS LTD	82,500	74.18	6,119,850.00
	COLES GROUP LTD	108,486	18.43	1,999,396.98
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.45	598,960.45
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	34.89	3,212,357.19

	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.23	782,230.80	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	307.48	1,470,676.84	
	PRO MEDICUS LTD	3,708	150.01	556,237.08	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	47.45	574,477.15	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	27.85	1,164,937.65	
	CSL LIMITED	37,640	307.80	11,585,592.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	29.74	7,090,700.02	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	139.25	18,173,935.25	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	36.91	8,888,407.83	
	WESTPAC BANKING	276,117	30.40	8,393,956.80	
	ASX LTD	14,549	63.87	929,244.63	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	209.70	5,922,137.70	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	34.53	476,928.36	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	7.43	1,238,298.66	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.94	914,801.02	
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	16.27	2,079,615.13	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	17.41	1,651,582.24	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	92.07	1,270,658.07	
	XERO LTD	11,340	141.62	1,605,970.80	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.96	1,221,529.32	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	9.90	1,539,796.50	
	オーストラリアドル 小計	5,214,124		136,631,895.99 (13,456,875,436)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.58	625,054.38	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	32.90	1,315,342.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	4.38	583,016.44	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.80	439,368.40	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	6.61	730,695.84	
	ニュージーランドドル 小計	430,555		3,693,477.06 (330,935,544)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,996	41.15	7,242,235.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	103.40	11,063,800.00	
	MTR CORP	125,000	27.45	3,431,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	16.84	2,020,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	31.70	5,515,800.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	14.78	2,926,440.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.56	3,660,153.56	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	23.25	6,544,875.00	
	HANG SENG BANK	59,400	91.90	5,458,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	232.60	22,399,380.00	
	AIA GROUP LTD	864,200	51.95	44,895,190.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	56.55	2,120,625.00	

	CLP HOLDINGS	136,500	68.95	9,411,675.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.43	5,816,944.51	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	53.50	5,992,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	31.35	3,824,574.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	22.45	2,811,368.60	
	SINO LAND CO	315,400	8.50	2,680,900.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	71.95	7,554,750.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	64.85	2,885,825.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	14.28	1,373,736.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	21.00	1,764,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	22.40	2,755,200.00	
	香港ドル 小計	5,065,678		164,150,382.67 (3,087,668,698)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.00	676,800.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.58	675,092.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.04	654,325.28	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.81	238,632.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.11	555,446.00	
	DBS GROUP	155,760	35.62	5,548,171.20	
	OCBC BANK	257,100	14.28	3,671,388.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	30.67	2,882,980.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	10.36	683,760.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	2.95	1,835,321.85	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	4.72	396,952.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.57	668,457.00	
	シンガポールドル 小計	2,379,135		18,487,325.33 (2,069,656,070)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	15.92	946,077.84	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	739.40	1,586,752.40	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	36.17	3,555,872.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	34.40	3,870,412.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.81	1,971,095.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	137.90	1,724,163.70	
	NICE LTD	4,991	678.50	3,386,393.50	
	AZRIELI GROUP	1,537	245.00	376,565.00	
	イスラエルシェケル 小計	390,926		17,417,332.94 (690,269,805)	
	合 計	84,710,891		714,947,136,014 (714,947,136,014)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	

新株予約権証券	カナダドル 小計		1,490.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	659,656.80	
	オーストラリアドル 小計		83,290	659,656.80 (64,969,598)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,121,650.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,121,650.00 (58,718,236)	
投資信託受益証券合計			398,290	123,687,834 (123,687,834)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,445,596.86	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	962,997.44	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	7,971,461.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	759,634.62	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,521,834.92	
		BXP INC	11,259	802,541.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	925,308.09	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,693,982.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,348	3,469,979.76	
		EQUINIX INC	7,333	6,089,176.54	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	998,276.50	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,853,107.15	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,485,559.05	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,655,726.39	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	901,311.95	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,188,400.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	955,489.59	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,603,635.04	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,557,462.64	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,068,103.10	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,403,616.75	
		PROLOGIS INC	71,288	8,889,613.60	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,827,528.76	
		REALTY INCOME CORP	64,068	3,899,178.48	
REGENCY CENTERS CORP	12,511	882,150.61			
SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	1,950,163.23			
SIMON PROPERTY GROUP	25,979	4,153,782.31			
SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,438,677.90			
UDR INC	23,815	998,801.10			

	VENTAS INC	31,565	1,843,711.65	
	VICI PROPERTIES INC	83,762	2,687,922.58	
	WELLTOWER INC	43,994	5,083,066.76	
	WP CAREY INC	16,024	937,243.76	
	アメリカドル 小計	926,874	81,905,043.05 (11,994,993,554)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	244,252.26	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	275,567.10	
	カナダドル 小計	20,377	519,819.36 (55,828,599)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	243,336.48	
	GECINA SA	3,139	299,931.45	
	KLEPIERRE	17,225	458,874.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	718,467.60	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	316,134.72	
	ユーロ 小計	48,695	2,036,744.25 (330,583,959)	
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	357,716.59	
	SEGRE PLC	103,047	923,301.12	
	イギリスポンド 小計	159,336	1,281,017.71 (243,611,137)	
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	705,675.00	
	GOODMAN GROUP	135,303	4,585,418.67	
	GPT GROUP	167,884	799,127.84	
	MIRVAC GROUP	266,683	530,699.17	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,300,175.03	
	STOCKLAND	207,412	966,539.92	
	VICINITY CENTERS	305,149	665,224.82	
	オーストラリアドル 小計	1,557,804	9,552,860.45 (940,861,225)	
香港ドル	LINK REIT	166,900	5,816,465.00	
	香港ドル 小計	166,900	5,816,465.00 (109,407,706)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	784,220.88	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	721,066.77	
	シンガポールドル 小計	622,667	1,505,287.65 (168,516,952)	
	投資証券合計	3,502,653	13,843,803,132 (13,843,803,132)	
	合計		13,967,490,966 (13,967,490,966)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 581銘柄	97.8%				74.8%
	投資証券 33銘柄				2.2%	1.6%
カナダドル	株式 85銘柄	99.8%				3.2%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 2銘柄				0.2%	0.0%
ユーロ	株式 217銘柄	99.5%				8.7%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポ ンド	株式 77銘柄	99.2%				4.0%
	投資証券 2銘柄				0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%				2.7%
スウェーデン クローナ	株式 43銘柄	100.0%				0.8%
ノルウェー クローネ	株式 11銘柄	100.0%				0.2%
デンマーク クローネ	株式 15銘柄	100.0%				1.0%
オーストラ リアドル	株式 50銘柄	93.0%				1.8%
	投資信託受 益証券 1銘柄			0.4%		0.0%
	投資証券 7銘柄				6.5%	0.1%
ニュージー ランドドル	株式 5銘柄	100.0%				0.0%
香港ドル	株式 23銘柄	94.8%				0.4%
	投資信託受 益証券 1銘柄			1.8%		0.0%
	投資証券 1銘柄				3.4%	0.0%
シンガポ ールドル	株式 12銘柄	92.5%				0.3%
	投資証券 2銘柄				7.5%	0.0%
イスラエル シェケル	株式 8銘柄	100.0%				0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	863,664,024
コール・ローン	3,973,697,237
国債証券	348,260,630,623
派生商品評価勘定	12,588,975
未収入金	1,285,665
未収利息	2,235,370,674
前払金	3,456,517
前払費用	257,293,877
差入委託証拠金	260,232,952
流動資産合計	355,868,220,544
資産合計	355,868,220,544
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,185,320
未払解約金	596,870,674
流動負債合計	613,055,994
負債合計	613,055,994
純資産の部	
元本等	
元本	99,892,817,357
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	255,362,347,193
元本等合計	355,255,164,550
純資産合計	355,255,164,550
負債純資産合計	355,868,220,544

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

2024年 8月20日現在	
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,892,817,357口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.5564円 (1万口当たり純資産額) (35,564円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	86,820,791,837円
期中追加設定元本額	19,977,235,298円
期中一部解約元本額	6,905,209,778円
期末元本額	99,892,817,357円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,073,295,058円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	452,927,435円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,365,390,990円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,965,144円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,726,765,661円
世界経済インデックスファンド	24,736,565,452円
DCマイセクション25	1,820,144,955円
DCマイセクション50	1,716,023,946円
DCマイセクション75	1,351,520,391円
DC外国債券インデックス・オープン	2,231,932,155円
DCマイセクションS25	1,141,332,278円
DCマイセクションS50	1,024,613,957円
DCマイセクションS75	656,524,705円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,117,531円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,560,292円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	57,040,290円
DC世界経済インデックスファンド	15,843,811,884円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	798,874,247円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,029,773円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	896,753円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	7,662,795円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	22,050,134円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	39,664,392円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	51,485,093円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,419,910円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	638,340,034円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	345,558,193円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,450,613,475円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,331,755円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	24,823,033円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	317,659,341円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	119,661,121円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	161,461,776円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	620,655,002円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,465,821,229円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	591,994,936円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,872,582円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	814,506,880円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,542,664,307円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,066,743円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,932,367円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,294,643,888円
SMT インデックスバランス・オープン	164,016,844円
SMT 世界経済インデックス・オープン	451,456,107円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	677,963,891円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,012,931,671円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,733,050円
グローバル経済コア	1,191,482,278円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	24,262,725円

区分	2024年 8月20日現在
DCターゲット・イヤー ファンド 2055	2,850,539円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	73,886,578円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	102,669,403円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	51,881,343円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	71,858,670円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	906,524,404円
10資産分散投資ファンド	35,442,406円
グローバル10資産バランスファンド	31,733,288円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	24,154円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,194円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,322円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,322円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	31,494円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	21,345円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	21,210円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	16,457円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	13,834,620,858円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	246,092,573円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	288,286,602円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	138,386,383円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		10,217,157,969
合計		10,217,157,969

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引					
	買建	2,670,205,745	-	2,666,749,228	3,456,517	
合計		2,670,205,745	-	2,666,749,228	3,456,517	

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	3,129,878,778	-	3,129,738,950	139,828	
	アメリカドル	1,529,085,925	-	1,520,523,912	8,562,013	

	カナダドル	118,659,034	-	118,870,233	211,199
	ユーロ	956,908,361	-	963,303,215	6,394,854
	イギリスポンド	176,447,788	-	178,163,088	1,715,300
	オフショア人民元	348,777,670	-	348,878,502	100,832
	合計	3,129,878,778	-	3,129,738,950	139,828

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 07/31/25	7,640,000.00	7,341,047.18	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	5,028,529.59	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,864,941.41	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,428,015.61	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,567,812.48	
		T 0.375% 07/31/27	16,100,000.00	14,545,343.75	
		T 0.375% 09/30/27	2,440,000.00	2,193,235.94	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,852,871.09	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,794,062.48	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,254,257.79	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,686,425.00	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,190,058.58	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,326,939.07	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,216,207.78	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,750,000.00	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,891,650.40	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,629,781.25	
		T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	10,110,234.34	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,947,674.84	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,253,955.07	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,633,250.04	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,659,628.88	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,681,484.36	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,975,644.55			
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,770,234.36			

T 0.75% 08/31/26	9,630,000.00	9,017,592.18	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,543,281.28	
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,718,126.96	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,372,097.71	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,469,195.31	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,290,312.48	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,120,116.79	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,377,054.66	
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,832,169.16	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,747,440.61	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,293,750.00	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,963,504.86	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,460,117.18	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	8,175,761.73	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,795,023.43	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,581,357.41	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,587,929.67	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,701,921.50	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,138,339.85	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,190,962.50	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,652,213.24	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,032,304.68	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,842,515.58	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,661,562.50	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,743,388.65	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,747,402.30	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,824,707.05	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,390,437.47	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,317,744.11	
T 1.625% 05/15/31	10,980,000.00	9,574,903.12	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,103,212.90	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,661,312.50	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,055,501.97	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,536,145.33	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,502,187.50	
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,978,678.08	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,716,640.64	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,244,928.06	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,742,775.36	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,137,632.79	
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,180,458.96	
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,801,002.30	

T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,978,548.03
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	2,058,632.79
T 1% 07/31/28	13,000,000.00	11,668,515.56
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,478,007.80
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,329,192.36
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,940,964.83
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,276,025.40
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,961,961.33
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,187,326.19
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,166,257.80
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,799,082.04
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,288,109.36
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,278,556.62
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,248,857.41
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,608,679.71
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,524,691.41
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,226,738.04
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,647,169.74
T 2.375% 05/15/51	7,450,000.00	5,257,051.74
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,908,197.28
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,133,953.50
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,840,179.68
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,856,353.48
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,086,027.35
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,583,925.37
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,370,989.46
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,320,031.25
T 2.625% 07/31/29	15,200,000.00	14,414,765.56
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,691,778.12
T 2.75% 02/15/28	8,550,000.00	8,247,410.19
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,290,332.00
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,444,724.58
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,950,640.62
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,799,119.11
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,144,128.88
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,779,793.23
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,893,483.96
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,363,154.30
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,171,738.27
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,728,137.90
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,465,001.99
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	4,158,359.37
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,784,674.96

T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	8,478,421.84	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,378,210.45	
T 2.875% 08/15/28	13,220,000.00	12,761,173.06	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,857,339.83	
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	751,045.31	
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,836,171.92	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,788,520.49	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,367,644.56	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,062,330.05	
T 2% 11/15/26	6,320,000.00	6,052,634.35	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,527,937.50	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	914,422.85	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,261,320.32	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,954,329.66	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	10,067,188.55	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,559,759.37	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	6,020,273.43	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,937,874.01	
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	10,134,501.01	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,654,836.89	
T 3.25% 06/30/29	6,500,000.00	6,346,386.73	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	13,143,366.47	
T 3.375% 05/15/44	3,910,000.00	3,450,727.72	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	2,057,421.87	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,573,734.37	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,944,687.52	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,916,718.73	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	732,432.42	
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,449,619.14	
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,870,912.68	
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,483,136.74	
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,703,370.15	
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	2,097,492.17	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,322,531.25	
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,526,114.43	
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,994,609.36	
T 3.75% 11/15/43	4,730,000.00	4,421,995.69	
T 3.75% 12/31/30	6,160,000.00	6,144,720.30	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,464,453.12	
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,391,601.55	
T 3.875% 08/15/33	11,070,000.00	11,075,621.45	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,422,614.25	

T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,555,141.78
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,166,362.72
T 3% 02/15/47	5,920,000.00	4,825,262.47
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	810,273.44
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	806,171.88
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,085,131.83
T 3% 05/15/45	700,000.00	578,101.56
T 3% 05/15/47	1,710,000.00	1,391,779.68
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,624,755.86
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,192,804.66
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,134,867.19
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,919,335.95
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,322,687.50
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,893,996.08
T 4.125% 03/31/29	3,350,000.00	3,399,399.40
T 4.125% 07/31/31	3,500,000.00	3,571,367.17
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	4,291,349.60
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,364,773.47
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,124,582.03
T 4.125% 11/15/32	8,000,000.00	8,165,156.24
T 4.25% 02/15/54	10,050,000.00	10,252,570.31
T 4.25% 02/28/31	9,000,000.00	9,236,601.54
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	927,281.25
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,887,332.01
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	758,167.57
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,049,648.44
T 4.375% 05/15/34	3,310,000.00	3,444,727.32
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,980,490.23
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	674,235.35
T 4.375% 07/15/27	800,000.00	810,843.75
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,035,859.36
T 4.375% 08/15/43	1,500,000.00	1,530,498.04
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,447,647.51
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	1,001,231.25
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,644,052.74
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,161,403.51
T 4.5% 04/15/27	5,730,000.00	5,813,264.06
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	583,988.28
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,075,585.90
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,796,886.72
T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,721,369.37
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,479,457.02
T 4.625% 04/30/31	2,900,000.00	3,041,771.48

T 4.625% 05/15/54	900,000.00	976,921.87	
T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,145,861.52	
T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,638,256.29	
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	814,350.58	
T 4.75% 11/15/53	3,880,000.00	4,293,992.96	
T 4.875% 05/31/26	3,400,000.00	3,442,500.00	
T 4.875% 10/31/30	2,500,000.00	2,648,876.95	
T 4% 01/15/27	7,200,000.00	7,205,906.23	
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,480,703.12	
T 4% 02/15/34	7,000,000.00	7,071,640.66	
T 4% 02/28/30	1,350,000.00	1,364,686.52	
T 4% 07/31/30	3,980,000.00	4,024,541.81	
T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,616,267.59	
T 4% 11/15/52	7,400,000.00	7,215,289.04	
T 5.0% 05/15/37	400,000.00	445,156.24	
T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,375,664.05	
T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,135,707.04	
T 5% 08/31/25	6,750,000.00	6,783,238.08	
T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,748,808.59	
T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,551,613.27	
T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,183,136.72	
アメリカドル 小計	1,222,190,000.00	1,120,409,800.98	(164,084,015,353)
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	1,340,000.00	1,276,693.93	
CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,912,760.89	
CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,993,834.77	
CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,793,902.89	
CAN 1.25% 06/01/30	3,950,000.00	3,590,125.01	
CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	881,511.99	
CAN 1.5% 06/01/31	4,110,000.00	3,734,992.82	
CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,266,130.30	
CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	2,144,157.75	
CAN 1% 06/01/27	810,000.00	766,538.86	
CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,463,459.42	
CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	233,205.76	
CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,212,722.06	
CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,173,890.38	
CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,584,818.89	
CAN 2.75% 12/01/48	980,000.00	914,571.91	
CAN 2.75% 12/01/55	1,840,000.00	1,698,172.32	
CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	574,845.22	
CAN 2% 06/01/28	410,000.00	395,865.29	

	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,413,259.47
	CAN 2% 12/01/51	3,750,000.00	2,960,647.94
	CAN 3.25% 09/01/28	1,890,000.00	1,907,165.30
	CAN 3.25% 12/01/33	2,370,000.00	2,407,292.35
	CAN 3.25% 12/01/34	440,000.00	446,203.10
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,178,158.03
	CAN 3.5% 08/01/25	920,000.00	917,712.64
	CAN 3.5% 09/01/29	990,000.00	1,013,744.96
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	1,011,786.50
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,330,477.63
	CAN 3% 06/01/34	2,280,000.00	2,266,767.71
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,266,405.53
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	821,354.03
	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	303,940.68
	CAN 4.5% 11/01/25	1,330,000.00	1,343,127.32
	CAN 4% 03/01/29	2,180,000.00	2,272,529.00
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,270,183.48
	CAN 4% 08/01/26	1,120,000.00	1,134,089.83
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,677,039.98
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,952,024.55
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	586,727.30
	カナダドル 小計	68,020,000.00	65,092,837.79 (6,990,970,778)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,919,898.39
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	30,183,384.14
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,920,173.87
	MBONO 7.5% 05/26/33	30,430,000.00	26,957,632.70
	MBONO 7.5% 06/03/27	33,800,000.00	32,096,584.10
	MBONO 7.75% 05/29/31	38,870,000.00	35,713,303.16
	MBONO 7.75% 11/13/42	32,960,000.00	27,634,734.20
	MBONO 7.75% 11/23/34	15,310,000.00	13,663,741.86
	MBONO 7% 09/03/26	13,190,000.00	12,474,838.20
	MBONO 8.5% 03/01/29	14,540,000.00	14,010,307.80
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,230,000.00	31,093,461.58
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,651,398.29
	MBONO 8% 07/31/53	24,870,000.00	20,947,516.77
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,910,818.19
		メキシコペソ 小計	370,890,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,233,961.18
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	1,020,173.15
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	434,841.00
	BGB 0.65% 06/22/71	530,000.00	231,759.46

BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,441,532.56
BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,504,892.00
BGB 0.9% 06/22/29	1,670,000.00	1,550,279.78
BGB 0% 10/22/27	900,000.00	833,136.74
BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,211,813.14
BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,166,564.82
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	675,841.68
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	668,268.80
BGB 1.6% 06/22/47	950,000.00	696,539.07
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	794,235.20
BGB 1.9% 06/22/38	780,000.00	678,312.69
BGB 1% 06/22/26	1,560,000.00	1,516,663.20
BGB 1% 06/22/31	1,770,000.00	1,594,373.96
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	664,792.48
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	523,474.17
BGB 2.7% 10/22/29	480,000.00	483,784.80
BGB 2.75% 04/22/39	730,000.00	700,857.30
BGB 2.85% 10/22/34	1,110,000.00	1,110,410.35
BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	1,001,685.90
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	453,118.16
BGB 3.5% 06/22/55	630,000.00	639,099.40
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	997,829.17
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,479,581.45
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,048,356.14
BGB 4.25% 03/28/41	1,680,000.00	1,911,734.83
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,172,981.56
BGB 4% 03/28/32	880,000.00	959,805.44
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,249,819.91
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,153,759.72
BKO 2.5% 03/19/26	1,010,000.00	1,008,782.95
BKO 2.9% 06/18/26	730,000.00	735,074.01
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,364,352.00
BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,829,539.53
BTPS 0.25% 03/15/28	2,030,000.00	1,849,338.12
BTPS 0.45% 02/15/29	1,640,000.00	1,466,580.66
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,844,612.10
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,185,445.36
BTPS 0.6% 08/01/31	1,960,000.00	1,638,058.74
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,234,583.00
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,516,718.80
BTPS 0.95% 03/01/37	1,320,000.00	954,218.76
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,943,279.21
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,962,734.50

BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,407,990.40	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,817,833.70	
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,139,229.79	
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	3,057,736.28	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,247,889.86	
BTPS 1.2% 08/15/25	1,050,000.00	1,031,156.70	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,613,086.40	
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,046,116.25	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,300,000.00	1,027,994.16	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	815,875.00	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,056,784.05	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,430,000.00	2,164,082.67	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,314,455.95	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,520,000.00	950,958.35	
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	710,753.37	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,280,000.00	1,252,113.52	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,420,318.08	
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	430,945.02	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	695,433.57	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,242,653.03	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,418,665.87	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,510,000.00	1,393,224.15	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	1,024,863.21	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,651,723.24	
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,359,677.47	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,748,905.06	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	893,716.50	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	625,583.03	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,581,890.66	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,412,497.65	
BTPS 2.95% 02/15/27	330,000.00	330,606.04	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,380,000.00	1,246,174.50	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,196,073.00	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,183,140.69	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,283,474.81	
BTPS 3.2% 01/28/26	2,000,000.00	2,005,762.40	
BTPS 3.25% 03/01/38	2,080,000.00	1,949,606.14	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,010,232.55	
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	1,844,042.76	
BTPS 3.35% 07/01/29	1,600,000.00	1,620,417.12	
BTPS 3.4% 04/01/28	2,000,000.00	2,033,411.20	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,653,073.24	

BTPS 3.5% 01/15/26	1,840,000.00	1,853,055.72
BTPS 3.5% 02/15/31	2,440,000.00	2,473,550.00
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,409,253.20
BTPS 3.7% 06/15/30	1,730,000.00	1,776,289.95
BTPS 3.8% 04/15/26	1,870,000.00	1,896,415.62
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,814,762.75
BTPS 3.85% 07/01/34	1,300,000.00	1,327,484.47
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,410,979.50
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	876,731.04
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,962,097.13
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,148,126.65
BTPS 4.1% 02/01/29	440,000.00	459,684.14
BTPS 4.15% 10/01/39	460,000.00	470,390.25
BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	2,019,642.42
BTPS 4.35% 11/01/33	2,090,000.00	2,226,450.66
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,135,334.73
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,636,412.23
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,128,743.13
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,586,505.96
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,808,340.30
BTPS 4.75% 09/01/44	1,700,000.00	1,860,297.25
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,160,347.03
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	910,184.00
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,307,852.00
BTPS 4% 11/15/30	2,310,000.00	2,409,214.50
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	3,001,638.86
BTPS 5.25% 11/01/29	3,350,000.00	3,704,118.45
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,661,239.25
BTPS 5% 08/01/34	2,830,000.00	3,165,675.35
BTPS 5% 09/01/40	2,740,000.00	3,067,050.51
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	3,000,061.80
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,329,726.21
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,530,655.00
DBR 0.25% 02/15/27	2,490,000.00	2,369,082.48
DBR 0.25% 02/15/29	1,970,000.00	1,813,148.60
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,940,816.84
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,911,353.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,284,271.12
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	332,882.37
DBR 0% 02/15/30	970,000.00	864,473.70
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,449,167.54
DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,646,214.24
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,865,116.99

DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,850,446.21	
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,787,446.60	
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,656,000.05	
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,073,507.91	
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,306,677.93	
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,445,831.83	
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,448,110.76	
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,540,640.14	
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,254,018.25	
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,819,105.26	
DBR 1.25% 08/15/48	3,340,000.00	2,607,908.74	
DBR 1.7% 08/15/32	2,600,000.00	2,514,425.81	
DBR 1.8% 08/15/53	3,700,000.00	3,192,804.92	
DBR 1% 05/15/38	2,180,000.00	1,818,684.07	
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,388,471.30	
DBR 2.1% 11/15/29	3,430,000.00	3,416,448.07	
DBR 2.2% 02/15/34	2,900,000.00	2,892,992.85	
DBR 2.3% 02/15/33	4,320,000.00	4,358,291.18	
DBR 2.4% 11/15/30	1,590,000.00	1,610,012.53	
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,929,769.26	
DBR 2.5% 08/15/46	3,010,000.00	3,012,746.62	
DBR 2.5% 08/15/54	1,460,000.00	1,468,369.73	
DBR 2.6% 08/15/33	2,440,000.00	2,519,188.24	
DBR 2.6% 08/15/34	800,000.00	824,505.76	
DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,249,499.84	
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	3,011,750.10	
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,210,826.67	
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,564,520.10	
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	3,050,007.50	
DBR 4.75% 07/04/40	2,060,000.00	2,671,409.43	
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,705,416.67	
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,116,883.47	
DBR 6.25% 01/04/30	1,570,000.00	1,890,705.62	
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,000,762.25	
FRTR 0.25% 11/25/26	3,700,000.00	3,508,706.30	
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,334,274.00	
FRTR 0.5% 05/25/29	4,260,000.00	3,854,298.90	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,792,090.10	
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	492,249.48	
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,213,197.02	
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,877,384.20	
FRTR 0.75% 05/25/28	6,860,000.00	6,406,226.43	

FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,563,071.58
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,578,277.56
FRTR 0.75% 11/25/28	4,550,000.00	4,208,363.25
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,858,845.69
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,747,127.46
FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	3,054,778.64
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,199,371.98
FRTR 0% 11/25/30	6,120,000.00	5,181,740.49
FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	4,016,413.71
FRTR 1.25% 05/25/34	5,510,000.00	4,733,353.09
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,661,938.37
FRTR 1.25% 05/25/38	2,300,000.00	1,809,723.95
FRTR 1.5% 05/25/31	5,280,000.00	4,889,515.27
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,070,218.00
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,088,564.40
FRTR 1.75% 06/25/39	3,570,000.00	2,974,820.31
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,757,370.32
FRTR 1% 11/25/25	4,200,000.00	4,106,831.40
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,517,838.56
FRTR 2.5% 05/25/43	1,710,000.00	1,512,170.70
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,129,641.14
FRTR 2.5% 09/24/27	1,100,000.00	1,095,760.60
FRTR 2.75% 02/25/29	4,370,000.00	4,385,544.09
FRTR 2.75% 02/25/30	1,070,000.00	1,072,087.24
FRTR 2.75% 10/25/27	5,460,000.00	5,480,488.64
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,223,988.91
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,725,728.85
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,822,438.19
FRTR 3.25% 05/25/55	490,000.00	467,360.39
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,791,880.22
FRTR 3.5% 11/25/33	4,100,000.00	4,295,458.88
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,254,773.35
FRTR 3% 05/25/54	2,340,000.00	2,136,718.34
FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	722,574.18
FRTR 4.5% 04/25/41	3,490,000.00	4,046,005.86
FRTR 4.75% 04/25/35	3,460,000.00	4,012,369.97
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,787,844.81
FRTR 4% 04/25/60	1,880,000.00	2,087,646.94
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,341,031.60
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,644,978.00
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,289,552.88
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,967,806.63
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	630,423.10

IRISH 0.2% 10/18/30	910,000.00	795,256.30
IRISH 0.35% 10/18/32	450,000.00	378,129.60
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	543,582.00
IRISH 0.55% 04/22/41	410,000.00	284,298.61
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	729,036.00
IRISH 0% 10/18/31	1,120,000.00	938,666.82
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	922,899.56
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	388,450.79
IRISH 1.35% 03/18/31	370,000.00	345,341.30
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	593,183.60
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	652,961.94
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	973,077.75
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	927,775.44
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	198,956.74
IRISH 2% 02/18/45	1,010,000.00	865,562.42
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	373,797.56
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	858,177.27
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,066,215.99
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,686,822.81
NETHER 0.5% 07/15/32	1,300,000.00	1,120,334.14
NETHER 0.75% 07/15/27	1,060,000.00	1,012,324.91
NETHER 0.75% 07/15/28	960,000.00	902,919.64
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,147,655.63
NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,633,861.30
NETHER 0% 01/15/29	1,770,000.00	1,596,611.87
NETHER 0% 01/15/38	1,390,000.00	973,174.44
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	861,935.95
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,174,915.12
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,162,605.29
NETHER 2.5% 01/15/30	1,210,000.00	1,216,291.02
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,553,353.42
NETHER 2.5% 07/15/33	1,170,000.00	1,169,916.75
NETHER 2.5% 07/15/34	930,000.00	926,160.12
NETHER 2.75% 01/15/47	1,900,000.00	1,918,132.07
NETHER 2% 01/15/54	1,160,000.00	999,974.23
NETHER 3.25% 01/15/44	750,000.00	808,215.89
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,939,179.29
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,893,520.50
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,683,516.37
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,949,548.55
OBL 0% 04/16/27	1,830,000.00	1,723,798.23
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,549,630.05

OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,880,928.00
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,452,525.87
OBL 2.1% 04/12/29	2,780,000.00	2,768,841.76
OBL 2.2% 04/13/28	3,450,000.00	3,447,623.80
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,302,584.37
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	525,531.24
RAGB 0.5% 02/20/29	1,800,000.00	1,647,572.84
RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,413,809.96
RAGB 0.7% 04/20/71	420,000.00	197,161.39
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	828,894.88
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	462,017.01
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,424,839.16
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	109,047.60
RAGB 0.9% 02/20/32	1,120,000.00	987,519.12
RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,289,839.24
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,409,836.54
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	794,085.21
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	359,009.56
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,168,555.01
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	810,125.82
RAGB 1.5% 11/02/86	400,000.00	251,150.00
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	524,389.80
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	513,600.75
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	902,152.31
RAGB 2.9% 02/20/33	1,510,000.00	1,529,991.64
RAGB 2.9% 02/20/34	720,000.00	727,709.16
RAGB 2.9% 05/23/29	350,000.00	356,237.70
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	842,733.61
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	446,221.16
RAGB 3.2% 07/15/39	330,000.00	337,684.05
RAGB 3.45% 10/20/30	230,000.00	241,111.87
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	490,607.25
RAGB 4.15% 03/15/37	1,550,000.00	1,748,167.34
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,207,611.05
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,302,192.18
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	320,858.12
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	220,277.90
RFGB 0.125% 09/15/31	710,000.00	597,035.08
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	195,660.11
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	550,745.13
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	315,202.23
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	509,143.18
RFGB 0.5% 09/15/28	780,000.00	720,385.95

RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	478,613.85	
RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	452,948.34	
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	431,088.90	
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	436,449.15	
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	616,548.44	
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	552,784.31	
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	339,922.36	
RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	420,104.74	
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	521,812.91	
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	446,029.53	
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	390,162.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	680,000.00	686,891.66	
RFGB 2.875% 04/15/29	320,000.00	324,492.80	
RFGB 2.95% 04/15/55	350,000.00	345,237.25	
RFGB 3% 09/15/33	480,000.00	490,325.37	
RFGB 3% 09/15/34	430,000.00	437,723.87	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,846,188.30	
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,842,875.51	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,189,303.33	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,774,191.85	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,500,000.00	2,134,806.25	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,315,889.40	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,210,000.00	2,019,930.05	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,760,000.00	1,312,455.31	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,555,826.42	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,729,353.73	
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,789,239.47	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,527,494.13	
SPGB 1.25% 10/31/30	3,370,000.00	3,086,909.89	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	2,011,598.82	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,230,000.00	2,135,681.59	
SPGB 1.4% 07/30/28	2,400,000.00	2,291,796.00	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,549,931.70	
SPGB 1.45% 10/31/27	1,960,000.00	1,890,896.28	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	338,609.70	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,456,751.25	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,936,897.32	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,760,000.00	1,223,756.16	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,271,533.75	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,937,055.26	
SPGB 1% 07/30/42	1,350,000.00	909,922.95	
SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,132,175.00	

	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,556,990.98
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,190,000.00	2,087,716.05
	SPGB 2.5% 05/31/27	2,330,000.00	2,320,114.42
	SPGB 2.55% 10/31/32	2,500,000.00	2,438,730.00
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,466,801.50
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,670,000.00	1,671,665.65
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,780,000.00	1,601,675.58
	SPGB 3.15% 04/30/33	2,170,000.00	2,204,511.89
	SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,188,007.70
	SPGB 3.45% 07/30/43	1,290,000.00	1,272,044.81
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,440,000.00	1,356,642.00
	SPGB 3.45% 10/31/34	1,200,000.00	1,238,143.80
	SPGB 3.5% 05/31/29	1,540,000.00	1,596,163.02
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,370,880.15
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,660,000.00	1,755,789.47
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	1,980,303.65
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,780,000.00	2,064,194.80
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	2,037,840.52
	SPGB 4% 10/31/54	770,000.00	806,359.16
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,076,407.02
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,520,000.00	1,871,862.21
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,709,193.27
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,447,717.58
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,037,792.66
	ユーロ 小計	691,820,000.00	653,192,386.99 (106,019,656,332)
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,197,565.99
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,336,614.25
	UKT 0.25% 07/31/31	2,490,000.00	1,962,845.83
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,763,056.00
	UKT 0.375% 10/22/30	2,180,000.00	1,782,976.22
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,891,975.13
	UKT 0.5% 10/22/61	2,420,000.00	760,364.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,584,000.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	610,595.00
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	787,644.00
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,630,886.00
	UKT 0.875% 10/22/29	1,460,000.00	1,267,747.20
	UKT 1.125% 01/31/39	2,130,000.00	1,426,887.00
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	398,055.00
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,161,812.50
	UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,220,164.00
	UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,284,178.00

UKT 1.5% 07/22/26	1,990,000.00	1,899,853.00	
UKT 1.5% 07/22/47	1,540,000.00	896,588.00	
UKT 1.5% 07/31/53	1,520,000.00	798,456.00	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	984,100.40	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	720,384.00	
UKT 1.625% 10/22/71	1,670,000.00	790,745.00	
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	652,212.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,900,000.00	1,036,260.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,445,661.00	
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	3,032,547.75	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	919,024.00	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,322,427.80	
UKT 3.25% 01/22/44	2,310,000.00	1,967,196.00	
UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,781,463.40	
UKT 3.5% 01/22/45	2,000,000.00	1,755,800.00	
UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,224,804.00	
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,324,191.83	
UKT 3.75% 01/29/38	2,430,000.00	2,333,286.00	
UKT 3.75% 03/07/27	1,540,000.00	1,526,679.00	
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	1,021,660.00	
UKT 3.75% 10/22/53	3,060,000.00	2,703,204.00	
UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,341,536.40	
UKT 4.125% 07/22/29	1,210,000.00	1,222,947.00	
UKT 4.25% 03/07/36	1,730,000.00	1,763,389.00	
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,360,656.00	
UKT 4.25% 07/31/34	1,250,000.00	1,278,775.00	
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,270,635.00	
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,822,482.00	
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,442,460.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,723,272.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,510,000.00	1,464,549.00	
UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,641,520.00	
UKT 4.375% 07/31/54	1,390,000.00	1,366,648.00	
UKT 4.5% 06/07/28	3,370,000.00	3,439,039.16	
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,451,160.00	
UKT 4.5% 12/07/42	2,290,000.00	2,331,907.00	
UKT 4.625% 01/31/34	2,230,000.00	2,349,338.45	
UKT 4.75% 10/22/43	1,380,000.00	1,443,480.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,710,000.00	1,802,767.50	
UKT 4.75% 12/07/38	1,800,000.00	1,909,260.00	
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,154,375.00	
UKT 4% 10/22/31	490,000.00	494,515.35	

	UKT 4% 10/22/63	1,440,000.00	1,324,944.00
	UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,188,005.60
イギリスポンド 小計		114,860,000.00	97,791,570.76 (18,597,023,011)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,280,000.00	4,717,231.20
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,532,438.80
	SGB 0.75% 11/12/29	6,770,000.00	6,421,175.75
	SGB 1.75% 11/11/33	4,610,000.00	4,558,379.97
	SGB 1% 11/12/26	7,570,000.00	7,429,699.20
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,447,633.62
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,686,386.50
スウェーデンクローナ 小計		40,280,000.00	39,792,945.04 (565,855,678)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,171,267.00
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,670,403.66
	NGB 1.5% 02/19/26	5,320,000.00	5,152,563.89
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,453,052.97
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,812,938.50
	NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,430,247.87
	NGB 2% 04/26/28	4,150,000.00	3,971,375.70
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,894,582.98
	NGB 3.625% 04/13/34	3,310,000.00	3,376,531.00
	NGB 3% 08/15/33	5,180,000.00	5,041,623.81
ノルウェークローネ 小計		42,260,000.00	39,974,587.38 (555,247,018)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,680,000.00	3,218,292.23
	DGB 0.5% 11/15/27	4,430,000.00	4,202,235.98
	DGB 0.5% 11/15/29	5,290,000.00	4,868,813.47
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,625,432.89
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,499,722.25
	DGB 2.25% 11/15/26	1,920,000.00	1,918,865.28
	DGB 2.25% 11/15/33	3,880,000.00	3,894,309.44
	DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	11,934,434.92
デンマーククローネ 小計		43,770,000.00	42,162,106.46 (917,025,815)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	4,500,000.00	4,071,541.50
	POLGB 0% 10/25/25	1,480,000.00	1,402,892.74
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,106,936.95
	POLGB 1.75% 04/25/32	4,610,000.00	3,608,459.06
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,684,455.12
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,530,000.00	4,234,281.60
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,250,000.00	3,937,032.12
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,370,822.00

	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,045,144.40	
	POLGB 4.75% 07/25/29	1,650,000.00	1,624,308.57	
	POLGB 5.75% 04/25/29	4,170,000.00	4,279,502.11	
	POLGB 5% 10/25/34	550,000.00	538,975.25	
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,563,519.75	
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,970,000.00	4,313,071.52	
	ポーランドズロチ 小計	50,970,000.00	47,780,942.69 (1,817,558,391)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,980,000.00	1,894,048.20	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,242,776.00	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,295,914.50	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,850,000.00	2,466,931.50	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,085,328.60	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,704,540.00	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,292,721.60	
	ACGB 1% 12/21/30	1,500,000.00	1,272,480.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,600,000.00	1,527,840.00	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,200,582.80	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,094,164.40	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,680,000.00	1,502,138.40	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,493,050.50	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,607,660.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,706,575.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,110,000.00	2,079,890.30	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	847,259.60	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,627,706.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,440,000.00	1,400,400.00	
	ACGB 3.75% 05/21/34	2,340,000.00	2,309,346.00	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,084,873.50	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,713,058.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,786,266.30	
	ACGB 4.25% 06/21/34	750,000.00	770,910.00	
ACGB 4.25% 12/21/35	770,000.00	789,365.50		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,720,000.00	2,846,969.60		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,160,000.00	2,225,059.20		
ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	760,608.00		
	オーストラリアドル 小計	50,650,000.00	46,628,464.70 (4,592,437,488)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	1,340,000.00	1,177,619.61	
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	687,988.28	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	854,385.83	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	311,108.90	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	531,342.78	

	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	431,880.55
	NZGB 2% 05/15/32	900,000.00	776,812.33
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,258,805.86
	NZGB 3% 04/20/29	940,000.00	908,665.70
	NZGB 4.25% 05/15/34	750,000.00	753,363.29
	NZGB 4.5% 04/15/27	930,000.00	947,347.19
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	505,463.91
	NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	449,017.58
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	403,871.98
	ニュージーランドドル 小計	10,910,000.00	9,997,673.79 (895,791,571)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	766,774.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	842,695.05
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	521,641.88
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	601,520.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	341,630.10
	SIGB 2.125% 06/01/26	830,000.00	819,957.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	720,860.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	380,000.00	359,578.80
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	718,200.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	456,550.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	804,924.30
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	621,810.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	990,000.00	998,217.00
	SIGB 2.875% 08/01/28	140,000.00	141,014.63
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	422,100.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	840,000.00	848,484.00
	SIGB 3.25% 06/01/54	210,000.00	225,785.25
	SIGB 3.375% 05/01/34	160,000.00	168,178.97
	SIGB 3.375% 09/01/33	880,000.00	924,000.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	754,282.00
SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	151,872.00	
SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	506,237.13	
	シンガポールドル 小計	12,990,000.00	12,716,312.11 (1,423,591,140)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,545,942.04
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,516,184.20
	MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	712,871.52
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,295,355.52
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,960,193.35
	MGS 3.757% 05/22/40	2,950,000.00	2,877,684.25
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,781,792.62

	MGS 3.844% 04/15/33	1,030,000.00	1,035,079.85	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,197,253.52	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,146,022.27	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,001,319.65	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,506,738.78	
	MGS 3.906% 07/15/26	1,210,000.00	1,225,384.18	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,704,834.31	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	3,030,325.16	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,568,895.40	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,818,789.35	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,340,000.00	2,385,004.28	
	MGS 4.457% 03/31/53	1,090,000.00	1,139,143.19	
	MGS 4.498% 04/15/30	3,070,000.00	3,210,298.69	
	MGS 4.504% 04/30/29	720,000.00	750,385.50	
	MGS 4.642% 11/07/33	2,010,000.00	2,144,454.11	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,142,694.14	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,072,351.86	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	3,024,800.68	
	MGS 4.893% 06/08/38	2,130,000.00	2,352,775.20	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,882,226.30	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,151,494.57	
	マレーシアリングット 小計	51,600,000.00	53,180,294.49	(1,784,262,696)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,428,958.45	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,970,000.00	2,343,065.67	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,880,000.00	1,962,061.05	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,429,056.77	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,932,404.88	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,486,981.07	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,520,000.00	979,104.79	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,530,000.00	2,391,657.57	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,690,000.00	2,614,346.44	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,098,176.27	
	ILGOV 3.75% 09/30/27	770,000.00	757,651.51	
	ILGOV 4% 03/30/35	1,210,000.00	1,133,634.96	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	1,984,643.80	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,396,491.18	
	イスラエルシェケル 小計	31,550,000.00	27,938,234.41	(1,107,225,755)
オフショア 人民元	CGB 1.67% 06/15/26	34,680,000.00	34,701,505.06	
	CGB 1.85% 05/15/27	2,400,000.00	2,406,912.00	
	CGB 1.99% 03/15/26	19,540,000.00	19,662,853.84	
	CGB 2.04% 02/25/27	41,310,000.00	41,586,268.88	

CGB 2.05% 04/15/29	36,880,000.00	37,134,335.54
CGB 2.12% 06/25/31	14,000,000.00	14,031,500.00
CGB 2.18% 08/15/26	28,600,000.00	28,867,072.52
CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,210,264.22
CGB 2.22% 09/25/25	32,270,000.00	32,509,017.43
CGB 2.27% 05/25/34	19,000,000.00	19,131,290.00
CGB 2.28% 03/25/31	29,700,000.00	30,030,364.98
CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,487,250.57
CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,606,748.90
CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,606,010.90
CGB 2.35% 02/25/34	19,880,000.00	20,152,759.56
CGB 2.37% 01/15/29	19,460,000.00	19,847,682.12
CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,520,340.84
CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,360,598.25
CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,445,761.06
CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	18,051,812.28
CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,668,485.59
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,386,216.00
CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	27,135,159.95
CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,320,595.24
CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	60,012,852.83
CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,364,299.85
CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	27,966,969.30
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	33,141,677.48
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,456,202.45
CGB 2.62% 04/15/28	34,000,000.00	34,930,260.40
CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,551,899.84
CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,642,689.86
CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	39,254,347.86
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,707,155.24
CGB 2.67% 11/25/33	23,400,000.00	24,362,867.88
CGB 2.68% 05/21/30	30,700,000.00	31,806,848.59
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,550,811.35
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	20,229,825.65
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	15,138,843.90
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,483,197.45
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	11,188,702.17
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,608,244.92
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,991,011.45
CGB 2.8% 03/25/30	39,490,000.00	41,175,152.82
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,835,165.80
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,968,133.09
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,965,516.89

	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,519,000.80	
	CGB 2.91% 10/14/28	24,320,000.00	25,312,898.04	
	CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,138,762.84	
	CGB 3.02% 05/27/31	27,560,000.00	29,278,349.45	
	CGB 3.02% 10/22/25	49,870,000.00	50,762,433.62	
	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,229,376.96	
	CGB 3.12% 10/25/52	12,970,000.00	14,873,706.76	
	CGB 3.19% 04/15/53	17,060,000.00	19,939,101.89	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,390,980.12	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,832,429.17	
	CGB 3.29% 05/23/29	35,000,000.00	37,337,828.50	
	CGB 3.32% 04/15/52	18,600,000.00	22,051,012.37	
	CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	24,844,192.55	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	10,222,472.47	
	CGB 3.72% 04/12/51	15,140,000.00	19,043,788.44	
	CGB 3.81% 09/14/50	21,220,000.00	26,958,685.87	
	CGB 3.86% 07/22/49	18,180,000.00	23,079,410.01	
	CGB 3% 10/15/53	9,330,000.00	10,505,353.28	
	CGB 4.08% 10/22/48	19,370,000.00	25,389,033.80	
	オフショア人民元 小計	1,690,770,000.00	1,765,902,299.74 (36,259,095,330)	
	合計		348,260,630,623 (348,260,630,623)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 216銘柄	100.0%	47.1%
カナダドル	国債証券 40銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 368銘柄	100.0%	30.4%
イギリスポンド	国債証券 61銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券 22銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%

イスラエルシェケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券	66銘柄	100.0%	10.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年 8月20日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	11,746,969,650
コール・ローン	569,231,278
株式	194,129,355,448
投資信託受益証券	438,517,116
投資証券	186,046,777
派生商品評価勘定	348,705,825
未収入金	21,775,048
未収配当金	595,994,401
未収利息	3,396
差入委託証拠金	2,110,249,518
流動資産合計	210,146,848,457
資産合計	210,146,848,457
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,155,334
前受金	336,368,556
未払金	4,883,581
未払解約金	478,790,560
流動負債合計	833,198,031
負債合計	833,198,031
純資産の部	
元本等	
元本	46,618,122,367
剰余金	
剰余金又は欠損金()	162,695,528,059
元本等合計	209,313,650,426
純資産合計	209,313,650,426
負債純資産合計	210,146,848,457

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p>

2024年 8月20日現在	
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,618,122,367口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4.4900円 (1万口当たり純資産額) (44,900円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	2024年 8月20日現在
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2.金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月20日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	40,615,994,191円
期中追加設定元本額	8,487,820,531円
期中一部解約元本額	2,485,692,355円
期末元本額	46,618,122,367円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,166,680,562円
世界経済インデックスファンド	13,038,923,295円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,317,354,464円
DC 世界経済インデックスファンド	7,683,671,757円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	79,200,595円
コア投資戦略ファンド(安定型)	49,649,474円
コア投資戦略ファンド(成長型)	136,653,244円
分散投資コア戦略ファンドA	310,316,270円
分散投資コア戦略ファンドS	1,419,462,050円
DC 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,357,628,035円
DC 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	808,776,438円
コア投資戦略ファンド(切替型)	41,079,373円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	368,418,217円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,572,393円
SMT インデックスバランス・オープン	88,209,225円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	32,497,669円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	2,323,085,520円
SMT 世界経済インデックス・オープン	295,179,874円

区分	2024年 8月20日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,379,077,953円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	223,167,360円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,563,954円
グローバル経済コア	617,677,478円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	524,218,531円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	41,624,559円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	14,488,359円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	121,196,675円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	128,099,276円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	57,207,636円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	72,077,200円
10資産分散投資ファンド	17,793,099円
グローバル10資産バランスファンド	26,525,076円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,209,293円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,612,402,815円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	123,115,582円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,190,608円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	12,979,630円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	21,148,828円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	26,475,891,912
投資信託受益証券	40,260,683
投資証券	27,859,802
合計	26,488,292,793

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	14,361,703,459	-	14,698,072,015	336,368,556
合計		14,361,703,459	-	14,698,072,015	336,368,556

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
	為替予約取引				

市場取引以外の取引	買建	282,733,690	-	281,907,014	826,676
	アメリカドル	282,733,690	-	281,907,014	826,676
	売建	2,266,090	-	2,257,479	8,611
	ブラジルリアル	1,292,368	-	1,293,583	1,215
	カタールリアル	973,722	-	963,896	9,826
合計		284,999,780	-	284,164,493	818,065

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.79	249,804.80	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	14.08	519,974.40	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-BLOCKED GDR REG S	171	-	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,001	105.29	1,684,745.29	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	20.40	1,485,752.40	
	NIO INC - ADR	231,271	4.07	941,272.97	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	29.02	1,184,770.52	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	9.06	718,168.08	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	33.82	2,247,406.64	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	23.61	290,001.63	
	IQIYI INC-ADR	59,454	3.31	196,792.74	
	KANZHUN LTD	38,815	14.77	573,297.55	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	10.64	1,686,940.08	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	104,219	151.11	15,748,533.09	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	14.02	766,557.52	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	56.95	842,176.60	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	488,730	1.63	796,629.90	
CREDICORP LTD	10,882	169.09	1,840,037.38		
QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	24.48	508,033.44		
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	168,912	1.59	270,090.28		
KE HOLDINGS INC	114,048	15.23	1,736,951.04		
		1,987,402		34,287,936.35	

アメリカドル 小計				(5,021,468,278)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	12.40	33,036,836.40
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	106.74	52,184,332.08
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	253.79	8,882,650.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	22.63	4,040,631.76
	ALFA S.A.B.-A	313,500	11.65	3,652,275.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	121.58	12,401,160.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	531.03	17,829,332.25
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	154.05	8,180,055.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	312.46	18,741,350.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	179.89	7,678,604.65
	WALMART DE MEXICO-SER V	941,080	62.90	59,193,932.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	185.41	15,180,443.75
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	211.24	66,147,693.60
	GRUMA S.A.B.-B	25,960	382.50	9,929,700.00
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	70.20	19,627,920.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	34.21	6,219,378.00
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	53.19	7,590,213.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	451,600	141.77	64,023,332.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	47.58	12,927,486.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	16.23	57,151,348.20
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.07	3,553,077.00	
メキシコペソ 小計		10,403,440		488,171,751.49 (3,826,631,908)
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	13.94	2,259,674.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	41.24	26,150,284.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	38.44	32,360,329.60
	PRIO SA	130,000	47.89	6,225,700.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	23.95	3,638,005.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.01	1,193,794.00
	GERDAU SA-PREF	186,708	17.65	3,295,396.20
	SUZANO SA	121,779	55.04	6,702,716.16
	VALE SA	581,587	56.98	33,138,827.26
	WEG SA	314,144	51.79	16,269,517.76
	CCR SA	248,600	13.59	3,378,474.00
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	44.25	6,077,295.00
	RUMO SA	244,300	23.60	5,765,480.00
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	17.00	3,679,599.00
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	26.25	4,541,250.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	9.71	1,287,546.00
	RAIA DROGASIL SA	259,280	29.07	7,537,269.60
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	10.71	3,209,787.00

	AMBEV SA	756,200	13.01	9,838,162.00	
	BRF SA	119,300	25.25	3,012,325.00	
	JBS SA	110,000	38.16	4,197,600.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	200,308	14.20	2,844,373.60	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.45	4,650,935.30	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	32.05	3,067,185.00	
	HYPERA SA	54,500	32.27	1,758,715.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	14.09	4,593,664.07	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	15.64	12,952,766.48	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	29.13	9,117,690.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	36.96	31,101,137.76	
	ITAUSA SA	824,701	11.04	9,104,699.04	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	12.79	13,503,797.11	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	36.05	3,925,845.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	14.65	2,080,300.00	
	TOTVS SA	124,500	29.90	3,722,550.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	52.12	4,659,528.00	
	TIM SA	96,100	18.27	1,755,747.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	45.70	1,690,900.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	41.53	8,791,901.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	11.85	3,263,193.75	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	97.50	4,923,750.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	10.54	2,156,484.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	33.20	903,040.00	
	ENEVA SA	102,200	13.81	1,411,382.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	46.66	2,158,025.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	35.52	5,864,352.00	
	ブラジルリアル 小計	13,186,008		323,760,992.69 (8,756,860,697)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,320.00	571,473,360.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,630.00	221,622,950.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	30,645	34,545.00	1,058,631,525.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	56.70	139,549,359.60	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	11.23	475,777,277.36	
	FALABELLA SA	214,533	3,253.00	697,875,849.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,817.50	556,940,160.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	115.12	872,978,329.36	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	28,799.00	201,276,211.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	47.36	547,016,003.84	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	95.50	333,420,582.50	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	50.56	129,498,215.68	
		70,798,772		5,806,059,823.34	

	チリペソ 小計			(920,295,318)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	36,280.00	1,839,323,440.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	34,260.00	2,109,216,900.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,200.00	919,300,200.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,867,840,540.00	(176,785,364)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	21.48	111,717.48	
	METLEN ENERGY & METALS SA	20,295	34.50	700,177.50	
	OPAP SA	44,643	16.09	718,305.87	
	JUMBO SA	19,341	23.04	445,616.64	
	ALPHA SERVICES AND HLD	511,806	1.59	816,330.57	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	2.02	863,875.22	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	8.11	1,086,983.99	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.91	442,852.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.20	398,346.40	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.62	649,465.04	
		ユーロ 小計	1,358,036		6,233,670.81
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	165.20	23,555,868.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	49.28	12,757,015.04	
	SASA POLYESTER SANAYI	2,951,032	5.11	15,079,773.52	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	58.85	11,718,918.20	
	KOC HOLDING AS	89,884	185.20	16,646,516.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	43.66	13,043,337.68	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	221.50	7,773,985.50	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	297.00	25,724,655.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	918.50	15,035,845.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	251.50	7,948,154.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	573.50	46,584,258.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	223,014	66.70	14,875,033.80	
	AKBANK T.A.S.	586,183	60.25	35,317,525.75	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	93.05	19,668,164.60	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	13.51	25,354,662.83	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	29.58	10,977,936.66	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	106.30	15,210,573.30	
	トルコリラ 小計	7,602,687		317,272,224.18	(1,376,802,816)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	771.50	10,263,264.50	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	105.20	6,386,692.00	
	CEZ AS	25,283	895.00	22,628,285.00	
	チェココルナ 小計	99,296		39,278,241.50	(253,387,863)

ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	2,722.00	261,360,996.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	10,360.00	297,756,760.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	18,200.00	728,382,200.00	
ハンガリーフォリント 小計		164,780		1,287,499,956.00	(530,054,719)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	64.58	6,650,383.82	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	138.95	2,804,844.70	
	BUDIMEX	2,656	613.00	1,628,128.00	
	LPP SA	230	14,790.00	3,401,700.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	179.85	1,205,714.40	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	38.26	3,206,415.67	
	DINO POLSKA SA	9,471	345.20	3,269,389.20	
	BANK PEKAO SA	27,684	160.10	4,432,208.40	
	M BANK SA	1,423	628.60	894,497.80	
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	57.14	9,137,828.80	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	518.20	3,805,142.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	116,529	48.55	5,657,482.95	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	6.90	689,418.40	
	ポーランドズロチ 小計		638,720		46,783,154.74
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13	
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-	
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12	
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	722,000	0.00	0.07	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01	
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-	
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-	
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11	
	VTB BANK PJSC	151,214	0.00	0.01	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-	
ロシアルーブル 小計		5,317,350		0.48	(-)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	8.89	2,924,810.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	6.89	1,667,380.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	5.02	19,424,388.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	33.50	19,279,250.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	272,000	9.16	2,491,520.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	6.90	26,220,000.00	

YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	557,700	10.14	5,655,078.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	4.59	5,140,800.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	17.78	4,222,750.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	10.36	5,754,980.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.38	1,732,640.00
CMOC GROUP LTD-H	810,000	6.36	5,151,600.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	17.74	958,669.60
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	13.72	3,210,480.00
MMG LIMITED	1,176,000	2.32	2,728,320.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	16.44	4,027,800.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	13.72	4,404,120.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	16.06	14,534,300.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.78	1,039,500.00
BOC AVIATION LTD	68,800	66.00	4,540,800.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	4.12	2,249,520.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.77	2,661,620.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	11.32	5,003,440.00
CITIC LTD	1,038,000	7.37	7,650,060.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	5.24	4,904,640.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.16	1,198,080.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	178,000	21.90	3,898,200.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	20.20	3,363,300.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	408,800	12.28	5,020,064.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	31.30	1,949,990.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	12.02	4,634,274.94
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	10.82	5,605,301.00
JD LOGISTICS INC	326,200	9.97	3,252,214.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	8.26	2,659,720.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	32,500	106.70	3,467,750.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.34	1,655,400.00
BYD CO LTD-H	187,000	221.40	41,401,800.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	42.55	6,127,200.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	7.89	7,479,720.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	10.54	5,204,125.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	2.57	920,944.08
LI AUTO INC-CLASS A	234,842	80.65	18,940,007.30
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	27.60	4,613,671.20
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	9.62	2,251,080.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	22.25	1,929,075.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	67.95	16,321,590.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.95	1,730,100.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	23.45	10,801,070.00

HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	99,000	20.70	2,049,300.00
LI NING CO LTD	380,000	14.08	5,350,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	63.60	10,099,680.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	12.46	2,915,640.00
MEITUAN-CLASS B	873,750	108.70	94,976,625.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	54.85	13,410,825.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	13.04	2,175,072.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	8.76	692,040.00
TRIP.COM GROUP LTD	96,607	332.00	32,073,524.00
BAIDU INC-CLASS A	404,500	85.80	34,706,100.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	108.20	4,501,120.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	23.60	1,217,760.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	2.33	2,954,440.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	20.95	3,586,640.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	44.20	19,996,080.00
NETEASE INC	338,630	140.70	47,645,241.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,137,400	372.60	423,795,240.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	81.45	222,789,207.60
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	50.15	451,350.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	6.72	1,693,440.00
JD.COM INC - CL A	414,161	112.40	46,551,696.40
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	29.90	1,282,829.60
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	41.50	2,680,900.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	3.06	1,254,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	9.26	851,920.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	3.03	2,375,520.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	23.15	4,478,367.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	104.48	1,588,096.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	3.60	2,030,400.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	12.76	7,362,520.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	24.00	5,904,000.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	28.80	10,039,680.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	9.09	1,772,550.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	9.44	3,927,040.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	47.35	5,492,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.86	4,743,360.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	40.35	3,655,710.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	25.55	2,235,625.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	19.90	1,500,460.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	4.12	1,644,704.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.78	1,512,552.00

SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	19.62	3,751,344.00
AKESO INC	61,000	44.35	2,705,350.00
BEIGENE LTD	110,905	117.10	12,986,975.50
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.09	8,453,894.40
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.64	1,911,960.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	12.72	2,823,840.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	18.30	4,977,600.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	40.70	8,262,100.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.25	6,405,750.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	33.20	2,114,441.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	11.92	7,485,760.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	3.64	18,691,400.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.55	47,702,060.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	6.11	8,379,712.25
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.87	7,622,524.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	5.68	94,297,201.60
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.42	907,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	33.60	24,374,212.80
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	2.78	5,103,802.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	11,401,515	4.70	53,587,120.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.38	8,103,000.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.88	1,874,040.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	8.26	2,900,912.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	11.26	3,217,826.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.38	1,291,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	6.43	569,698.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.53	1,260,916.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	8.23	2,189,180.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	10.78	14,229,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	506,600	19.34	9,797,644.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.39	1,543,961.36
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	309,600	15.16	4,693,536.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.77	5,202,060.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	10.08	12,068,663.04
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	34.55	40,699,900.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	5.91	2,913,630.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	29.30	6,489,950.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	30.10	4,831,050.00
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	9.65	15,324,200.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	46.10	5,508,950.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,704,200	17.62	47,648,004.00
ZTE CORP-H	82,908	16.66	1,381,247.28

	CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.98	6,940,360.00	
	BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.90	1,541,050.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.45	1,494,500.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	3.41	4,869,480.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.28	3,395,392.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	7.07	3,195,640.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.56	2,370,960.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	27.70	5,451,360.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	22.55	5,804,370.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	55.30	6,470,100.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	4.00	1,784,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.62	3,252,480.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	7.57	4,148,360.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	10.72	686,080.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.13	3,558,370.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	17.94	1,614,600.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	3.25	2,911,957.75	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	12.90	1,179,756.60	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	12.66	7,400,276.40	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	22.65	12,256,164.15	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	22.50	2,677,500.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	4.10	1,293,550.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	9.14	3,139,590.00	
	香港ドル 小計	136,539,398		1,955,687,610.95 (36,786,483,961)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	19.00	1,679,600.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	5.49	2,286,036.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	5.14	3,894,064.00	
	GAMUDA BHD	414,102	7.45	3,085,059.90	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.68	901,407.28	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	10.04	1,077,101.24	
	MISC BHD	217,540	8.69	1,890,422.60	
	GENTING BHD	271,600	4.40	1,195,040.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.53	935,341.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	2.10	637,245.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.79	1,024,588.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	21.10	2,459,458.20	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	105.10	1,912,820.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	14.48	2,367,190.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.70	836,160.00	
	SD GUTHRIE BHD	247,046	4.55	1,124,059.30	

	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.27	2,955,678.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.89	1,470,423.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	7.97	9,828,619.94	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	20.10	2,437,969.20	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	10.60	9,343,953.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.54	11,550,214.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.92	1,298,534.24	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.43	1,314,846.27	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	3.60	1,792,800.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.54	948,366.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.90	1,873,708.80	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	18.16	2,694,944.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	13.90	6,140,672.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	3.47	2,820,069.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	4.20	2,097,480.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.47	953,209.00	
	マレーシアリングット 小計	13,749,909		86,827,080.47 (2,913,152,742)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	308,100	144.00	44,366,400.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	34.50	58,118,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	53.25	15,634,466.25	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	18.40	3,797,760.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	24.50	11,910,283.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	23.40	4,743,180.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	208.00	27,123,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	58.00	37,984,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.95	6,495,150.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.28	2,657,784.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	26.00	22,072,388.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	27.25	4,964,950.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	8.35	7,015,127.25	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	14.60	11,569,040.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	57.00	54,514,800.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	29.00	6,899,390.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	24.60	13,687,440.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	26.25	49,562,625.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	244.00	20,178,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	138.50	18,448,200.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	18.40	8,071,160.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	106.50	16,102,800.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.80	15,708,960.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	41.00	4,161,500.00	

	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	103.00	51,088,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	241.00	49,115,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	84.50	10,296,325.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	10.20	20,559,303.60	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	39.00	2,659,800.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	47.75	33,143,275.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	58.50	22,136,400.00	
	タイパーツ 小計	25,509,040		654,787,207.10 (2,789,393,502)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	619.50	33,706,995.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	24.20	14,184,176.60	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	925.00	33,563,625.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	396.00	60,639,480.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	248.00	15,130,480.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	94.10	8,992,196.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	120.70	28,340,601.40	
	BDO UNIBANK INC	394,773	147.00	58,031,631.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	70.05	38,182,643.85	
	PLDT INC	20,460	1,608.00	32,899,680.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	421.60	22,420,688.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	34.30	43,934,870.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	30.65	47,610,177.50	
	フィリピンペソ 小計	5,069,060		437,637,244.35 (1,130,985,930)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,280.00	7,092,344,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	25,100.00	5,042,590,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	10,450.00	11,532,620,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,470.00	1,449,126,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,895,911	1,120.00	3,243,420,320.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK	1,270,900	9,850.00	12,518,365,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	8,550.00	6,446,700,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,340.00	3,798,514,980.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	5,025.00	16,468,432,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	54.00	7,270,554,816.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,860.00	8,976,682,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,553,300	5,000.00	7,766,500,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,400.00	6,833,160,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	6,450.00	9,054,510,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	2,360.00	2,731,464,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,610.00	6,743,485,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	10,375.00	97,208,562,500.00	
BANK MANDIRI	6,101,792	7,150.00	43,627,812,800.00		

	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	5,350.00	13,827,610,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	4,820.00	57,987,019,640.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	2,930.00	26,072,605,000.00	
	インドネシアルピア 小計	199,939,906		355,692,078,556.00 (3,379,074,746)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	81,500.00	422,170,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	62,900.00	401,742,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	100,200.00	1,006,408,800.00	
	ENCHEM CO LTD	1,966	205,000.00	403,030,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	27,600.00	504,417,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	25,850.00	289,235,650.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	526,000.00	633,304,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	57,200.00	308,250,800.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	132,400.00	251,295,200.00	
	LG CHEM LTD	9,272	289,500.00	2,684,244,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	196,300.00	172,155,100.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	82,400.00	190,838,400.00	
	POSCO HOLDINGS INC	13,371	322,500.00	4,312,147,500.00	
	SKC CO LTD	1,432	121,500.00	173,988,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	39,800.00	481,500,400.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	18,230.00	1,494,914,690.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	172,400.00	1,419,196,800.00	
	ECOPRO CO LTD	15,665	85,500.00	1,339,357,500.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	79,000.00	218,751,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	45,000.00	296,685,000.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	300,000.00	1,747,800,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	31,300.00	464,773,700.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	3,567	288,500.00	1,029,079,500.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	211,000.00	446,265,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	199,300.00	1,249,411,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	30,850.00	301,342,800.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	58,200.00	780,811,200.00	
	L&F CO LTD	4,327	89,300.00	386,401,100.00	
	LG CORP	16,658	80,000.00	1,332,640,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	8,760	329,500.00	2,886,420,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	200,500.00	953,979,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	50,700.00	438,402,900.00	
	SAMSUNG C&T CORP	15,406	144,200.00	2,221,545,200.00	
	SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	26,600.00	805,980,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	10,800.00	1,027,825,200.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	31,650.00	73,997,700.00	
	SK INC	6,394	138,300.00	884,290,200.00	

SK SQUARE CO LTD	19,731	86,200.00	1,700,812,200.00	
HANJIN KAL CORP	7,812	66,200.00	517,154,400.00	
HMM CO LTD	35,545	17,920.00	636,966,400.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5,586	104,700.00	584,854,200.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	21,150.00	567,285,300.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	18,150	43,250.00	784,987,500.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	220,500.00	2,237,634,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	255,000.00	5,979,240,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	168,200.00	1,016,264,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	166,900.00	575,638,100.00	
KIA CORP	45,204	103,200.00	4,665,052,800.00	
COWAY CO LTD	9,036	62,200.00	562,039,200.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	97,400.00	1,680,539,600.00	
HYBE CO LTD	4,975	168,400.00	837,790,000.00	
KAKAO CORP	52,020	36,650.00	1,906,533,000.00	
KRAFTON INC	6,265	325,000.00	2,036,125,000.00	
NAVER CORP	21,578	156,600.00	3,379,114,800.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	191,700.00	519,315,300.00	
NETMARBLE CORP	2,465	57,100.00	140,751,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	342,500.00	629,857,500.00	
KT&G CORP	19,456	101,100.00	1,967,001,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	92,000.00	289,064,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	122,900.00	462,349,800.00	
LG H&H CO LTD	1,321	338,000.00	446,498,000.00	
HLB INC	23,903	90,500.00	2,163,221,500.00	
ALTEOGEN INC	6,824	298,500.00	2,036,964,000.00	
CELLTRION INC	27,796	197,600.00	5,492,489,600.00	
CELLTRION PHARM INC	2,169	72,200.00	156,601,800.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,202	295,500.00	355,191,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	930,000.00	3,126,660,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	107,400.00	343,357,800.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	60,200.00	126,420,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,854	96,400.00	1,335,525,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	62,900.00	3,223,562,100.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,890.00	393,503,700.00	
KAKAOBANK CORP	35,459	21,650.00	767,687,350.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	87,000.00	5,620,113,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	57,200.00	4,607,059,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	16,040.00	1,825,576,560.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	73,500.00	338,247,000.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	91,000.00	1,544,725,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,120.00	251,841,800.00	

	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	13,620.00	164,897,340.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	111,700.00	1,125,265,800.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	346,500.00	2,128,896,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	93,600.00	1,135,461,600.00	
	POSCO DX CO LTD	9,010	26,250.00	236,512,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	141,800.00	1,032,871,200.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,978	108,800.00	432,806,400.00	
	LG DISPLAY CO LTD	51,846	11,280.00	584,822,880.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	250,000.00	674,000,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	11,233	143,900.00	1,616,428,700.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	822,794	78,300.00	64,424,770,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	63,400.00	8,995,001,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	309,000.00	3,171,267,000.00	
	KT CORP	10,500	38,250.00	401,625,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	9,690.00	214,391,250.00	
	SK TELECOM	9,563	55,100.00	526,921,300.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,220.00	850,292,800.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	124,900.00	904,026,200.00	
	SK HYNIX INC	94,417	193,900.00	18,307,456,300.00	
	韓国ウォン 小計	2,613,000		208,793,928,220.00 (22,967,332,104)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	60.00	14,294,400.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	44.35	20,142,705.60	
	CHINA STEEL	2,373,261	22.00	52,211,742.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	44.90	24,338,538.90	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	52.20	31,206,412.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	46.40	35,762,892.80	
	TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	32.70	41,477,301.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	805.00	25,403,385.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	36.35	13,159,717.80	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	22,000	685.00	15,070,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,975.00	17,775,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	33.30	16,723,692.90	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	21.00	9,765,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	34.50	13,317,000.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	187.00	34,261,205.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.80	14,065,600.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	79.50	5,933,482.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	63.70	13,822,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	47.85	22,157,468.85	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	520.00	20,767,240.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	142.00	11,203,942.00	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	459.00	14,229,000.00
POU CHEN	273,780	34.25	9,376,965.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	646.00	34,922,760.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	277.00	24,526,688.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	80.50	62,499,797.50
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	682.00	17,050,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	627,846	17.70	11,112,874.20
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	35.00	108,158,295.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,524,109	27.15	68,529,559.35
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,240,618	26.85	60,160,593.30
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,533,544	25.55	39,182,049.20
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,128,069	38.65	82,249,866.85
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	26.60	47,652,410.40
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,080,677	18.60	38,700,592.20
TAIWAN BUSINESS BANK	890,572	16.00	14,249,152.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,139,268	25.75	55,086,151.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	41.15	28,392,882.75
CHAILEASE HOLDING CO LTD	293,456	149.00	43,724,944.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,958,218	31.65	61,977,599.70
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,731,057	62.30	107,844,851.10
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	90.00	121,810,590.00
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,576,226	16.15	41,606,049.90
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	2,085,158	11.10	23,145,253.80
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	525.00	45,150,000.00
ACER INC	617,803	43.20	26,689,089.60
ADVANTECH CO LTD	76,261	348.00	26,538,828.00
ASIA VITAL COMPONENTS	55,000	617.00	33,935,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	524.00	66,596,208.00
AUO CORP	1,268,072	16.70	21,176,802.40
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	234.00	27,775,800.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	32.05	25,824,608.00
DELTA ELECTRONICS INC	347,903	404.50	140,726,763.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	281.50	40,536,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	262.50	19,687,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,185,248	187.00	408,641,376.00
INNOLUX CORP	1,320,576	14.55	19,214,380.80
INVENTEC CO LTD	455,511	47.10	21,454,568.10
LARGAN PRECISION CO LTD	20,040	2,905.00	58,216,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	109.00	38,526,268.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	174.50	17,450,000.00
PEGATRON CORP	340,474	104.00	35,409,296.00
QUANTA COMPUTER INC	463,270	278.00	128,789,060.00

	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	72.20	14,591,620.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	158.50	33,443,500.00	
	WISTRON CORP	427,000	100.50	42,913,500.00	
	WIWYNN CORP	16,000	1,930.00	30,880,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	83.20	21,689,574.40	
	YAGEO CORPORATION	77,172	633.00	48,849,876.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	123.50	17,033,367.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	123.50	72,162,902.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	89.60	19,353,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	109.50	26,849,400.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	2,475.00	29,700,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	594,315	154.00	91,524,510.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,600.00	31,200,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,180.00	15,340,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	487.50	20,475,000.00	
	MEDIATEK INC	266,804	1,255.00	334,839,020.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	56.60	14,659,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	547.00	52,536,615.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	550.00	47,269,200.00	
	SILERGY CORP	53,000	434.00	23,002,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,243,389	973.00	4,128,817,497.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	56.00	110,656,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	126.00	23,688,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	385,263	24.00	9,246,312.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	49.80	13,898,034.60	
	新台湾ドル 小計	60,377,394		8,046,005,229.60 (36,784,726,708)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	343.55	103,032,019.20	
	COAL INDIA LTD	295,479	522.00	154,240,038.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	388.00	73,032,852.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	170.05	101,525,971.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	335.10	180,872,905.80	
	PETRONET LNG LTD	83,779	375.30	31,442,258.70	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	522,888	2,977.20	1,556,742,153.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	633.60	46,590,508.80	
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,357.75	35,886,690.25	
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	3,076.45	206,746,669.35	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,597.40	121,670,008.20	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	658.80	162,651,132.00	
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	722.60	39,288,484.60	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	952.10	66,431,825.40	
	JSW STEEL LTD	99,332	917.45	91,132,143.40	

NMDC LTD	146,261	219.95	32,170,106.95
PI INDUSTRIES LTD	12,797	4,327.90	55,384,136.30
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	3,054.80	89,077,968.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	24,847.30	34,463,205.10
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	4,277	10,376.70	44,381,145.90
SRF LTD	33,773	2,475.60	83,608,438.80
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	5,268.85	52,751,726.20
TATA STEEL LTD	1,356,728	153.95	208,868,275.60
ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	11,310.25	224,531,083.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	561.85	39,133,414.35
VEDANTA LTD	184,749	442.55	81,760,669.95
ABB LTD INDIA	11,720	7,818.30	91,630,476.00
ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,102.10	104,385,665.00
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	257.55	62,320,146.15
ASTRAL LTD	19,918	1,888.60	37,617,134.80
BHARAT ELECTRONICS LTD	646,541	302.00	195,255,382.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	293.70	44,584,541.10
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	710.65	50,034,023.90
CUMMINS INDIA LTD	20,968	3,754.90	78,732,743.20
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,881.85	67,118,062.10
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	4,789.45	173,933,666.20
LARSEN & TOUBRO LTD	118,675	3,556.35	422,049,836.25
POLYCAB INDIA LTD	7,354	6,639.30	48,825,412.20
SIEMENS INDIA LTD	16,262	7,099.90	115,458,573.80
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	80.76	121,140,000.00
THERMAX LTD	7,627	4,305.65	32,839,192.55
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	52,993	937.35	49,672,988.55
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,496.30	156,486,046.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	967.95	25,607,117.25
GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	96.30	37,990,157.40
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	4,232.45	111,952,534.95
BAJAJ AUTO LTD	9,644	9,770.70	94,228,630.80
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,804.35	24,765,214.85
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,592.10	48,275,656.20
BOSCH LTD	1,235	31,622.10	39,053,293.50
EICHER MOTORS LTD	26,253	4,813.60	126,371,440.80
HERO MOTOCORP LTD	21,431	5,186.60	111,154,024.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	165,233	2,765.40	456,935,338.20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,144.30	295,713,705.00
MRF LTD	432	134,908.20	58,280,342.40
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	186.25	97,080,018.75
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	690.15	40,918,303.35

TATA MOTORS LTD	277,381	1,087.85	301,748,920.85
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	749.15	56,186,250.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,973.50	84,047,472.00
TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,607.90	107,586,306.60
PAGE INDUSTRIES LTD	886	41,161.90	36,469,443.40
TITAN CO LTD	56,531	3,463.95	195,820,557.45
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	614.35	101,058,731.95
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	634.05	27,853,816.50
ZOMATO LTD	1,054,701	262.30	276,648,072.30
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	7,390.20	106,093,711.20
TRENT LTD	37,950	6,684.20	253,665,390.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	5,003.00	143,045,776.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,732.30	127,004,838.80
ITC LTD	480,447	501.15	240,776,014.05
MARICO LTD	81,711	669.05	54,668,744.55
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,503.95	128,853,267.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,177.90	109,826,218.10
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,403.65	82,225,817.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,508.85	121,248,168.30
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	3,548.80	92,268,800.00
DABUR INDIA LTD	144,837	621.20	89,972,744.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,403.60	88,982,625.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,744.20	395,329,452.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,720.30	97,861,008.60
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	875.30	105,203,182.30
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,520.45	53,846,736.75
CIPLA LTD	88,546	1,575.45	139,499,795.70
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	4,668.40	102,387,348.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	6,910.25	126,602,690.25
LUPIN LTD	48,134	2,069.00	99,589,246.00
MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,317.40	42,396,833.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,747.50	292,671,300.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	3,348.70	40,921,114.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	618.85	57,000,416.95
AXIS BANK LTD	391,573	1,153.15	451,542,404.95
BANDHAN BANK LTD	74,811	192.00	14,363,712.00
BANK OF BARODA	248,313	247.35	61,420,220.55
CANARA BANK	305,000	109.90	33,519,500.00
HDFC BANK LTD	485,940	1,631.55	792,835,407.00
ICICI BANK LTD	879,852	1,175.75	1,034,485,989.00
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	72.06	38,265,877.68
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,347.70	65,181,510.50

KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,781.25	331,927,031.25
PUNJAB NATIONAL BANK	272,403	115.20	31,380,825.60
STATE BANK OF INDIA	314,786	813.65	256,125,628.90
UNION BANK OF INDIA	238,889	120.20	28,714,457.80
YES BANK LTD	2,352,478	24.45	57,518,087.10
BAJAJ FINANCE LTD	49,376	6,618.65	326,802,462.40
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,551.85	118,811,187.85
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	9,602.90	28,760,685.50
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,348.85	113,300,702.30
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	4,196.00	59,469,908.00
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	331.50	156,196,833.00
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,840.60	22,865,773.80
POWER FINANCE CORPORATION	265,755	504.85	134,166,411.75
REC LTD	186,584	583.65	108,899,751.60
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	699.95	42,483,465.25
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	3,075.10	168,192,594.50
SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	4,099.70	45,769,050.80
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	207,570	685.90	142,372,263.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	2,011.70	67,655,482.70
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	720.50	32,650,178.00
PB FINTECH LTD	48,956	1,650.65	80,809,221.40
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,671.10	121,549,129.60
HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,678.15	274,082,170.60
INFOSYS LTD	579,880	1,864.10	1,080,954,308.00
LTIMINDTREE LTD	15,699	5,674.75	89,087,900.25
MPHASIS LTD	19,317	2,977.95	57,525,060.15
PERSISTENT SYSTEMS LTD	15,982	4,886.55	78,096,842.10
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	4,489.35	683,992,876.65
TATA ELXSI LTD	7,679	6,921.90	53,153,270.10
TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,594.65	151,168,036.05
WIPRO LTD	247,008	519.50	128,320,656.00
BHARTI AIRTEL LTD	389,936	1,469.50	573,010,952.00
INDUS TOWERS LTD	127,238	418.65	53,268,188.70
TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,871.85	37,107,554.40
ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,898.60	115,248,817.20
ADANI POWER LTD	167,705	696.65	116,831,688.25
GAIL INDIA LTD	504,548	238.80	120,486,062.40
JSW ENERGY LTD	63,163	667.30	42,148,669.90
NHPC LTD	546,313	96.20	52,555,310.60
NTPC LTD	766,679	402.90	308,894,969.10
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	340.25	272,533,445.00
TATA POWER CO LTD	285,870	418.80	119,722,356.00

	TORRENT POWER LTD	28,990	1,673.85	48,524,911.50	
	DLF LTD	126,742	857.35	108,662,253.70	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,928.25	87,150,576.50	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,286.55	53,960,480.10	
	PHOENIX MILLS LTD	17,280	3,490.00	60,307,200.00	
	インドルピー 小計	26,473,199		21,452,016,619.13 (37,755,549,249)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	14.62	875,942.68	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.49	2,113,315.27	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.65	2,167,480.18	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	13.20	3,734,530.80	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.09	2,177,108.92	
	DUKHAN BANK	319,751	3.77	1,205,461.27	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.22	2,547,972.12	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	11.00	2,359,863.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	19.35	6,488,074.35	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	15.69	11,631,028.38	
	OOREDOO QSC	72,800	10.97	798,616.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	15.47	1,493,040.64	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.59	538,851.53	
		カタールリアル 小計	5,782,030		38,131,285.14 (1,533,640,288)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	167.35	5,726,214.95	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	690.40	6,897,786.40	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	557.37	37,590,704.91	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	301.00	43,404,200.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	192.82	19,255,198.02	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	88.45	13,342,417.15	
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	363.62	6,428,437.98	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	125.85	6,049,483.65	
	SASOL LTD	88,115	137.53	12,118,455.95	
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	19.11	15,277,776.15	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	285.82	14,377,603.46	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,650.12	111,660,820.92	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	21.26	10,110,788.28	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	65.65	11,575,145.40	
	BID CORP LTD	58,066	438.10	25,438,714.60	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	356.00	12,610,232.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	307.51	26,207,232.24	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	232.50	13,062,315.00	
	ABSA GROUP LTD	140,135	165.58	23,203,553.30	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,880.00	42,048,000.00		

	NEDBANK GROUP LTD	88,111	297.04	26,172,491.44	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	237.19	57,625,073.31	
	FIRSTSTRAND LTD	816,636	84.60	69,087,405.60	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	468.54	8,052,796.98	
	REMGRO LTD	74,679	143.88	10,744,814.52	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	150.16	14,832,654.64	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.38	12,066,241.28	
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	48.54	11,545,918.56	
	SANLAM LTD	307,490	85.15	26,182,773.50	
	MTN GROUP LTD	350,498	90.28	31,642,959.44	
	VODACOM GROUP	166,454	107.28	17,857,185.12	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	139.12	9,367,784.32	
	南アフリカランド 小計	6,024,943		751,563,179.07 (6,207,911,859)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.13	1,106,845.98	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	2.85	1,229,621.10	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.60	1,598,479.20	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.85	4,172,155.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	250,781	12.72	3,189,934.32	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.90	3,098,349.60	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	19.60	7,010,900.40	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.22	9,571,531.18	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	17.12	10,993,402.56	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	7.13	5,175,175.03	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	8.11	8,991,297.48	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	6,200,824		56,137,692.35 (2,242,139,432)	
クウェートディ ナール	BOUBYAN BANK K.S.C	171,769	0.58	100,828.40	
	GULF BANK	162,936	0.31	50,998.96	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,794,507	0.71	1,286,661.51	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.88	1,240,153.19	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.45	134,167.16	
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.85	129,136.90	
	クウェートディナール 小計	3,980,853		2,941,946.12 (1,407,073,990)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	8.26	1,211,742.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	40.35	3,591,150.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	15.20	972,800.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.13	548,635.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	9.07	907,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	24.30	2,337,660.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.24	1,721,614.08	

SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	8.10	644,760.00
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	15.13	149,787.00
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	40,365	14.70	593,365.50
YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	30.18	845,040.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	6.81	1,118,883.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	22.59	665,049.60
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.10	2,253,950.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	10.18	938,596.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	16.95	352,560.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	27.21	392,368.20
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	26.54	297,248.00
GEM CO LTD-A	289,800	5.83	1,689,534.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	14.17	351,784.42
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	13.66	506,786.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.25	921,875.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	1.90	1,580,990.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	45.27	1,014,048.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.44	663,840.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.72	223,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	7.56	168,588.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	49.88	505,783.20
LB GROUP CO LTD-A	15,300	15.94	243,882.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	7.08	333,468.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	15.32	1,213,344.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	2.31	45,045.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	13.96	664,496.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	8.79	425,875.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	16.18	897,585.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	29.46	213,643.92
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	22.29	399,882.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.62	1,037,492.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	11.44	185,785.60
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	4.18	458,454.04
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.46	475,404.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	30.84	333,072.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	10.04	500,996.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	26.32	300,048.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	12.30	120,540.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.12	1,034,592.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	70.61	2,845,583.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.65	393,140.80
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	34.51	568,897.35

YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	31.44	57,220.80
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	26.74	109,634.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	23.02	860,948.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	22.25	164,872.50
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	17.80	2,303,320.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	20.07	699,399.36
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	16.22	4,364,802.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	36.81	419,634.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	39.20	607,600.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	25.34	212,856.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	7.89	504,960.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	39.42	2,176,575.30
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.24	1,350,944.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	7.16	1,647,516.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.67	3,188,808.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	175.60	9,619,368.00
CRRG CORP LTD-A	185,800	8.02	1,490,116.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	14.24	615,168.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	35.98	1,420,238.54
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	58.84	141,216.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	7.47	150,229.17
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	18.12	105,096.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	44.73	512,426.88
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	13.25	544,575.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	15.98	768,638.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.27	1,082,043.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	23.69	1,989,486.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	8,316	92.01	765,155.16
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	47.00	589,098.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.57	909,024.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.62	654,478.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	3.69	1,795,923.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	41.82	1,187,395.26
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	6.00	150,360.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	14,000	67.53	945,420.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	15.85	645,095.00
TBEA CO LTD-A	29,274	13.06	382,318.44
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	13.00	561,600.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.70	1,335,980.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	17.99	568,484.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	49.01	404,822.60
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	16.54	120,742.00

ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.73	539,073.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	27.25	299,750.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.21	1,628,739.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.75	2,283,325.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.78	151,200.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	12.70	2,330,450.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.91	1,109,055.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	34.34	1,823,454.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	33.58	178,612.02
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.37	282,828.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.40	802,080.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	6.61	144,362.40
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	34.97	528,746.40
BYD CO LTD -A	17,000	235.42	4,002,140.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	118.68	1,068,120.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.01	564,009.52
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	45.31	838,235.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	14.07	482,601.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	89.60	752,640.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	14.09	412,837.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	66,265	33.36	2,210,600.40
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	13.09	557,634.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	16.30	639,840.20
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	37.77	105,756.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	40.74	1,772,190.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	20.33	564,360.80
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	25.90	205,438.80
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	62.36	3,167,888.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	49.16	378,532.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	23.91	2,417,301.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	49.61	396,880.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	23.81	623,822.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	7.89	264,157.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	13.22	323,890.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.19	385,384.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.71	795,974.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	20.43	333,009.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.24	199,260.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	63.40	1,313,648.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	5.42	598,910.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	13.12	292,457.92
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	17,035	19.43	330,990.05

ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	30.18	322,926.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	178.40	285,440.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	37.47	82,434.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	51.78	947,574.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	75.20	225,600.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	56.75	448,325.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	34.70	1,875,777.90
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	39.27	667,590.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	22.90	1,799,482.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	23.91	820,160.82
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	41.72	721,756.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	78.17	711,347.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	17.53	201,595.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,425.44	18,530,720.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	124.78	2,295,952.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	41.99	1,409,100.42
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	9.41	252,188.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	184.03	1,726,201.40
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	34.50	393,300.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	19.13	730,000.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	123.95	5,143,925.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	25.82	260,782.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	11.13	330,561.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	10.34	948,684.66
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.85	477,600.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	27.92	79,236.96
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	30.63	297,723.60
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	27,985	4.76	133,208.60
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	11.97	177,156.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	255.60	3,808,440.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	66.08	1,240,982.40
BEIJING Tiantan Biological-A	99,816	24.10	2,405,565.60
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	36.30	1,030,920.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	69.20	725,700.40
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	58.38	529,331.46
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	84.19	185,218.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	13,260	42.88	568,588.80
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	24.38	362,043.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	49.25	1,093,005.25
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	53.18	425,440.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	15.66	295,191.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	165.75	482,664.00

JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	42.11	5,015,385.22
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.56	484,596.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	14.93	162,438.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	28.33	198,310.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	16.44	155,193.60
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	31.47	353,471.04
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	10.95	186,150.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	39.77	654,773.28
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	53.69	533,678.60
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	205.00	799,500.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.55	158,301.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.89	5,046,969.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.62	325,960.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	15.15	2,384,610.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	7.92	4,054,248.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.55	1,527,085.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.96	1,828,730.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.28	1,516,300.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	20.27	1,181,741.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.58	344,890.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	8.05	1,005,445.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.26	2,723,078.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	33.42	6,216,120.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.51	960,336.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.78	1,115,280.40
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.46	771,324.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	6.27	3,627,822.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	16.95	3,483,225.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	10.29	1,228,626.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.06	715,990.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	9.02	3,944,446.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.27	278,075.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	9.01	715,394.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	6.63	380,097.90
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.04	100,296.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	6.79	317,093.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	15.05	431,333.00
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	19.04	2,686,163.20
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	19.40	467,540.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	10.61	1,245,900.47
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.84	53,424.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.24	315,448.00

GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	12.01	727,806.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	5.09	873,846.11
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.19	2,068,669.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.24	1,029,552.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.38	970,079.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	101.96	550,584.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.56	395,640.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.25	599,917.50
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.58	348,142.08
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.63	959,336.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.13	1,885,588.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.79	432,060.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	11.10	485,070.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	5.89	1,854,172.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	28.60	2,865,720.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	42.07	4,408,936.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.20	193,680.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	196.00	945,308.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	30.38	980,241.08
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	16.43	272,113.66
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	34.51	372,708.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	47.41	142,230.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	30.08	344,024.96
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	40.05	220,275.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	8.70	114,579.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	33.48	1,268,892.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	3.81	2,341,626.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	30.34	849,520.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	7.93	275,964.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	37.69	342,979.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	20.78	3,430,778.00
GOERTEK INC -A	26,900	20.30	546,070.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.64	332,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	28.65	200,550.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	33.29	656,212.48
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	17.00	285,600.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	36.72	1,705,644.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	69.00	119,232.00
NINESTAR CORP-A	18,543	23.94	443,919.42
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	18.38	446,634.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	107.12	509,891.20
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	77.57	698,828.13

SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	22.24	633,840.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.85	431,970.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	20.03	367,350.20
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	26.70	112,140.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	6.10	327,631.00
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	78.27	367,869.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	32.70	515,025.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	13.73	416,019.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	121.64	1,481,575.20
ZTE CORP-A	76,400	26.16	1,998,624.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.79	2,025,212.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	11.30	1,963,940.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.73	1,141,349.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	29.73	9,807,332.40
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.60	1,034,160.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	5.53	1,745,821.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	16.64	2,943,616.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	18.19	1,678,937.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	145.95	1,035,807.15
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	54.18	549,276.84
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	255.00	2,912,610.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	36.35	764,513.20
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	78.98	495,362.56
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	14.90	441,561.50
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	19.90	149,250.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	76.84	3,160,045.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	48.10	360,750.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	10.25	350,570.50
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	30.86	919,628.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	6.98	160,442.28
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	13.48	1,352,583.20
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	55.31	1,164,552.05
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	316.20	980,220.00
SG MICRO CORP-A	4,095	68.95	282,350.25
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,920	81.06	317,755.20
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	87.61	358,850.56
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	7.99	294,631.25
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.02	262,655.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	20.94	470,438.04
TONGWEI CO LTD-A	66,600	18.93	1,260,738.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	16.60	421,938.80
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	48.62	333,484.58

	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	89.70	653,913.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	26.19	445,806.18	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	8.89	486,283.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	414,800	6.80	2,820,640.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.37	1,761,836.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	8.18	669,124.00	
	オフショア人民元 小計	26,183,982		334,352,501.37 (6,865,226,475)	
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	80,157	21.30	1,707,344.10	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	708,811	28.35	20,094,791.85	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	38.40	452,160.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	115.80	4,332,425.40	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	28.10	1,327,472.10	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	40.90	8,623,519.60	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	133.20	1,245,286.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	74.20	12,158,189.40	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	18.74	1,598,953.02	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	8.63	892,609.53	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	39.00	1,992,081.00	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	304.00	1,872,336.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	257.00	1,081,199.00	
	JARIR MARKETING CO	125,000	12.76	1,595,000.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	127.60	820,595.60	
	ALMARAI CO	56,483	56.60	3,196,937.80	
	SAVOLA	36,289	41.45	1,504,179.05	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	165.20	1,128,811.60	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	304.40	4,991,855.60	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	109.80	1,748,455.20	
	AL RAJHI BANK	346,607	84.20	29,184,309.40	
	ALINMA BANK	201,652	31.50	6,352,038.00	
	ARAB NATIONAL BANK	195,935	19.96	3,910,862.60	
	BANK AL-JAZIRA	122,367	17.10	2,092,475.70	
	BANK ALBILAD	112,127	38.80	4,350,527.60	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	35.10	3,328,708.50	
	RIYAD BANK	234,479	25.30	5,932,318.70	
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	36.65	5,420,351.75	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	12.34	1,089,622.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	35.05	17,201,628.70	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	234.60	2,570,512.20		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	232.40	3,305,425.20		
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	165.40	2,754,737.00		
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	302.20	1,334,817.40		

ELM CO	4,094	997.20	4,082,536.80
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	52.50	2,564,310.00
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	10.72	970,245.76
SAUDI TELECOM CO	339,167	39.00	13,227,513.00
ACWA POWER CO	24,653	410.40	10,117,591.20
POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	58.30	937,522.30
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	16.82	2,726,673.38
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	14.30	1,444,171.30
サウジアラビアリアル 小計	4,650,675		197,263,101.14 (7,712,987,254)
合計	634,813,478		194,129,355,448 (194,129,355,448)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	16,295,143.20	
		メキシコペソ 小計	97,360	16,295,143.20 (127,732,739)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	7,272,893.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,875,610.00	
		KLABIN SA-UNIT	110,000	2,341,900.00	
ブラジルリアル 小計	347,700	11,490,403.00 (310,784,377)			
投資信託受益証券合計			445,060	438,517,116 (438,517,116)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	15,041,787.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	126,346	8,692,604.80	
	メキシコペソ 小計	740,046	23,734,391.80 (186,046,777)		
投資証券合計			740,046	186,046,777 (186,046,777)	
合計				624,563,893 (624,563,893)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 24銘柄	100.0%			2.6%

メキシコペソ	株式	21銘柄	92.4%		2.0%
	投資信託受 益証券	1銘柄		3.1%	0.1%
	投資証券	2銘柄		4.5%	0.1%
ブラジルリアル	株式	45銘柄	96.6%		4.5%
	投資信託受 益証券	3銘柄		3.4%	0.2%
チリペソ	株式	12銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式	3銘柄	100.0%		0.1%
ユーロ	株式	10銘柄	100.0%		0.5%
トルコリラ	株式	17銘柄	100.0%		0.7%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式	13銘柄	100.0%		0.9%
ロシアルーブル	株式	14銘柄			
香港ドル	株式	156銘柄	100.0%		18.9%
マレーシアリンギット	株式	32銘柄	100.0%		1.5%
タイバーツ	株式	31銘柄	100.0%		1.4%
フィリピンペソ	株式	13銘柄	100.0%		0.6%
インドネシアルピア	株式	21銘柄	100.0%		1.7%
韓国ウォン	株式	98銘柄	100.0%		11.8%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%		18.9%
インドルピー	株式	146銘柄	100.0%		19.4%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%		3.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	11銘柄	100.0%		1.2%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%		0.7%
オフショア人民元	株式	307銘柄	100.0%		3.5%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%		4.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	884,807,641
コール・ローン	1,405,359,841
国債証券	146,981,761,564
派生商品評価勘定	10,203,410
未収入金	1,819,638
未収利息	2,081,436,838
前払費用	330,288,444
流動資産合計	151,695,677,376
資産合計	151,695,677,376
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	996,058
未払金	83,700
未払解約金	333,556,115
流動負債合計	334,635,873
負債合計	334,635,873
純資産の部	
元本等	
元本	66,091,502,911
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,269,538,592
元本等合計	151,361,041,503
純資産合計	151,361,041,503
負債純資産合計	151,695,677,376

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,091,502,911口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2902円 (1万口当たり純資産額) (22,902円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	54,157,444,415円
期中追加設定元本額	14,114,613,921円
期中一部解約元本額	2,180,555,425円
期末元本額	66,091,502,911円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,848,703,373円
世界経済インデックスファンド	25,292,798,384円
DC 新興国債券インデックス・オープン	6,010,560,008円
DC 世界経済インデックスファンド	15,800,803,409円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	5,425,849円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円

区分	2024年 8月20日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	836,184,211円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,689,119,569円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	232,882,706円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,682,924円
SMT インデックスバランス・オープン	170,336,118円
SMT 世界経済インデックス・オープン	532,800,616円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	800,314,846円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,195,514,900円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,715,044円
グローバル経済コア	1,191,430,346円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	131,695,844円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	113,673,937円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	48,098,209円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	58,160,556円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	327,870,968円
10資産分散投資ファンド	57,171,292円
グローバル10資産バランスファンド	49,488,186円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	288,009,680円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	164,444,466円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	217,762,217円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	218,907,727円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	217,965,256円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	212,611,355円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	210,503,600円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	139,420,198円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,575,116,005
合計		3,575,116,005

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,110,385,916	-	1,119,593,268	9,207,352
	メキシコペソ	169,541,399	-	170,881,312	1,339,913
	チェココルナ	100,322,627	-	100,761,234	438,607
	ハンガリーフォリント	51,017,763	-	51,160,712	142,949
	ポーランドズロチ	135,619,143	-	137,115,102	1,495,959
	マレーシアリンギット	174,077,120	-	175,768,425	1,691,305
	タイバーツ	161,464,744	-	163,075,705	1,610,961
	南アフリカランド	147,819,765	-	150,391,016	2,571,251
	オフショア人民元	170,523,355	-	170,439,762	83,593

合計	1,110,385,916	-	1,119,593,268	9,207,352
----	---------------	---	---------------	-----------

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	38,800,000.00	40,478,603.23			
		MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000.00	190,574,584.20			
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	164,337,384.85			
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	55,879,219.32			
		MBONO 7.5% 05/26/33	154,000,000.00	136,427,060.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	131,994,828.12			
		MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000.00	193,680,584.18			
		MBONO 7.75% 11/13/42	133,000,000.00	111,511,518.50			
		MBONO 7.75% 11/23/34	92,100,000.00	82,196,644.49			
		MBONO 7% 09/03/26	132,600,000.00	125,410,428.00			
		MBONO 8.5% 03/01/29	146,000,000.00	140,681,220.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000.00	134,677,233.54			
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	90,141,504.99			
		MBONO 8% 05/24/35	20,000,000.00	17,699,400.00			
		MBONO 8% 07/31/53	118,500,000.00	99,810,242.80			
		MBONO 8% 11/07/47	175,700,000.00	149,350,843.78			
		メキシコペソ 小計			2,041,200,000.00	1,864,851,300.00 (14,618,009,885)	
		国債証券	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	86,500,000.00	74,470,683.74	
				BLTN 0% 01/01/28	58,400,000.00	40,610,068.19	
				BLTN 0% 01/01/30	20,200,000.00	11,289,200.66	
BLTN 0% 07/01/25	68,000,000.00			62,023,175.35			
BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00			63,717,250.74			
BLTN 0% 07/01/27	64,500,000.00			47,419,066.14			
BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000.00			66,414,404.06			
BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000.00			49,106,904.95			
BNTNF 10% 01/01/31	33,850,000.00			31,802,676.71			
BNTNF 10% 01/01/33	28,900,000.00			26,898,241.09			
BNTNF 10% 01/01/35	8,000,000.00			7,369,523.72			

ブラジルリアル 小計		566,050,000.00	481,121,195.35 (13,013,029,306)	
チリペソ	BTPCL 0% 04/01/29	1,700,000,000.00	1,344,700,000.00	
	BTPCL 2.5% 03/01/25	1,985,000,000.00	1,957,205,013.68	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	2,160,000,000.00	2,137,918,646.16	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,290,000,000.00	2,182,948,740.25	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,360,000,000.00	2,243,301,341.76	
	BTPCL 5% 10/01/28	840,000,000.00	820,222,142.88	
	BTPCL 6.2% 10/01/40	1,400,000,000.00	1,479,886,485.00	
	BTPCL 6% 01/01/43	2,000,000,000.00	2,089,631,484.00	
	BTPCL 6% 04/01/33	2,550,000,000.00	2,616,916,176.90	
	BTPCL 7% 05/01/34	620,000,000.00	682,296,991.78	
チリペソ 小計		17,905,000,000.00	17,555,027,022.41 (2,782,577,113)	
コロンビア ペソ	COLTES 13.25% 02/09/33	12,000,000,000.00	14,158,999,800.00	
	COLTES 5.75% 11/03/27	25,000,000,000.00	22,895,422,750.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	33,000,000,000.00	32,696,204,970.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000.00	42,471,299,520.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000.00	36,472,367,708.70	
	COLTES 7.75% 09/18/30	7,000,000,000.00	6,466,669,720.00	
	COLTES 7% 03/26/31	10,700,000,000.00	9,418,359,243.00	
	COLTES 7% 06/30/32	10,000,000,000.00	8,499,308,800.00	
	COLTES 9.25% 05/28/42	3,000,000,000.00	2,594,808,210.00	
コロンビアペソ 小計		206,410,000,000.00	175,673,440,721.70 (6,379,932,346)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	6,950,000.00	5,922,842.61	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	9,250,000.00	8,492,342.67	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	10,400,000.00	10,645,300.53	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	11,300,000.00	11,313,841.37	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	1,750,000.00	1,820,450.08	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	11,129,750.83	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	12,100,000.00	12,817,660.68	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,800,000.00	10,436,178.46	
	PERUGB 7.6% 08/12/39	4,100,000.00	4,370,025.30	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,450,000.00	2,598,494.91	
	ペルーソル 小計		79,150,000.00	79,546,887.44 (3,114,634,513)
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,500,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,719,938.60	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	40,000,000.00	40,600,000.00	
ウルグアイペソ 小計		82,000,000.00	80,819,938.60 (293,764,312)	
	DOMREP 10.75% 06/01/36	70,000,000.00	73,867,500.00	

ドミニカペソ	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	43,226,423.60	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	38,327,685.76	
ドミニカペソ 小計		142,000,000.00	155,421,609.36	(380,782,942)
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	41,100,000.00	34,469,131.50	
	CZGB 0.25% 02/10/27	95,200,000.00	87,928,505.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	108,900,000.00	94,466,502.90	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	84,454,440.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	24,852,643.15	
	CZGB 1.75% 06/23/32	102,500,000.00	89,270,068.75	
	CZGB 1.95% 07/30/37	29,000,000.00	23,260,175.00	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	65,686,628.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	74,817,716.50	
	CZGB 2.5% 08/25/28	98,700,000.00	95,190,228.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	100,500,000.00	97,203,851.25	
	CZGB 2% 10/13/33	102,500,000.00	88,921,235.62	
	CZGB 3.5% 05/30/35	57,000,000.00	55,364,100.00	
	CZGB 3% 03/03/33	28,000,000.00	26,473,146.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	45,000,000.00	46,482,390.00	
	CZGB 4.5% 11/11/32	25,000,000.00	26,365,125.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	51,705,650.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	74,643,096.00	
	CZGB 5.75% 03/29/29	18,000,000.00	19,756,260.00	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	86,408,896.00	
CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	31,242,375.00		
CZGB 6% 02/26/26	68,000,000.00	70,518,856.00		
チェココルナ 小計		1,420,100,000.00	1,349,481,019.67	(8,705,637,005)
ハンガリーフォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	568,675,499.70	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	471,623,321.40	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	785,826,850.00	
	HGB 2.25% 04/20/33	872,000,000.00	647,967,852.80	
	HGB 2.25% 06/22/34	291,000,000.00	207,239,869.50	
	HGB 2.75% 12/22/26	685,500,000.00	638,628,252.00	
	HGB 2% 05/23/29	733,000,000.00	615,725,570.80	
	HGB 3.25% 10/22/31	1,042,000,000.00	874,087,952.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	242,992,052.10	
	HGB 3% 08/21/30	835,000,000.00	712,299,756.00	
	HGB 3% 10/27/27	932,000,000.00	854,692,930.00	
	HGB 3% 10/27/38	580,000,000.00	399,498,780.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	603,000,000.00	575,684,100.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	873,000,000.00	793,993,805.55	

	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	898,474,500.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	788,441,101.50	
	HGB 7% 10/24/35	340,000,000.00	357,280,126.00	
	HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	246,026,975.00	
ハンガリーフォリント 小計		12,014,000,000.00	10,679,159,294.35	(4,396,535,127)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	21,500,000.00	19,452,920.50	
	POLGB 0.75% 04/25/25	17,300,000.00	16,915,351.80	
	POLGB 0% 10/25/25	15,200,000.00	14,408,087.60	
	POLGB 1.25% 10/25/30	22,800,000.00	18,163,631.40	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	17,768,334.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	20,363,039.62	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	22,152,864.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	19,453,570.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000.00	34,820,829.30	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,835,473.65	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	20,451,444.02	
	POLGB 4.75% 07/25/29	13,400,000.00	13,191,354.49	
	POLGB 5% 10/25/34	6,600,000.00	6,467,703.00	
	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000.00	33,990,354.00	
	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000.00	30,962,856.00	
ポーランドズロチ 小計		329,450,000.00	311,397,814.08	(11,845,386,008)
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,736,249.12	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	11,100,000.00	10,595,005.50	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,643,951.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	10,205,832.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,410,291.76	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,456,850.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,555,017.82	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,352,600.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	10,200,000.00	8,829,911.52	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,622,238.50	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,331,783.16	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,300,000.00	7,240,229.57	
	ROMGB 5% 02/12/29	11,200,000.00	10,651,320.62	
	ROMGB 6.3% 04/25/29	5,500,000.00	5,501,355.75	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	9,600,000.00	9,655,920.00	
	ROMGB 7.1% 07/31/34	3,500,000.00	3,616,328.10	
	ROMGB 7.2% 05/31/27	5,800,000.00	5,947,464.42	
	ROMGB 7.2% 10/28/26	5,300,000.00	5,418,609.76	
ROMGB 7.2% 10/30/33	5,300,000.00	5,529,954.28		
ROMGB 7.35% 04/28/31	8,200,000.00	8,591,843.56		

	ROMGB 7.9% 02/24/38	6,100,000.00	6,768,194.00	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	10,200,000.00	11,208,882.00	
	ROMGB 8.75% 10/30/28	7,500,000.00	8,152,938.00	
	ROMGB 8% 04/29/30	9,100,000.00	9,740,594.50	
	ルーマニアレイ 小計	183,900,000.00	179,763,364.94 (5,859,081,282)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	43,200,000.00	40,475,573.42	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,722,285.57	
	MGS 3.582% 07/15/32	21,500,000.00	21,259,651.71	
	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000.00	43,443,110.70	
	MGS 3.757% 05/22/40	32,450,000.00	31,654,526.85	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,254,632.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,200,000.00	6,226,762.30	
	MGS 3.885% 08/15/29	24,800,000.00	25,227,725.60	
	MGS 3.899% 11/16/27	25,500,000.00	25,905,406.65	
	MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,754,173.30	
	MGS 3.906% 07/15/26	24,600,000.00	24,912,769.32	
	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000.00	34,197,564.03	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,750,000.00	13,572,303.25	
	MGS 4.254% 05/31/35	13,650,000.00	14,186,556.93	
	MGS 4.457% 03/31/53	7,500,000.00	7,838,141.25	
	MGS 4.504% 04/30/29	14,900,000.00	15,528,811.29	
	MGS 4.642% 11/07/33	14,000,000.00	14,936,496.40	
	MGS 4.696% 10/15/42	26,800,000.00	29,149,341.60	
	MGS 4.762% 04/07/37	18,500,000.00	20,129,069.30	
	MGS 4.893% 06/08/38	26,700,000.00	29,492,534.31	
MGS 4.921% 07/06/48	11,400,000.00	12,772,249.92		
	マレーシアリンギット 小計	448,650,000.00	457,639,686.20 (15,354,360,639)	
タイバーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	172,200,000.00	170,422,341.51	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	70,800,000.00	64,016,547.21	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	59,077,449.92	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	108,100,000.00	104,276,137.62	
	THAIGB 1% 06/17/27	203,000,000.00	196,349,403.32	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	202,766,513.86	
	THAIGB 2.25% 03/17/27	83,000,000.00	83,129,131.40	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,397,273.40	
	THAIGB 2.4% 03/17/29	118,000,000.00	118,620,621.00	
	THAIGB 2.4% 11/17/27	11,000,000.00	11,072,349.20	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	164,000,000.00	166,519,892.80	
	THAIGB 2.8% 06/17/34	118,000,000.00	120,748,880.80	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	97,866,034.49	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	103,543,079.00	

	THAIGB 2% 06/17/42	93,600,000.00	82,368,404.35	
	THAIGB 2% 12/17/31	123,000,000.00	119,547,038.22	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	158,591,018.42	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	157,000,000.00	167,112,542.70	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	170,000,000.00	183,775,848.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	169,147,640.16	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	151,000,000.00	162,088,760.50	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	136,500,000.00	147,070,177.80	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	196,780,428.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	107,569,796.02	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	188,500,000.00	210,679,136.20	
	タイバーツ 小計	3,272,300,000.00	3,345,536,445.90 (14,251,985,259)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,638,544,790.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	7,851,102,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	60,930,213,750.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000.00	107,385,790,660.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,793,201,280.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	37,800,000,000.00	36,174,308,184.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	115,000,000,000.00	112,931,246,600.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	26,100,000,000.00	25,411,311,306.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	100,500,000,000.00	100,421,019,060.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	74,921,045,615.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	53,000,000,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	82,000,000,000.00	81,702,340,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,895,402,800.00	
	INDOGB 6.875% 04/15/29	49,000,000,000.00	49,615,440,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	24,000,000,000.00	24,777,840,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	62,800,000,000.00	64,341,972,360.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	28,500,000,000.00	29,287,455,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	51,000,000,000.00	54,110,189,100.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	36,770,004,210.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	49,700,000,000.00	52,577,192,640.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,249,355,040.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	104,000,000,000.00	106,083,140,800.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,126,978,780.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	85,000,000,000.00	86,561,620,000.00	
INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	57,765,216,380.00		
INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,642,980,880.00		
INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,569,695,380.00		
INDOGB 8.375% 03/15/34	71,000,000,000.00	79,155,067,100.00		
INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,578,189,320.00		

	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,531,946,940.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	42,830,512,920.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,041,959,100.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,424,889,930.00	
インドネシアルピア 小計		1,573,800,000,000.00	1,613,097,171,925.00	(15,324,423,133)
インドルピー	IGB 5.77% 08/03/30	185,000,000.00	175,912,413.35	
	IGB 6.1% 07/12/31	150,000,000.00	144,263,470.50	
	IGB 6.99% 12/15/51	190,000,000.00	190,519,479.00	
	IGB 7.18% 07/24/37	110,000,000.00	112,923,547.00	
	IGB 7.18% 08/14/33	200,000,000.00	203,702,200.00	
	IGB 7.26% 08/22/32	170,000,000.00	174,439,873.00	
	IGB 7.36% 09/12/52	200,000,000.00	208,702,240.00	
	IGB 7.37% 10/23/28	140,000,000.00	142,884,280.00	
	IGB 7.38% 06/20/27	160,000,000.00	162,900,144.00	
	IGB 7.54% 05/23/36	130,000,000.00	136,372,691.00	
インドルピー 小計		1,635,000,000.00	1,652,620,337.85	(2,908,611,794)
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	204,700,000.00	214,198,080.00	
	SAGB 11.625% 03/31/53	35,000,000.00	35,973,000.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	50,612,885.90	
	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	73,654,113.00	
	SAGB 7% 02/28/31	122,700,000.00	107,086,425.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	198,500,000.00	180,322,739.65	
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	120,740,817.79	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	89,120,283.84	
	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000.00	149,382,664.24	
	SAGB 8.875% 02/28/35	230,000,000.00	203,596,000.00	
	SAGB 8% 01/31/30	210,100,000.00	198,968,525.92	
	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000.00	155,901,028.00	
南アフリカランド 小計		1,820,000,000.00	1,579,556,563.34	(13,047,137,213)
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,643,067.12	
	CGB 2.04% 02/25/27	26,000,000.00	26,173,880.20	
	CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,431,749.88	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,265,771.64	
	CGB 2.28% 03/25/31	13,000,000.00	13,144,604.20	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,150,626.00	
	CGB 2.35% 02/25/34	8,400,000.00	8,515,250.52	
	CGB 2.39% 11/15/26	2,000,000.00	2,028,566.00	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,196,142.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	16,600,000.00	16,929,948.24	
	CGB 2.46% 02/15/26	21,600,000.00	21,871,648.08	

CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,504,278.32	
CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,119,841.50	
CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,125,694.00	
CGB 2.52% 08/25/33	15,700,000.00	16,141,884.35	
CGB 2.54% 12/25/30	17,800,000.00	18,304,411.06	
CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	17,475,642.73	
CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	18,287,018.68	
CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,674,050.80	
CGB 2.62% 09/25/29	4,000,000.00	4,134,229.20	
CGB 2.64% 01/15/28	16,200,000.00	16,638,420.60	
CGB 2.67% 05/25/33	16,700,000.00	17,395,259.41	
CGB 2.67% 11/25/33	7,300,000.00	7,600,381.86	
CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	28,284,266.01	
CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,197,815.00	
CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,417,006.00	
CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	8,039,248.14	
CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,324,709.78	
CGB 2.76% 05/15/32	13,000,000.00	13,593,750.30	
CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,518,116.80	
CGB 2.8% 03/24/29	19,000,000.00	19,749,966.10	
CGB 2.8% 03/25/30	16,500,000.00	17,204,102.85	
CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,406,117.70	
CGB 2.85% 06/04/27	9,400,000.00	9,684,191.14	
CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	18,212,999.16	
CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,432,548.80	
CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,408,264.00	
CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,227,154.56	
CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	9,029,969.90	
CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,430,634.96	
CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,945,364.40	
CGB 3.12% 10/25/52	5,600,000.00	6,421,955.12	
CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,497,658.00	
CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,814,106.15	
CGB 3.19% 04/15/53	6,200,000.00	7,246,332.46	
CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,077,949.68	
CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,665,783.80	
CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,897,912.94	
CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,737,454.40	
CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,196,638.06	
CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	15,148,490.42	
CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,742,153.20	
CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	10,773,384.16	
CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	10,691,691.00	

	CGB 3.81% 09/14/50	14,800,000.00	18,802,476.48	
	CGB 3% 10/15/53	13,000,000.00	14,637,684.10	
	オフショア人民元 小計	683,100,000.00	716,210,261.96 (14,705,873,687)	
	合計		146,981,761,564 (146,981,761,564)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	9.9%
ブラジルレアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.9%
チリペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	1.9%
コロンビアペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	4.3%
ペルーソル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.1%
ウルグアイペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
チェココルナ	国債証券 22銘柄	100.0%	5.9%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.0%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	8.1%
ルーマニアレイ	国債証券 24銘柄	100.0%	4.0%
マレーシアリンギット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.4%
タイバーツ	国債証券 25銘柄	100.0%	9.7%
インドネシアルピア	国債証券 33銘柄	100.0%	10.4%
インドルピー	国債証券 10銘柄	100.0%	2.0%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	8.9%
オフショア人民元	国債証券 56銘柄	100.0%	10.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,443,224,714

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
投資証券	126,036,975,600
派生商品評価勘定	152,286,740
未収入金	21,656,124
未収配当金	1,027,022,490
未収利息	26,508
差入委託証拠金	412,696,007
流動資産合計	132,093,888,183
資産合計	132,093,888,183
負債の部	
流動負債	
前受金	152,989,640
未払金	129,368,062
未払解約金	167,812,229
流動負債合計	450,169,931
負債合計	450,169,931
純資産の部	
元本等	
元本	63,031,274,058
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,612,444,194
元本等合計	131,643,718,252
純資産合計	131,643,718,252
負債純資産合計	132,093,888,183

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	63,031,274,058口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0885円 (1万口当たり純資産額) (20,885円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	66,568,277,606円
期中追加設定元本額	14,674,118,014円
期中一部解約元本額	18,211,121,562円
期末元本額	63,031,274,058円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,835,562,934円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,991,491円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	16,357,607,035円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	33,833,713,816円
コア投資戦略ファンド（安定型）	994,368,691円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,667,921,955円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	2,029,781,182円

区分	2024年 8月20日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	749,595,751円
SMT インデックスバランス・オープン	22,037,136円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	234,857,516円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,749,688円
グローバル経済コア	508,919,573円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	19,276,880円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	532,715,549円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	151,850,097円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	1,157,188,770円
10資産分散投資ファンド	32,831,145円
グローバル10資産バランスファンド	53,691,752円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	347,949,979円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	13,234,035円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	591,219,204円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	86,095,451円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	497,002,824円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	273,991,738円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		3,422,741,807
合計		3,422,741,807

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 8月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	5,431,870,360	-	5,584,860,000	152,989,640
合計		5,431,870,360	-	5,584,860,000	152,989,640

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,753	326,230,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,985	341,116,000	

S O S i L A 物流リート投資法人	6,207	725,598,300	
東海道リート投資法人	2,125	248,412,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	4,296	2,839,656,000	
森ヒルズリート投資法人	14,629	1,871,049,100	
産業ファンド投資法人	22,778	2,819,916,400	
アドバンス・レジデンス投資法人	12,227	4,096,045,000	
アクティブ・プロパティーズ投資法人	6,047	2,092,262,000	
G L P 投資法人	41,788	5,516,016,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	6,299	1,981,035,500	
日本プロロジスリート投資法人	21,672	5,669,395,200	
星野リゾート・リート投資法人	2,631	1,339,179,000	
O n e リート投資法人	2,170	573,314,000	
イオンリート投資法人	15,260	2,038,736,000	
ヒューリックリート投資法人	10,993	1,576,396,200	
日本リート投資法人	4,041	1,319,386,500	
積水ハウス・リート投資法人	37,383	3,102,789,000	
トーセイ・リート投資法人	2,705	372,208,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,067	378,161,100	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,390	351,204,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	40,231	6,074,881,000	
いちごホテルリート投資法人	2,059	249,962,600	
ラサールロジポート投資法人	15,938	2,355,636,400	
スターアジア不動産投資法人	20,238	1,094,875,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,918	236,105,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	5,188	2,324,224,000	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	2,008	145,580,000	
投資法人みらい	17,131	765,755,700	
三菱地所物流リート投資法人	4,296	1,649,664,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,356	812,505,200	
ザイマックス・リート投資法人	2,130	253,683,000	
タカラレーベン不動産投資法人	7,013	678,858,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,451	714,081,000	
日本ビルファンド投資法人	14,513	9,157,703,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,779	7,105,124,000	
日本都市ファンド投資法人	62,675	5,809,972,500	
オリックス不動産投資法人	24,788	3,879,322,000	
日本プライムリアルティ投資法人	8,508	2,828,910,000	
N T T 都市開発リート投資法人	12,645	1,475,671,500	
東急リアル・エステート投資法人	8,341	1,268,666,100	
グローバル・ワン不動産投資法人	9,186	946,158,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	27,829	4,024,073,400	
森トラストリート投資法人	23,980	1,647,426,000	

インヴィンシブル投資法人	68,545	4,373,171,000	
フロンティア不動産投資法人	4,616	2,001,036,000	
平和不動産リート投資法人	9,122	1,206,840,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	8,359	2,190,058,000	
福岡リート投資法人	6,434	1,010,138,000	
KDX不動産投資法人	34,805	5,523,553,500	
いちごオフィスリート投資法人	9,077	766,098,800	
大和証券オフィス投資法人	5,154	1,577,124,000	
阪急阪神リート投資法人	5,932	780,651,200	
スタートプロシード投資法人	2,156	422,144,800	
大和ハウスリート投資法人	18,753	4,538,226,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	45,704	3,359,244,000	
大和証券リビング投資法人	18,374	1,899,871,600	
ジャパンエクセレント投資法人	10,683	1,311,872,400	
合計	808,361	126,036,975,600	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	176,013,215
コール・ローン	388,637,757
投資証券	122,170,191,211
派生商品評価勘定	4,636
未収入金	11,123,362
未収配当金	198,729,226
未収利息	2,318
流動資産合計	122,944,701,725
資産合計	122,944,701,725
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,595,906
未払金	72,894,816
未払解約金	193,914,183
流動負債合計	268,404,905
負債合計	268,404,905
純資産の部	
元本等	
元本	40,049,449,745
剰余金	
剰余金又は欠損金()	82,626,847,075
元本等合計	122,676,296,820

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
純資産合計	122,676,296,820
負債純資産合計	122,944,701,725

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,049,449,745口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.0631円 (1万口当たり純資産額) (30,631円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 8月20日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	36,111,716,588円
期中追加設定元本額	11,624,980,040円
期中一部解約元本額	7,687,246,883円
期末元本額	40,049,449,745円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	50,541,889円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	70,730,034円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,511,670,402円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,668,904円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,932,970,652円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,681,723,275円
コア投資戦略ファンド（安定型）	403,296,915円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,152,016,613円
分散投資コア戦略ファンドA	914,131,906円
分散投資コア戦略ファンドS	1,481,866,335円
コア投資戦略ファンド（切替型）	318,648,009円
SMT インデックスバランス・オープン	103,742,243円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	154,548,609円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,280,010円
グローバル経済コア	363,469,497円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,163,101円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	307,315,084円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	102,818,365円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	319,581,286円
10資産分散投資ファンド	17,452,419円
グローバル10資産バランスファンド	39,304,484円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,202,754,197円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	189,825,547円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,050,559円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	32,152,485円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	49,039,981円

区分	2024年 8月20日現在
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	84,504,514円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	84,961,328円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	84,595,585円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	82,505,712円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	81,687,719円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	41,321,115円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	54,110,971円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		21,309,383,210
合計		21,309,383,210

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

(2024年 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	301,652,540	-	300,061,270	1,591,270
	アメリカドル	254,707,600	-	253,303,893	1,403,707
	ユーロ	16,312,600	-	16,229,290	83,310
	オーストラリアドル	30,632,340	-	30,528,087	104,253
合計		301,652,540	-	300,061,270	1,591,270

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	56,433	1,213,309.50	
		AGREE REALTY CORP	57,626	4,166,359.80	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,332	826,774.56	
		ALEXANDER'S INC	1,336	295,964.08	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	89,110	10,302,898.20	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	99,864.00	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	747,688.32	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	37,338	716,142.84	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	183,609	7,079,963.04	
AMERICOLD REALTY TRUST	152,253	4,394,021.58	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	80,107	698,533.04	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	124,742	1,793,789.96	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	35,039	413,109.81	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	15,436.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,456	17,381,714.24	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	81,508.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	106,313	548,575.08	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	171,636	4,488,281.40	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	109,009	1,938,180.02	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	89,500.00	
BXP INC	81,757	5,827,638.96	
CAMDEN PROPERTY TRUST	60,656	7,242,932.96	
CARETRUST REIT INC	81,143	2,285,798.31	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	14,237	369,307.78	
CENTERSPACE	8,999	675,194.97	
CHATHAM LODGING TRUST	25,562	211,142.12	
CITY OFFICE REIT INC	15,298	87,045.62	
CLIPPER REALTY INC	7,300	32,777.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	288,964.20	
COPT DEFENSE PROPERTIES	65,404	1,877,748.84	
COUSINS PROPERTIES INC	85,700	2,349,894.00	
CTO REALTY GROWTH INC	12,400	237,708.00	
CUBESMART	128,035	6,299,322.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	123,244	1,038,946.92	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	508,800	305,280.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	184,332	27,395,421.84	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	379,600.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	93,480	1,429,309.20	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,918	787,105.62	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	27,537	5,039,271.00	
ELME COMMUNITIES	50,407	863,975.98	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	75,879	777,000.96	
EPR PROPERTIES	42,005	1,914,587.90	
EQUINIX INC	53,886	44,745,856.68	
EQUITY COMMONWEALTH	59,311	1,205,792.63	

EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	105,892	7,502,448.20
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	195,622	14,004,578.98
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	100,129	3,036,912.57
ESSEX PROPERTY TRUST	36,483	10,412,613.03
EXTRA SPACE STORAGE INC	120,435	20,381,215.05
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	281,400.00
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,257	4,772,505.58
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,446	4,129,159.58
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	50,711	1,371,732.55
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	73,097.07
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	153,770	7,659,283.70
GETTY REALTY CORP	27,420	847,278.00
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	21,056	309,102.08
GLADSTONE LAND CORP	16,220	221,889.60
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	350,700.48
GLOBAL NET LEASE INC	108,650	908,314.00
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	212,955	3,718,194.30
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	398,359	8,644,390.30
HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,762	1,836,900.12
HOST HOTELS AND RESORTS INC	400,439	6,739,388.37
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,572	347,505.84
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	126,789	2,482,528.62
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	158,201.82
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,679	1,874,424.45
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,939	1,126,679.19
INVITATION HOMES INC	326,321	11,626,817.23
IRON MOUNTAIN INC	166,813	18,289,377.32
JBG SMITH PROPERTIES	47,755	814,222.75
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	82,248.00
KILROY REALTY CORPORATION	59,364	2,039,747.04
KIMCO REALTY CORP	378,770	8,446,571.00
KITE REALTY GROUP TRUST	126,619	3,176,870.71
LINEAGE INC	32,300	2,832,064.00
LTC PROPERTIES INC	25,175	899,754.50
LXP INDUSTRIAL TRUST	170,594	1,678,644.96
MACERICH CO/THE	119,865	1,781,193.90
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	62,637.30
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	332,938	1,544,832.32
MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,295	10,119,931.75
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	39,809	1,718,952.62
NATL HEALTH INVESTORS INC	26,019	1,936,073.79

NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	261,092.56
NETSTREIT CORP	41,151	671,584.32
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,534	90,275.64
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	624,628.48
NNN REIT INC	103,860	4,776,521.40
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	52,528.02
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	138,989	5,239,885.30
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	222,542.12
ORION OFFICE REIT INC	34,844	133,104.08
PARAMOUNT GROUP INC	100,128	488,624.64
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	119,531	1,749,933.84
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	242,440.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	925,921.70
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	69,768	2,452,345.20
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	640,344.45
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	511,317.60
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	187,779.20
PRIME US REIT	324,500	59,059.00
PROLOGIS INC	525,400	65,517,380.00
PUBLIC STORAGE	89,815	29,017,430.20
REALTY INCOME CORP	494,524	30,096,730.64
REGENCY CENTERS CORP	93,166	6,569,134.66
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,747	1,133,164.52
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	124,195	6,332,703.05
RLJ LODGING TRUST	86,118	808,648.02
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	34,031	3,478,308.51
SABRA HEALTH CARE REIT INC	130,495	2,081,395.25
SAFEHOLD INC	23,595	563,448.60
SAUL CENTERS INC	6,846	268,637.04
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	416,649.07
SIMON PROPERTY GROUP	185,133	29,600,915.37
SITE CENTERS CORP	24,899	1,533,280.42
SL GREEN REALTY CORP	36,018	2,299,749.30
STAG INDUSTRIAL INC	103,605	4,106,902.20
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	457,316.96
SUN COMMUNITIES INC	70,687	9,338,459.57
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	114,627	1,171,487.94
TANGER INC	61,543	1,741,666.90
TERRENO REALTY CORP	55,234	3,755,912.00
UDR INC	172,022	7,214,602.68
UMH PROPERTIES INC	38,966	750,485.16

	UNITI GROUP INC	142,514	638,462.72
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	337,513.31
	URBAN EDGE PROPERTIES	65,756	1,305,256.60
	VENTAS INC	230,144	13,442,711.04
	VERIS RESIDENTIAL INC	47,792	789,045.92
	VICI PROPERTIES INC	592,767	19,021,893.03
	VORNADO REALTY TRUST	90,043	2,966,016.42
	WELLTOWER INC	339,276	39,199,949.04
	WHITESTONE REIT	25,954	344,669.12
	WP CAREY INC	124,240	7,266,797.60
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,969	750,544.29
	アメリカドル 小計	14,942,939	654,846,814.35 (95,902,315,961)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	646,571.64
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	204,120.90
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,593	1,105,382.76
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	170,810.00
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	65,400.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,706	2,334,365.88
	CHOICE PROPERTIES REIT	90,496	1,275,993.60
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	372,875.31
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	401,807.70
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	69,220	921,318.20
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	47,855.17
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,799	955,995.46
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,458	1,241,263.80
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	736,905.19
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	529,098.70
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	675,583.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	174,825.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,956	223,491.00
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	126,838.80
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	282,585.60
	PRIMARIS REIT	30,375	423,731.25
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	82,560.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	87,939	1,564,434.81
	SLATE GROCERY REIT	16,578	200,593.80
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	38,580	936,722.40

	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,486	40,508.58
	カナダドル 小計	897,898	15,741,638.55 (1,690,651,980)
ユーロ	AEDIFICA	26,407	1,613,467.70
	ALTAREA	2,775	280,830.00
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	328,199.58
	CARMILA	32,392	540,298.56
	COFINIMMO	21,600	1,329,480.00
	COVIVIO(FP)	27,329	1,340,214.16
	CROMWELL REIT EUR	170,400	231,744.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	596,466.00
	GECINA SA	29,614	2,829,617.70
	HAMBORNER REIT AG	37,000	240,870.00
	ICADE	17,487	353,936.88
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	71,803.75
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	169,963	932,247.05
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	256,000	230,400.00
	KLEPIERRE	112,276	2,991,032.64
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	22,979	185,440.53
	MERCIALYS	53,414	632,955.90
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	223,427	2,390,668.90
	MONTEA NV	9,926	805,991.20
	NSI NV	11,864	236,805.44
	RETAIL ESTATES	6,645	428,602.50
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	696,406.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	57,448	3,947,826.56
	VASTNED RETAIL	10,650	252,405.00
WAREHOUSES DE PAUW SCA	100,084	2,450,056.32	
WERELDHAVE NV	16,227	227,827.08	
XIOR STUDENT HOUSING NV	18,383	593,770.90	
	ユーロ 小計	1,534,452	26,759,364.85 (4,343,312,508)
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	130,487.18
	AEW UK REIT PLC	68,000	64,464.00
	ASSURA PLC	1,597,645	669,732.78
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	336,776.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	111,609	1,390,648.14
	BRITISH LAND CO PLC	524,948	2,108,191.16
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	68,677.48
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	186,952.24
	DERWENT LONDON PLC	64,392	1,473,288.96

	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	305,816.22
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	233,105	806,543.30
	HAMMERSON PLC	2,067,017	592,407.07
	HELICAL PLC	65,400	149,112.00
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	216,609.94
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	431,966	2,745,143.93
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	60,158.92
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,180,246	2,412,422.82
	NEWRIVER REIT PL	196,000	159,544.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	257,520.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730,219	703,931.11
	PRS REIT PLC/THE	260,002	228,801.76
	REGIONAL REIT LTD	22,200	28,416.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,385	1,044,517.92
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	103,200.00
	SEGRE PLC	763,989	6,845,341.44
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,093,936	1,611,367.72
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	668,864	502,985.72
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347,000	288,357.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	127,257.03
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,317,397	2,146,039.71
	UNITE GROUP PLC	252,857	2,413,520.06
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	261,651	322,354.03
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	207,903.62
	WORKSPACE GROUP PLC	83,057	512,461.69
	イギリス債券 小計	16,021,542	31,372,617.74 (5,966,130,715)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	224,474	244,676.66
	ABACUS STORAGE KING	347,779	417,334.80
	ARENA REIT	192,648	766,739.04
	BWP TRUST	309,156	1,134,602.52
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	796,967.10
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	985,313.31
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	243,695.15
	CHARTER HALL GROUP	264,477	3,313,896.81
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,694	1,393,767.80
	CHARTER HALL RETAIL REIT	307,930	1,083,913.60
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	558,956.44
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	287,859.20
	DEXUS	602,323	4,517,422.50
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	322,050.00

	GDI PROPERTY GROUP	315,597	195,670.14	
	GOODMAN GROUP	980,404	33,225,891.56	
	GPT GROUP	1,097,901	5,226,008.76	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	317,874.90	
	HEALTHCO REIT	300,321	364,890.01	
	HMC CAPITAL LTD	146,729	1,179,701.16	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	985,745	1,256,824.87	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	349,200.40	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	207,805	1,055,649.40	
	MIRVAC GROUP	2,199,457	4,376,919.43	
	NATIONAL STORAGE REIT	750,136	1,815,329.12	
	REGION RE GROUP	676,974	1,516,421.76	
	RURAL FUNDS GROUP	222,079	461,924.32	
	SCENTRE GROUP	2,955,904	10,079,632.64	
	STOCKLAND	1,360,265	6,338,834.90	
	VICINITY CENTERS	2,177,885	4,747,789.30	
	WAYPOINT REIT LTD	398,821	1,020,981.76	
	オーストラリアドル 小計	19,648,299	89,596,739.36 (8,824,382,859)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	507,278	580,833.31	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	585,524	1,253,021.36	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	923,753	872,946.58	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	877,392	1,180,092.24	
	ニュージーランドドル 小計	2,893,947	3,886,893.49 (348,265,656)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	1,972,230.00	
	FORTUNE REIT	875,000	3,605,000.00	
	LINK REIT	1,450,300	50,542,955.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,037,760.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,054,680.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,228,260.40	
	香港ドル 小計	6,111,960	59,440,885.40 (1,118,083,054)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	478,674.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,039,418	5,628,793.68	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,356,377	1,180,047.99	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	421,309.75	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,899,144	6,175,176.72	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	346,173.00	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-LOGOS REIT	3,505,364	911,394.64	

	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	332,100.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	628,862	1,452,671.22	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,602,996	1,619,025.96	
	KEPPEL DC REIT	799,503	1,630,986.12	
	KEPPEL REIT	1,231,400	1,034,376.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	917,650	500,119.25	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,146,463	2,694,188.05	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,973,985	2,546,440.65	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,283,473	1,642,845.44	
	PARAGON REIT	761,500	685,350.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	233,000	848,120.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	202,623.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	863,000	414,240.00	
	SUNTEC REIT	1,320,500	1,584,600.00	
	シンガポールドル 小計	24,999,456	32,375,960.07 (3,624,488,729)	
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	103,640,800.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	86,720	425,795,200.00	
	JR REIT XXVII	95,683	351,635,025.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	124,748,865.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	287,383,200.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	56,208,240.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	46,380	301,470,000.00	
	SK REITS CO LTD	75,914	387,920,540.00	
	韓国ウォン 小計	445,799	2,038,801,870.00 (224,268,205)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	597,600.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,532,835.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	155,000	1,106,700.00	
	イスラエルシェケル 小計	618,500	3,237,135.00 (128,291,544)	
	合計	88,114,792	122,170,191,211 (122,170,191,211)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 139銘柄	100.0%	78.5%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.4%

ユーロ	投資証券	27銘柄	100.0%	3.6%
イギリスポンド	投資証券	36銘柄	100.0%	4.9%
オーストラリアドル	投資証券	31銘柄	100.0%	7.2%
ニュージーランドドル	投資証券	4銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券	22銘柄	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券	8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年 8月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,270,756
コール・ローン	87,867,447
投資信託受益証券	32,765,595,518
派生商品評価勘定	1,426,632,238
未収利息	524
流動資産合計	34,287,366,483
資産合計	34,287,366,483
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,127
未払金	1,932,810,209
未払解約金	2,393,540
流動負債合計	1,935,295,876
負債合計	1,935,295,876
純資産の部	
元本等	
元本	21,517,807,288
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,834,263,319
元本等合計	32,352,070,607
純資産合計	32,352,070,607
負債純資産合計	34,287,366,483

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 8月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券

2024年 8月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2024年 8月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,517,807,288口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.5035円 (1万口当たり純資産額) (15,035円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月20日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

2024年 8月20日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	25,106,860,700円
期中追加設定元本額	2,800,757,400円
期中一部解約元本額	6,389,810,812円
期末元本額	21,517,807,288円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,434,912,462円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,557,515,681円
分散投資コア戦略ファンドA	1,929,983,078円
分散投資コア戦略ファンドS	7,669,032,598円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,135,354,307円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	269,791,908円
グローバル経済コア	1,660,070,195円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,979,900,037円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	719,389,272円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	185,126,063円
グローバル10資産バランスファンド	84,228,200円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	355,232,592円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	465,501,468円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	71,769,427円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 8月20日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	1,731,674,799	
合計	1,731,674,799	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

(2024年 8月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,002,768,127	-	90,275

	アメリカドル	2,002,768,127	-	2,002,858,402	90,275
	売建	34,220,416,652	-	32,793,966,816	1,426,449,836
	アメリカドル	34,220,416,652	-	32,793,966,816	1,426,449,836
	合計	36,223,184,779	-	34,796,825,218	1,426,540,111

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	4,725,075	223,732,301.25	
		アメリカドル 小計	4,725,075	223,732,301.25 (32,765,595,518)	
合計			4,725,075	32,765,595,518 (32,765,595,518)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【グローバル経済コア】

【純資産額計算書】

(2024年 9月30日現在)

資産総額	23,563,882,149円
負債総額	21,275,356円
純資産総額(-)	23,542,606,793円
発行済口数	14,910,641,201口
1口当たり純資産額(/)	1.5789円
(1万口当たり純資産額)	(15,789円)

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

資産総額	674,463,353,960円
負債総額	1,515,024,887円
純資産総額(-)	672,948,329,073円
発行済口数	242,341,869,199口
1口当たり純資産額(/)	2.7769円
(1万口当たり純資産額)	(27,769円)

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

資産総額	679,769,917,472円
負債総額	6,779,378,432円
純資産総額(-)	672,990,539,040円
発行済口数	509,858,434,543口
1口当たり純資産額(/)	1.3200円
(1万口当たり純資産額)	(13,200円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

資産総額	767,381,193,586円
負債総額	862,707,918円
純資産総額(-)	766,518,485,668円
発行済口数	117,167,283,618口

1口当たり純資産額（ / ）	6.5421円
（1万口当たり純資産額）	（65,421円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	358,765,531,491円
負債総額	351,575,139円
純資産総額（ - ）	358,413,956,352円
発行済口数	101,514,169,946口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5307円
（1万口当たり純資産額）	（35,307円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	222,428,236,941円
負債総額	656,476,256円
純資産総額（ - ）	221,771,760,685円
発行済口数	47,533,171,848口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6656円
（1万口当たり純資産額）	（46,656円）

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	154,390,317,667円
負債総額	87,519,567円
純資産総額（ - ）	154,302,798,100円
発行済口数	67,188,481,918口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2966円
（1万口当たり純資産額）	（22,966円）

J - R E I Tインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	110,716,670,209円
負債総額	391,708,101円
純資産総額（ - ）	110,324,962,108円
発行済口数	53,201,287,555口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0737円

（1万口当たり純資産額）	（20,737円）
--------------	-----------

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	127,210,683,457円
負債総額	110,465,444円
純資産総額（ - ）	127,100,218,013円
発行済口数	40,027,034,342口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1754円
（1万口当たり純資産額）	（31,754円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2024年 9月30日現在）

資産総額	36,901,494,474円
負債総額	235,366,969円
純資産総額（ - ）	36,666,127,505円
発行済口数	23,211,595,604口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5796円
（1万口当たり純資産額）	（15,796円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年 9月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

委託会社の機構は2024年11月20日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 9月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	532	15,497,778
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	60	209,691
単体型公社債投資信託	52	175,369
合計	644	15,882,839

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	49	510	460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

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

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種 類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(リ・ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
前事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

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

当事業年度（2024年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額1,017百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）は上記に含めておりません。

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

（２）時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

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

2. その他有価証券

前事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりませ

ん。
なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	185	1	33

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度(2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建				
	米ドル	152	-	3	3
合計		7,458	-	48	48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度(2024年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
	合計	8,231	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度(2023年3月31日)

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
----	---------------	-------------------------	-------------	---------------

市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
	合計	12,378	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		21	-	0
合計			5,082	-	88

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表
該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度109百万円、当事業年度122百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

- (ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

- (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2024年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年11月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社SBI証券	54,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	13,195	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2024年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年10月31日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル経済コアの2023年8月22日から2024年8月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル経済コアの2024年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。