

【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19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】	サテライト投資戦略ファンド（株式型）
【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】

サテライト投資戦略ファンド（株式型）

愛称として「サテラップ（株式型）」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々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20日から2025年 5月16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8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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 3,000億円

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	なし	その他	ロング・
債券		日本	ンズ		()	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、不動産投						
信、その他資		中近東				
産)資産配分変		(中東)				
更型))						
資産複合		エマージ				
()		ング				
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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. 世界の株式等の収益源泉を多面的に捉えた分散投資を行い、中期的な世界経済の成長果実を積極的に捉えます。

- 投資対象ファンドを通じて、主として相対的に高い収益が期待できる国内外の株式等^{*1}に分散投資を行い、積極的に世界経済の成長果実を享受することを目指します。

*1 株式等にはリート等の株式の代替資産も含まれます。

●リート(不動産投資信託)

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

2. 短期的な下振れリスクにも配慮した運用を目指します。

- 投資対象ファンドを通じてヘッジファンド^{*2}等にも投資することで、短期的な市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制し、ポートフォリオの収益の安定化を目指します。

*2 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへ見直します。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び景気・金融政策等を中心とする投資環境の局面判断等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。

当ファンドの運用について

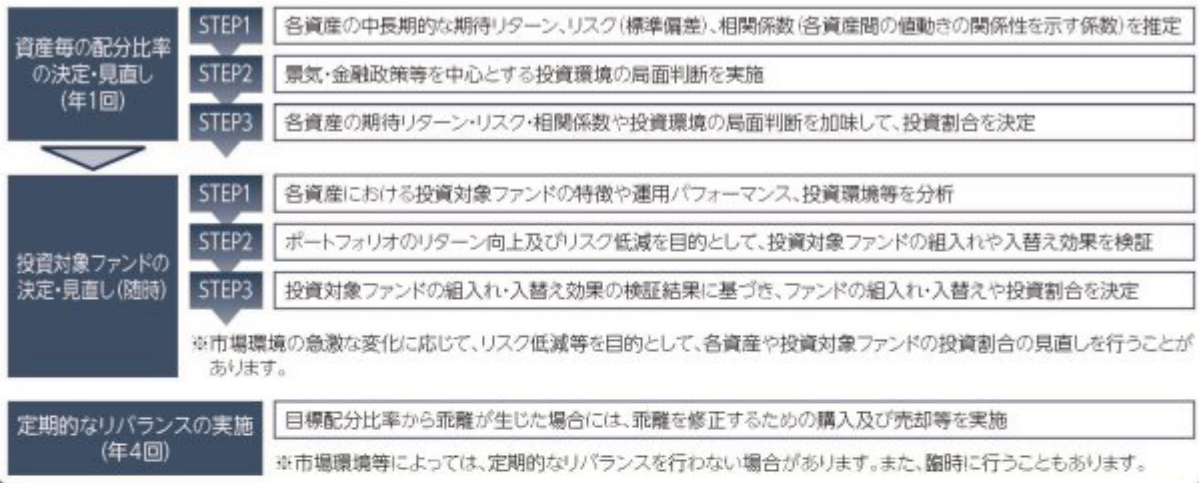
当ファンドは中期的に収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合もあらかじめ定めているものでもありません。運用者の判断に基づき、投資対象とする資産やファンドの追加・除外、またそれらへの投資割合の変更を行います。

当ファンドの投資対象ファンドの選定について

投資対象となる運用商品の見極め(デューデリジェンス)や組み入れ後のモニタリング等は、機関投資家ニーズの多様化・高度化に対応してきた三井住友信託銀行株式会社(委託会社の親会社である三井住友トラストグループ株式会社の連結子会社)のノウハウをもとに行います。

ポートフォリオ構築プロセス

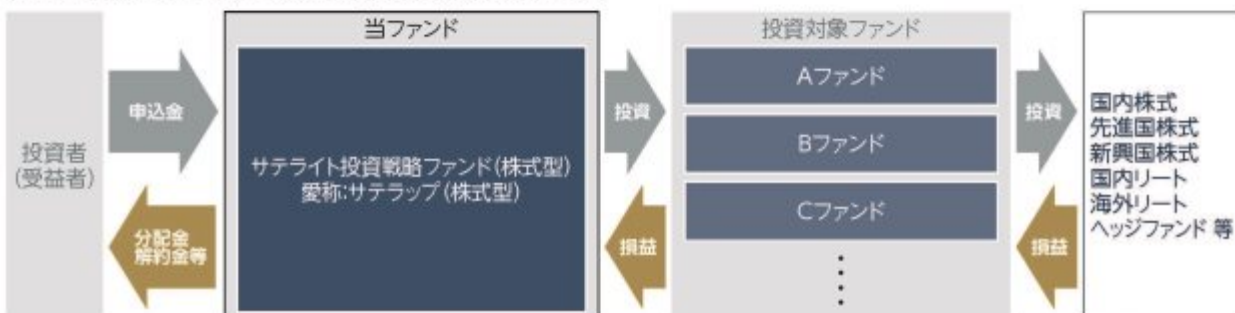
●運用に当たっては三井住友信託銀行から投資助言を受けます。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針(2) 投資対象 (参考)投資対象ファンドの概要」をご参照ください。

? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

- 年1回、毎決算時に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

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

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】

2015年 6月16日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2024年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。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

投資対象

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

投資態度

イ．主として、日本を含む先進国及び新興国の株式、株式代替資産^{*1}及びその他の様々な資産並びにヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンド^{*2}に分散投資します。

*1：この投資信託において、株式代替資産とは、不動産投資信託証券（REIT）、マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）、転換社債（CB）、その他上場有価証券、その他委託会社が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

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

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

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

ニ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

- 1．為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2024年 9月30日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

1. F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	国内株式エンハンス運用戦略マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資を行ない、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ）の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。</p> <p>株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</p> <p>ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：2月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の利息・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.374%（税抜 0.34%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年1月30日
信託期間	2015年1月30日から2035年2月15日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIX

に関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みT O P I Xに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、配当込みT O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、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J P Xは責任を負いません。

2.国内株式インデックス マザーファンド

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

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

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

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

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

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

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

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

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

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

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

3. 日本株式E S Gセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年1回：4月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、親指数（MSCIジャパンIMI）構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc.（以下「MSCI」）、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者（総称して「MSCI当事者」）が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使

用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害（逸失利益を含む）について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

4. 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ）に対する超過リターンを目指します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として信託財産総額の90%以上とします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>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、金利先渡取引を行うことができます。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2002年12月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「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。

5. 国内株式アクティブバリューフンド（適格機関投資家専用）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（TOPIX（東証株価指数）（配当込み））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 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およびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜 0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広

範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。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。

6. 日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。</p> <p>信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。</p> <p>事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。</p> <p>投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。</p> <p>ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。</p> <p>市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>決算日</p>	<p>年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。</p> <p>分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。</p> <p>収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜 0.645%）</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額</p>
<p>設定日</p>	<p>2014年6月10日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>みずほ信託銀行株式会社</p>

7.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

<p>運用会社</p>	<p>三井住友DSアセットマネジメント株式会社</p>
-------------	-----------------------------

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、T O P I X（東証株価指数）（配当込み）（ ）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュースタック指標（P B R、P E R、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。 <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>安定した収益の確保および効率的な運用を行うためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行いません。</p> <p>イ．投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的</p> <p>ロ．信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託者が決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜 0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIXに関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）に帰属します。JPXは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、JPXは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

8. SMDAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
------	----------------------

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本グロース株マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を主要投資対象とし、GARP（Growth at a Reasonable Price）戦略に基づき、アクティブ運用することにより信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>銘柄選定に関しては、ボトムアップ・アプローチによる定性分析とバリュエーション分析を重視し、組織運用による銘柄選定を行います。</p> <p>TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（ ）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <p>株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>資金動向、市況動向、残存期間等及びやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託者の判断により分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については特に制限を定めず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>

信託報酬	純資産総額に対して以下に定める率とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜 0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜 0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜 0.35%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年3月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社J P X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に関する知的財産権その他一切の権利は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）に帰属します。J P Xは、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章または商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、J P Xは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

9. 外国株式インデックス マザーファンド

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

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

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

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

10. 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

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

運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：6月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年7月8日

信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCIコクサイESGリーダーズ指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「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。

当ファンドは、MSCI Inc.(以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

11. 新興国株式インデックス マザーファンド

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

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

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

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

12. ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンブルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。</p> <p>MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（ ）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。</p> <p>「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。</p> <p>資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。</p> <p>MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。</p> <p>マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。</p> <p>外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。</p> <p>資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。</p>
-------------	--

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>純資産総額に対し、年率0.671%（税抜 0.61%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2021年9月24日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCIオール・カン

トリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc.に帰属します。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

13. ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	<p>ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資対象></p> <p>日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。</p>
投資態度	<p>主として、ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。</p> <p>MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）（ ）をベンチマークとします。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。</p> <p>徹底的なリサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。</p> <p>運用にあたっては、Sanders Capital, LLCに運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。</p> <p>MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（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。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	MSCI KOKUSA1 Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<ul style="list-style-type: none"> ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・ 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・ 留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7381%（税抜 0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI KOKUSA1 Index（配当込・税引後）」は、MSCI Inc.が公表している指数であり、日本を除く主

要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利は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。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

14. 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	世界エクイティ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。以下同じ。）
投資態度	主として、世界エクイティ・マザーファンド受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。 なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> 主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 株式の銘柄選定にあたっては、市場動向や銘柄毎の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 運用指図権限を日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッドに委託します。
主な投資制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則として以下の通り収益分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益及び売買益（評価益を含む）等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

信託報酬	<p>純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜 0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜 0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜 0.54%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年12月16日
信託期間	2022年12月16日から2038年5月20日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

15.Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。</p> <p>投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス（ESG）や社会的規範を考慮した運用を行います。</p> <p>市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。</p> <p>市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>年率0.525%</p> <p>その他の費用 ファンド管理費用がかかります。</p> <p>その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日

信託期間	無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社 キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル ・ 投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・ 管理事務代行会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・ 名義書換事務受託会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・ 保管受託銀行 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）

16. J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券
投資態度	<p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証券、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「東証REIT指数」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

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

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

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

J P Xは、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

17. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券
投資態度	<p>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。</p> <p>不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに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並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。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&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。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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せん。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されていません。Standard & Poor's^(R)及びS&P^(R)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^(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow

Jones、S&P又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

18. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 > （2024年 9月30日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares

投資態度

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

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

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

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

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。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p> <p>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。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、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ます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>LBMA金価格（円ヘッジベース）（ ）（2024年 9月30日現在）</p> <p>ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。</p>
<p>決算日</p>	<p>年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）</p>
<p>収益の分配</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>信託財産留保額</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>設定日</p>	<p>2017年10月11日</p>
<p>信託期間</p>	<p>原則として無期限</p>
<p>受託会社</p>	<p>三井住友信託銀行株式会社</p>

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11時に公表される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。

19. BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。 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。
主な投資制限	投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・ 投資顧問会社 RBC Global Asset Management (UK) Limited ・ 副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc. ・ 管理事務代行会社 / 名義書換事務受託会社 / 保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

20. ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券（当マザーファンドの説明において、以下「円建債券」といいます。）を主要投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	円建債券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」（以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」といいます。）の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。</p> <p>Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券です。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：8月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2015年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

21. F O F s用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）

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

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：10月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

22. 米国株式LSマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

主要投資対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券（以下「米ドル建債券」といいます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。</p> <p>米ドル建債券への投資額のうち、マーケット・ニュートラル戦略による運用に用いられない余剰資金は、原則として米ドル建MMFもしくはそれに類するもの又は米ドル建公社債、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券もしくは短期金融商品等により運用されます。</p> <p>米ドル建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

運用にあたっては、三井住友信託銀行（委託者の親会社である三井住友トラストグループ株式会社の連結子会社）から、米ドル建債券に係るマーケット・ニュートラル戦略の運用会社等に係る有用な情報の提供等の投資助言を受けます。ただし、今後変更となる場合があります。

23. コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主としてブルームバーグ商品指数（ ）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」 1とといいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券 2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。</p> <p>2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。</p>
投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBS セキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。

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

24. G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。 債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

25. ノムラF0Fs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	野村アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本成長株投資マザーファンド受益証券および野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、TOPIX（東証株価指数）を対象とした株価指数先物取引（以下、「株価指数先物取引」といいます。）を主要取引対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

投資態度

各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。

非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<日本成長株投資マザーファンドの投資態度>

わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。

ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

<野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度>

株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。

ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜 0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

26. ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。
主要投資対象	「ウェスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 主に日本の公社債を主要投資対象とし、為替予約取引等を積極的に活用します。

投資態度	<p>ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。</p> <p>ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>主に、日本の公社債に投資するとともに、主要先進国通貨を中心とした為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。</p> <p>モデルによる定量分析とポートフォリオマネージャーによる定性分析を組み合わせた独自のアプローチにより、ポートフォリオを構築します。</p> <p>リスク管理を運用プロセスに組み込み、ポジション・リスクの分散化を図ります。</p> <p>資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるウエスタン・アセット・マネジメント株式会社及びウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド（在英国）に委託します。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.418%（税抜 0.38%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p> <p>投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

27.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	UBS Asset Management (Americas) LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
投資態度	公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%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、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 投資信託証券への投資は行いません。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 運用会社 UBS Asset Management (Americas) LLC ・ 保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited
------	--

28.MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
運用の基本方針	オルタナティブ運用手法を活用して投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物に投資します。
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・ 主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物で運用します。 ・ トレーディング・アドバイザーの支援を受けて、各先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉します。 ・ 各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築します。 ・ 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。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 先物での運用割合（想定元本ベース）は、投資信託財産の純資産総額の90%以上とします。 ・ 現物の空売りは行いません。 ・ 発行体の法的支配や経営権の取得を企図した有価証券の取得を行いません。 ・ 投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月の最終ファンド営業日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	固定報酬：年率0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年12月19日
信託期間	原則として無期限

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社（マネージャー） SG Kleinwort Hambros Corporate Services (CI) Limited ・ 投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー） Graham Capital Management, L.P. ・ 副管理会社（サブ・マネージャー） Amundi Asset Management S.A.S ・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） Societe Generale Securities Services France S.A. ・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） CACEIS Bank, Luxembourg Branch ・ 保管受託銀行（カストディ） SG Kleinwort Hambros Trust Company (CI) Limited
------	---

29. 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	<p>主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略¹に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>1) この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き²を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。</p> <p>2) 当該戦略の参照対象は、S&P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含まれます。</p>
投資態度	<p>円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。</p> <p>円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

- ・年1回、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．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ニ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ．公社債の借入れの指図及び範囲

（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。

ヘ．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。

ト．外国為替予約取引の指図

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

チ．資金の借入れ

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

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

（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。

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

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

< その他の投資制限 >

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

債券の価格は、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。

リートの価格変動リスク

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

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。なお、投資対象ファンドにおいて、外貨建資産について、為替予約を活用し、為替変動リスクの低減を図る場合がありますが、完全にヘッジすることはできませんので、外貨の為替変動の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジを行う通貨の短期金利と円短期金利を比較して、円短期金利の方が低い場合には、当該通貨と円の金利差相当分のコストがかかりますが、さらに需給要因等によっては金利差相当分を上回るコストがかかる場合があることにご留意ください。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、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。

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

仕組み債券に係るリスク

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

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

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

ブローカーの信用リスク

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

有価証券の貸付等に係るリスク

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

ESGの投資リスク

一部の投資対象ファンドにおいては、ESGを投資対象選定の主要な要素としており、ESG評価が相対的に高い企業の発行する有価証券を選別して組み入れます。

ESG評価と短期的な有価証券の値動きには必ずしも関連性があるわけではありません。また、ESG評価がファンドの収益源となる場合もありますが、損失が発生する要因となる場合もあります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

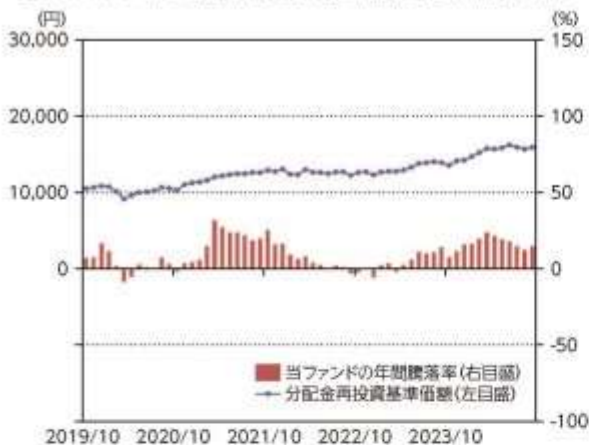
(2) リスクの管理体制

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新研が算出・公表する指数で、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの両価算出方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、株式会社JPX新研又は株式会社JPX新研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利ノウハウ及び同指数に係る権利又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Market インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Market 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・サービスに際し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき自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 JPM Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

取得申込受付日の翌々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。

当ファンドが投資対象ファンドに投資する際に信託財産留保額（ 3 ）がかかる場合、当該信託財産留保額を当ファンドが負担します。

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

（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>

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

（ 3 ）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 1.628%（税抜 1.48%）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 1.023% （税抜 0.93%）	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 0.55% （税抜 0.5%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

2024年11月19日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.374%（税抜 0.34%）
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.517%（税抜 0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.7095%（税抜 0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.495%（税抜 0.45%）
SMDAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	<ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜 0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜 0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜 0.35%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.671%（税抜 0.61%）
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	年率 0.7381%（税抜 0.671%）
世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	<ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜 0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜 0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜 0.54%）

Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率 0.525%
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	年率 0.74%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	ありません。
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066%（税抜 0.06%）
米国株式LSマザーファンド	ありません。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。
GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.506%（税抜 0.46%）
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンド S（適格機関投資家専用）	年率 0.418%（税抜 0.38%）
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率 0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	固定報酬：年率 0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。

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

実質的な信託報酬率：年率1.628%～2.18965%程度（税抜 1.48%～2.0013%程度）
（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.56165%程度（税抜0.0%～0.5213%程度））

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

（４）【その他の手数料等】

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

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、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（投資対象ファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

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

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとし、

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。

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

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

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

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

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN

AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかりません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式LSマザーファンド

主要投資対象である米ドル建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・米ドル建債券の評価額に対して年率0.38%が発行・管理手数料等としてかかります。加えて保管費用として年率0.02%、その他管理費用等がかかりません。
- ・マーケット・ニュートラル戦略による運用額に対する運用報酬として年率2.00%、純資産価値算出費用として年率0.03%、有価証券の売買費用、借株費用、その他管理費用等がかかりません。
- ・米ドル建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・コモディティLSアルファ・マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

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

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

主要投資対象である円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・円建債券の評価額に対して年率上限0.5%程度（投資比率による加重平均）の発行・管理手数料等がかかりません。
- ・円建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

	税 率（内 訳）
--	----------

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

個別元本について

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

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

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

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当
該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配
金）について」をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象
となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせくださ
い。

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

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率 ¹	その他費用の比率 ²
1.93%	1.62%	0.31%

※対象期間は2023年2月18日～2024年2月19日です。

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

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年9月30日現在の状況について記載してあります。

【サテライト投資戦略ファンド(株式型)】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	3,910,337,122	41.65
投資証券	ルクセンブルク	418,422,737	4.46
	ケイマン	291,247,171	3.10
	ジャージー	265,257,623	2.83
	小計	974,927,531	10.38
親投資信託受益証券	日本	4,000,664,960	42.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		503,647,164	5.36
合計(純資産総額)		9,389,576,777	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	投資信託受益証券	FOfs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	290,806,163	1.6917	491,985,575	1.9309	561,517,620	5.98
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	295,302,043	1.7683	522,202,092	1.8724	552,923,545	5.89
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	189,957,492	2.7122	515,202,710	2.7769	527,492,959	5.62
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	142,943,632	2.8178	402,786,567	3.1754	453,903,209	4.83
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	293,219,702	1.4061	412,296,222	1.5051	441,324,973	4.70

日本	投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	285,129,610	1.3612	388,118,425	1.547	441,095,506	4.70
日本	投資信託受益証券	ニッセイ/サンダース・グローバルバリュース株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	238,478,027	1.5966	380,754,017	1.8079	431,144,425	4.59
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	65,295,576	5.9840	390,728,727	6.5421	427,170,187	4.55
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	134,069,589	2.889	387,327,042	3.1525	422,654,379	4.50
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	172,616,641	2.231	385,107,726	2,424	418,422,737	4.46
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）	261,658,599	1.2461	326,052,781	1.5796	413,315,922	4.40
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	174,050,641	1.9903	346,412,991	2.0737	360,928,814	3.84
日本	親投資信託受益証券	米国株式LSマザーファンド	259,694,531	1.2274	318,749,068	1.2168	315,996,305	3.37
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	29,018	10,071.79	292,263,202	10,036.77	291,247,171	3.10
日本	親投資信託受益証券	コモディティLSアルファ・マザーファンド	229,107,994	1.2461	285,491,472	1.2646	289,729,969	3.09
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式エンハンス運用戦略ファンド（適格機関投資家専用）	111,612,704	2.2777	254,220,255	2.4849	277,346,408	2.95
ジャージー	投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	26,219	10,507.34	275,491,947	10,117	265,257,623	2.83
日本	親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）	237,616,348	1.1203	266,201,595	1.1065	262,922,489	2.80
日本	親投資信託受益証券	ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	228,207,449	1.0286	234,734,183	1.0482	239,207,048	2.55
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	97,766,456	2.2122	216,278,953	2.3198	226,798,624	2.42
日本	投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	252,903,778	0.8401	212,464,463	0.8374	211,781,623	2.26
日本	親投資信託受益証券	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	174,857,855	0.9044	158,141,444	0.8743	152,878,222	1.63
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	32,497,669	4.1573	135,102,560	4.6656	151,621,124	1.61
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	130,865,973	1.1807	154,513,454	1.1337	148,362,753	1.58
日本	親投資信託受益証券	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	84,973,097	1.5914	135,226,187	1.7247	146,553,100	1.56
日本	投資信託受益証券	SMDAM日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	133,035,715	1.0415	138,570,000	1.0773	143,319,375	1.53
日本	親投資信託受益証券	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	84,681,133	1.4682	124,328,840	1.5332	129,833,113	1.38
日本	親投資信託受益証券	日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	21,267,790	6.0756	129,214,585	6.0708	129,112,499	1.38
日本	投資信託受益証券	ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	61,691,814	0.8416	51,924,704	0.844	52,067,891	0.55

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	41.65
投資証券	10.38
親投資信託受益証券	42.61
合計	94.64

(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 (2016年 2月17日)	37,286,279,341	37,286,279,341	8,647	8,647
第2期計算期間末 (2017年 2月17日)	30,621,118,809	30,621,118,809	9,555	9,555
第3期計算期間末 (2018年 2月19日)	18,433,690,243	18,433,690,243	10,131	10,131
第4期計算期間末 (2019年 2月18日)	18,337,969,638	18,337,969,638	9,864	9,864
第5期計算期間末 (2020年 2月17日)	13,138,863,682	13,138,863,682	10,917	10,917
第6期計算期間末 (2021年 2月17日)	11,518,211,025	11,518,211,025	11,845	11,845
第7期計算期間末 (2022年 2月17日)	9,679,176,610	9,679,176,610	12,563	12,563
第8期計算期間末 (2023年 2月17日)	8,916,277,272	8,916,277,272	12,791	12,791
第9期計算期間末 (2024年 2月19日)	9,401,714,979	9,401,714,979	15,024	15,024
2023年 9月末日	8,997,442,794		13,886	
10月末日	8,713,806,174		13,536	
11月末日	9,026,780,639		14,125	
12月末日	8,965,925,488		14,199	
2024年 1月末日	9,237,641,504		14,700	
2月末日	9,401,240,782		15,199	
3月末日	9,625,654,763		15,732	
4月末日	9,538,632,644		15,673	
5月末日	9,547,902,879		15,840	
6月末日	9,729,748,403		16,211	
7月末日	9,473,773,181		15,899	
8月末日	9,299,249,836		15,675	
9月末日	9,389,576,777		15,899	

【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	2015年 6月16日～2016年 2月17日	0
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	0
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	0
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	0

第8期計算期間	2022年 2月18日～2023年 2月17日	0
第9期計算期間	2023年 2月18日～2024年 2月19日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	13.5
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	10.5
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	6.0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.6
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	10.7
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	8.5
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	6.1
第8期計算期間	2022年 2月18日～2023年 2月17日	1.8
第9期計算期間	2023年 2月18日～2024年 2月19日	17.5
第10期中間計算期間	2024年 2月20日～2024年 8月19日	4.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	49,526,375,760	6,407,778,915	43,118,596,845
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	11,056,157,024	22,127,791,489	32,046,962,380
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	8,740,142,510	22,591,145,594	18,195,959,296
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	7,015,265,506	6,619,741,116	18,591,483,686
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	1,220,521,390	7,776,843,668	12,035,161,408
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	167,978,519	2,478,672,606	9,724,467,321
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	97,944,390	2,117,977,175	7,704,434,536
第8期計算期間	2022年 2月18日～2023年 2月17日	70,367,550	804,261,025	6,970,541,061
第9期計算期間	2023年 2月18日～2024年 2月19日	62,444,897	775,139,085	6,257,846,873
第10期中間計算期間	2024年 2月20日～2024年 8月19日	27,952,723	348,436,638	5,937,362,958

(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。

日本株式ESGセレクト・リーダーズ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	16,469,577,980	98.15
投資証券	日本	81,441,300	0.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		228,512,234	1.36
合計(純資産総額)		16,779,531,514	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	227,685,000	1.36

(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	443,600	3,455.29	1,532,769,630	2,542.50	1,127,853,000	6.72
日本	株式	日立製作所	電気機器	200,300	2,894.18	579,704,676	3,781.00	757,334,300	4.51
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	269,500	2,564.78	691,210,263	2,777.50	748,536,250	4.46
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	64,200	7,001.72	449,510,493	8,705.00	558,861,000	3.33
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	162,300	2,918.90	473,738,301	3,045.00	494,203,500	2.95
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	19,400	35,450.56	687,740,934	25,290.00	490,626,000	2.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	81,200	4,836.19	392,699,305	5,231.00	424,757,200	2.53

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	51,400	6,861.23	352,667,555	7,678.00	394,649,200	2.35
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	8,200	44,151.60	362,043,153	47,420.00	388,844,000	2.32
日本	株式	第一三共	医薬品	79,900	4,762.12	380,493,596	4,709.00	376,249,100	2.24
日本	株式	任天堂	その他製品	44,900	7,749.63	347,958,696	7,636.00	342,856,400	2.04
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	104,200	2,910.64	303,289,192	2,936.00	305,931,200	1.82
日本	株式	KDDI	情報・通信業	66,300	4,434.58	294,013,122	4,594.00	304,582,200	1.82
日本	株式	HOYA	精密機器	15,200	17,742.89	269,692,038	19,785.00	300,732,000	1.79
日本	株式	三菱重工業	機械	138,500	1,405.40	194,648,649	2,117.50	293,273,750	1.75
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,234,000	191.53	236,348,811	187.20	231,004,800	1.38
日本	株式	ダイキン工業	機械	11,400	20,126.31	229,439,946	20,075.00	228,855,000	1.36
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	33,100	6,064.62	200,739,162	6,741.00	223,127,100	1.33
日本	株式	富士通	電気機器	71,600	2,427.69	173,823,064	2,935.50	210,181,800	1.25
日本	株式	村田製作所	電気機器	73,100	2,751.81	201,157,470	2,806.50	205,155,150	1.22
日本	株式	M S & A D インシュアランスグループホールディングス	保険業	55,600	2,816.72	156,609,739	3,330.00	185,148,000	1.10
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	48,400	3,371.35	163,173,762	3,688.00	178,499,200	1.06
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	47,100	4,564.49	214,987,502	3,698.00	174,175,800	1.04
日本	株式	ファナック	電気機器	40,900	4,214.54	172,374,925	4,190.00	171,371,000	1.02
日本	株式	オリックス	その他金融業	49,900	3,206.00	159,979,725	3,318.00	165,568,200	0.99
日本	株式	小松製作所	機械	40,000	4,378.68	175,147,430	3,966.00	158,640,000	0.95
日本	株式	三井不動産	不動産業	115,400	1,559.59	179,977,751	1,338.00	154,405,200	0.92
日本	株式	TDK	電気機器	84,000	1,540.80	129,427,905	1,823.00	153,132,000	0.91
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	72,700	2,615.98	190,181,849	2,079.00	151,143,300	0.90
日本	株式	日本電気	電気機器	10,600	11,294.87	119,725,669	13,750.00	145,750,000	0.87

(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	鉱業	0.47
		建設業	1.80
		食料品	3.06
		繊維製品	0.39
		化学	5.91
		医薬品	4.10
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.82
		ガラス・土石製品	0.50
		鉄鋼	1.16
		非鉄金属	0.58
		金属製品	0.13
		機械	5.98

電気機器	23.19
輸送用機器	7.22
精密機器	2.22
その他製品	3.16
電気・ガス業	1.13
陸運業	1.87
海運業	0.62
空運業	0.13
倉庫・運輸関連業	0.02
情報・通信業	4.74
卸売業	3.61
小売業	4.54
銀行業	5.34
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	4.73
その他金融業	1.05
不動産業	2.36
サービス業	5.86
小計	98.15
投資証券	0.49
合計	98.64

(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	ミニTOPIX先物	買建	86円		233,077,068	227,685,000	1.36

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

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

日本株式エクセレント・フォーカス 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	46,179,614,200	98.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		603,192,948	1.29
合計(純資産総額)		46,782,807,148	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	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	MARUWA	ガラス・ 土石製品	64,000	31,063.24	1,988,047,683	41,950.00	2,684,800,000	5.74
日本	株式	川崎重工業	輸送用機 器	374,000	3,947.08	1,476,211,031	5,805.00	2,171,070,000	4.64
日本	株式	三越伊勢丹ホールディング ス	小売業	935,500	2,044.35	1,912,496,592	2,226.00	2,082,423,000	4.45
日本	株式	三菱重工業	機械	947,900	1,069.11	1,013,418,558	2,117.50	2,007,178,250	4.29
日本	株式	日立製作所	電気機器	516,300	2,362.46	1,219,742,474	3,781.00	1,952,130,300	4.17
日本	株式	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ	銀行業	1,219,100	1,375.32	1,676,655,043	1,453.50	1,771,961,850	3.79
日本	株式	信越化学工業	化学	288,400	5,628.02	1,623,121,087	5,977.00	1,723,766,800	3.68
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	67,100	28,431.18	1,907,732,684	25,290.00	1,696,959,000	3.63
日本	株式	三井住友フィナンシャルグ ループ	銀行業	538,400	2,641.04	1,421,941,108	3,045.00	1,639,428,000	3.50
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	584,900	2,576.66	1,507,089,048	2,777.50	1,624,559,750	3.47
日本	株式	リクルートホールディング ス	サービ ス業	182,600	5,946.70	1,085,867,510	8,705.00	1,589,533,000	3.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	21,200	65,019.51	1,378,413,739	68,360.00	1,449,232,000	3.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	479,100	2,647.15	1,268,249,815	2,952.50	1,414,542,750	3.02
日本	株式	第一三共	医薬品	296,200	4,323.90	1,280,741,887	4,709.00	1,394,805,800	2.98
日本	株式	ディスコ	機械	34,300	39,714.91	1,362,221,680	37,490.00	1,285,907,000	2.75
日本	株式	野村総合研究所	情報・通 信業	226,200	4,236.85	958,376,079	5,300.00	1,198,860,000	2.56
日本	株式	マツキヨココカラ&カンパ ニー	小売業	481,000	2,522.93	1,213,529,740	2,353.00	1,131,793,000	2.42
日本	株式	荏原製作所	機械	468,100	2,489.07	1,165,137,020	2,327.50	1,089,502,750	2.33
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	145,700	5,475.00	797,708,004	6,741.00	982,163,700	2.10
日本	株式	村田製作所	電気機器	335,300	2,927.52	981,598,623	2,806.50	941,019,450	2.01
日本	株式	NTTデータグループ	情報・通 信業	349,700	2,362.56	826,189,464	2,574.50	900,302,650	1.92
日本	株式	富士電機	電気機器	101,400	7,361.23	746,429,349	8,620.00	874,068,000	1.87
日本	株式	西武ホールディングス	陸運業	265,600	2,025.62	538,004,836	3,191.00	847,529,600	1.81
日本	株式	S M C	機械	12,600	76,679.21	966,158,083	63,650.00	801,990,000	1.71
日本	株式	H O Y A	精密機器	36,700	17,333.77	636,149,585	19,785.00	726,109,500	1.55
日本	株式	ダイフク	機械	260,200	2,882.53	750,036,761	2,761.50	718,542,300	1.54
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	309,800	1,997.82	618,927,612	2,295.50	711,145,900	1.52
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	274,300	3,099.75	850,263,038	2,542.50	697,407,750	1.49
日本	株式	ユニ・チャーム	化学	124,800	4,811.71	600,502,447	5,183.00	646,838,400	1.38
日本	株式	シマノ	輸送用機 器	22,600	26,841.40	606,615,744	27,170.00	614,042,000	1.31

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
----	-------	----	-------------

株式	国内	建設業	0.81
		化学	5.07
		医薬品	3.79
		ガラス・土石製品	5.74
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	2.08
		機械	13.67
		電気機器	20.84
		輸送用機器	8.43
		精密機器	1.55
		陸運業	3.11
		情報・通信業	6.40
		卸売業	3.02
		小売業	10.83
		銀行業	7.29
		保険業	0.30
		不動産業	1.81
		サービス業	3.40
			小計
合計		98.71	

(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

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。

外国株式 E S G リーダーズ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	12,749,032,497	69.46
	イギリス	669,338,888	3.65
	カナダ	592,556,588	3.23
	フランス	546,561,307	2.98
	アイルランド	503,547,756	2.74
	スイス	471,979,838	2.57
	オランダ	392,611,708	2.14
	デンマーク	285,914,301	1.56
	オーストラリア	263,841,009	1.44
	ドイツ	185,132,636	1.01
	スウェーデン	180,873,526	0.99
	イタリア	104,768,301	0.57
	スペイン	99,819,533	0.54
	香港	91,953,514	0.50
	フィンランド	71,428,107	0.39
	ノルウェー	46,663,384	0.25
	キュラソー	31,230,531	0.17
	シンガポール	30,859,466	0.17
	バミューダ	25,001,641	0.14
	リベリア	23,338,402	0.13
	ベルギー	17,709,829	0.10
	ジャージー	14,523,302	0.08
	ニュージーランド	12,421,872	0.07
	オーストリア	6,870,337	0.04
	ポルトガル	6,269,694	0.03
	ルクセンブルク	3,960,098	0.02
ケイマン	3,670,730	0.02	
	小計	17,431,878,795	94.98
投資信託受益証券	オーストラリア	4,086,616	0.02
投資証券	アメリカ	305,051,919	1.66

	オーストラリア	23,286,702	0.13
	イギリス	10,863,320	0.06
	シンガポール	8,993,371	0.05
	フランス	2,739,852	0.01
	ベルギー	2,167,113	0.01
	小計	353,102,277	1.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		564,503,359	3.08
合計(純資産総額)		18,353,571,047	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	454,621,811	2.48
	買建	ドイツ	97,513,765	0.53

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		30,584,700	0.17

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	25,557	63,534.77	1,623,758,348	61,091.29	1,561,310,216	8.51
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	89,095	16,898.64	1,505,584,991	17,327.42	1,543,786,663	8.41
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	21,300	25,291.95	538,718,571	23,400.58	498,432,429	2.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	18,336	25,524.83	468,023,398	23,591.84	432,580,009	2.36
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	10,410	27,179.44	282,938,034	37,175.45	386,996,495	2.11
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	2,924	127,778.78	373,625,168	125,286.96	366,339,091	2.00
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	5,698	39,390.78	224,448,712	39,275.01	223,789,030	1.22

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	8,578	24,123.24	206,929,196	24,770.79	212,483,849	1.16
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	3,005	65,726.07	197,506,860	70,457.23	211,723,998	1.15
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	3,589	50,818.69	182,388,282	57,024.91	204,662,427	1.12
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	8,731	21,536.68	188,036,820	23,036.62	201,132,747	1.10
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	11,658	20,809.97	242,602,640	17,029.17	198,526,064	1.08
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,454	147,088.74	213,867,042	120,736.33	175,550,637	0.96
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	14,813	9,263.22	137,216,135	10,246.58	151,782,689	0.83
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	9,168	18,679.17	171,250,716	16,226.97	148,768,895	0.81
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	3,531	34,725.99	122,617,472	39,484.82	139,420,925	0.76
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	5,850	22,795.57	133,354,129	23,457.67	137,227,402	0.75
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,650	23,720.30	134,019,733	22,262.63	125,783,895	0.69
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	4,972	24,035.84	119,506,229	24,264.09	120,641,105	0.66
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,740	63,859.27	111,115,136	68,440.46	119,086,404	0.65
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,150	16,366.95	117,023,751	16,619.70	118,830,857	0.65
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,605	74,972.50	120,330,874	73,574.46	118,087,009	0.64
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,629	37,844.72	99,493,790	43,345.67	113,955,776	0.62
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	2,267	44,408.40	100,673,843	49,912.68	113,152,048	0.62
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	1,003	113,891.85	114,233,529	112,143.06	112,479,491	0.61
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	3,962	23,341.13	92,477,589	26,459.28	104,831,697	0.57
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	3,325	25,696.89	85,442,186	31,520.49	104,805,640	0.57
アメリカ	株式	CATERPILLAR	資本財	1,770	47,928.24	84,832,990	55,818.84	98,799,362	0.54
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	15,374	5,928.36	91,142,630	6,407.14	98,503,519	0.54
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS	半導体・半導体製造装置	3,296	27,916.39	92,012,439	29,850.55	98,387,420	0.54

(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	2.43
		素材	3.69
		資本財	6.63
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.66
		自動車・自動車部品	2.27
		耐久消費財・アパレル	1.99
		消費者サービス	1.87
		メディア・娯楽	6.72
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.46
		生活必需品流通・小売り	0.81
		食品・飲料・タバコ	2.45
		家庭用品・パーソナル用品	2.71
		ヘルスケア機器・サービス	2.38
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.43
		銀行	3.37
		金融サービス	7.55
		保険	3.67
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.07
		ソフトウェア・サービス	14.48
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.64
電気通信サービス	0.93		
公益事業	1.72		
半導体・半導体製造装置	12.24		
不動産管理・開発	0.21		
	小計	94.98	
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.92
合計			96.92

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	11	アメリカドル	3,139,935.6	448,163,007	3,185,187.5	454,621,811	2.48

株価指数先物取引	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	12	ユーロ	589,128.4	93,924,741	611,640	97,513,765	0.53
----------	-----	-------------------	---------------	----	----	-----	-----------	------------	---------	------------	------

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	165,000.00	23,872,500	23,546,182	0.13
	ユーロ	買建	17,000.00	2,762,007	2,710,026	0.01
	イギリスポンド	買建	12,000.00	2,339,904	2,292,032	0.01
	スイスフラン	買建	12,000.00	2,060,064	2,036,460	0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	インド	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
	ブラジルレアル	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。

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	G L P 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	K D X 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	アクティブア・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。

ピクテ マルチストラテジー リンク 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(%)
社債券	ケイマン	23,548,083,720	98.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		446,114,714	1.86
合計(純資産総額)		23,994,198,434	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(%)
ケイマン	社債券	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	22,092,000,000	105.51	23,310,558,060	106.59	23,548,083,720	0.000	2025/12/15	98.14

(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(%)
社債券	98.14
合計	98.14

(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。

米国株式LS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(%)
社債券	アイルランド	14,216,537,582	93.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		917,936,257	6.07
合計(純資産総額)		15,134,473,839	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		14,184,500,000	93.72

(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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 004 10/18/27	67,000,000	21,839.48	14,632,456,941	21,218.71	14,216,537,582	0.000	2027/10/18	93.93

(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(%)
社債券	93.93
合計	93.93

(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	100,000,000.00	14,164,550,000	14,184,500,000	93.72

(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。

コモディティ L S アルファ・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(%)
社債券	アイルランド	12,013,820,000	78.62
	イギリス	3,191,680,000	20.89
	小計	15,205,500,000	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		75,843,713	0.50
合計(純資産総額)		15,281,343,713	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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 0 7/16/25	9,430,000,000	126.13	11,894,059,000	127.40	12,013,820,000	0.000	2025/7/16	78.62
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル 0% 20 25/04/30	3,200,000,000	99.11	3,171,580,000	99.74	3,191,680,000	0.000	2025/4/30	20.89

(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（％）
社債券	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

該当事項はありません。

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	13,690,222,700	57.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		10,320,793,340	42.98
合計（純資産総額）		24,011,016,040	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。

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	3,373,463,839	14.05
	買建	イギリス	10,983,357,723	45.74
	売建	日本	15,043,600,000	62.65
	売建	ドイツ	2,858,536,853	11.91

(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		11,433,778,840	47.62
	売建		9,869,840,715	41.11

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第1226回国庫短期証券	7,000,000,000	99.87	6,990,949,000	99.92	6,994,967,000		2025/4/21	29.13
日本	国債証券	第1244回国庫短期証券	3,000,000,000	99.84	2,995,428,000	99.87	2,996,379,000		2025/7/22	12.48
日本	国債証券	第1189回国庫短期証券	2,000,000,000	100.03	2,000,798,000	99.99	1,999,912,000		2024/10/21	8.33
日本	国債証券	第1220回国庫短期証券	1,700,000,000	99.90	1,698,429,200	99.93	1,698,964,700		2025/3/21	7.08

(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	57.02
合計	57.02

(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

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	通貨	簿価金額(現地通貨)	帳簿価額(円)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	売建	104	円	15,018,875,680	15,018,875,680	15,043,600,000	15,043,600,000	62.65
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	206	アメリカドル	23,646,734.08	3,375,098,354	23,635,282.28	3,373,463,839	14.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	133	ユーロ	17,759,750.7	2,831,437,053	17,929,730	2,858,536,853	11.91
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建	583	イギリスポンド	57,808,097.5	11,043,080,865	57,495,460	10,983,357,723	45.74

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

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

種類	資産の名称	買建/売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	20,089,000.00	2,857,179,057	2,861,175,825	11.92
	カナダドル	買建	23,948,000.00	2,544,079,290	2,523,759,980	10.51
	イギリスポンド	買建	4,678,000.00	891,051,435	891,720,360	3.71
	スウェーデンクローナ	買建	67,158,000.00	951,411,478	949,614,120	3.95
	ノルウェークローネ	買建	196,272,000.00	2,616,491,264	2,664,392,400	11.10
	オーストラリアドル	買建	15,659,000.00	1,492,067,768	1,543,116,155	6.43
	ユーロ	売建	1,642,000.00	258,699,723	261,373,560	1.09
	スイスフラン	売建	29,866,000.00	4,995,638,593	5,066,318,910	21.10
	ニュージーランドドル	売建	50,159,000.00	4,513,267,014	4,542,148,245	18.92

(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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
社債券	アイルランド	6,928,602,000	97.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		199,240,307	2.80
合計(純資産総額)		7,127,842,307	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(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 0% 10/20 / 25	7,932,000,000	89.95	7,134,988,600	87.35	6,928,602,000	0.000	2025/10/20	97.20

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.20
合計	97.20

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

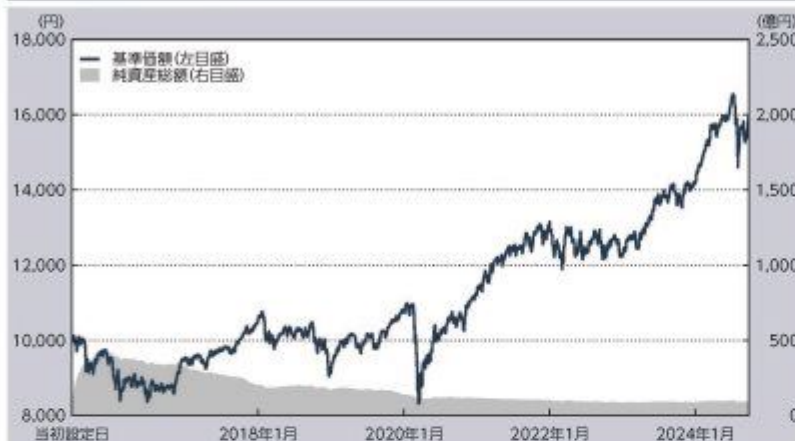
交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2015年6月16日

作成基準日：2024年9月30日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年2月	0円
2021年2月	0円
2022年2月	0円
2023年2月	0円
2024年2月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
FOFs用国内株式EVI/バリューファンド(適格機関投資家専用)	6.0%
国内株式アクティブ/バリューファンド(適格機関投資家専用)	5.9%
国内株式インデックス マザーファンド	5.6%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.8%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	4.7%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	4.7%
ニッセイ/サンダース・グローバル/バリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4.6%
外国株式インデックス マザーファンド	4.5%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	4.5%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	4.5%

※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)



※2015年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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

< 申込コース >

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

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として、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々営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

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ます。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々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

< 一部解約代金の支払い >

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

< 受付不可日 >

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないもの

とします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（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1万口当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 >

内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）の評価方法

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

外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

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

- ・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。

- ・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。

- ・公社債等（仕組債を含みます。）

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

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

- ・債券先物取引

原則として、金融商品取引所等が発表する計算日の清算値段（外国で取引されているものについては、計算日に知り得る直近の日の主たる金融商品取引所等が発表する清算値段又は最終相場）で評価します。

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】

2015年 6月16日（設定日）から2026年 2月17日までとします。

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。

なお、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

ただし、第1計算期間は2015年6月16日から2016年2月17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、本手続きに従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資

信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2023年2月18日から2024年2月19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】

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2023年 2月17日現在）	第9期 （2024年 2月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	272,623,265	169,614,748
投資信託受益証券	2,839,242,976	4,221,579,198
投資証券	516,765,394	870,166,375
親投資信託受益証券	5,361,287,130	4,176,150,909
未収入金	-	45,713,067
流動資産合計	8,989,918,765	9,483,224,297
資産合計	8,989,918,765	9,483,224,297
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	6,299,726
未払受託者報酬	2,479,507	2,532,313
未払委託者報酬	70,914,039	72,424,076
未払利息	57	36
その他未払費用	247,890	253,167
流動負債合計	73,641,493	81,509,318
負債合計	73,641,493	81,509,318
純資産の部		
元本等		
元本	6,970,541,061	6,257,846,873
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,945,736,211	3,143,868,106
（分配準備積立金）	1,999,575,150	3,171,581,610
元本等合計	8,916,277,272	9,401,714,979
純資産合計	8,916,277,272	9,401,714,979
負債純資産合計	8,989,918,765	9,483,224,297

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自 至	2022年 2月18日 2023年 2月17日	自 至	2023年 2月18日 2024年 2月19日
営業収益				
受取配当金		4,857,638		5,214,271
受取利息		868		775
有価証券売買等損益		302,980,209		1,601,310,910
その他収益		-		503,685
営業収益合計		307,838,715		1,607,029,641
営業費用				
支払利息		83,865		100,863
受託者報酬		5,034,596		4,980,044
委託者報酬		143,989,389		142,429,132
その他費用		503,329		497,890
営業費用合計		149,611,179		148,007,929
営業利益又は営業損失（ ）		158,227,536		1,459,021,712
経常利益又は経常損失（ ）		158,227,536		1,459,021,712
当期純利益又は当期純損失（ ）		158,227,536		1,459,021,712
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（ ）		997,589		65,844,265
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,974,742,074		1,945,736,211
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,898,873		21,488,802
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		17,898,873		21,488,802
剰余金減少額又は欠損金増加額		206,129,861		216,534,354
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		206,129,861		216,534,354
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,945,736,211		3,143,868,106

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)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。 (3)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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
3. 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2月18日から翌年2月17日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は2023年 2月18日から2024年 2月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2023年 2月17日現在)	第9期 (2024年 2月19日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,970,541,061口	6,257,846,873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) 1.2791円 (12,791円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5024円 (15,024円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2022年 2月18日 至 2023年 2月17日			第9期 自 2023年 2月18日 至 2024年 2月19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	52,207,361円	費用控除後の配当等収益額	A	77,766,289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	107,017,764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	1,315,411,158円
収益調整金額	C	174,271,128円	収益調整金額	C	173,228,338円
分配準備積立金額	D	1,840,350,025円	分配準備積立金額	D	1,778,404,163円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,173,846,278円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,344,809,948円
当ファンドの期末残存口数	F	6,970,541,061口	当ファンドの期末残存口数	F	6,257,846,873口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,118円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	5,344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9期 自 2023年 2月18日 至 2024年 2月19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。

	第9期 自 2023年 2月18日 至 2024年 2月19日

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (2024年 2月19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	第8期 自 2022年 2月18日 至 2023年 2月17日	第9期 自 2023年 2月18日 至 2024年 2月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,704,434,536円	6,970,541,061円
期中追加設定元本額	70,367,550円	62,444,897円
期中一部解約元本額	804,261,025円	775,139,085円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 (2023年 2月17日現在)	第9期 (2024年 2月19日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	93,193,633	733,667,841
投資証券	3,565,147	120,747,141
親投資信託受益証券	174,310,525	498,078,061
合計	263,939,011	1,352,493,043

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【 附属明細表 】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考

投資信託受益証券	ノムラ F O F s 用 日本株ベータヘッジ戦略 ファンド（適格機関投資家専用）	334,608,053	282,476,118
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機 関投資家専用）	315,281,535	556,692,606
	F O F s 用国内株式エンハンス運用戦略ファンド （適格機関投資家専用）	120,390,704	274,213,906
	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向 け）	332,398,610	452,460,987
	ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株 式ファンド（ F O F s 用）（適格機関投資家専 用）	277,388,027	442,877,723
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド （適格機関投資家専用）	200,369,456	443,257,310
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投 資家専用）	141,466,589	408,696,975
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド （適格機関投資家専用）	311,304,702	437,725,541
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS （適格機関投資家専用）	252,903,778	212,464,463
	F O F s 用 M A N A H L ダイバーシファイ ド リンクファンド（適格機関投資家専用）	141,605,973	167,194,172
	F O F s 用国内株式EVIバリューファンド（適格機関 投資家専用）	322,181,030	543,519,397
投資信託受益証券合計		2,749,898,457	4,221,579,198
投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	12,758	137,990,528
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	199,474.783	445,028,240
	MA Hedge Fund Strategies Limited	28,489	287,147,607
投資証券合計		240,721.783	870,166,375
親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	211,531,584	420,186,338
	グローバル R E I T インデックス マザーファ ンド	162,214,836	457,088,964
	中小型株式 マザーファンド	24,464,795	132,760,656
	新興国株式インデックス マザーファンド	35,711,445	148,463,190
	国内株式インデックス マザーファンド	257,305,573	697,864,175
	外国株式インデックス マザーファンド	76,270,162	456,400,649
	ピクテ マルチストラテジー リンク マザー ファンド	230,727,977	237,326,797
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	316,330,899	394,179,933
	コモディティ L S アルファ・マザーファンド	230,431,272	285,896,079
	日本株式 E S G セレクト・リーダーズインデッ クスマザーファンド	98,618,905	144,792,276
	外国株式 E S G リーダーズインデックスマザー ファンド	97,504,297	155,168,338
	米国株式 L S マザーファンド	267,116,183	327,858,403
	G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）	142,281,202	160,023,667
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザー ファンド	174,857,855	158,141,444
親投資信託受益証券合計		2,325,366,985	4,176,150,909

合計	9,267,896,482
----	---------------

(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。

中小型株式 マザーファンド

貸借対照表

2024年 2月19日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,333,437,278
株式	24,014,872,280
未収入金	107,860,645
未収配当金	35,865,000
流動資産合計	25,492,035,203
資産合計	
25,492,035,203	
負債の部	
流動負債	
未払金	94,142,447
未払解約金	7,285,698
未払利息	286
流動負債合計	101,428,431
負債合計	
101,428,431	
純資産の部	
元本等	
元本	4,678,911,492
剰余金	
剰余金又は欠損金()	20,711,695,280
元本等合計	25,390,606,772
純資産合計	
25,390,606,772	
負債純資産合計	
25,492,035,203	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 2月19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. 収益及び費用の計上基準	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。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 2月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		4,678,911,492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)	5.4266円 (54,266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 2月19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、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。	
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 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	4,573,695,116円
期中追加設定元本額	532,920,060円
期中一部解約元本額	427,703,684円
期末元本額	4,678,911,492円
期末元本額の内訳	
中小型株式オープン	2,668,259,287円
中小型株式オープン（SMA専用）	39,734,153円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,946,453,257円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	24,464,795円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		181,516,388
合計		181,516,388

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「中小型株式 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

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
寿スピリッツ	174,100	1,928.00	335,664,800	
わらべや日洋ホールディングス	20,300	2,832.00	57,489,600	
セーレン	109,400	2,429.00	265,732,600	
トリケミカル研究所	162,900	4,180.00	680,922,000	
ニフコ	126,000	3,749.00	472,374,000	
ロート製薬	147,900	2,944.50	435,491,550	
ペプチドリーム	374,000	1,550.00	579,700,000	
MARUWA	18,200	31,500.00	573,300,000	
横河ブリッジホールディングス	151,500	2,766.00	419,049,000	
三益半導体工業	141,200	3,160.00	446,192,000	
芝浦機械	60,000	3,400.00	204,000,000	
牧野フライス製作所	28,200	5,770.00	162,714,000	
ローツェ	3,800	19,860.00	75,468,000	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	49,400	3,575.00	176,605,000	
竹内製作所	107,300	5,120.00	549,376,000	
イビデン	66,100	7,157.00	473,077,700	
富士電機	100,000	9,064.00	906,400,000	
日本マイクロニクス	18,500	6,000.00	111,000,000	
日本セラミック	124,500	2,545.00	316,852,500	
図研	44,500	4,265.00	189,792,500	
エンプラス	16,900	8,790.00	148,551,000	
大真空	300,600	887.00	266,632,200	
AeroEdge	25,000	3,160.00	79,000,000	
ナカニシ	112,800	2,214.00	249,739,200	
前田工織	144,900	3,355.00	486,139,500	
SHOEI	58,000	2,057.00	119,306,000	
アシックス	48,300	5,758.00	278,111,400	
メタウォーター	123,900	2,219.00	274,934,100	
富士急行	105,200	3,960.00	416,592,000	

A Z - C O M丸和ホールディングス	245,700	1,423.00	349,631,100
ブレインパッド	246,400	1,435.00	353,584,000
S H I F T	13,800	26,900.00	371,220,000
インターネットイニシアティブ	24,000	2,851.00	68,424,000
カナミックネットワーク	305,100	525.00	160,177,500
チェンジホールディングス	84,800	1,554.00	131,779,200
マネーフォワード	110,700	5,816.00	643,831,200
エクサウィザーズ	651,200	516.00	336,019,200
サスメド	209,600	627.00	131,419,200
シンプレクス・ホールディングス	168,700	2,550.00	430,185,000
F i n a t e x tホールディングス	430,700	825.00	355,327,500
サーバーワークス	30,200	4,105.00	123,971,000
S a n s a n	102,300	1,512.00	154,677,600
ギフトィ	199,200	1,460.00	290,832,000
J M D C	50,000	3,734.00	186,700,000
J T O W E R	88,400	4,965.00	438,906,000
A n y M i n d G r o u p	75,000	1,171.00	87,825,000
A N Y C O L O R	117,200	3,150.00	369,180,000
ネットワンシステムズ	93,800	2,580.00	242,004,000
ビジョン	318,400	1,114.00	354,697,600
東宝	122,500	4,795.00	587,387,500
カブコン	92,100	5,830.00	536,943,000
神戸物産	109,600	3,759.00	411,986,400
アズワン	58,500	5,239.00	306,481,500
B u y S e l l T e c h n o l o g i e s	53,000	3,060.00	162,180,000
パルグループホールディングス	187,100	2,252.00	421,349,200
物語コーポレーション	60,300	4,695.00	283,108,500
薬王堂ホールディングス	90,000	2,811.00	252,990,000
京都フィナンシャルグループ	178,600	2,532.00	452,215,200
F P パートナー	28,500	6,600.00	188,100,000
アニコム ホールディングス	400,000	590.00	236,000,000
イー・ギャランティ	165,100	1,929.00	318,477,900
S R E ホールディングス	130,600	3,300.00	430,980,000
東急不動産ホールディングス	221,900	982.20	217,950,180
ティーケーピー	183,700	1,628.00	299,063,600
エス・エム・エス	217,900	2,632.50	573,621,750
エスプール	284,800	310.00	88,288,000
イオンファンタジー	75,000	2,530.00	189,750,000
弁護士ドットコム	110,200	3,880.00	427,576,000
K e e P e r 技研	42,200	6,620.00	279,364,000
ジャパンマテリアル	185,700	2,676.00	496,933,200
E R I ホールディングス	76,500	1,865.00	142,672,500

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	212,100	2,275.00	482,527,500	
マネジメントソリューションズ	56,100	3,030.00	169,983,000	
LITALICO	133,200	2,152.00	286,646,400	
東祥	147,600	792.00	116,899,200	
ダイセキ	81,200	4,000.00	324,800,000	
合計	10,232,600		24,014,872,280	

(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

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,827,264,232
株式	653,905,366,950
派生商品評価勘定	130,847,400
未収入金	29,223,200
未収配当金	935,794,340
差入委託証拠金	235,653,767
流動資産合計	660,064,149,889
資産合計	660,064,149,889
負債の部	
流動負債	
前受金	130,934,300
未払解約金	744,007,098
未払利息	1,035
流動負債合計	874,942,433
負債合計	874,942,433
純資産の部	
元本等	
元本	243,047,559,097
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	416,141,648,359
元本等合計	659,189,207,456
純資産合計	659,189,207,456
負債純資産合計	660,064,149,889

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月19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。

2024年 2月19日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,047,559,097口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7122円 (27,122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 2月19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 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	258,952,777,044円
期中追加設定元本額	23,558,943,960円
期中一部解約元本額	39,464,161,907円
期末元本額	243,047,559,097円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	300,427,419円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,324,790,832円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,832,876円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,624,197,356円
世界経済インデックスファンド	5,480,677,698円
日本株式インデックス・オープン	2,896,980,884円
DCマイセレクション25	5,188,926,852円
DCマイセレクション50	16,564,807,037円
DCマイセレクション75	18,645,246,715円
DC日本株式インデックス・オープン	5,994,992,573円
DCマイセレクションS25	3,123,291,441円
DCマイセレクションS50	9,227,916,384円
DCマイセレクションS75	8,406,820,029円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,318,957,520円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	90,457,897円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	624,121,247円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	490,373,216円
DC世界経済インデックスファンド	3,872,297,962円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	786,915,534円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,485,487円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,119,126円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,731,768円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	145,843,024円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,942,020円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	13,916,110円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	66,062,210円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,768,203円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	41,964,694円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	468,207,102円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	296,411,844円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,023,757,191円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	28,436,332円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	11,549,460円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	307,167,187円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	167,048,030円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,230,020円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	18,043,662円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	393,934,053円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,447,230,955円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,912,564,066円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,066,009,806円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,532,570,159円
分散投資コア戦略ファンドA	1,869,978,613円
分散投資コア戦略ファンドS	6,134,390,087円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	625,605,332円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,269,370円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,126,863,232円

区分	2024年 2月19日現在
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	190,527,085円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,473,559円
SMT インデックスバランス・オープン	46,492,176円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,882,707,441円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	257,305,573円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,605,943円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	217,329,233円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,154,236円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,796,995円
グローバル経済コア	229,903,805円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,186,135円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,472,356,275円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,668,159円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	951,696,698円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	236,546,406円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,022,400円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	54,129,701円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,873,476円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	28,639,350円
10資産分散投資ファンド	88,147,302円
グローバル10資産バランスファンド	20,200,573円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	34,725円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	37,911円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	34,844円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,400円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	19,911円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	41,836,998,951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）	466,464,769円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	290,079,521円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	16,904,339円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	139,797,804円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P（適格機関投資家専用）	48,798,722,492円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,873,463円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	203,574,847円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		117,166,440,611
合計		117,166,440,611

(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 2月19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	4,050,535,700	-	4,181,470,000	130,934,300
	合計	4,050,535,700	-	4,181,470,000	130,934,300

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,300	3,595.00	33,433,500	
ニッスイ	244,900	944.10	231,210,090	
マルハニチロ	36,300	2,958.00	107,375,400	
雪国まいたけ	20,900	952.00	19,896,800	
カネコ種苗	7,500	1,436.00	10,770,000	
サカタのタネ	27,900	3,830.00	106,857,000	
ホクト	19,600	1,838.00	36,024,800	
ホクリヨウ	1,800	1,040.00	1,872,000	
住石ホールディングス	27,700	2,131.00	59,028,700	
日鉄鉱業	9,800	5,150.00	50,470,000	
三井松島ホールディングス	14,500	3,000.00	43,500,000	
I N P E X	905,800	2,033.50	1,841,944,300	
石油資源開発	28,400	6,200.00	176,080,000	
K & O エナジーグループ	11,100	2,499.00	27,738,900	
ショーボンドホールディングス	33,400	6,242.00	208,482,800	
ミライト・ワン	81,000	1,751.00	141,831,000	
タマホーム	15,400	3,965.00	61,061,000	
サンヨーホームズ	1,300	761.00	989,300	
日本アクア	4,500	1,017.00	4,576,500	
ファーストコーポレーション	3,100	787.00	2,439,700	
ベステラ	2,600	1,097.00	2,852,200	
キャンディル	2,000	581.00	1,162,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,200	1,026.00	2,257,200	
第一カッター興業	7,100	1,361.00	9,663,100	
安藤・間	141,900	1,239.00	175,814,100	
東急建設	76,700	808.00	61,973,600	
コムシスホールディングス	78,200	3,339.00	261,109,800	
ピーアールホールディングス	35,900	374.00	13,426,600	
高松コンストラクショングループ	18,200	2,723.00	49,558,600	
東建コーポレーション	7,000	9,600.00	67,200,000	
ソネック	1,200	927.00	1,112,400	
ヤマウラ	12,400	1,504.00	18,649,600	
オリエンタル白石	90,700	390.00	35,373,000	

大成建設	160,300	4,859.00	778,897,700
大林組	612,700	1,440.50	882,594,350
清水建設	485,800	914.80	444,409,840
飛島建設	17,700	1,482.00	26,231,400
長谷工コーポレーション	157,200	1,886.00	296,479,200
松井建設	16,000	858.00	13,728,000
銭高組	1,100	4,150.00	4,565,000
鹿島建設	379,900	2,843.50	1,080,245,650
不動テトラ	11,800	2,228.00	26,290,400
大末建設	3,000	1,642.00	4,926,000
鉄建建設	12,300	2,561.00	31,500,300
西松建設	32,700	4,587.00	149,994,900
三井住友建設	127,500	443.00	56,482,500
大豊建設	5,900	3,140.00	18,526,000
佐田建設	4,800	709.00	3,403,200
ナカノフドー建設	5,400	634.00	3,423,600
奥村組	27,800	5,080.00	141,224,000
東鉄工業	21,200	3,035.00	64,342,000
イチケン	1,900	2,428.00	4,613,200
富士ピー・エス	3,500	452.00	1,582,000
浅沼組	12,700	4,150.00	52,705,000
戸田建設	231,800	958.00	222,064,400
熊谷組	28,300	3,865.00	109,379,500
北野建設	1,400	3,095.00	4,333,000
植木組	2,100	1,798.00	3,775,800
矢作建設工業	23,300	1,585.00	36,930,500
ピーエス三菱	21,700	1,057.00	22,936,900
日本ハウスホールディングス	36,600	306.00	11,199,600
新日本建設	24,000	1,242.00	29,808,000
東亜道路工業	6,800	6,420.00	43,656,000
日本道路	20,100	2,038.00	40,963,800
東亜建設工業	13,200	4,675.00	61,710,000
日本国土開発	48,700	521.00	25,372,700
若築建設	5,900	3,140.00	18,526,000
東洋建設	43,200	1,322.00	57,110,400
五洋建設	242,900	764.40	185,672,760
世紀東急工業	22,000	1,938.00	42,636,000
福田組	6,500	5,330.00	34,645,000
住友林業	148,100	4,109.00	608,542,900
日本基礎技術	4,600	453.00	2,083,800
巴コーポレーション	9,500	655.00	6,222,500
大和ハウス工業	473,800	4,337.00	2,054,870,600

ライト工業	35,200	1,895.00	66,704,000
積水ハウス	519,600	3,292.00	1,710,523,200
日特建設	16,400	1,152.00	18,892,800
北陸電気工事	11,700	1,259.00	14,730,300
ユアテック	37,700	1,260.00	47,502,000
日本リーテック	14,000	1,243.00	17,402,000
四電工	7,200	4,000.00	28,800,000
中電工	26,600	2,953.00	78,549,800
関電工	107,300	1,593.00	170,928,900
きんでん	120,600	2,650.00	319,590,000
東京エネシス	17,000	1,165.00	19,805,000
トーエネック	5,700	5,190.00	29,583,000
住友電設	16,300	3,075.00	50,122,500
日本電設工業	32,200	2,091.00	67,330,200
エクシオグループ	83,700	3,117.00	260,892,900
新日本空調	11,100	2,862.00	31,768,200
九電工	37,000	5,710.00	211,270,000
三機工業	37,000	1,913.00	70,781,000
日揮ホールディングス	169,500	1,412.00	239,334,000
中外炉工業	5,600	2,829.00	15,842,400
ヤマト	6,300	974.00	6,136,200
太平電業	10,600	4,460.00	47,276,000
高砂熱学工業	45,900	4,390.00	201,501,000
三晃金属工業	1,000	4,955.00	4,955,000
朝日工業社	8,000	2,986.00	23,888,000
明星工業	33,100	1,230.00	40,713,000
大気社	19,700	4,885.00	96,234,500
ダイダン	22,500	1,811.00	40,747,500
日比谷総合設備	12,400	2,560.00	31,744,000
フィル・カンパニー	2,600	878.00	2,282,800
テスホールディングス	36,900	448.00	16,531,200
インフロニア・ホールディングス	197,500	1,500.00	296,250,000
東洋エンジニアリング	25,200	848.00	21,369,600
レイズネクスト	24,800	2,349.00	58,255,200
ニッポン	51,500	2,399.00	123,548,500
日清製粉グループ本社	159,000	2,137.00	339,783,000
日東富士製粉	3,100	5,370.00	16,647,000
昭和産業	16,600	3,455.00	57,353,000
鳥越製粉	6,800	730.00	4,964,000
中部飼料	23,800	1,280.00	30,464,000
フィード・ワン	25,100	1,015.00	25,476,500
東洋精糖	1,400	2,686.00	3,760,400

日本甜菜製糖	10,000	2,120.00	21,200,000
D M三井製糖ホールディングス	17,100	3,280.00	56,088,000
塩水港精糖	10,000	314.00	3,140,000
ウェルネオシュガー	8,600	2,282.00	19,625,200
森永製菓	73,600	2,748.00	202,252,800
中村屋	4,300	3,130.00	13,459,000
江崎グリコ	49,200	4,697.00	231,092,400
名糖産業	6,800	1,849.00	12,573,200
井村屋グループ	10,300	2,459.00	25,327,700
不二家	11,800	2,507.00	29,582,600
山崎製パン	115,100	3,907.00	449,695,700
第一屋製パン	1,400	675.00	945,000
モロゾフ	5,600	4,150.00	23,240,000
亀田製菓	9,800	4,430.00	43,414,000
寿スピリッツ	81,300	1,928.00	156,746,400
カルビー	78,700	3,155.00	248,298,500
森永乳業	60,100	3,156.00	189,675,600
六甲バター	12,600	1,379.00	17,375,400
ヤクルト本社	245,800	3,158.00	776,236,400
明治ホールディングス	210,900	3,461.00	729,924,900
雪印メグミルク	41,600	2,219.00	92,310,400
プリマハム	23,100	2,283.00	52,737,300
日本ハム	74,000	5,284.00	391,016,000
林兼産業	2,500	577.00	1,442,500
丸大食品	17,300	1,652.00	28,579,600
S Foods	19,000	3,195.00	60,705,000
柿安本店	6,700	2,592.00	17,366,400
伊藤ハム米久ホールディングス	26,300	4,150.00	109,145,000
サッポロホールディングス	56,600	7,051.00	399,086,600
アサヒグループホールディングス	397,400	5,327.00	2,116,949,800
キリンホールディングス	716,400	2,148.50	1,539,185,400
宝ホールディングス	117,400	1,187.00	139,353,800
オエノンホールディングス	51,400	351.00	18,041,400
養命酒製造	5,700	1,872.00	10,670,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	134,700	1,907.50	256,940,250
ライフドリンク カンパニー	2,600	5,110.00	13,286,000
サントリー食品インターナショナル	121,100	4,737.00	573,650,700
ダイドーグループホールディングス	19,500	3,030.00	59,085,000
伊藤園	58,300	4,254.00	248,008,200
キーコーヒー	19,300	2,047.00	39,507,100
ユニカフェ	2,500	904.00	2,260,000
ジャパンフーズ	1,200	1,403.00	1,683,600

日清オイリオグループ	24,200	5,100.00	123,420,000
不二製油グループ本社	40,000	2,399.00	95,960,000
かどや製油	900	3,810.00	3,429,000
J・オイルミルズ	19,700	1,942.00	38,257,400
キッコーマン	114,000	9,336.00	1,064,304,000
味の素	408,700	5,670.00	2,317,329,000
ブルドックソース	9,100	2,123.00	19,319,300
キューピー	92,400	2,726.50	251,928,600
ハウス食品グループ本社	59,200	3,146.00	186,243,200
カゴメ	74,000	3,604.00	266,696,000
焼津水産化学工業	3,300	1,350.00	4,455,000
アリアケジャパン	17,100	5,700.00	97,470,000
ピエトロ	1,100	1,825.00	2,007,500
エバラ食品工業	4,400	2,921.00	12,852,400
やまみ	900	4,400.00	3,960,000
ニチレイ	78,800	3,747.00	295,263,600
東洋水産	86,900	8,549.00	742,908,100
イトアンドホールディングス	8,100	2,132.00	17,269,200
大冷	1,100	1,936.00	2,129,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,800	1,268.00	9,890,400
日清食品ホールディングス	181,400	4,442.00	805,778,800
永谷園ホールディングス	8,400	2,205.00	18,522,000
一正蒲鉾	3,300	741.00	2,445,300
フジッコ	17,700	1,945.00	34,426,500
ロック・フィールド	21,000	1,675.00	35,175,000
日本たばこ産業	1,045,100	3,912.00	4,088,431,200
ケンコーマヨネーズ	11,800	2,120.00	25,016,000
わらべや日洋ホールディングス	11,500	2,832.00	32,568,000
なとり	10,800	2,153.00	23,252,400
イフジ産業	1,500	1,458.00	2,187,000
ファーマフーズ	24,700	989.00	24,428,300
ユーグレナ	107,100	640.00	68,544,000
紀文食品	14,900	1,191.00	17,745,900
ピククルスホールディングス	10,100	1,258.00	12,705,800
ミヨシ油脂	2,900	1,250.00	3,625,000
理研ビタミン	14,900	2,430.00	36,207,000
片倉工業	16,400	1,800.00	29,520,000
ゲンゼ	12,500	5,650.00	70,625,000
東洋紡	76,100	1,081.00	82,264,100
ユニチカ	59,700	158.00	9,432,600
富士紡ホールディングス	7,800	4,465.00	34,827,000
倉敷紡績	13,200	3,100.00	40,920,000

シキボウ	9,300	1,200.00	11,160,000
日本毛織	46,300	1,371.00	63,477,300
トーア紡コーポレーション	3,000	421.00	1,263,000
帝国繊維	20,000	2,137.00	42,740,000
帝人	168,500	1,259.50	212,225,750
東レ	1,173,000	695.10	815,352,300
住江織物	1,600	2,367.00	3,787,200
日本フェルト	5,500	437.00	2,403,500
イチカワ	1,300	1,752.00	2,277,600
日東製網	800	1,650.00	1,320,000
アツギ	5,600	611.00	3,421,600
ダイニック	2,400	761.00	1,826,400
セーレン	34,000	2,429.00	82,586,000
ソトー	2,600	695.00	1,807,000
東海染工	1,000	820.00	820,000
小松マテーレ	25,500	781.00	19,915,500
ワコールホールディングス	35,900	3,639.00	130,640,100
ホギメディカル	23,100	3,555.00	82,120,500
T S Iホールディングス	57,000	702.00	40,014,000
マツオカコーポレーション	2,400	1,570.00	3,768,000
ワールド	24,800	1,970.00	48,856,000
三陽商会	6,600	2,736.00	18,057,600
ナイガイ	2,900	254.00	736,600
オンワードホールディングス	103,300	527.00	54,439,100
ルックホールディングス	4,900	2,455.00	12,029,500
ゴールドウイン	31,000	9,057.00	280,767,000
デサント	30,200	3,200.00	96,640,000
キング	3,500	703.00	2,460,500
ヤマトインターナショナル	6,400	300.00	1,920,000
特種東海製紙	9,600	3,835.00	36,816,000
王子ホールディングス	728,900	570.00	415,473,000
日本製紙	98,700	1,165.00	114,985,500
三菱製紙	10,500	549.00	5,764,500
北越コーポレーション	86,000	1,322.00	113,692,000
中越パルプ工業	3,100	1,800.00	5,580,000
大王製紙	77,300	1,091.50	84,372,950
阿波製紙	2,100	500.00	1,050,000
レンゴー	159,400	1,015.50	161,870,700
トーモク	10,100	2,297.00	23,199,700
ザ・パック	13,000	3,815.00	49,595,000
北の達人コーポレーション	73,700	229.00	16,877,300
クラレ	255,000	1,519.50	387,472,500

旭化成	1,183,700	1,049.50	1,242,293,150
共和レザー	4,500	823.00	3,703,500
巴川コーポレーション	2,200	814.00	1,790,800
レゾナック・ホールディングス	169,100	3,260.00	551,266,000
住友化学	1,298,400	313.60	407,178,240
住友精化	8,200	5,070.00	41,574,000
日産化学	82,200	6,237.00	512,681,400
ラサ工業	6,700	2,321.00	15,550,700
クレハ	38,300	2,677.00	102,529,100
多木化学	6,800	3,755.00	25,534,000
テイカ	15,100	1,386.00	20,928,600
石原産業	29,000	1,513.00	43,877,000
片倉コープアグリ	1,800	1,086.00	1,954,800
日本曹達	20,700	5,960.00	123,372,000
東ソー	233,600	1,999.00	466,966,400
トクヤマ	56,500	2,339.50	132,181,750
セントラル硝子	18,700	2,905.00	54,323,500
東亜合成	87,300	1,520.00	132,696,000
大阪ソーダ	12,200	11,480.00	140,056,000
関東電化工業	33,800	943.00	31,873,400
デンカ	63,600	2,528.00	160,780,800
信越化学工業	1,586,600	6,178.00	9,802,014,800
日本カーバイド工業	7,400	1,845.00	13,653,000
堺化学工業	13,300	1,994.00	26,520,200
第一稀元素化学工業	19,100	927.00	17,705,700
エア・ウォーター	165,100	2,202.00	363,550,200
日本酸素ホールディングス	169,700	4,159.00	705,782,300
日本化学工業	6,400	2,150.00	13,760,000
東邦アセチレン	8,200	410.00	3,362,000
日本パーカラライジング	78,000	1,270.00	99,060,000
高压ガス工業	25,400	878.00	22,301,200
チタン工業	1,000	1,072.00	1,072,000
四国化成ホールディングス	22,400	1,760.00	39,424,000
戸田工業	4,000	1,640.00	6,560,000
ステラ ケミファ	9,500	3,890.00	36,955,000
保土谷化学工業	5,500	3,540.00	19,470,000
日本触媒	25,500	5,702.00	145,401,000
大日精化工業	12,200	2,757.00	33,635,400
カネカ	44,400	3,718.00	165,079,200
三菱瓦斯化学	130,700	2,642.50	345,374,750
三井化学	144,300	4,067.00	586,868,100
J S R	190,600	4,060.00	773,836,000

東京応化工業	83,500	4,140.00	345,690,000
大阪有機化学工業	14,600	3,005.00	43,873,000
三菱ケミカルグループ	1,279,100	862.00	1,102,584,200
KHネオケム	26,700	2,279.00	60,849,300
ダイセル	224,900	1,438.00	323,406,200
住友ベークライト	24,500	8,136.00	199,332,000
積水化学工業	351,600	2,092.00	735,547,200
日本ゼオン	119,900	1,284.50	154,011,550
アイカ工業	44,200	3,535.00	156,247,000
UBE	83,200	2,582.00	214,822,400
積水樹脂	26,100	2,518.00	65,719,800
タキロンシーアイ	44,600	639.00	28,499,400
旭有機材	11,600	3,965.00	45,994,000
ニチバン	9,500	1,871.00	17,774,500
リケンテクノス	37,700	960.00	36,192,000
大倉工業	8,100	3,135.00	25,393,500
積水化成成品工業	24,600	460.00	11,316,000
群栄化学工業	4,100	3,660.00	15,006,000
タイガースポリマー	3,500	1,069.00	3,741,500
ミライアル	2,600	1,462.00	3,801,200
ダイキアクシス	3,200	703.00	2,249,600
ダイキョーニシカワ	38,600	733.00	28,293,800
竹本容器	2,900	775.00	2,247,500
森六ホールディングス	9,100	2,782.00	25,316,200
恵和	12,600	1,209.00	15,233,400
日本化薬	133,700	1,306.50	174,679,050
カーリットホールディングス	18,900	993.00	18,767,700
日本精化	11,600	2,647.00	30,705,200
扶桑化学工業	18,600	4,665.00	86,769,000
トリケミカル研究所	21,200	4,180.00	88,616,000
ADEKA	61,000	3,004.00	183,244,000
日油	52,800	7,160.00	378,048,000
新日本理化	10,700	206.00	2,204,200
ハリマ化成グループ	10,900	899.00	9,799,100
花王	395,600	5,651.00	2,235,535,600
第一工業製薬	6,900	3,170.00	21,873,000
石原ケミカル	7,800	1,882.00	14,679,600
日華化学	3,100	882.00	2,734,200
ニイタカ	1,500	1,904.00	2,856,000
三洋化成工業	10,800	4,185.00	45,198,000
有機合成薬品工業	6,300	298.00	1,877,400
大日本塗料	19,400	1,087.00	21,087,800

日本ペイントホールディングス	929,100	1,105.00	1,026,655,500
関西ペイント	171,500	2,296.50	393,849,750
神東塗料	6,400	128.00	819,200
中国塗料	35,900	2,100.00	75,390,000
日本特殊塗料	5,500	1,368.00	7,524,000
藤倉化成	20,200	453.00	9,150,600
太陽ホールディングス	30,500	3,205.00	97,752,500
D I C	68,400	3,020.00	206,568,000
サカティンクス	38,900	1,390.00	54,071,000
a r t i e n c e	38,100	2,904.00	110,642,400
T & K T O K A	16,800	1,411.00	23,704,800
富士フィルムホールディングス	325,000	9,441.00	3,068,325,000
資生堂	365,800	4,175.00	1,527,215,000
ライオン	229,300	1,317.00	301,988,100
高砂香料工業	13,200	3,430.00	45,276,000
マンダム	37,800	1,311.00	49,555,800
ミルボン	23,800	3,499.00	83,276,200
ファンケル	76,600	2,125.00	162,775,000
コーセー	35,600	8,436.00	300,321,600
コタ	16,100	1,584.00	25,502,400
シーボン	1,100	1,484.00	1,632,400
ポーラ・オルビスホールディングス	89,800	1,464.00	131,467,200
ノエビアホールディングス	15,600	5,240.00	81,744,000
アジュバンホールディングス	1,900	939.00	1,784,100
新日本製薬	10,000	1,723.00	17,230,000
I - n e	3,500	2,093.00	7,325,500
アクシージア	8,800	851.00	7,488,800
エステー	13,500	1,549.00	20,911,500
アグロ カネショウ	7,000	1,267.00	8,869,000
コニシ	55,100	1,386.00	76,368,600
長谷川香料	33,500	3,190.00	106,865,000
小林製薬	51,000	6,099.00	311,049,000
荒川化学工業	14,800	1,121.00	16,590,800
メック	14,400	4,180.00	60,192,000
日本高純度化学	4,000	2,741.00	10,964,000
タカラバイオ	47,200	1,069.00	50,456,800
J C U	19,600	4,040.00	79,184,000
新田ゼラチン	5,300	678.00	3,593,400
O A T アグリオ	5,800	1,690.00	9,802,000
デクセリアルズ	44,000	5,976.00	262,944,000
アース製薬	15,900	4,175.00	66,382,500
北興化学工業	17,600	1,074.00	18,902,400

大成ラミック	5,200	3,075.00	15,990,000
クミアイ化学工業	69,600	831.00	57,837,600
日本農薬	32,100	715.00	22,951,500
アキレス	11,000	1,483.00	16,313,000
有沢製作所	30,700	1,158.00	35,550,600
日東電工	112,500	14,045.00	1,580,062,500
レック	22,400	1,097.00	24,572,800
三光合成	22,100	642.00	14,188,200
きもと	12,800	207.00	2,649,600
藤森工業	13,800	3,870.00	53,406,000
前澤化成工業	11,300	1,574.00	17,786,200
未来工業	6,300	5,260.00	33,138,000
ウェーブロックホールディングス	2,900	679.00	1,969,100
J S P	12,300	2,182.00	26,838,600
エフピコ	33,100	2,870.00	94,997,000
天馬	12,700	2,414.00	30,657,800
信越ポリマー	37,800	1,619.00	61,198,200
東リ	17,200	400.00	6,880,000
ニフコ	52,400	3,749.00	196,447,600
バルカー	14,600	4,450.00	64,970,000
ユニ・チャーム	365,000	5,174.00	1,888,510,000
ショーエイコーポレーション	2,400	616.00	1,478,400
協和キリン	211,600	2,858.00	604,752,800
武田薬品工業	1,550,500	4,435.00	6,876,467,500
アステラス製薬	1,536,700	1,682.50	2,585,497,750
住友ファーマ	130,000	368.00	47,840,000
塩野義製薬	220,900	7,135.00	1,576,121,500
わかもと製薬	8,200	208.00	1,705,600
日本新薬	45,900	4,962.00	227,755,800
中外製薬	548,400	5,779.00	3,169,203,600
科研製薬	30,000	3,588.00	107,640,000
エーザイ	213,100	6,297.00	1,341,890,700
ロート製薬	169,700	2,944.50	499,681,650
小野薬品工業	371,800	2,418.00	899,012,400
久光製薬	38,900	4,030.00	156,767,000
持田製薬	20,100	3,175.00	63,817,500
参天製薬	319,300	1,539.00	491,402,700
扶桑薬品工業	6,200	2,212.00	13,714,400
日本ケミファ	900	1,615.00	1,453,500
ツムラ	55,200	2,766.50	152,710,800
キッセイ薬品工業	29,000	3,320.00	96,280,000
生化学工業	29,700	760.00	22,572,000

栄研化学	32,200	1,896.00	61,051,200
鳥居薬品	9,400	4,030.00	37,882,000
JCRファーマ	59,300	928.00	55,030,400
東和薬品	26,900	3,065.00	82,448,500
富士製薬工業	12,900	1,796.00	23,168,400
ゼリア新薬工業	24,300	2,173.00	52,803,900
そーせいグループ	57,500	1,382.00	79,465,000
第一三共	1,526,200	4,873.00	7,437,172,600
杏林製薬	38,000	1,772.00	67,336,000
大幸薬品	36,200	336.00	12,163,200
ダイト	13,500	1,987.00	26,824,500
大塚ホールディングス	364,400	5,512.00	2,008,572,800
ペプチドリーム	84,900	1,550.00	131,595,000
セルソース	4,800	1,312.00	6,297,600
あすか製薬ホールディングス	18,000	2,045.00	36,810,000
サワイグループホールディングス	40,100	5,900.00	236,590,000
日本コークス工業	177,700	118.00	20,968,600
ニチレキ	22,800	2,439.00	55,609,200
ユシロ化学工業	9,100	2,168.00	19,728,800
ピーピー・カストロール	3,000	911.00	2,733,000
富士石油	51,100	339.00	17,322,900
MORESCO	2,800	1,445.00	4,046,000
出光興産	972,900	927.50	902,364,750
ENEOSホールディングス	2,773,600	653.90	1,813,657,040
コスモエネルギーホールディングス	51,900	6,552.00	340,048,800
横浜ゴム	88,600	4,052.00	359,007,200
TOYO TIRE	100,700	2,872.00	289,210,400
ブリヂストン	512,800	6,288.00	3,224,486,400
住友ゴム工業	171,800	1,754.00	301,337,200
藤倉コンポジット	13,500	1,448.00	19,548,000
オカモト	8,300	4,855.00	40,296,500
フコク	9,200	1,550.00	14,260,000
ニッタ	17,800	3,740.00	66,572,000
住友理工	27,200	1,115.00	30,328,000
三ツ星ベルト	21,300	4,920.00	104,796,000
バンドー化学	26,000	1,717.00	44,642,000
日東紡績	22,200	4,905.00	108,891,000
AGC	156,300	5,420.00	847,146,000
日本板硝子	83,600	541.00	45,227,600
石塚硝子	1,400	3,275.00	4,585,000
日本山村硝子	3,100	1,480.00	4,588,000
日本電気硝子	71,600	3,589.00	256,972,400

オハラ	8,500	1,176.00	9,996,000
住友大阪セメント	29,200	3,665.00	107,018,000
太平洋セメント	103,700	3,254.00	337,439,800
日本ヒューム	15,600	878.00	13,696,800
日本コンクリート工業	34,400	456.00	15,686,400
三谷セキサン	7,400	5,680.00	42,032,000
アジアパイルホールディングス	25,200	791.00	19,933,200
東海カーボン	161,800	1,030.50	166,734,900
日本カーボン	9,300	5,440.00	50,592,000
東洋炭素	12,400	6,820.00	84,568,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	7,990.00	77,503,000
TOTO	115,700	3,747.00	433,527,900
日本碍子	203,900	1,923.50	392,201,650
日本特殊陶業	146,800	4,319.00	634,029,200
MARUWA	6,500	31,500.00	204,750,000
品川リフラクトリーズ	21,700	2,103.00	45,635,100
黒崎播磨	3,600	13,760.00	49,536,000
ヨータイ	10,900	1,445.00	15,750,500
東京窯業	8,700	472.00	4,106,400
ニッカトー	3,800	580.00	2,204,000
フジインコーポレーテッド	47,200	3,270.00	154,344,000
クニミネ工業	2,500	1,019.00	2,547,500
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,341.00	2,413,800
ニチアス	44,400	3,745.00	166,278,000
ニチハ	22,000	3,500.00	77,000,000
日本製鉄	807,000	3,585.00	2,893,095,000
神戸製鋼所	362,500	2,035.50	737,868,750
中山製鋼所	41,200	933.00	38,439,600
合同製鐵	10,100	6,020.00	60,802,000
JFEホールディングス	501,200	2,332.50	1,169,049,000
東京製鐵	50,700	1,720.00	87,204,000
共英製鋼	20,500	2,292.00	46,986,000
大和工業	34,000	8,533.00	290,122,000
東京鐵鋼	8,000	5,370.00	42,960,000
大阪製鐵	8,300	2,369.00	19,662,700
淀川製鋼所	20,500	4,280.00	87,740,000
中部鋼鈹	11,800	2,524.00	29,783,200
丸一鋼管	54,900	3,994.00	219,270,600
モリ工業	3,700	4,785.00	17,704,500
大同特殊鋼	113,500	1,770.50	200,951,750
日本高周波鋼業	3,100	604.00	1,872,400
日本冶金工業	13,200	4,550.00	60,060,000

山陽特殊製鋼	17,800	2,230.00	39,694,000
愛知製鋼	10,400	3,530.00	36,712,000
日本金属	2,100	857.00	1,799,700
大太平洋金属	15,400	1,404.00	21,621,600
新日本電工	89,700	304.00	27,268,800
栗本鐵工所	8,400	3,300.00	27,720,000
虹技	1,100	1,535.00	1,688,500
三菱製鋼	13,400	1,436.00	19,242,400
日亜鋼業	8,200	345.00	2,829,000
日本精線	2,900	5,720.00	16,588,000
エンビプロ・ホールディングス	14,300	504.00	7,207,200
シンニッタン	10,100	275.00	2,777,500
新家工業	1,700	3,530.00	6,001,000
大紀アルミニウム工業所	22,800	1,240.00	28,272,000
日本軽金属ホールディングス	52,700	1,737.00	91,539,900
三井金属鉱業	52,500	4,385.00	230,212,500
東邦亜鉛	11,600	1,073.00	12,446,800
三菱マテリアル	128,900	2,622.00	337,975,800
住友金属鉱山	209,000	4,105.00	857,945,000
D O W Aホールディングス	44,600	5,616.00	250,473,600
古河機械金属	23,800	1,777.00	42,292,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,300	2,756.00	86,262,800
東邦チタニウム	37,300	1,756.00	65,498,800
U A C J	25,300	4,175.00	105,627,500
C Kサンエツ	4,400	3,840.00	16,896,000
古河電気工業	60,000	2,899.50	173,970,000
住友電気工業	674,200	2,151.50	1,450,541,300
フジクラ	212,600	1,759.50	374,069,700
S W C C	20,200	3,340.00	67,468,000
タツタ電線	31,900	692.00	22,074,800
カナレ電気	1,400	1,730.00	2,422,000
平河ヒューテック	11,600	1,358.00	15,752,800
リョービ	19,200	2,660.00	51,072,000
アーレスティ	8,900	786.00	6,995,400
A R Eホールディングス	67,700	1,958.00	132,556,600
稲葉製作所	8,900	1,515.00	13,483,500
宮地エンジニアリンググループ	9,000	3,965.00	35,685,000
トーカロ	52,000	1,618.00	84,136,000
アルファC o	2,900	1,643.00	4,764,700
S U M C O	320,200	2,210.00	707,642,000
川田テクノロジーズ	4,300	9,110.00	39,173,000
R S Technologies	12,100	2,591.00	31,351,100

ジェイテックコーポレーション	1,300	2,089.00	2,715,700
信和	5,100	745.00	3,799,500
東洋製罐グループホールディングス	107,000	2,495.50	267,018,500
ホッカンホールディングス	8,800	1,850.00	16,280,000
コロナ	10,100	969.00	9,786,900
横河ブリッジホールディングス	28,200	2,766.00	78,001,200
駒井ハルテック	1,400	2,139.00	2,994,600
高田機工	600	3,455.00	2,073,000
三和ホールディングス	181,100	2,656.00	481,001,600
文化シャッター	47,200	1,606.00	75,803,200
三協立山	22,700	886.00	20,112,200
アルインコ	13,700	1,046.00	14,330,200
東洋シャッター	1,800	728.00	1,310,400
LIXIL	281,400	1,961.00	551,825,400
日本フィルコン	5,200	550.00	2,860,000
ノーリツ	29,900	1,654.00	49,454,600
長府製作所	17,900	2,103.00	37,643,700
リンナイ	87,800	3,527.00	309,670,600
ダイニチ工業	4,000	703.00	2,812,000
日東精工	26,100	580.00	15,138,000
三洋工業	900	3,625.00	3,262,500
岡部	32,200	826.00	26,597,200
ジーテクト	23,000	2,007.00	46,161,000
東プレ	31,800	2,295.00	72,981,000
高周波熱錬	27,800	1,080.00	30,024,000
東京製綱	11,700	1,555.00	18,193,500
サンコール	16,000	470.00	7,520,000
モリテック スチール	7,000	265.00	1,855,000
パイオラックス	22,400	2,685.00	60,144,000
エイチワン	18,500	690.00	12,765,000
日本発條	159,400	1,472.50	234,716,500
中央発條	13,300	740.00	9,842,000
アドバネクス	1,000	1,086.00	1,086,000
立川ブラインド工業	8,100	1,466.00	11,874,600
三益半導体工業	16,200	3,160.00	51,192,000
日本ドライケミカル	1,900	2,618.00	4,974,200
日本製綱所	48,600	2,497.00	121,354,200
三浦工業	73,700	2,961.00	218,225,700
タクマ	59,700	1,911.00	114,086,700
ツガミ	39,300	1,149.00	45,155,700
オークマ	15,400	7,060.00	108,724,000
芝浦機械	17,600	3,400.00	59,840,000

アマダ	281,500	1,605.00	451,807,500
アイダエンジニアリング	40,900	846.00	34,601,400
F U J I	83,100	2,616.50	217,431,150
牧野フライス製作所	19,500	5,770.00	112,515,000
オーエスジー	77,800	2,105.50	163,807,900
ダイジェット工業	900	833.00	749,700
旭ダイヤモンド工業	40,800	865.00	35,292,000
D M G 森精機	107,000	3,377.00	361,339,000
ソディック	43,000	723.00	31,089,000
ディスコ	84,900	43,540.00	3,696,546,000
日東工器	8,600	1,915.00	16,469,000
日進工具	16,400	1,000.00	16,400,000
パンチ工業	7,800	422.00	3,291,600
富士ダイス	10,500	679.00	7,129,500
豊和工業	4,300	765.00	3,289,500
リケンN P R	19,200	2,998.00	57,561,600
東洋機械金属	6,500	707.00	4,595,500
エンシュウ	1,900	687.00	1,305,300
島精機製作所	28,100	1,405.00	39,480,500
オプトラン	29,000	1,790.00	51,910,000
N C ホールディングス	1,900	1,512.00	2,872,800
イワキポンプ	11,800	2,343.00	27,647,400
フリュー	16,700	1,234.00	20,607,800
ヤマシンフィルタ	42,500	361.00	15,342,500
日阪製作所	19,300	985.00	19,010,500
やまびこ	28,800	1,830.00	52,704,000
野村マイクロ・サイエンス	6,000	14,280.00	85,680,000
平田機工	8,400	7,520.00	63,168,000
P E G A S U S	19,600	464.00	9,094,400
マルマエ	7,700	1,930.00	14,861,000
タツモ	10,700	3,845.00	41,141,500
ナプテスコ	110,700	2,442.50	270,384,750
三井海洋開発	22,300	3,035.00	67,680,500
レオン自動機	20,400	1,398.00	28,519,200
S M C	52,800	82,860.00	4,375,008,000
ホソカワミクロン	11,300	4,250.00	48,025,000
ユニオンツール	7,800	3,785.00	29,523,000
瑞光	12,700	1,827.00	23,202,900
オイレス工業	23,900	2,054.00	49,090,600
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,360.00	30,520,000
サトーホールディングス	25,100	2,243.00	56,299,300
技研製作所	16,600	2,098.00	34,826,800

日本エアーテック	8,300	1,157.00	9,603,100
カワタ	2,500	1,048.00	2,620,000
日精樹脂工業	13,200	1,132.00	14,942,400
オカダアイヨン	2,600	2,809.00	7,303,400
ワイエイシイホールディングス	6,600	2,294.00	15,140,400
小松製作所	827,000	4,319.00	3,571,813,000
住友重機械工業	104,400	4,489.00	468,651,600
日立建機	70,300	4,219.00	296,595,700
日工	26,200	761.00	19,938,200
巴工業	6,900	3,730.00	25,737,000
井関農機	16,600	1,009.00	16,749,400
TOWA	19,600	7,830.00	153,468,000
丸山製作所	1,300	2,352.00	3,057,600
北川鉄工所	7,000	1,580.00	11,060,000
ローツェ	9,200	19,860.00	182,712,000
タカキタ	2,600	481.00	1,250,600
クボタ	922,400	2,182.50	2,013,138,000
荏原実業	9,300	3,170.00	29,481,000
三菱化工機	6,200	3,850.00	23,870,000
月島ホールディングス	23,900	1,327.00	31,715,300
帝国電機製作所	12,400	2,704.00	33,529,600
新東工業	35,700	1,150.00	41,055,000
澁谷工業	16,600	3,135.00	52,041,000
アイチ コーポレーション	24,600	1,113.00	27,379,800
小森コーポレーション	43,500	1,305.00	56,767,500
鶴見製作所	13,500	3,315.00	44,752,500
日本ギア工業	3,100	634.00	1,965,400
酒井重工業	2,800	6,480.00	18,144,000
荏原製作所	72,400	11,000.00	796,400,000
石井鐵工所	1,000	2,760.00	2,760,000
西島製作所	15,200	2,500.00	38,000,000
北越工業	17,800	2,493.00	44,375,400
ダイキン工業	210,600	21,420.00	4,511,052,000
オルガノ	21,200	6,760.00	143,312,000
トーヨーカネツ	6,000	4,500.00	27,000,000
栗田工業	98,700	5,881.00	580,454,700
椿本チエイン	25,000	4,695.00	117,375,000
大同工業	3,500	753.00	2,635,500
木村化工機	13,600	721.00	9,805,600
アネスト岩田	27,300	1,331.00	36,336,300
ダイフク	297,800	3,332.00	992,269,600
サムコ	4,700	5,020.00	23,594,000

加藤製作所	4,000	1,425.00	5,700,000
油研工業	1,300	2,390.00	3,107,000
タダノ	101,600	1,300.50	132,130,800
フジテック	41,200	3,699.00	152,398,800
C K D	48,800	2,767.00	135,029,600
平和	52,200	2,070.00	108,054,000
理想科学工業	14,100	3,275.00	46,177,500
S A N K Y O	40,600	9,089.00	369,013,400
日本金銭機械	21,400	1,424.00	30,473,600
マースグループホールディングス	8,900	2,826.00	25,151,400
フクシマガリレイ	11,500	5,780.00	66,470,000
オーイズミ	3,000	415.00	1,245,000
ダイコク電機	8,700	4,390.00	38,193,000
竹内製作所	32,000	5,120.00	163,840,000
アマノ	50,100	3,732.00	186,973,200
J U K I	27,400	502.00	13,754,800
ジャノメ	17,900	683.00	12,225,700
マックス	24,900	3,100.00	77,190,000
グローリー	42,400	2,905.00	123,172,000
新晃工業	17,800	3,085.00	54,913,000
大和冷機工業	27,100	1,470.00	39,837,000
セガサミーホールディングス	157,600	1,795.50	282,970,800
T P R	22,400	2,121.00	47,510,400
ツバキ・ナカシマ	35,400	765.00	27,081,000
ホシザキ	104,100	5,436.00	565,887,600
大豊工業	15,300	832.00	12,729,600
日本精工	326,700	790.90	258,387,030
N T N	382,800	289.00	110,629,200
ジェイテクト	157,000	1,350.00	211,950,000
不二越	13,000	3,325.00	43,225,000
日本トムソン	48,100	607.00	29,196,700
T H K	101,800	3,092.00	314,765,600
ユーシン精機	14,000	674.00	9,436,000
前澤給装工業	13,600	1,299.00	17,666,400
イーグル工業	19,500	1,806.00	35,217,000
前澤工業	5,000	1,063.00	5,315,000
日本ピラー工業	16,400	5,530.00	90,692,000
キッツ	59,100	1,288.00	76,120,800
マキタ	201,200	3,857.00	776,028,400
三井E & S	87,500	1,241.00	108,587,500
日立造船	155,700	1,039.00	161,772,300
三菱重工業	308,500	11,270.00	3,476,795,000

I H I	131,400	3,138.00	412,333,200
スター精密	32,900	1,646.00	54,153,400
日清紡ホールディングス	132,600	1,257.50	166,744,500
イビデン	92,000	7,157.00	658,444,000
コニカミノルタ	394,600	473.60	186,882,560
ブラザー工業	235,800	2,502.50	590,089,500
ミネベアミツミ	306,900	3,039.00	932,669,100
日立製作所	847,900	12,185.00	10,331,661,500
三菱電機	1,963,600	2,276.00	4,469,153,600
富士電機	107,300	9,064.00	972,567,200
東洋電機製造	2,800	1,062.00	2,973,600
安川電機	191,600	5,439.00	1,042,112,400
シンフォニアテクノロジー	19,500	2,510.00	48,945,000
明電舎	32,700	2,730.00	89,271,000
オリジン	1,700	1,223.00	2,079,100
山洋電気	7,700	6,070.00	46,739,000
デンヨー	13,400	2,342.00	31,382,800
PHCホールディングス	33,100	1,327.00	43,923,700
KOKUSAI ELECTRIC	68,200	4,710.00	321,222,000
ソシオネクスト	128,100	3,842.00	492,160,200
東芝テック	22,600	3,040.00	68,704,000
芝浦メカトロニクス	10,100	6,710.00	67,771,000
マブチモーター	86,900	2,831.50	246,057,350
ニデック	389,500	5,724.00	2,229,498,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,700	374.00	4,375,800
トレックス・セミコンダクター	9,200	1,836.00	16,891,200
東光高岳	10,700	2,393.00	25,605,100
ダブル・スコープ	50,500	756.00	38,178,000
ダイヘン	17,700	7,070.00	125,139,000
ヤーマン	34,500	1,019.00	35,155,500
JVCケンウッド	139,600	715.00	99,814,000
ミマキエンジニアリング	17,000	1,003.00	17,051,000
I - P E X	12,400	1,785.00	22,134,000
大崎電気工業	38,600	673.00	25,977,800
オムロン	134,700	5,535.00	745,564,500
日東工業	23,800	4,250.00	101,150,000
I D E C	26,000	2,807.00	72,982,000
正興電機製作所	2,800	1,164.00	3,259,200
不二電機工業	1,800	1,139.00	2,050,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	69,000	2,722.50	187,852,500
サクサホールディングス	1,800	3,170.00	5,706,000
メルコホールディングス	5,600	3,220.00	18,032,000

テクノメディカ	4,400	1,804.00	7,937,600
日本電気	231,700	9,958.00	2,307,268,600
富士通	162,300	23,455.00	3,806,746,500
沖電気工業	79,800	1,112.00	88,737,600
岩崎通信機	3,700	632.00	2,338,400
電気興業	7,900	2,114.00	16,700,600
サンケン電気	16,400	7,872.00	129,100,800
ナカヨ	1,200	1,161.00	1,393,200
アイホン	9,500	2,810.00	26,695,000
ルネサスエレクトロニクス	1,151,500	2,402.00	2,765,903,000
セイコーエプソン	226,400	2,420.00	547,888,000
ワコム	134,500	631.00	84,869,500
アルバック	38,700	8,742.00	338,315,400
アクセル	7,100	1,968.00	13,972,800
E I Z O	12,900	5,110.00	65,919,000
日本信号	40,200	965.00	38,793,000
京三製作所	36,900	458.00	16,900,200
能美防災	23,900	2,280.00	54,492,000
ホーチキ	13,300	2,239.00	29,778,700
星和電機	3,900	520.00	2,028,000
エレコム	42,300	1,613.00	68,229,900
パナソニック ホールディングス	2,084,100	1,419.50	2,958,379,950
シャープ	297,400	820.00	243,868,000
アンリツ	124,300	1,161.50	144,374,450
富士通ゼネラル	50,000	1,986.50	99,325,000
ソニーグループ	1,235,600	13,475.00	16,649,710,000
T D K	279,400	7,779.00	2,173,452,600
帝国通信工業	7,800	1,876.00	14,632,800
タムラ製作所	70,300	570.00	40,071,000
アルプスアルパイン	157,700	1,032.00	162,746,400
池上通信機	2,500	850.00	2,125,000
日本電波工業	21,300	1,374.00	29,266,200
鈴木	9,600	1,155.00	11,088,000
メイコー	17,600	4,410.00	77,616,000
日本トリム	4,000	3,230.00	12,920,000
ローランド ディー・ジー	9,700	5,020.00	48,694,000
フォスター電機	13,100	1,126.00	14,750,600
S M K	4,700	2,443.00	11,482,100
ヨコオ	15,700	1,556.00	24,429,200
ホシデン	40,200	1,988.00	79,917,600
ヒロセ電機	26,000	16,075.00	417,950,000
日本航空電子工業	42,200	2,750.00	116,050,000

TOA	20,100	1,128.00	22,672,800
マクセル	39,100	1,565.00	61,191,500
古野電気	23,000	2,181.00	50,163,000
スミダコーポレーション	23,800	1,194.00	28,417,200
アイコム	6,800	3,455.00	23,494,000
リオン	7,300	2,653.00	19,366,900
横河電機	193,000	3,070.00	592,510,000
新電元工業	6,800	3,090.00	21,012,000
アズビル	120,200	4,578.00	550,275,600
東亜ディーケーケー	3,900	987.00	3,849,300
日本光電工業	75,000	4,182.00	313,650,000
チノー	7,300	2,305.00	16,826,500
共和電業	7,200	421.00	3,031,200
日本電子材料	10,700	2,055.00	21,988,500
堀場製作所	33,300	14,130.00	470,529,000
アドバンテスト	500,500	6,796.00	3,401,398,000
小野測器	3,700	579.00	2,142,300
エスベック	14,100	2,662.00	37,534,200
キーエンス	174,800	68,780.00	12,022,744,000
日置電機	8,300	6,820.00	56,606,000
シスメックス	150,700	8,170.00	1,231,219,000
日本マイクロニクス	31,400	6,000.00	188,400,000
メガチップス	13,900	4,265.00	59,283,500
OBARA GROUP	9,600	3,705.00	35,568,000
澤藤電機	1,100	1,300.00	1,430,000
原田工業	3,700	762.00	2,819,400
コーセル	21,100	1,535.00	32,388,500
イリソ電子工業	16,100	3,070.00	49,427,000
オブテックスグループ	32,200	1,820.00	58,604,000
千代田インテグレ	6,900	2,650.00	18,285,000
レーザーテック	80,100	40,440.00	3,239,244,000
スタンレー電気	111,900	2,553.50	285,736,650
ウシオ電機	88,900	2,027.50	180,244,750
岡谷電機産業	6,800	273.00	1,856,400
ヘリオス テクノ ホールディング	8,100	554.00	4,487,400
エノモト	2,300	1,584.00	3,643,200
日本セラミック	14,300	2,545.00	36,393,500
遠藤照明	3,600	1,560.00	5,616,000
古河電池	13,100	974.00	12,759,400
双信電機	3,800	295.00	1,121,000
山一電機	15,800	2,213.00	34,965,400
図研	15,300	4,265.00	65,254,500

日本電子	43,800	6,519.00	285,532,200
カシオ計算機	126,200	1,199.50	151,376,900
ファナック	851,800	4,085.00	3,479,603,000
日本シイエムケイ	37,400	607.00	22,701,800
エンプラス	5,100	8,790.00	44,829,000
大真空	26,300	887.00	23,328,100
ローム	323,000	2,623.00	847,229,000
浜松ホトニクス	140,200	5,270.00	738,854,000
三井ハイテック	15,500	7,839.00	121,504,500
新光電気工業	61,900	5,475.00	338,902,500
京セラ	1,085,400	2,205.50	2,393,849,700
太陽誘電	85,100	3,365.00	286,361,500
村田製作所	1,589,300	2,981.00	4,737,703,300
双葉電子工業	33,700	516.00	17,389,200
北陸電気工業	3,100	1,400.00	4,340,000
ニチコン	46,000	1,206.00	55,476,000
日本ケミコン	18,700	1,339.00	25,039,300
K O A	26,600	1,508.00	40,112,800
市光工業	31,900	539.00	17,194,100
小糸製作所	181,100	1,962.50	355,408,750
ミツバ	32,800	1,348.00	44,214,400
S C R E E Nホールディングス	59,700	18,350.00	1,095,495,000
キャノン電子	19,400	2,275.00	44,135,000
キャノン	871,200	4,196.00	3,655,555,200
リコー	438,000	1,278.50	559,983,000
象印マホービン	47,600	1,417.00	67,449,200
M U T O Hホールディングス	1,200	2,342.00	2,810,400
東京エレクトロン	369,700	34,800.00	12,865,560,000
イノテック	11,800	1,860.00	21,948,000
トヨタ紡織	73,600	2,439.00	179,510,400
芦森工業	1,600	2,766.00	4,425,600
ユニプレス	31,400	1,066.00	33,472,400
豊田自動織機	149,000	14,715.00	2,192,535,000
モリタホールディングス	30,700	1,628.00	49,979,600
三櫻工業	26,700	1,007.00	26,886,900
デンソー	1,441,200	2,683.50	3,867,460,200
東海理化電機製作所	49,300	2,358.00	116,249,400
川崎重工業	142,600	3,794.00	541,024,400
名村造船所	43,500	1,863.00	81,040,500
日本車輛製造	6,100	2,299.00	14,023,900
三菱ロジスネクスト	27,900	1,463.00	40,817,700
近畿車輛	1,100	2,361.00	2,597,100

日産自動車	2,357,300	564.30	1,330,224,390
いすゞ自動車	507,800	2,147.50	1,090,500,500
トヨタ自動車	9,591,500	3,430.00	32,898,845,000
日野自動車	262,700	472.70	124,178,290
三菱自動車工業	681,400	454.60	309,764,440
エフテック	5,400	701.00	3,785,400
レシップホールディングス	3,300	647.00	2,135,100
GMB	1,600	1,181.00	1,889,600
ファルテック	1,600	530.00	848,000
武蔵精密工業	42,700	1,639.00	69,985,300
日産車体	20,400	977.00	19,930,800
新明和工業	50,300	1,185.00	59,605,500
極東開発工業	28,800	2,426.00	69,868,800
トピー工業	14,200	2,910.00	41,322,000
ティラド	3,900	3,855.00	15,034,500
曙ブレーキ工業	106,600	116.00	12,365,600
タチエス	32,300	2,020.00	65,246,000
NOK	67,900	2,089.50	141,877,050
フタバ産業	46,900	998.00	46,806,200
カヤバ	16,800	4,880.00	81,984,000
大同メタル工業	34,300	550.00	18,865,000
プレス工業	69,900	654.00	45,714,600
ミクニ	9,900	465.00	4,603,500
太平洋工業	40,100	1,457.00	58,425,700
アイシン	134,800	5,266.00	709,856,800
マツダ	577,800	1,741.50	1,006,238,700
今仙電機製作所	5,000	687.00	3,435,000
本田技研工業	4,259,700	1,744.00	7,428,916,800
スズキ	320,800	6,712.00	2,153,209,600
S U B A R U	541,700	3,358.00	1,819,028,600
安永	3,500	748.00	2,618,000
ヤマハ発動機	754,900	1,362.50	1,028,551,250
T B K	8,600	398.00	3,422,800
エクセディ	28,600	2,852.00	81,567,200
豊田合成	50,800	2,932.00	148,945,600
愛三工業	29,000	1,434.00	41,586,000
盟和産業	1,200	1,029.00	1,234,800
日本プラスト	6,700	519.00	3,477,300
ヨロズ	16,400	918.00	15,055,200
エフ・シー・シー	31,000	2,100.00	65,100,000
シマノ	70,600	20,175.00	1,424,355,000
テイ・エス テック	62,200	1,949.50	121,258,900

ジャムコ	8,500	1,352.00	11,492,000
テルモ	488,400	5,633.00	2,751,157,200
クリエートメディック	2,500	957.00	2,392,500
日機装	40,700	1,176.00	47,863,200
日本エム・ディ・エム	13,900	720.00	10,008,000
島津製作所	232,100	3,828.00	888,478,800
JMS	16,200	518.00	8,391,600
長野計器	12,700	2,181.00	27,698,700
ブイ・テクノロジー	9,200	2,650.00	24,380,000
東京計器	13,400	2,326.00	31,168,400
愛知時計電機	7,600	2,510.00	19,076,000
インターアクション	10,500	1,152.00	12,096,000
オーバル	6,800	510.00	3,468,000
東京精密	35,700	9,696.00	346,147,200
マニー	69,900	2,086.00	145,811,400
ニコン	252,600	1,553.00	392,287,800
トプコン	84,900	1,753.00	148,829,700
オリンパス	1,075,200	2,195.00	2,360,064,000
理研計器	12,400	7,900.00	97,960,000
タムロン	10,700	6,410.00	68,587,000
HOYA	343,900	18,445.00	6,343,235,500
シード	3,900	748.00	2,917,200
ノーリツ鋼機	16,600	3,050.00	50,630,000
A & Dホロンホールディングス	25,500	2,134.00	54,417,000
朝日インテック	212,900	2,880.00	613,152,000
シチズン時計	160,700	1,066.00	171,306,200
リズム	1,700	3,640.00	6,188,000
大研医器	6,700	529.00	3,544,300
メニコン	60,100	1,714.00	103,011,400
シンシア	900	524.00	471,600
松風	7,900	2,690.00	21,251,000
セイコーグループ	24,300	3,135.00	76,180,500
ニプロ	145,600	1,265.50	184,256,800
KYORITSU	11,500	195.00	2,242,500
中本パックス	2,500	1,734.00	4,335,000
スノーピーク	24,900	988.00	24,601,200
パラマウントベッドホールディングス	36,300	2,490.00	90,387,000
トランザクション	11,500	2,557.00	29,405,500
粧美堂	2,100	677.00	1,421,700
ニホンフラッシュ	16,400	960.00	15,744,000
前田工織	14,800	3,355.00	49,654,000
永大産業	9,100	281.00	2,557,100

アートネイチャー	16,300	790.00	12,877,000
フルヤ金属	4,100	9,740.00	39,934,000
バンダイナムコホールディングス	478,500	2,910.00	1,392,435,000
アイフィスジャパン	2,100	610.00	1,281,000
S H O E I	39,500	2,057.00	81,251,500
フランスベッドホールディングス	22,600	1,312.00	29,651,200
パイロットコーポレーション	24,600	3,845.00	94,587,000
萩原工業	11,700	1,500.00	17,550,000
フジシールインターナショナル	35,400	1,985.00	70,269,000
タカラトミー	79,500	2,331.00	185,314,500
広済堂ホールディングス	45,000	671.00	30,195,000
エステールホールディングス	1,800	648.00	1,166,400
タカノ	2,900	1,048.00	3,039,200
プロネクサス	18,100	1,221.00	22,100,100
ホクシン	5,900	115.00	678,500
ウッドワン	2,800	1,041.00	2,914,800
T O P P A Nホールディングス	214,700	3,518.00	755,314,600
大日本印刷	190,900	4,556.00	869,740,400
共同印刷	4,900	3,180.00	15,582,000
N I S S H A	29,900	1,530.00	45,747,000
光村印刷	600	1,739.00	1,043,400
T A K A R A & C O M P A N Y	11,100	2,818.00	31,279,800
アシックス	148,800	5,758.00	856,790,400
ツツミ	4,100	2,119.00	8,687,900
ローランド	12,900	4,810.00	62,049,000
小松ウオール工業	7,100	3,395.00	24,104,500
ヤマハ	110,100	3,325.00	366,082,500
河合楽器製作所	5,300	3,405.00	18,046,500
クリナップ	17,200	761.00	13,089,200
ピジョン	111,300	1,573.50	175,130,550
キングジム	15,400	879.00	13,536,600
リンテック	35,100	3,085.00	108,283,500
イトーキ	35,800	2,070.00	74,106,000
任天堂	1,102,800	8,356.00	9,214,996,800
三菱鉛筆	24,800	2,474.00	61,355,200
タカラスタANDARD	36,800	1,868.00	68,742,400
コクヨ	71,500	2,466.00	176,319,000
ナカバヤシ	18,800	534.00	10,039,200
グローブライド	15,700	2,020.00	31,714,000
オカムラ	52,600	2,173.00	114,299,800
美津濃	17,400	5,170.00	89,958,000
東京電力ホールディングス	1,574,600	789.00	1,242,359,400

中部電力	643,700	1,917.50	1,234,294,750
関西電力	674,500	1,943.00	1,310,553,500
中国電力	303,500	990.00	300,465,000
北陸電力	178,600	730.00	130,378,000
東北電力	459,900	1,004.00	461,739,600
四国電力	162,700	1,042.50	169,614,750
九州電力	402,700	1,140.00	459,078,000
北海道電力	168,800	635.10	107,204,880
沖縄電力	44,600	1,093.00	48,747,800
電源開発	143,500	2,489.00	357,171,500
エフオン	12,700	413.00	5,245,100
イーレックス	31,100	761.00	23,667,100
レノバ	46,600	1,241.00	57,830,600
東京瓦斯	369,300	3,216.00	1,187,668,800
大阪瓦斯	353,800	3,064.00	1,084,043,200
東邦瓦斯	75,600	2,944.50	222,604,200
北海道瓦斯	10,400	2,281.00	23,722,400
広島ガス	36,900	385.00	14,206,500
西部ガスホールディングス	18,200	1,887.00	34,343,400
静岡ガス	34,800	964.00	33,547,200
メタウォーター	20,900	2,219.00	46,377,100
SBSホールディングス	15,600	2,325.00	36,270,000
東武鉄道	191,900	3,881.00	744,763,900
相鉄ホールディングス	62,500	2,732.50	170,781,250
東急	489,800	1,773.50	868,660,300
京浜急行電鉄	216,200	1,285.00	277,817,000
小田急電鉄	288,900	2,129.00	615,068,100
京王電鉄	84,000	4,227.00	355,068,000
京成電鉄	112,600	7,580.00	853,508,000
富士急行	21,500	3,960.00	85,140,000
東日本旅客鉄道	320,900	9,051.00	2,904,465,900
西日本旅客鉄道	207,200	6,283.00	1,301,837,600
東海旅客鉄道	672,800	3,786.00	2,547,220,800
西武ホールディングス	211,300	2,169.50	458,415,350
鴻池運輸	29,800	1,822.00	54,295,600
西日本鉄道	46,700	2,438.00	113,854,600
ハマキョウレックス	14,900	3,900.00	58,110,000
サカイ引越センター	19,400	2,576.00	49,974,400
近鉄グループホールディングス	174,400	4,476.00	780,614,400
阪急阪神ホールディングス	232,500	4,378.00	1,017,885,000
南海電気鉄道	77,800	2,932.00	228,109,600
京阪ホールディングス	96,100	3,504.00	336,734,400

神戸電鉄	4,700	2,855.00	13,418,500
名古屋鉄道	179,900	2,182.50	392,631,750
山陽電気鉄道	13,100	2,128.00	27,876,800
アルプス物流	13,900	1,911.00	26,562,900
ヤマトホールディングス	223,300	2,419.50	540,274,350
山九	44,400	5,381.00	238,916,400
丸運	4,500	272.00	1,224,000
丸全昭和運輸	10,800	4,465.00	48,222,000
センコーグループホールディングス	92,300	1,129.00	104,206,700
トナミホールディングス	3,800	4,440.00	16,872,000
ニッコンホールディングス	55,800	3,229.00	180,178,200
日本石油輸送	800	2,831.00	2,264,800
福山通運	19,900	4,250.00	84,575,000
セイノーホールディングス	98,100	2,316.00	227,199,600
エスライングループ本社	2,300	875.00	2,012,500
神奈川中央交通	4,900	3,015.00	14,773,500
A Z - C O M丸和ホールディングス	44,600	1,423.00	63,465,800
C & F ロジホールディングス	16,800	1,777.00	29,853,600
九州旅客鉄道	123,300	3,363.00	414,657,900
S Gホールディングス	292,800	1,907.00	558,369,600
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	59,200	8,068.00	477,625,600
日本郵船	500,100	4,772.00	2,386,477,200
商船三井	378,600	5,262.00	1,992,193,200
川崎汽船	140,200	7,035.00	986,307,000
N Sユナイテッド海運	9,600	5,210.00	50,016,000
飯野海運	64,800	1,334.00	86,443,200
共栄タンカー	2,400	1,106.00	2,654,400
乾汽船	21,400	1,049.00	22,448,600
日本航空	428,300	2,787.00	1,193,672,100
A N Aホールディングス	474,500	3,232.00	1,533,584,000
パスコ	1,500	1,842.00	2,763,000
ランコム	5,100	6,390.00	32,589,000
日新	13,200	2,911.00	38,425,200
三菱倉庫	42,800	4,581.00	196,066,800
三井倉庫ホールディングス	16,300	4,665.00	76,039,500
住友倉庫	47,000	2,610.00	122,670,000
澁澤倉庫	8,000	3,065.00	24,520,000
東陽倉庫	2,000	1,524.00	3,048,000
日本トランスシティ	35,100	616.00	21,621,600
ケイヒン	1,400	1,949.00	2,728,600
中央倉庫	9,300	1,139.00	10,592,700
川西倉庫	1,400	1,152.00	1,612,800

安田倉庫	11,900	1,189.00	14,149,100
ファイズホールディングス	1,100	1,300.00	1,430,000
東洋埠頭	2,200	1,381.00	3,038,200
上組	80,500	3,444.00	277,242,000
サンリツ	1,900	767.00	1,457,300
キムラユニティー	3,700	1,554.00	5,749,800
キューソー流通システム	8,000	933.00	7,464,000
東海運	4,500	293.00	1,318,500
エーアイティー	10,900	1,844.00	20,099,600
内外トランスライン	7,000	2,411.00	16,877,000
日本コンセプト	6,300	1,914.00	12,058,200
NEC ネットエスアイ	68,300	2,358.00	161,051,400
クロスキャット	11,100	1,194.00	13,253,400
システナ	265,100	280.00	74,228,000
デジタルアーツ	11,100	4,555.00	50,560,500
日鉄ソリューションズ	29,900	4,950.00	148,005,000
キューブシステム	9,800	1,108.00	10,858,400
コア	7,800	1,817.00	14,172,600
手間いらず	3,000	2,774.00	8,322,000
ラクーンホールディングス	14,500	694.00	10,063,000
ソリトンシステムズ	9,000	1,384.00	12,456,000
ソフトクリエイティブホールディングス	14,400	1,909.00	27,489,600
T I S	191,600	3,396.00	650,673,600
テクミラホールディングス	3,600	462.00	1,663,200
グリー	58,700	528.00	30,993,600
GMOペパボ	2,200	1,340.00	2,948,000
コーエーテクモホールディングス	109,800	1,856.00	203,788,800
三菱総合研究所	8,600	4,865.00	41,839,000
電算	900	1,500.00	1,350,000
A G S	3,200	905.00	2,896,000
ファインデックス	13,900	1,169.00	16,249,100
ブレインパッド	14,600	1,435.00	20,951,000
K L a b	32,200	379.00	12,203,800
ポールトゥウィンホールディングス	30,000	526.00	15,780,000
ネクソン	392,100	2,550.00	999,855,000
アイスタイル	57,200	435.00	24,882,000
エムアップホールディングス	21,500	1,029.00	22,123,500
エイチーム	10,400	584.00	6,073,600
エニグモ	22,300	355.00	7,916,500
テクノスジャパン	6,900	601.00	4,146,900
コロブラ	68,000	598.00	40,664,000
ブロードリーフ	86,400	576.00	49,766,400

クロス・マーケティンググループ	3,700	603.00	2,231,100	
デジタルハーツホールディングス	10,900	1,091.00	11,891,900	
メディアドゥ	7,900	1,247.00	9,851,300	
じげん	51,100	507.00	25,907,700	
ブイキューブ	21,100	308.00	6,498,800	
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	578.00	1,040,400	
サイバーリンクス	3,000	816.00	2,448,000	
フィックスターズ	19,800	1,836.00	36,352,800	
CARTA HOLDINGS	8,200	1,461.00	11,980,200	
オブティム	18,000	1,093.00	19,674,000	
セレス	7,100	1,625.00	11,537,500	
SHIFT	11,600	26,900.00	312,040,000	
ティーガイア	18,300	2,136.00	39,088,800	
セック	2,100	5,490.00	11,529,000	
テクマトリックス	32,000	2,050.00	65,600,000	
プロシップ	8,400	1,475.00	12,390,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,600	2,320.50	105,814,800	
GMOペイメントゲートウェイ	35,000	8,467.00	296,345,000	
ザッパラス	1,800	433.00	779,400	
システムリサーチ	6,000	3,410.00	20,460,000	
インターネットイニシアティブ	83,700	2,851.00	238,628,700	
さくらインターネット	19,700	5,240.00	103,228,000	
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	9,000	3,940.00	35,460,000	
システムインテグレータ	2,400	430.00	1,032,000	
朝日ネット	18,800	632.00	11,881,600	
eBASE	24,700	735.00	18,154,500	
アバントグループ	22,100	1,331.00	29,415,100	
アドソル日進	7,400	1,684.00	12,461,600	
ODKソリューションズ	1,700	607.00	1,031,900	
フリービット	9,200	1,658.00	15,253,600	
コムチュア	25,300	1,898.00	48,019,400	
アステリア	13,700	656.00	8,987,200	
アイル	8,200	3,535.00	28,987,000	
マークライنز	9,500	3,200.00	30,400,000	
メディカル・データ・ビジョン	21,000	580.00	12,180,000	
gumi	28,500	406.00	11,571,000	
ショーケース	1,800	328.00	590,400	
モバイルファクトリー	1,700	745.00	1,266,500	
テラスカイ	7,600	1,545.00	11,742,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,100	1,900.00	19,190,000	
PCIホールディングス	2,900	943.00	2,734,700	

アイピーシー	1,200	431.00	517,200
ネオジャパン	5,900	1,109.00	6,543,100
P R T I M E S	3,500	2,064.00	7,224,000
ラクス	82,900	2,199.50	182,338,550
ランドコンピュータ	3,800	893.00	3,393,400
ダブルスタンダード	5,300	1,901.00	10,075,300
オープンドア	10,200	821.00	8,374,200
アカツキ	8,300	2,494.00	20,700,200
ベネフィットジャパン	500	1,242.00	621,000
U b i c o mホールディングス	5,500	1,428.00	7,854,000
カナミックネットワーク	18,900	525.00	9,922,500
ノムラシステムコーポレーション	8,600	112.00	963,200
チェンジホールディングス	38,200	1,554.00	59,362,800
シンクロ・フード	4,900	697.00	3,415,300
オークネット	6,500	1,981.00	12,876,500
キャピタル・アセット・プランニング	1,500	761.00	1,141,500
セグエグループ	2,500	1,993.00	4,982,500
エイトレッド	1,200	1,426.00	1,711,200
マクロミル	34,400	784.00	26,969,600
ビーグリー	1,600	1,167.00	1,867,200
オロ	6,300	2,805.00	17,671,500
ユーザーローカル	7,400	2,382.00	17,626,800
テモナ	1,900	239.00	454,100
ニーズウェル	4,300	856.00	3,680,800
マネーフォワード	39,000	5,816.00	226,824,000
サインポスト	3,000	581.00	1,743,000
S u n A s t e r i s k	12,500	997.00	12,462,500
プラスアルファ・コンサルティング	10,400	2,462.00	25,604,800
電算システムホールディングス	7,800	2,672.00	20,841,600
A p p i e r G r o u p	59,900	1,844.00	110,455,600
ビジョナル	13,400	9,440.00	126,496,000
ソルクシーズ	6,300	342.00	2,154,600
フェイス	2,200	461.00	1,014,200
プロトコーポレーション	19,200	1,292.00	24,806,400
ハイマックス	5,500	1,402.00	7,711,000
野村総合研究所	388,100	4,088.00	1,586,552,800
C Eホールディングス	4,000	546.00	2,184,000
日本システム技術	6,500	3,240.00	21,060,000
インテージホールディングス	19,800	1,776.00	35,164,800
東邦システムサイエンス	6,500	1,278.00	8,307,000
ソースネクスト	80,300	142.00	11,402,600
インフォコム	22,600	2,258.00	51,030,800

シンプレクス・ホールディングス	26,400	2,550.00	67,320,000
HEROZ	6,900	1,935.00	13,351,500
ラクスル	42,200	1,075.00	45,365,000
メルカリ	85,300	2,192.00	186,977,600
I P S	5,000	2,280.00	11,400,000
F I G	9,000	319.00	2,871,000
システムサポート	6,800	1,885.00	12,818,000
イーソル	12,700	1,007.00	12,788,900
東海ソフト	1,300	1,161.00	1,509,300
ウイングアーク1st	18,200	3,030.00	55,146,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,178.00	5,536,600
サーバーワークス	3,600	4,105.00	14,778,000
東名	600	2,400.00	1,440,000
ヴィッツ	800	765.00	612,000
トピラシステムズ	2,200	839.00	1,845,800
S a n s a n	57,500	1,512.00	86,940,000
L i n k - U	1,900	681.00	1,293,900
ギフトィ	15,400	1,460.00	22,484,000
メドレー	23,500	4,765.00	111,977,500
ベース	6,100	3,560.00	21,716,000
J M D C	29,900	3,734.00	111,646,600
フォーカスシステムズ	11,700	1,065.00	12,460,500
クレスコ	14,400	1,898.00	27,331,200
フジ・メディア・ホールディングス	168,300	1,950.50	328,269,150
オービック	58,600	22,185.00	1,300,041,000
ジャストシステム	25,200	2,558.00	64,461,600
T D C ソフト	16,400	2,238.00	36,703,200
L I N E ヤフー	2,494,100	423.20	1,055,503,120
トレンドマイクロ	82,800	7,183.00	594,752,400
I D ホールディングス	11,800	1,640.00	19,352,000
日本オラクル	33,500	11,585.00	388,097,500
アルファシステムズ	4,600	3,475.00	15,985,000
フューチャー	37,400	1,674.00	62,607,600
C A C H o l d i n g s	9,400	1,799.00	16,910,600
S B テクノロジー	7,400	2,128.00	15,747,200
トーセ	2,200	711.00	1,564,200
オービックビジネスコンサルタント	24,600	7,010.00	172,446,000
アイティフォー	22,400	1,395.00	31,248,000
東計電算	4,900	3,495.00	17,125,500
エクスネット	1,100	1,107.00	1,217,700
大塚商会	86,900	6,303.00	547,730,700
サイボウズ	24,100	2,046.00	49,308,600

電通総研	21,300	5,450.00	116,085,000
A C C E S S	18,200	940.00	17,108,000
デジタルガレージ	28,000	3,325.00	93,100,000
E Mシステムズ	29,200	740.00	21,608,000
ウェザーニューズ	5,400	5,110.00	27,594,000
C I J	29,100	712.00	20,719,200
ビジネスエンジニアリング	3,300	3,930.00	12,969,000
日本エンタープライズ	8,200	122.00	1,000,400
WOWOW	13,200	1,134.00	14,968,800
スカラ	16,300	717.00	11,687,100
インテリジェント ウェイブ	4,100	1,177.00	4,825,700
A N Y C O L O R	18,500	3,150.00	58,275,000
I M A G I C A G R O U P	17,600	732.00	12,883,200
ネットワンシステムズ	70,700	2,580.00	182,406,000
システムソフト	61,300	57.00	3,494,100
アルゴグラフィックス	16,100	4,225.00	68,022,500
マーベラス	28,500	746.00	21,261,000
エイベックス	29,800	1,293.00	38,531,400
B I P R O G Y	57,300	4,599.00	263,522,700
都築電気	9,200	2,365.00	21,758,000
T B Sホールディングス	88,100	4,300.00	378,830,000
日本テレビホールディングス	155,100	2,221.00	344,477,100
朝日放送グループホールディングス	16,400	691.00	11,332,400
テレビ朝日ホールディングス	42,500	2,106.00	89,505,000
スカパーJ S A Tホールディングス	136,100	914.00	124,395,400
テレビ東京ホールディングス	12,600	3,030.00	38,178,000
日本BS放送	2,800	898.00	2,514,400
ビジョン	26,400	1,114.00	29,409,600
スマートバリュー	2,300	430.00	989,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	19,600	4,495.00	88,102,000
ワイヤレスゲート	3,400	226.00	768,400
日本通信	172,500	218.00	37,605,000
クロップス	1,100	1,038.00	1,141,800
日本電信電話	52,111,700	181.30	9,447,851,210
K D D I	1,353,800	4,601.00	6,228,833,800
ソフトバンク	2,819,400	1,958.00	5,520,385,200
光通信	17,700	25,210.00	446,217,000
エムティーアイ	12,000	763.00	9,156,000
G M Oインターネットグループ	64,700	2,657.50	171,940,250
ファイバーゲート	9,400	1,032.00	9,700,800
アイドママーケティングコミュニケーション	2,200	234.00	514,800
K A D O K A W A	92,600	3,024.00	280,022,400

学研ホールディングス	29,200	992.00	28,966,400
ゼンリン	30,000	858.00	25,740,000
昭文社ホールディングス	3,400	365.00	1,241,000
インプレスホールディングス	7,900	175.00	1,382,500
アイネット	10,600	2,277.00	24,136,200
松竹	9,100	9,956.00	90,599,600
東宝	97,500	4,795.00	467,512,500
東映	5,800	19,850.00	115,130,000
N T Tデータグループ	458,100	2,364.00	1,082,948,400
ピー・シー・エー	10,100	1,626.00	16,422,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,900	2,296.00	15,842,400
D T S	36,900	3,905.00	144,094,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,000	6,670.00	533,600,000
シーイーシー	22,100	1,792.00	39,603,200
カプコン	156,700	5,830.00	913,561,000
アイ・エス・ピー	9,000	1,371.00	12,339,000
ジャステック	10,800	1,358.00	14,666,400
S C S K	122,600	2,697.50	330,713,500
N S W	7,800	2,962.00	23,103,600
アイネス	13,700	1,492.00	20,440,400
T K C	27,800	3,685.00	102,443,000
富士ソフト	35,200	6,210.00	218,592,000
N S D	62,500	2,723.00	170,187,500
コナミグループ	65,600	9,795.00	642,552,000
福井コンピュータホールディングス	10,800	2,623.00	28,328,400
J B C Cホールディングス	11,600	3,890.00	45,124,000
ミロク情報サービス	15,900	1,979.00	31,466,100
ソフトバンクグループ	864,200	8,548.00	7,387,181,600
高千穂交易	5,900	3,915.00	23,098,500
オルバヘルスケアホールディングス	1,400	1,827.00	2,557,800
伊藤忠食品	4,200	7,750.00	32,550,000
エレマテック	16,600	1,789.00	29,697,400
あらた	28,300	3,190.00	90,277,000
トーメンデバイス	2,700	5,120.00	13,824,000
東京エレクトロン デバイス	18,400	6,740.00	124,016,000
円谷フィールズホールディングス	31,700	1,621.00	51,385,700
双日	205,800	3,812.00	784,509,600
アルフレッサ ホールディングス	185,500	2,323.50	431,009,250
横浜冷凍	50,400	1,089.00	54,885,600
ラサ商事	7,500	1,648.00	12,360,000
アルコニックス	24,400	1,393.00	33,989,200
神戸物産	143,000	3,759.00	537,537,000

ハイパー	1,900	308.00	585,200
あい ホールディングス	29,600	2,442.00	72,283,200
ディービーエックス	2,300	1,066.00	2,451,800
ダイワボウホールディングス	81,800	2,708.00	221,514,400
マクニカホールディングス	43,700	8,168.00	356,941,600
ラクト・ジャパン	7,200	2,214.00	15,940,800
グリムス	7,800	1,929.00	15,046,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,000	1,295.00	36,260,000
八洲電機	15,000	1,330.00	19,950,000
メディアスホールディングス	11,800	742.00	8,755,600
レスターホールディングス	15,700	2,990.00	46,943,000
ジオリーブグループ	1,900	1,320.00	2,508,000
大光	4,300	626.00	2,691,800
OCHIホールディングス	1,900	1,587.00	3,015,300
TOKAIホールディングス	100,400	1,003.00	100,701,200
黒谷	2,300	607.00	1,396,100
Cominix	1,600	855.00	1,368,000
三洋貿易	20,900	1,335.00	27,901,500
ビューティガレージ	5,800	2,251.00	13,055,800
ウイン・パートナーズ	12,300	1,282.00	15,768,600
ミタチ産業	2,300	1,156.00	2,658,800
シップヘルスケアホールディングス	66,400	2,149.50	142,726,800
明治電機工業	6,900	1,485.00	10,246,500
デリカフーズホールディングス	3,600	587.00	2,113,200
スターティアホールディングス	2,100	1,586.00	3,330,600
コメダホールディングス	45,300	2,762.00	125,118,600
ピーバンドットコム	1,100	382.00	420,200
アセンテック	7,100	643.00	4,565,300
富士興産	2,300	2,108.00	4,848,400
協栄産業	800	3,035.00	2,428,000
フルサト・マルカホールディングス	16,500	2,267.00	37,405,500
ヤマエグループホールディングス	12,200	2,583.00	31,512,600
小野建	18,200	1,753.00	31,904,600
南陽	1,700	2,429.00	4,129,300
佐島電機	10,300	2,266.00	23,339,800
エコートレーディング	1,600	1,270.00	2,032,000
伯東	10,600	5,900.00	62,540,000
コンドーテック	14,200	1,216.00	17,267,200
中山福	4,400	366.00	1,610,400
ナガイレーベン	23,400	2,332.00	54,568,800
三菱食品	17,100	5,080.00	86,868,000
松田産業	14,100	2,423.00	34,164,300

第一興商	71,500	1,921.00	137,351,500
メディバルホールディングス	190,600	2,380.00	453,628,000
S P K	8,200	2,049.00	16,801,800
萩原電気ホールディングス	7,900	4,700.00	37,130,000
アズワン	28,900	5,239.00	151,407,100
スズデン	6,500	2,210.00	14,365,000
尾家産業	1,900	1,707.00	3,243,300
シモジマ	12,400	1,275.00	15,810,000
ドウシシャ	17,100	2,127.00	36,371,700
小津産業	1,800	1,662.00	2,991,600
高速	11,000	2,373.00	26,103,000
たけびし	7,100	1,969.00	13,979,900
リックス	3,700	3,695.00	13,671,500
丸文	16,500	1,530.00	25,245,000
ハピネット	15,700	3,200.00	50,240,000
橋本総業ホールディングス	7,300	1,315.00	9,599,500
日本ライフライン	54,200	1,267.00	68,671,400
タカショー	16,100	515.00	8,291,500
I D O M	48,900	883.00	43,178,700
進和	11,300	2,433.00	27,492,900
エスケイジャパン	2,000	708.00	1,416,000
ダイトロン	7,300	2,896.00	21,140,800
シークス	26,400	1,550.00	40,920,000
田中商事	2,300	810.00	1,863,000
オーハシテクニカ	9,700	1,761.00	17,081,700
白銅	5,200	2,479.00	12,890,800
ダイコー通産	900	1,241.00	1,116,900
伊藤忠商事	1,242,300	6,620.00	8,224,026,000
丸紅	1,540,900	2,458.50	3,788,302,650
高島	5,600	1,349.00	7,554,400
長瀬産業	84,700	2,466.00	208,870,200
蝶理	11,600	2,996.00	34,753,600
豊田通商	161,900	9,342.00	1,512,469,800
三共生興	25,600	771.00	19,737,600
兼松	77,300	2,375.00	183,587,500
ツカモトコーポレーション	1,200	1,282.00	1,538,400
三井物産	1,392,500	6,512.00	9,067,960,000
日本紙パルプ商事	8,800	4,975.00	43,780,000
カメイ	19,700	1,884.00	37,114,800
東都水産	500	6,260.00	3,130,000
O U Gホールディングス	1,200	2,620.00	3,144,000
スターゼン	12,800	2,758.00	35,302,400

山善	56,100	1,290.00	72,369,000
椿本興業	3,800	6,810.00	25,878,000
住友商事	1,118,500	3,605.00	4,032,192,500
内田洋行	7,500	7,930.00	59,475,000
三菱商事	3,662,100	3,196.00	11,704,071,600
第一実業	17,400	1,967.00	34,225,800
キャノンマーケティングジャパン	42,800	4,251.00	181,942,800
西華産業	7,300	2,992.00	21,841,600
佐藤商事	12,800	1,771.00	22,668,800
菱洋エレクトロ	17,500	3,900.00	68,250,000
東京産業	16,900	740.00	12,506,000
ユアサ商事	14,400	5,050.00	72,720,000
神鋼商事	4,600	7,290.00	33,534,000
トルク	4,500	284.00	1,278,000
阪和興業	33,200	5,790.00	192,228,000
正栄食品工業	12,300	4,675.00	57,502,500
カナデン	13,900	1,570.00	21,823,000
RYODEN	14,900	2,625.00	39,112,500
岩谷産業	42,100	7,383.00	310,824,300
ナイス	2,600	1,601.00	4,162,600
ニチモウ	2,600	2,146.00	5,579,600
極東貿易	11,000	2,130.00	23,430,000
アステナホールディングス	34,800	475.00	16,530,000
三愛オブリ	44,400	1,925.00	85,470,000
稲畑産業	36,500	3,185.00	116,252,500
G S Iクレオス	9,900	2,417.00	23,928,300
明和産業	21,900	707.00	15,483,300
クワザワホールディングス	3,000	795.00	2,385,000
ワキタ	30,600	1,594.00	48,776,400
東邦ホールディングス	51,100	3,268.00	166,994,800
サンゲツ	42,500	3,610.00	153,425,000
ミツウロコグループホールディングス	23,600	1,535.00	36,226,000
シナネンホールディングス	5,100	4,175.00	21,292,500
伊藤忠エネクス	45,800	1,532.00	70,165,600
サンリオ	52,400	7,433.00	389,489,200
サンワテクノス	9,400	2,265.00	21,291,000
リョーサン	13,100	5,080.00	66,548,000
新光商事	24,900	1,224.00	30,477,600
トーホー	7,200	2,905.00	20,916,000
三信電気	7,500	2,293.00	17,197,500
東陽テクニカ	18,800	1,493.00	28,068,400
モスフードサービス	27,200	3,480.00	94,656,000

加賀電子	16,900	6,400.00	108,160,000
ソーダニッカ	15,600	1,185.00	18,486,000
立花エレテック	12,300	3,085.00	37,945,500
フォーバル	7,300	1,367.00	9,979,100
PALTAC	24,900	4,333.00	107,891,700
三谷産業	32,400	392.00	12,700,800
西本Wismettacホールディングス	4,700	6,970.00	32,759,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	2,409.00	1,686,300
コア商事ホールディングス	13,000	714.00	9,282,000
KPPグループホールディングス	47,900	632.00	30,272,800
ヤマタネ	8,200	2,549.00	20,901,800
丸紅建材リース	600	2,788.00	1,672,800
泉州電業	9,200	3,700.00	34,040,000
トラスコ中山	38,800	2,380.00	92,344,000
オートボックスセブン	64,300	1,649.50	106,062,850
モリト	13,200	1,419.00	18,730,800
加藤産業	22,900	4,810.00	110,149,000
北恵	2,100	847.00	1,778,700
イエローハット	29,400	1,909.00	56,124,600
JKホールディングス	14,200	1,020.00	14,484,000
日伝	12,500	2,888.00	36,100,000
北沢産業	5,000	325.00	1,625,000
杉本商事	8,900	2,244.00	19,971,600
因幡電機産業	47,900	3,510.00	168,129,000
東テク	6,200	6,820.00	42,284,000
ミスミグループ本社	279,100	2,094.50	584,574,950
アルテック	4,400	256.00	1,126,400
タキヒヨー	2,000	1,206.00	2,412,000
蔵王産業	1,500	2,630.00	3,945,000
スズケン	70,300	4,929.00	346,508,700
ジェコス	11,100	1,161.00	12,887,100
グローセル	21,600	748.00	16,156,800
ローソン	39,300	10,250.00	402,825,000
サンエー	14,200	4,550.00	64,610,000
カワチ薬品	14,600	2,728.00	39,828,800
エービーシー・マート	81,000	2,560.50	207,400,500
ハードオフコーポレーション	6,800	1,779.00	12,097,200
アスクル	44,800	2,050.00	91,840,000
ゲオホールディングス	20,900	2,116.00	44,224,400
アダストリア	22,400	3,530.00	79,072,000
くら寿司	21,700	4,100.00	88,970,000
キャンドウ	6,700	2,718.00	18,210,600

I Kホールディングス	3,900	388.00	1,513,200
パルグループホールディングス	36,500	2,252.00	82,198,000
エディオン	73,400	1,523.00	111,788,200
サーラコーポレーション	39,400	808.00	31,835,200
ワッツ	4,700	608.00	2,857,600
ハローズ	8,500	4,315.00	36,677,500
あみやき亭	4,600	4,440.00	20,424,000
大黒天物産	5,700	8,810.00	50,217,000
ハニーズホールディングス	16,700	1,622.00	27,087,400
ファーマライズホールディングス	2,500	647.00	1,617,500
アルペン	15,500	2,005.00	31,077,500
ハブ	3,200	726.00	2,323,200
クオールホールディングス	25,700	1,643.00	42,225,100
ジーンズホールディングス	11,100	3,815.00	42,346,500
ビックカメラ	98,600	1,331.00	131,236,600
D C Mホールディングス	98,000	1,396.00	136,808,000
MonotaRO	262,300	1,564.00	410,237,200
東京一番フーズ	2,700	522.00	1,409,400
きちりホールディングス	2,200	994.00	2,186,800
J . フロント リテイリング	212,400	1,577.00	334,954,800
ドトール・日レスホールディングス	33,000	2,095.00	69,135,000
マツキヨココカラ&カンパニー	336,400	2,613.50	879,181,400
ブロンコピリー	11,000	3,270.00	35,970,000
Z O Z O	117,900	3,434.00	404,868,600
トレジャー・ファクトリー	10,500	1,512.00	15,876,000
物語コーポレーション	31,000	4,695.00	145,545,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,500	2,129.50	663,339,250
H a m e e	7,800	1,116.00	8,704,800
マーケットエンタープライズ	1,100	859.00	944,900
ウエルシアホールディングス	96,000	2,632.50	252,720,000
クリエイティブSDホールディングス	26,300	3,175.00	83,502,500
丸善C H Iホールディングス	10,900	328.00	3,575,200
ミサワ	2,300	628.00	1,444,400
ティーライフ	1,400	1,402.00	1,962,800
チムニー	2,500	1,437.00	3,592,500
シュッピン	17,100	1,057.00	18,074,700
オイシックス・ラ・大地	25,200	1,433.00	36,111,600
ネクステージ	42,400	2,157.00	91,456,800
ジョイフル本田	54,000	2,013.00	108,702,000
鳥貴族ホールディングス	6,900	4,120.00	28,428,000
ホットランド	14,400	1,862.00	26,812,800
すかいらーくホールディングス	252,800	2,224.00	562,227,200

SFPホールディングス	10,100	2,090.00	21,109,000
綿半ホールディングス	14,600	1,480.00	21,608,000
ヨシックスホールディングス	3,900	2,873.00	11,204,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,000	1,000.00	52,000,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	606.00	5,454,000
BEENOS	7,900	1,397.00	11,036,300
あさひ	17,500	1,277.00	22,347,500
日本調剤	12,900	1,431.00	18,459,900
コスモス薬品	15,700	15,150.00	237,855,000
トーエル	4,200	787.00	3,305,400
セブン&アイ・ホールディングス	637,000	6,263.00	3,989,531,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	125,100	1,095.00	136,984,500
ツルハホールディングス	38,800	10,980.00	426,024,000
サンマルクホールディングス	15,100	2,217.00	33,476,700
フェリシモ	2,300	925.00	2,127,500
トリドールホールディングス	51,900	4,220.00	219,018,000
TOKYO BASE	23,500	296.00	6,956,000
ウイルプラスホールディングス	2,000	981.00	1,962,000
JMホールディングス	14,100	2,433.00	34,305,300
サツドラホールディングス	3,900	805.00	3,139,500
アレンザホールディングス	14,200	1,163.00	16,514,600
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,797.00	9,344,400
パロックジャパンリミテッド	14,900	828.00	12,337,200
クスリのアオキホールディングス	55,700	3,088.00	172,001,600
力の源ホールディングス	9,500	1,637.00	15,551,500
FOOD & LIFE COMPANIES	98,700	3,068.00	302,811,600
メディカルシステムネットワーク	20,700	611.00	12,647,700
はるやまホールディングス	4,600	595.00	2,737,000
ノジマ	53,800	1,741.00	93,665,800
カップ・クリエイト	29,100	1,670.00	48,597,000
ライトオン	6,200	413.00	2,560,600
良品計画	201,900	2,373.00	479,108,700
パリティホールディングス	11,000	432.00	4,752,000
アドヴァングループ	18,000	1,165.00	20,970,000
アルビス	6,200	2,639.00	16,361,800
コナカ	8,900	415.00	3,693,500
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,623.00	2,109,900
G-7ホールディングス	20,500	1,446.00	29,643,000
イオン北海道	54,800	930.00	50,964,000
コジマ	31,100	755.00	23,480,500

ヒマラヤ	3,000	943.00	2,829,000	
コーナン商事	22,800	3,930.00	89,604,000	
エコス	7,000	2,370.00	16,590,000	
ワタミ	19,500	1,033.00	20,143,500	
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	373,200	3,516.00	1,312,171,200	
西松屋チェーン	36,600	2,137.00	78,214,200	
ゼンショーホールディングス	94,200	6,741.00	635,002,200	
幸楽苑ホールディングス	13,700	1,396.00	19,125,200	
ハークスレイ	3,300	916.00	3,022,800	
サイゼリヤ	27,400	5,000.00	137,000,000	
V Tホールディングス	71,000	520.00	36,920,000	
魚力	6,600	2,406.00	15,879,600	
フジ・コーポレーション	9,000	1,739.00	15,651,000	
ユナイテッドアローズ	21,900	1,790.00	39,201,000	
ハイデイ日高	27,600	2,752.00	75,955,200	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	7,500	146.00	1,095,000	
コロワイド	79,500	2,267.00	180,226,500	
壱番屋	14,700	6,110.00	89,817,000	
P L A N T	2,100	1,704.00	3,578,400	
スギホールディングス	37,300	7,095.00	264,643,500	
薬王堂ホールディングス	9,200	2,811.00	25,861,200	
スクロール	27,900	946.00	26,393,400	
ヨンドシーホールディングス	17,700	1,956.00	34,621,200	
木曽路	28,100	2,627.00	73,818,700	
S R Sホールディングス	30,800	1,182.00	36,405,600	
千趣会	34,000	297.00	10,098,000	
リテールパートナーズ	27,700	1,755.00	48,613,500	
上新電機	18,500	2,370.00	43,845,000	
日本瓦斯	98,100	2,376.00	233,085,600	
ロイヤルホールディングス	32,600	2,454.00	80,000,400	
いなげや	18,000	1,226.00	22,068,000	
チヨダ	18,100	884.00	16,000,400	
ライフコーポレーション	19,400	3,735.00	72,459,000	
リンガーハット	23,800	2,377.00	56,572,600	
M r M a x H D	24,000	629.00	15,096,000	
A O K Iホールディングス	40,000	1,156.00	46,240,000	
オークワ	26,700	860.00	22,962,000	
コメリ	28,600	3,305.00	94,523,000	
青山商事	39,700	1,671.00	66,338,700	
しまむら	43,400	8,498.00	368,813,200	
はせがわ	5,000	353.00	1,765,000	

高島屋	127,800	2,293.50	293,109,300
松屋	31,400	988.00	31,023,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,900	1,810.00	148,239,000
近鉄百貨店	8,100	2,522.00	20,428,200
丸井グループ	122,700	2,478.00	304,050,600
アクシアル リテイリング	12,700	4,010.00	50,927,000
イオン	626,500	3,602.00	2,256,653,000
イズミ	32,800	3,605.00	118,244,000
平和堂	30,900	2,195.00	67,825,500
フジ	28,400	1,969.00	55,919,600
ヤオコー	20,900	8,145.00	170,230,500
ゼビオホールディングス	25,500	972.00	24,786,000
ケーズホールディングス	130,400	1,238.50	161,500,400
Olympicグループ	4,400	555.00	2,442,000
日産東京販売ホールディングス	13,000	501.00	6,513,000
シルバーライフ	4,000	847.00	3,388,000
Genky DrugStores	8,200	6,380.00	52,316,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	1,244.00	2,114,800
ブックオフグループホールディングス	11,100	1,229.00	13,641,900
ギフトホールディングス	8,000	2,949.00	23,592,000
アインホールディングス	25,500	4,655.00	118,702,500
元気寿司	10,600	3,455.00	36,623,000
ヤマダホールディングス	569,400	437.70	249,226,380
アークランズ	55,200	1,676.00	92,515,200
ニトリホールディングス	67,300	22,155.00	1,491,031,500
グルメ杵屋	15,400	1,106.00	17,032,400
愛眼	6,000	181.00	1,086,000
ケーユーホールディングス	9,000	1,171.00	10,539,000
吉野家ホールディングス	68,200	3,296.00	224,787,200
松屋フーズホールディングス	8,800	5,630.00	49,544,000
サガミホールディングス	28,000	1,504.00	42,112,000
関西フードマーケット	12,800	1,582.00	20,249,600
王将フードサービス	13,700	7,750.00	106,175,000
ミニストップ	13,500	1,630.00	22,005,000
アークス	34,000	3,065.00	104,210,000
バローホールディングス	35,400	2,461.00	87,119,400
ベルク	9,300	6,590.00	61,287,000
大庄	9,200	1,324.00	12,180,800
ファーストリテイリング	83,200	42,060.00	3,499,392,000
サンドラッグ	62,500	4,505.00	281,562,500
サックスパー ホールディングス	16,100	859.00	13,829,900
ヤマザワ	2,000	1,270.00	2,540,000

やまや	1,800	3,390.00	6,102,000
ペルーナ	45,200	618.00	27,933,600
いよぎんホールディングス	204,700	1,090.00	223,123,000
しずおかフィナンシャルグループ	382,200	1,450.00	554,190,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	144,800	1,122.50	162,538,000
楽天銀行	59,800	2,698.00	161,340,400
京都フィナンシャルグループ	218,000	2,532.00	551,976,000
島根銀行	2,200	529.00	1,163,800
じもとホールディングス	6,700	571.00	3,825,700
めぶきフィナンシャルグループ	853,700	438.90	374,688,930
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,000	4,190.00	92,180,000
九州フィナンシャルグループ	333,000	972.50	323,842,500
ゆうちょ銀行	1,890,500	1,545.50	2,921,767,750
富山第一銀行	54,600	885.00	48,321,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	923,100	732.00	675,709,200
西日本フィナンシャルホールディングス	97,100	1,623.00	157,593,300
三十三フィナンシャルグループ	15,400	1,950.00	30,030,000
第四北越フィナンシャルグループ	27,000	4,305.00	116,235,000
ひろぎんホールディングス	244,900	1,040.50	254,818,450
おきなわフィナンシャルグループ	14,700	2,457.00	36,117,900
十六フィナンシャルグループ	22,300	4,295.00	95,778,500
北國フィナンシャルホールディングス	18,100	4,770.00	86,337,000
プロクレアホールディングス	19,700	1,845.00	36,346,500
あいちフィナンシャルグループ	26,500	2,640.00	69,960,000
あおぞら銀行	123,600	2,136.00	264,009,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,477,000	1,497.50	15,689,307,500
りそなホールディングス	2,006,000	836.50	1,678,019,000
三井住友トラスト・ホールディングス	618,000	2,988.00	1,846,584,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,223,200	8,185.00	10,011,892,000
千葉銀行	479,400	1,161.50	556,823,100
群馬銀行	333,800	779.50	260,197,100
武蔵野銀行	24,000	2,800.00	67,200,000
千葉興業銀行	32,500	826.00	26,845,000
筑波銀行	75,500	247.00	18,648,500
七十七銀行	50,100	3,760.00	188,376,000
秋田銀行	11,500	2,040.00	23,460,000
山形銀行	19,100	1,105.00	21,105,500
岩手銀行	10,900	2,537.00	27,653,300
東邦銀行	136,100	312.00	42,463,200
東北銀行	3,700	1,208.00	4,469,600
ふくおかフィナンシャルグループ	149,800	3,735.00	559,503,000
スルガ銀行	151,600	799.00	121,128,400

八十二銀行	369,200	870.00	321,204,000
山梨中央銀行	19,300	1,739.00	33,562,700
大垣共立銀行	32,800	2,083.00	68,322,400
福井銀行	15,400	1,790.00	27,566,000
清水銀行	6,800	1,575.00	10,710,000
富山銀行	1,300	1,787.00	2,323,100
滋賀銀行	28,600	3,990.00	114,114,000
南都銀行	25,900	2,726.00	70,603,400
百五銀行	161,800	620.00	100,316,000
紀陽銀行	61,500	1,885.00	115,927,500
ほくほくフィナンシャルグループ	106,500	1,708.00	181,902,000
山陰合同銀行	107,700	1,026.00	110,500,200
鳥取銀行	2,600	1,421.00	3,694,600
百十四銀行	16,900	2,734.00	46,204,600
四国銀行	25,200	1,070.00	26,964,000
阿波銀行	24,100	2,462.00	59,334,200
大分銀行	10,300	2,660.00	27,398,000
宮崎銀行	10,400	2,753.00	28,631,200
佐賀銀行	10,100	1,903.00	19,220,300
琉球銀行	36,600	1,144.00	41,870,400
セブン銀行	539,200	299.00	161,220,800
みずほフィナンシャルグループ	2,322,200	2,766.50	6,424,366,300
高知銀行	2,600	994.00	2,584,400
山口フィナンシャルグループ	168,700	1,527.50	257,689,250
名古屋銀行	11,100	5,990.00	66,489,000
北洋銀行	260,700	348.00	90,723,600
大光銀行	2,500	1,424.00	3,560,000
愛媛銀行	23,200	1,120.00	25,984,000
トマト銀行	2,700	1,214.00	3,277,800
京葉銀行	72,200	719.00	51,911,800
栃木銀行	85,900	307.00	26,371,300
北日本銀行	5,600	2,143.00	12,000,800
東和銀行	31,600	661.00	20,887,600
福島銀行	8,000	233.00	1,864,000
大東銀行	3,300	750.00	2,475,000
トモニホールディングス	162,800	403.00	65,608,400
フィデアホールディングス	17,800	1,600.00	28,480,000
池田泉州ホールディングス	238,600	358.00	85,418,800
F P G	58,200	1,864.00	108,484,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,000	901.00	25,228,000
マーキュリアホールディングス	4,100	780.00	3,198,000
S B I ホールディングス	252,100	4,055.00	1,022,265,500

ジャフコ グループ	51,300	1,747.00	89,621,100
大和証券グループ本社	1,332,800	1,093.50	1,457,416,800
野村ホールディングス	2,893,200	841.80	2,435,495,760
岡三証券グループ	151,200	753.00	113,853,600
丸三証券	57,300	983.00	56,325,900
東洋証券	46,000	372.00	17,112,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204,500	584.00	119,428,000
光世証券	1,900	648.00	1,231,200
水戸証券	51,000	478.00	24,378,000
いちよし証券	32,400	808.00	26,179,200
松井証券	84,800	854.00	72,419,200
マネックスグループ	168,600	884.00	149,042,400
極東証券	23,700	1,031.00	24,434,700
岩井コスモホールディングス	19,700	2,210.00	43,537,000
アイザワ証券グループ	24,900	1,242.00	30,925,800
マネーパートナーズグループ	8,300	301.00	2,498,300
スパークス・グループ	19,200	1,848.00	35,481,600
かんぽ生命保険	175,200	2,694.50	472,076,400
F P パートナー	3,400	6,600.00	22,440,000
S O M P O ホールディングス	258,800	9,016.00	2,333,340,800
アニコム ホールディングス	58,400	590.00	34,456,000
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	385,200	7,558.00	2,911,341,600
第一生命ホールディングス	840,600	3,445.00	2,895,867,000
東京海上ホールディングス	1,700,500	4,517.00	7,681,158,500
T & D ホールディングス	462,000	2,570.50	1,187,571,000
アドバンスクリエイト	9,900	1,040.00	10,296,000
全国保証	45,100	5,545.00	250,079,500
あんしん保証	5,200	251.00	1,305,200
イントラスト	3,500	825.00	2,887,500
日本モーゲージサービス	5,100	535.00	2,728,500
C a s a	3,500	819.00	2,866,500
S B I アルヒ	17,000	917.00	15,589,000
プレミアグループ	29,200	1,749.00	51,070,800
ネットプロテクションズホールディングス	59,500	189.00	11,245,500
クレディセゾン	109,200	2,791.00	304,777,200
芙蓉総合リース	15,900	13,700.00	217,830,000
みずほリース	28,900	5,390.00	155,771,000
東京センチュリー	128,900	1,612.50	207,851,250
日本証券金融	63,500	1,656.00	105,156,000
アイフル	254,500	433.00	110,198,500
リコーリース	16,400	5,100.00	83,640,000
イオンフィナンシャルサービス	99,100	1,349.00	133,685,900

アコム	308,200	404.30	124,605,260
ジャックス	18,400	5,580.00	102,672,000
オリエントコーポレーション	56,600	1,078.00	61,014,800
オリックス	1,048,800	3,105.00	3,256,524,000
三菱HCキャピタル	767,000	1,043.00	799,981,000
九州リースサービス	3,400	1,271.00	4,321,400
日本取引所グループ	449,000	3,870.00	1,737,630,000
イー・ギャランティ	28,200	1,929.00	54,397,800
アサックス	4,000	749.00	2,996,000
NECキャピタルソリューション	8,600	3,715.00	31,949,000
Robot Home	51,400	166.00	8,532,400
大東建託	63,100	17,040.00	1,075,224,000
いちご	199,700	409.00	81,677,300
日本駐車場開発	185,500	182.00	33,761,000
スター・マイカ・ホールディングス	21,100	543.00	11,457,300
SREホールディングス	7,600	3,300.00	25,080,000
ADワークスグループ	19,300	241.00	4,651,300
ヒューリック	401,700	1,512.50	607,571,250
野村不動産ホールディングス	95,900	3,699.00	354,734,100
三重交通グループホールディングス	37,800	603.00	22,793,400
サムティ	27,600	2,510.00	69,276,000
ディア・ライフ	30,000	919.00	27,570,000
地主	13,400	2,156.00	28,890,400
プレサンスコーポレーション	27,700	1,704.00	47,200,800
ハウスコム	1,900	967.00	1,837,300
JPMC	10,500	1,213.00	12,736,500
サンセイランディック	2,800	1,039.00	2,909,200
フージャースホールディングス	26,500	1,064.00	28,196,000
オープンハウスグループ	63,200	4,886.00	308,795,200
東急不動産ホールディングス	517,900	982.20	508,681,380
飯田グループホールディングス	165,100	1,941.50	320,541,650
イーランド	1,600	1,566.00	2,505,600
ムゲンエステート	5,600	1,423.00	7,968,800
And Doホールディングス	10,400	1,112.00	11,564,800
シーアールイー	10,000	1,324.00	13,240,000
ケイアイスター不動産	8,500	3,735.00	31,747,500
グッドコムアセット	16,800	757.00	12,717,600
ジェイ・エス・ビー	8,800	2,755.00	24,244,000
ロードスターキャピタル	11,500	2,272.00	26,128,000
テンポイノベーション	2,900	949.00	2,752,100
フェイスネットワーク	2,500	1,453.00	3,632,500
霞ヶ関キャピタル	4,700	13,800.00	64,860,000

パーク24	112,100	1,775.00	198,977,500
パラカ	6,400	1,955.00	12,512,000
三井不動産	795,800	4,074.00	3,242,089,200
三菱地所	1,124,900	2,113.50	2,377,476,150
平和不動産	28,100	3,990.00	112,119,000
東京建物	150,600	2,166.00	326,199,600
京阪神ビルディング	32,600	1,584.00	51,638,400
住友不動産	248,900	4,686.00	1,166,345,400
テオオーシー	31,600	682.00	21,551,200
レオパレス21	172,100	428.00	73,658,800
スターツコーポレーション	24,900	3,030.00	75,447,000
フジ住宅	22,600	719.00	16,249,400
空港施設	25,300	606.00	15,331,800
明和地所	10,300	1,082.00	11,144,600
ゴールドクレスト	14,300	2,288.00	32,718,400
エスリード	8,300	3,345.00	27,763,500
日神グループホールディングス	28,800	507.00	14,601,600
日本エスコン	32,200	988.00	31,813,600
MIRARTHホールディングス	79,000	492.00	38,868,000
AVANTIA	5,000	891.00	4,455,000
イオンモール	89,500	1,826.00	163,427,000
毎日コムネット	3,600	758.00	2,728,800
ファースト住建	3,600	1,096.00	3,945,600
カチタス	46,600	1,932.00	90,031,200
トーセイ	28,900	2,060.00	59,534,000
穴吹興産	2,100	2,104.00	4,418,400
サンフロンティア不動産	25,800	1,711.00	44,143,800
FJネクストホールディングス	18,600	1,183.00	22,003,800
インテリックス	1,900	550.00	1,045,000
ランドビジネス	2,800	264.00	739,200
サンネクスタグループ	3,200	958.00	3,065,600
グランディハウス	13,900	646.00	8,979,400
日本空港ビルデング	61,000	5,845.00	356,545,000
明豊ファシリティワークス	4,300	947.00	4,072,100
LIFULL	62,800	167.00	10,487,600
MIXI	38,600	2,426.00	93,643,600
ジェイエイシーリクルートメント	65,300	744.00	48,583,200
日本M&Aセンターホールディングス	286,500	1,007.50	288,648,750
メンバーズ	6,400	945.00	6,048,000
中広	2,000	411.00	822,000
UTグループ	23,200	3,225.00	74,820,000
アイティメディア	7,100	1,987.00	14,107,700

ケアネット	27,900	668.00	18,637,200
E・Jホールディングス	10,700	1,680.00	17,976,000
オープンアップグループ	54,000	2,141.00	115,614,000
コシダカホールディングス	54,000	927.00	50,058,000
アルトナー	3,400	2,394.00	8,139,600
パソナグループ	21,900	2,664.00	58,341,600
CDS	2,100	1,699.00	3,567,900
リンクアンドモチベーション	51,700	617.00	31,898,900
エス・エム・エス	63,000	2,632.50	165,847,500
サニーサイドアップグループ	3,200	637.00	2,038,400
パーソルホールディングス	1,829,200	219.20	400,960,640
リニカル	5,700	449.00	2,559,300
クックパッド	51,500	128.00	6,592,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,300	722.00	3,104,600
学情	9,300	1,849.00	17,195,700
スタジオアリス	9,100	2,065.00	18,791,500
エプコ	2,500	896.00	2,240,000
NJS	4,000	2,743.00	10,972,000
総合警備保障	300,300	804.70	241,651,410
カカクコム	118,800	1,725.00	204,930,000
アイロムグループ	7,400	1,823.00	13,490,200
セントケア・ホールディング	13,400	938.00	12,569,200
サイネックス	1,700	828.00	1,407,600
ルネサンス	14,300	1,087.00	15,544,100
ディップ	27,600	2,704.00	74,630,400
デジタルホールディングス	9,600	1,173.00	11,260,800
新日本科学	16,500	1,600.00	26,400,000
キャリアデザインセンター	1,800	1,781.00	3,205,800
ベネフィット・ワン	62,500	2,167.50	135,468,750
エムスリー	355,000	2,096.00	744,080,000
ツカダ・グローバルホールディング	5,100	419.00	2,136,900
アウトソーシング	115,400	1,737.00	200,449,800
ウェルネット	7,600	539.00	4,096,400
ワールドホールディングス	8,200	2,455.00	20,131,000
ディー・エヌ・エー	64,000	1,266.00	81,024,000
博報堂DYホールディングス	229,300	1,447.50	331,911,750
ぐるなび	34,500	307.00	10,591,500
タカミヤ	24,900	522.00	12,997,800
ファンコミュニケーションズ	27,700	403.00	11,163,100
ライク	6,900	1,568.00	10,819,200
Aoba - BBT	3,700	396.00	1,465,200
エスプール	52,500	310.00	16,275,000

WDBホールディングス	9,300	2,317.00	21,548,100
ティア	5,300	467.00	2,475,100
CDG	1,100	1,255.00	1,380,500
アドウェイズ	25,200	465.00	11,718,000
バリューコマース	15,900	1,169.00	18,587,100
インフォマート	187,100	393.00	73,530,300
JPホールディングス	46,500	472.00	21,948,000
エコナックホールディングス	9,000	133.00	1,197,000
CLホールディングス	4,700	1,024.00	4,812,800
プレステージ・インターナショナル	84,500	605.00	51,122,500
アミューズ	11,100	1,517.00	16,838,700
ドリームインキュベータ	6,200	3,170.00	19,654,000
クイック	12,600	2,409.00	30,353,400
TAC	5,300	191.00	1,012,300
電通グループ	176,500	4,305.00	759,832,500
イオンファンタジー	6,600	2,530.00	16,698,000
シーティーエス	23,100	730.00	16,863,000
NEXYZ Group	2,800	654.00	1,831,200
H.U.グループホールディングス	52,700	2,749.50	144,898,650
アルプス技研	17,100	2,924.00	50,000,400
日本空調サービス	19,600	890.00	17,444,000
オリエンタルランド	950,300	5,553.00	5,277,015,900
ダスキン	40,100	3,373.00	135,257,300
明光ネットワークジャパン	22,200	731.00	16,228,200
ファルコホールディングス	8,200	2,298.00	18,843,600
ラウンドワン	169,400	687.00	116,377,800
リゾートトラスト	78,100	2,547.00	198,920,700
ビー・エム・エル	22,200	2,734.00	60,694,800
リソー教育	93,000	233.00	21,669,000
早稲田アカデミー	10,100	1,647.00	16,634,700
ユー・エス・エス	201,600	2,643.50	532,929,600
東京個別指導学院	21,900	447.00	9,789,300
サイバーエージェント	397,100	1,069.50	424,698,450
楽天グループ	1,539,600	792.50	1,220,133,000
クリーク・アンド・リバー社	9,200	1,921.00	17,673,200
SBIグローバルアセットマネジメント	35,600	732.00	26,059,200
テー・オー・ダブリュー	36,000	363.00	13,068,000
山田コンサルティンググループ	8,300	1,711.00	14,201,300
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	17,300	1,476.00	25,534,800
エン・ジャパン	29,300	2,782.00	81,512,600
リソルホールディングス	800	5,880.00	4,704,000

テクノプロ・ホールディングス	105,200	3,256.00	342,531,200
アトラグループ	2,400	182.00	436,800
アイ・アールジャパンホールディングス	9,500	1,421.00	13,499,500
K e e P e r 技研	11,100	6,620.00	73,482,000
ファーストロジック	2,400	516.00	1,238,400
三機サービス	1,600	1,366.00	2,185,600
G u n o s y	14,700	721.00	10,598,700
デザインワン・ジャパン	4,000	135.00	540,000
イー・ガーディアン	7,000	1,390.00	9,730,000
リブセンス	4,800	234.00	1,123,200
ジャパンマテリアル	55,100	2,676.00	147,447,600
ベクトル	22,300	1,240.00	27,652,000
ウチヤマホールディングス	4,100	363.00	1,488,300
チャーム・ケア・コーポレーション	15,200	1,383.00	21,021,600
キャリアリンク	6,700	2,589.00	17,346,300
I B J	14,100	609.00	8,586,900
アサンテ	9,000	1,680.00	15,120,000
バリューHR	15,900	1,380.00	21,942,000
M & A キャピタルパートナーズ	14,600	2,520.00	36,792,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,083.00	8,014,200
E R I ホールディングス	2,400	1,865.00	4,476,000
アビスト	1,300	3,175.00	4,127,500
シグマクス・ホールディングス	24,400	1,668.00	40,699,200
ウィルグループ	15,200	1,140.00	17,328,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,600	141.00	1,635,600
メドピア	16,200	792.00	12,830,400
レアジョブ	1,800	946.00	1,702,800
リクルートホールディングス	1,329,400	6,008.00	7,987,035,200
エラン	24,000	979.00	23,496,000
土木管理総合試験所	4,600	331.00	1,522,600
日本郵政	2,110,300	1,413.00	2,981,853,900
ベルシステム24ホールディングス	19,400	1,794.00	34,803,600
鎌倉新書	15,800	582.00	9,195,600
S M N	2,500	388.00	970,000
グローバルキッズCOMPANY	1,900	633.00	1,202,700
エアトリ	13,300	1,645.00	21,878,500
アトラエ	11,000	515.00	5,665,000
ストライク	7,600	5,250.00	39,900,000
ソラスト	50,000	538.00	26,900,000
セラク	5,700	1,131.00	6,446,700
インソース	39,300	791.00	31,086,300
ベイカレント・コンサルティング	132,100	3,178.00	419,813,800

Orchestra Holdings	4,100	1,150.00	4,715,000
アイモバイル	24,600	461.00	11,340,600
キャリアインデックス	4,100	180.00	738,000
MS - Japan	6,800	1,189.00	8,085,200
船場	2,000	1,281.00	2,562,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	58,300	2,275.00	132,632,500
フルテック	1,400	1,143.00	1,600,200
GameWith	3,900	309.00	1,205,100
MS&Consulting	1,500	601.00	901,500
ウェルビー	9,300	1,085.00	10,090,500
エル・ティー・エス	2,200	2,687.00	5,911,400
ミダックホールディングス	11,000	1,626.00	17,886,000
キュービーネットホールディングス	10,500	1,327.00	13,933,500
RPAホールディングス	25,400	265.00	6,731,000
スプリックス	2,700	806.00	2,176,200
マネジメントソリューションズ	7,800	3,030.00	23,634,000
プロレド・パートナーズ	5,200	360.00	1,872,000
テノ・ホールディングス	1,500	499.00	748,500
フロンティア・マネジメント	4,700	1,940.00	9,118,000
コプロ・ホールディングス	2,800	1,716.00	4,804,800
ギークス	1,600	469.00	750,400
アンビスホールディングス	19,300	2,569.00	49,581,700
カーブスホールディングス	49,500	742.00	36,729,000
フォーラムエンジニアリング	24,800	927.00	22,989,600
Fast Fitness Japan	6,400	1,015.00	6,496,000
ダイレクトマーケティングミックス	19,100	319.00	6,092,900
ポピンズ	2,900	1,493.00	4,329,700
LITALICO	14,100	2,152.00	30,343,200
コンフィデンス・インターワークス	900	1,625.00	1,462,500
アドバンテッジリスクマネジメント	4,600	418.00	1,922,800
リログループ	90,100	1,289.00	116,138,900
東祥	12,800	792.00	10,137,600
ID&Eホールディングス	10,900	3,660.00	39,894,000
ビーウィズ	4,700	1,779.00	8,361,300
TREホールディングス	34,600	1,208.00	41,796,800
人・夢・技術グループ	6,900	1,748.00	12,061,200
NISSOホールディングス	15,900	800.00	12,720,000
大栄環境	32,700	2,674.00	87,439,800
日本管財ホールディングス	18,900	2,576.00	48,686,400
M&A総研ホールディングス	8,600	6,490.00	55,814,000
エイチ・アイ・エス	52,300	1,737.00	90,845,100
ラックランド	8,300	2,576.00	21,380,800

共立メンテナンス	28,200	6,306.00	177,829,200	
イチネンホールディングス	19,200	1,684.00	32,332,800	
建設技術研究所	9,300	5,740.00	53,382,000	
スペース	12,000	975.00	11,700,000	
燦ホールディングス	17,100	1,057.00	18,074,700	
スバル興業	5,700	3,090.00	17,613,000	
東京テアトル	2,900	1,138.00	3,300,200	
タナベコンサルティンググループ	6,400	1,037.00	6,636,800	
ナガワ	5,600	7,190.00	40,264,000	
東京都競馬	15,100	4,280.00	64,628,000	
カナモト	27,900	2,938.00	81,970,200	
ニシオホールディングス	16,800	3,880.00	65,184,000	
トランス・コスモス	22,400	2,953.00	66,147,200	
乃村工藝社	78,600	879.00	69,089,400	
藤田観光	7,200	6,850.00	49,320,000	
KNT-CTホールディングス	10,700	1,241.00	13,278,700	
トーカイ	16,000	2,149.00	34,384,000	
セコム	182,900	10,995.00	2,010,985,500	
セントラル警備保障	9,800	2,598.00	25,460,400	
丹青社	35,100	802.00	28,150,200	
メイテックグループホールディングス	64,800	3,004.00	194,659,200	
応用地質	16,900	2,346.00	39,647,400	
船井総研ホールディングス	37,500	2,669.00	100,087,500	
進学会ホールディングス	3,200	263.00	841,600	
オオバ	5,700	996.00	5,677,200	
いであ	2,300	2,347.00	5,398,100	
学究社	7,300	2,108.00	15,388,400	
ベネッセホールディングス	60,500	2,595.00	156,997,500	
イオンディライト	19,300	3,535.00	68,225,500	
ナック	15,800	527.00	8,326,600	
ダイセキ	36,700	4,000.00	146,800,000	
ステップ	6,700	2,034.00	13,627,800	
合 計	268,082,700		653,905,366,950	

(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。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	121,870,663
株式	13,855,639,680
投資証券	99,757,900
派生商品評価勘定	1,663,536
未収入金	3,199,248
未収配当金	17,006,350
差入委託証拠金	4,022,356
流動資産合計	14,103,159,733
資産合計	14,103,159,733
負債の部	
流動負債	
前受金	1,666,000
未払金	70,257,615
未払解約金	33,554
未払利息	26
流動負債合計	71,957,195
負債合計	71,957,195
純資産の部	
元本等	
元本	9,556,826,518
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,474,376,020
元本等合計	14,031,202,538
純資産合計	14,031,202,538
負債純資産合計	14,103,159,733

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、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。</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>

	2024年 2月19日現在
--	---------------

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,556,826,518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)
	1.4682円 (14,682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 2月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年 2月18日
期首元本額		9,766,829,960円
期中追加設定元本額		1,540,947,476円
期中一部解約元本額		1,750,950,918円

区分	2024年 2月19日現在
期末元本額	9,556,826,518円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	190,770,112円
コア投資戦略ファンド（成長型）	441,486,988円
コア投資戦略ファンド（切替型）	192,100,826円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	7,291,355,892円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	98,618,905円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	162,430,453円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,178,136円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	1,013,661,422円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	52,233,334円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	73,990,450円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,211,600,215
投資証券	3,144,064
合計	3,208,456,151

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式ESGセレクト・リーダーズ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 2月19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	72,436,000	-	74,102,000	1,666,000
合計		72,436,000	-	74,102,000	1,666,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
INPEX	35,800	2,033.50	72,799,300	
大林組	24,000	1,440.50	34,572,000	
清水建設	19,200	914.80	17,564,160	
大和ハウス工業	21,900	4,337.00	94,980,300	
積水ハウス	22,000	3,292.00	72,424,000	

高砂熱学工業	1,600	4,390.00	7,024,000
大気社	900	4,885.00	4,396,500
明治ホールディングス	8,700	3,461.00	30,110,700
サッポロホールディングス	2,300	7,051.00	16,217,300
アサヒグループホールディングス	17,800	5,327.00	94,820,600
キリンホールディングス	28,700	2,148.50	61,661,950
サントリー食品インターナショナル	5,100	4,737.00	24,158,700
伊藤園	2,000	4,254.00	8,508,000
キッコーマン	5,000	9,336.00	46,680,000
味の素	16,400	5,670.00	92,988,000
カゴメ	2,800	3,604.00	10,091,200
ニチレイ	4,000	3,747.00	14,988,000
日清食品ホールディングス	7,400	4,442.00	32,870,800
東洋紡	3,000	1,081.00	3,243,000
帝人	6,600	1,259.50	8,312,700
東レ	51,200	695.10	35,589,120
クラレ	10,500	1,519.50	15,954,750
旭化成	46,300	1,049.50	48,591,850
住友化学	52,000	313.60	16,307,200
東ソー	9,600	1,999.00	19,190,400
デンカ	2,900	2,528.00	7,331,200
カネカ	1,800	3,718.00	6,692,400
三井化学	6,300	4,067.00	25,622,100
J S R	6,500	4,060.00	26,390,000
東京応化工業	3,500	4,140.00	14,490,000
三菱ケミカルグループ	47,300	862.00	40,772,600
ダイセル	8,500	1,438.00	12,223,000
積水化学工業	14,200	2,092.00	29,706,400
U B E	3,300	2,582.00	8,520,600
日本化薬	4,700	1,306.50	6,140,550
花王	17,200	5,651.00	97,197,200
日本ペイントホールディングス	35,000	1,105.00	38,675,000
関西ペイント	6,600	2,296.50	15,156,900
D I C	2,800	3,020.00	8,456,000
富士フイルムホールディングス	13,800	9,441.00	130,285,800
資生堂	14,800	4,175.00	61,790,000
ライオン	8,600	1,317.00	11,326,200
日東電工	5,300	14,045.00	74,438,500
信越ポリマー	1,500	1,619.00	2,428,500
ニフコ	2,800	3,749.00	10,497,200
ユニ・チャーム	14,900	5,174.00	77,092,600
協和キリン	10,000	2,858.00	28,580,000

アステラス製薬	66,800	1,682.50	112,391,000
塩野義製薬	9,600	7,135.00	68,496,000
エーザイ	9,300	6,297.00	58,562,100
小野薬品工業	14,300	2,418.00	34,577,400
第一三共	68,300	4,873.00	332,825,900
E N E O Sホールディングス	106,400	653.90	69,574,960
ブリヂストン	21,100	6,288.00	132,676,800
住友理工	1,300	1,115.00	1,449,500
太平洋セメント	4,300	3,254.00	13,992,200
東海カーボン	7,500	1,030.50	7,728,750
T O T O	4,900	3,747.00	18,360,300
日本特殊陶業	5,700	4,319.00	24,618,300
日本製鉄	31,600	3,585.00	113,286,000
神戸製鋼所	13,200	2,035.50	26,868,600
J F Eホールディングス	21,200	2,332.50	49,449,000
日本軽金属ホールディングス	2,100	1,737.00	3,647,700
三井金属鉱業	2,000	4,385.00	8,770,000
三菱マテリアル	4,600	2,622.00	12,061,200
住友金属鉱山	9,100	4,105.00	37,355,500
D O W Aホールディングス	1,900	5,616.00	10,670,400
U A C J	1,200	4,175.00	5,010,000
L I X I L	10,600	1,961.00	20,786,600
三浦工業	3,200	2,961.00	9,475,200
アマダ	12,600	1,605.00	20,223,000
ナブテスコ	4,000	2,442.50	9,770,000
小松製作所	34,100	4,319.00	147,277,900
日立建機	4,000	4,219.00	16,876,000
クボタ	37,100	2,182.50	80,970,750
荏原製作所	3,400	11,000.00	37,400,000
ダイキン工業	9,700	21,420.00	207,774,000
栗田工業	3,900	5,881.00	22,935,900
ダイフク	11,200	3,332.00	37,318,400
グローリー	1,500	2,905.00	4,357,500
セガサミーホールディングス	5,800	1,795.50	10,413,900
N T N	14,700	289.00	4,248,300
日立造船	6,000	1,039.00	6,234,000
三菱重工業	11,800	11,270.00	132,986,000
I H I	5,100	3,138.00	16,003,800
イビデン	4,200	7,157.00	30,059,400
コニカミノルタ	16,700	473.60	7,909,120
ブラザー工業	8,600	2,502.50	21,521,500
日立製作所	34,200	12,185.00	416,727,000

富士電機	4,700	9,064.00	42,600,800
安川電機	8,900	5,439.00	48,407,100
オムロン	6,500	5,535.00	35,977,500
日本電気	9,100	9,958.00	90,617,800
富士通	6,500	23,455.00	152,457,500
ルネサスエレクトロニクス	54,200	2,402.00	130,188,400
セイコーエプソン	10,700	2,420.00	25,894,000
アルバック	1,700	8,742.00	14,861,400
パナソニック ホールディングス	81,500	1,419.50	115,689,250
シャープ	9,600	820.00	7,872,000
アンリツ	5,000	1,161.50	5,807,500
ソニーグループ	46,500	13,475.00	626,587,500
T D K	14,400	7,779.00	112,017,600
アルプスアルパイン	6,900	1,032.00	7,120,800
横河電機	8,400	3,070.00	25,788,000
アズビル	4,200	4,578.00	19,227,600
アドバンテスト	28,300	6,796.00	192,326,800
シスメックス	6,200	8,170.00	50,654,000
スタンレー電気	4,700	2,553.50	12,001,450
ファナック	35,200	4,085.00	143,792,000
太陽誘電	4,300	3,365.00	14,469,500
村田製作所	63,600	2,981.00	189,591,600
リコー	20,200	1,278.50	25,825,700
東京エレクトロン	17,400	34,800.00	605,520,000
川崎重工業	5,600	3,794.00	21,246,400
トヨタ自動車	391,400	3,430.00	1,342,502,000
ヤマハ発動機	33,000	1,362.50	44,962,500
島津製作所	8,700	3,828.00	33,303,600
ニコン	11,000	1,553.00	17,083,000
H O Y A	13,100	18,445.00	241,629,500
ノーリツ鋼機	700	3,050.00	2,135,000
前田工織	700	3,355.00	2,348,500
大日本印刷	7,600	4,556.00	34,625,600
N I S S H A	1,400	1,530.00	2,142,000
アシックス	6,000	5,758.00	34,548,000
ヤマハ	4,800	3,325.00	15,960,000
リンテック	1,400	3,085.00	4,319,000
任天堂	38,400	8,356.00	320,870,400
コクヨ	2,900	2,466.00	7,151,400
美津濃	600	5,170.00	3,102,000
東北電力	16,700	1,004.00	16,766,800
九州電力	14,900	1,140.00	16,986,000

電源開発	5,400	2,489.00	13,440,600
レノバ	1,500	1,241.00	1,861,500
東京瓦斯	13,600	3,216.00	43,737,600
大阪瓦斯	13,800	3,064.00	42,283,200
東邦瓦斯	2,700	2,944.50	7,950,150
西部ガスホールディングス	900	1,887.00	1,698,300
東武鉄道	7,000	3,881.00	27,167,000
相鉄ホールディングス	2,900	2,732.50	7,924,250
東急	18,500	1,773.50	32,809,750
京王電鉄	3,800	4,227.00	16,062,600
西日本旅客鉄道	8,100	6,283.00	50,892,300
西武ホールディングス	9,000	2,169.50	19,525,500
西日本鉄道	2,200	2,438.00	5,363,600
阪急阪神ホールディングス	8,400	4,378.00	36,775,200
南海電気鉄道	3,800	2,932.00	11,141,600
京阪ホールディングス	3,800	3,504.00	13,315,200
名古屋鉄道	6,900	2,182.50	15,059,250
ヤマトホールディングス	9,800	2,419.50	23,711,100
山九	1,800	5,381.00	9,685,800
センコーグループホールディングス	4,100	1,129.00	4,628,900
九州旅客鉄道	4,900	3,363.00	16,478,700
S Gホールディングス	11,800	1,907.00	22,502,600
日本郵船	17,900	4,772.00	85,418,800
A N Aホールディングス	5,900	3,232.00	19,068,800
トランコム	200	6,390.00	1,278,000
T I S	8,100	3,396.00	27,507,600
S H I F T	500	26,900.00	13,450,000
ティーガイア	600	2,136.00	1,281,600
マネーフォワード	1,600	5,816.00	9,305,600
野村総合研究所	14,300	4,088.00	58,458,400
メルカリ	4,200	2,192.00	9,206,400
フリー	1,600	2,636.00	4,217,600
L I N Eヤフー	98,600	423.20	41,727,520
ネットワンシステムズ	3,100	2,580.00	7,998,000
B I P R O G Y	2,800	4,599.00	12,877,200
K D D I	55,200	4,601.00	253,975,200
ソフトバンク	106,100	1,958.00	207,743,800
S C S K	5,800	2,697.50	15,645,500
双日	8,300	3,812.00	31,639,600
T O K A Iホールディングス	3,600	1,003.00	3,610,800
アズワン	1,000	5,239.00	5,239,000
伊藤忠商事	43,900	6,620.00	290,618,000

丸紅	52,900	2,458.50	130,054,650
キヤノンマーケティングジャパン	1,700	4,251.00	7,226,700
伊藤忠エネクス	1,900	1,532.00	2,910,800
ローソン	1,700	10,250.00	17,425,000
ゲオホールディングス	900	2,116.00	1,904,400
アダストリア	900	3,530.00	3,177,000
ジーンズホールディングス	500	3,815.00	1,907,500
J.フロント リテイリング	9,000	1,577.00	14,193,000
マツキヨココカラ&カンパニー	12,700	2,613.50	33,191,450
ZOZO	5,200	3,434.00	17,856,800
三越伊勢丹ホールディングス	12,500	2,129.50	26,618,750
オイシックス・ラ・大地	1,000	1,433.00	1,433,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,900	1,000.00	1,900,000
イオン北海道	1,500	930.00	1,395,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	14,100	3,516.00	49,575,600
スギホールディングス	1,300	7,095.00	9,223,500
日本瓦斯	3,800	2,376.00	9,028,800
マックスバリュ東海	400	3,140.00	1,256,000
丸井グループ	6,500	2,478.00	16,107,000
イオン	24,100	3,602.00	86,808,200
ヤオコー	700	8,145.00	5,701,500
ケーズホールディングス	5,200	1,238.50	6,440,200
ヤマダホールディングス	21,400	437.70	9,366,780
ファーストリテイリング	6,500	42,060.00	273,390,000
りそなホールディングス	78,500	836.50	65,665,250
三井住友トラスト・ホールディングス	24,200	2,988.00	72,309,600
三井住友フィナンシャルグループ	46,900	8,185.00	383,876,500
みずほフィナンシャルグループ	89,000	2,766.50	246,218,500
大和証券グループ本社	49,200	1,093.50	53,800,200
野村ホールディングス	110,900	841.80	93,355,620
SOMPOホールディングス	10,900	9,016.00	98,274,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	15,800	7,558.00	119,416,400
東京海上ホールディングス	66,500	4,517.00	300,380,500
T&Dホールディングス	18,500	2,570.50	47,554,250
東京センチュリー	5,400	1,612.50	8,707,500
オリックス	43,300	3,105.00	134,446,500
ヒューリック	14,200	1,512.50	21,477,500
野村不動産ホールディングス	4,100	3,699.00	15,165,900
東急不動産ホールディングス	22,600	982.20	22,197,720
三井不動産	32,900	4,074.00	134,034,600

三菱地所	41,600	2,113.50	87,921,600
東京建物	6,900	2,166.00	14,945,400
住友不動産	10,500	4,686.00	49,203,000
パーソルホールディングス	68,900	219.20	15,102,880
H.U.グループホールディングス	2,000	2,749.50	5,499,000
オリエンタルランド	40,300	5,553.00	223,785,900
ダスキン	1,500	3,373.00	5,059,500
リゾートトラスト	2,800	2,547.00	7,131,600
ビー・エム・エル	800	2,734.00	2,187,200
ユー・エス・エス	7,600	2,643.50	20,090,600
楽天グループ	55,300	792.50	43,825,250
テクノプロ・ホールディングス	4,000	3,256.00	13,024,000
リクルートホールディングス	53,200	6,008.00	319,625,600
エラン	1,100	979.00	1,076,900
インソース	1,900	791.00	1,502,900
カーブスホールディングス	1,900	742.00	1,409,800
LITALICO	800	2,152.00	1,721,600
乃村工藝社	2,900	879.00	2,549,100
セコム	7,800	10,995.00	85,761,000
ベネッセホールディングス	2,500	2,595.00	6,487,500
合計	3,967,000		13,855,639,680

(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	森ヒルズリート投資法人	57	7,404,300	
	積水ハウス・リート投資法人	154	11,365,200	
	日本ビルファンド投資法人	57	33,003,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	47	25,098,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	103	14,409,700	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	33	8,477,700	
合計		451	99,757,900	

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2024年 2月19日現在
項目	金額（円）
預金	2,570,363,635
コール・ローン	577,182,025
株式	667,894,889,978
投資信託受益証券	121,274,590
投資証券	12,820,770,065
派生商品評価勘定	335,871,732
未収入金	4,218,528
未収配当金	590,766,716
差入委託証拠金	5,633,721,675
流動資産合計	690,549,058,944
資産合計	690,549,058,944
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	994,151
前受金	334,487,005
未払解約金	941,258,599
未払利息	123
流動負債合計	1,276,739,878
負債合計	1,276,739,878
純資産の部	
元本等	
元本	115,185,099,865
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	574,087,219,201
元本等合計	689,272,319,066
純資産合計	689,272,319,066
負債純資産合計	690,549,058,944

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2024年 2月19日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,185,099,865口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 5.9840円 (1万口当たり純資産額) (59,840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 2月19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>
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 2月19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

	2024年 2月19日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	121,979,552,292円
期中追加設定元本額	12,856,606,654円
期中一部解約元本額	19,651,059,081円
期末元本額	115,185,099,865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)	1,522,068,826円
S B I 資産設計オープン (分配型)	5,796,259円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,229,085,104円
世界経済インデックスファンド	13,175,740,652円
外国株式インデックス・オープン	884,864,976円
D C マイセクション 2 5	629,406,189円
D C マイセクション 5 0	3,240,328,545円
D C マイセクション 7 5	4,292,293,710円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,962,042,374円
D C マイセクション S 2 5	400,735,227円
D C マイセクション S 5 0	1,811,528,297円
D C マイセクション S 7 5	1,922,704,407円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	20,484,069円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	141,283,091円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	111,010,417円
D C 世界経済インデックスファンド	9,376,542,451円
外国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	924,201,865円
マイセクション 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,014,261円
マイセクション 7 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	2,927,777円
外国株式インデックス・オープン V A 1 (適格機関投資家専用)	21,849,993円
バランス 3 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	6,274,054円
バランス 5 0 V A 1 (適格機関投資家専用)	29,668,119円
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	6,614,760円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	18,799,225円
バランス A (2 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	145,565,632円
バランス B (3 7 . 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	117,708,325円
バランス C (5 0) V A 1 (適格機関投資家専用)	918,150,477円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	63,931,678円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	15,576,725円
バランス D (3 5) V A 1 (適格機関投資家専用)	104,062,026円

区分	2024年 2月19日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	32,263,324円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	735,306,519円
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)	781,717,084円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,179,341,199円
コア投資戦略ファンド(安定型)	120,638,147円
コア投資戦略ファンド(成長型)	290,213,250円
分散投資コア戦略ファンドA	1,491,590,936円
分散投資コア戦略ファンドS	6,952,080,946円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,486,288,668円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,019,972,887円
コア投資戦略ファンド(切替型)	130,977,347円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	439,250,426円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	23,925,767円
SMT インデックスバランス・オープン	109,795,682円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	76,270,162円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,073,214,982円
SMT 世界経済インデックス・オープン	240,593,770円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,054,037,556円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	175,349,905円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,382,857円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	1,722,070,510円
グローバル経済コア	574,665,165円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,966,726円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,966,576円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	124,430,320円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,671,774円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	152,183,308円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	146,146,060円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	65,206,142円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	77,788,082円
10資産分散投資ファンド	49,304,741円
グローバル10資産バランスファンド	9,138,548円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	50,271円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	23,675円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	25,847円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	23,756円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	15,277円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	13,575円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	54,251,500円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	201,679,086円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	622,693,865円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,406,710,218円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	81,983,480円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	69,905,701円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	76,978,155円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	80,129,160円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	179,358,397円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	180,617,821円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	179,700,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	174,601,806円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	172,871,024円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	91,215,580円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	116,188,483円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)

株式	92,402,926,300
投資信託受益証券	21,660,108
投資証券	822,028,419
合計	93,203,294,611

(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 2月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,415,453,050	-	7,749,940,055	334,487,005
	合計	7,415,453,050	-	7,749,940,055	334,487,005

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年 2月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	965,438,960	-	965,048,384	390,576
	アメリカドル	735,442,000	-	734,989,920	452,080
	ユーロ	116,414,560	-	116,481,584	67,024
	イギリスポンド	113,582,400	-	113,576,880	5,520
	合計	965,438,960	-	965,048,384	390,576

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	31.57	738,485.44	
	BAKER HUGHES CO	77,332	29.15	2,254,227.80	

CHENIERE ENERGY INC	18,099	160.37	2,902,536.63
CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	78.73	667,787.86
CHEVRON CORP	142,373	154.63	22,015,136.99
CONOCOPHILLIPS	92,757	110.57	10,256,141.49
COTERRA ENERGY INC	54,546	24.68	1,346,195.28
DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	43.46	2,184,125.76
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	179.42	2,380,365.14
EOG RESOURCES INC	45,763	113.56	5,196,846.28
EQT CORPORATION	27,026	34.70	937,802.20
EXXON MOBIL	309,867	103.73	32,142,503.91
HALLIBURTON CO	70,302	35.31	2,482,363.62
HESS CORP	21,602	148.43	3,206,384.86
HF SINCLAIR CORP	13,429	60.11	807,217.19
KINDER MORGAN INC	160,038	17.11	2,738,250.18
MARATHON OIL CORP	50,360	23.38	1,177,416.80
MARATHON PETROLEUM CORP	30,811	170.01	5,238,178.11
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	60.52	2,990,051.12
ONEOK INC	43,535	71.99	3,134,084.65
OVINTIV INC	20,398	44.83	914,442.34
PHILLIPS 66	34,260	143.81	4,926,930.60
PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	231.57	4,023,297.18
SCHLUMBERGER	110,287	48.57	5,356,639.59
TARGA RESOURCES CORP	17,298	96.94	1,676,868.12
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,511.81	805,794.73
VALERO ENERGY CORP	28,661	139.54	3,999,355.94
WILLIAMS COS	90,577	34.31	3,107,696.87
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	226.85	3,965,111.15
ALBEMARLE CORP	8,403	122.59	1,030,123.77
AMCOR PLC	110,292	9.04	997,039.68
AVERY DENNISON CORP	6,638	208.83	1,386,213.54
BALL CORP	21,539	62.09	1,337,356.51
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	151.06	1,296,396.92
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,499	77.70	1,281,972.30
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	19.87	854,410.00
CORTEVA INC	56,865	54.80	3,116,202.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	72.26	718,264.40
DOW INC	56,839	55.48	3,153,427.72
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	68.45	2,335,445.55
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	85.19	752,398.08
ECOLAB INC	20,345	215.38	4,381,906.10
FMC CORP	8,264	52.34	432,537.76
FREEMPORT-MCMORAN INC	118,197	38.83	4,589,589.51

INT'L PAPER CO	25,191	35.80	901,837.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	81.19	1,567,535.33
LINDE PLC	38,096	431.63	16,443,376.48
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	97.70	1,929,086.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	539.87	2,708,527.79
MOSAIC CO/THE	27,732	30.55	847,212.60
NEWMONT CORPORATION	86,194	33.43	2,881,465.42
NUCOR CORP	18,727	185.58	3,475,356.66
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,783	167.98	1,307,388.34
PPG INDUSTRIES INC	17,495	141.91	2,482,715.45
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	326.43	1,346,850.18
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	108.44	1,133,848.64
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,614	309.08	6,062,295.12
STEEL DYNAMICS INC	11,618	123.34	1,432,964.12
VULCAN MATERIALS CO	10,153	255.15	2,590,537.95
WESTLAKE CORP	2,222	144.15	320,301.30
WESTROCK CO	21,356	43.71	933,470.76
3 M COMPANY	43,663	91.25	3,984,248.75
AECOM	10,456	89.19	932,570.64
AERCAP HOLDINGS NV	18,199	77.64	1,412,970.36
ALLEGION PLC	5,598	132.42	741,287.16
AMETEK INC	17,753	173.89	3,087,069.17
AXON ENTERPRISE INC	5,367	269.80	1,448,016.60
BOEING CO	43,809	203.89	8,932,217.01
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	183.79	2,023,527.90
CARLISLE COS INC	3,456	341.92	1,181,675.52
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	54.00	3,351,402.00
CATERPILLAR	39,504	321.91	12,716,732.64
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.15	984,465.90
CUMMINS INC	10,414	266.48	2,775,122.72
DEERE&CO	21,646	360.68	7,807,279.28
DOVER CORP	10,657	161.46	1,720,679.22
EATON CORP	30,932	277.52	8,584,248.64
EMERSON ELECTRIC CO	46,685	106.15	4,955,612.75
FASTENAL CO	44,011	70.24	3,091,332.64
FERGUSON PLC	16,260	198.99	3,235,577.40
FORTIVE CORP	25,894	84.32	2,183,382.08
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	79.31	817,686.10
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	269.44	4,892,760.96
GENERAL ELECTRIC CO	83,474	149.16	12,450,981.84
GRACO INC	13,378	88.15	1,179,270.70
GRAINGER (WW) INC	3,363	935.80	3,147,095.40

HEICO CORP	3,640	194.01	706,196.40
HEICO CORP-CLASS A	7,398	157.19	1,162,891.62
HONEYWELL INTL INC	51,027	197.17	10,060,993.59
HOWMET AEROSPACE INC	32,364	62.82	2,033,106.48
HUBBELL INC	3,709	358.88	1,331,085.92
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	285.09	707,593.38
IDEX CORP	5,916	227.47	1,345,712.52
ILLINOIS TOOL WORKS	23,865	253.92	6,059,800.80
INGERSOLL-RAND INC	31,562	89.47	2,823,852.14
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	41.32	524,764.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	56.86	2,858,124.76
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	211.98	3,112,290.36
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	448.41	1,132,683.66
LOCKHEED MARTIN CORP	17,553	424.07	7,443,700.71
MASCO CORP	15,277	73.16	1,117,665.32
NORDSON CORP	4,121	264.07	1,088,232.47
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,303	450.96	5,097,200.88
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	91.24	2,802,619.08
OWENS CORNING	6,460	139.95	904,077.00
PACCAR INC	42,924	107.77	4,625,919.48
PARKER HANNIFIN CORP	10,397	520.06	5,407,063.82
PENTAIR PLC	10,813	74.92	810,109.96
QUANTA SERVICES INC	11,573	211.44	2,446,995.12
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	279.72	2,368,109.52
RTX CORP	112,196	91.01	10,210,957.96
SMITH (A.O.) CORP	9,016	80.09	722,091.44
SNAP-ON INC	4,000	267.24	1,068,960.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	88.35	1,113,033.30
TEXTRON	17,063	85.69	1,462,128.47
TORO CO	8,812	93.76	826,213.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	272.17	4,634,510.76
TRANSDIGM GROUP INC	4,468	1,146.39	5,122,070.52
UNITED RENTALS INC	5,364	650.31	3,488,262.84
VERTIV HOLDINGS CO-A	26,201	62.97	1,649,876.97
WABTEC CORP	13,304	134.28	1,786,461.12
WATSCO INC	2,656	381.46	1,013,157.76
XYLEM INC	19,874	123.79	2,460,202.46
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	252.97	8,074,549.43
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	145.59	1,345,251.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,847	197.92	1,948,918.24
CINTAS CORP	7,479	614.66	4,597,042.14
COPART INC	63,766	48.96	3,121,983.36

DAYFORCE INC	10,668	73.26	781,537.68
EQUIFAX INC	9,160	258.08	2,364,012.80
JACOBS SOLUTIONS INC	10,700	147.54	1,578,678.00
LEIDOS HOLDINGS	11,487	123.83	1,422,435.21
PAYCHEX INC	24,118	123.38	2,975,678.84
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	190.82	808,122.70
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	177.39	607,205.97
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	180.43	2,968,975.65
ROBERT HALF INC	7,185	80.84	580,835.40
ROLLINS INC	25,466	41.05	1,045,379.30
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	63.46	977,410.92
TRANSUNION	15,741	75.07	1,181,676.87
VERALTO CORP	17,691	86.09	1,523,018.19
VERISK ANALYTICS INC	10,738	244.70	2,627,588.60
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	167.87	3,319,629.25
WASTE MANAGEMENT INC	31,977	201.54	6,444,644.58
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	72.25	604,515.75
CSX CORP	161,331	36.72	5,924,074.32
DELTA AIR LINES INC	9,648	40.12	387,077.76
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	124.16	1,524,684.80
FEDEX CORP	18,863	237.59	4,481,660.17
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.53	398,928.83
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	211.70	1,216,851.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	56.82	774,058.86
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	252.04	4,264,516.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	423.45	3,114,898.20
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	33.93	459,174.69
U-HAUL HOLDING CO	6,606	65.35	431,702.10
UBER TECHNOLOGIES INC	140,815	78.41	11,041,304.15
UNION PACIFIC CORP	46,736	246.59	11,524,630.24
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	148.41	8,246,698.47
APTIV PLC	21,896	78.96	1,728,908.16
BORGWARNER INC	19,781	30.61	605,496.41
FORD MOTOR COMPANY	314,432	12.30	3,867,513.60
GENERAL MOTORS CO	103,664	38.70	4,011,796.80
LEAR CORP	5,714	136.30	778,818.20
LUCID GROUP INC	61,234	3.71	227,178.14
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	16.30	836,776.80
TESLA INC	221,215	199.95	44,231,939.25
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	862.98	1,814,846.94
DR HORTON INC	22,973	141.27	3,245,395.71
GARMIN LTD	13,192	122.20	1,612,062.40

HASBRO INC	10,572	50.78	536,846.16
LENNAR CORP-CL A	18,864	150.22	2,833,750.08
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	449.60	3,875,102.40
NIKE B	94,445	103.51	9,776,001.95
NVR INC	247	7,390.65	1,825,490.55
PULTE GROUP INC	16,747	101.45	1,698,983.15
VF CORP	25,718	16.65	428,204.70
AIRBNB INC-CLASS A	34,609	152.51	5,278,218.59
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,716.84	10,403,435.16
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	42.51	746,475.60
CARNIVAL CORPORATION	71,810	14.80	1,062,788.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,192	2,598.43	5,695,758.56
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	162.46	1,495,769.22
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	421.85	1,201,428.80
DOORDASH INC - A	19,212	116.01	2,228,784.12
DRAFTKINGS INC	32,654	44.57	1,455,388.78
EXPEDIA GROUP INC	11,638	135.25	1,574,039.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,974	197.57	4,143,833.18
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	132.83	503,027.21
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	55.25	1,412,190.00
MARRIOTT INTL A	19,516	241.63	4,715,651.08
MCDONALD'S CORP	55,965	292.02	16,342,899.30
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	42.54	967,955.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,676	116.09	2,400,276.84
STARBUCKS CORP	88,273	93.22	8,228,809.06
VAIL RESORTS INC	3,014	225.48	679,596.72
WYNN RESORTS LTD	6,702	105.13	704,581.26
YUM BRANDS INC	22,162	134.55	2,981,897.10
ALPHABET INC-CL A	459,452	140.52	64,562,195.04
ALPHABET INC-CL C	405,242	141.76	57,447,105.92
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	293.00	2,107,256.00
COMCAST CORP-CL A	319,239	41.24	13,165,416.36
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	142.28	2,807,611.24
FOX CORP - CLASS A	21,544	30.44	655,799.36
FOX CORP- CLASS B	10,345	27.95	289,142.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.45	925,181.95
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	60.37	552,566.61
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	69.18	1,063,919.22
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	30.01	407,655.84
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	93.25	1,082,912.25
MATCH GROUP INC	22,730	37.59	854,420.70
META PLATFORMS INC-CLASS A	172,117	473.32	81,466,418.44

NETFLIX INC	34,076	583.95	19,898,680.20
NEWS CORP-CLASS A	33,479	26.24	878,488.96
OMNICOM GROUP	14,048	87.51	1,229,340.48
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	12.00	390,096.00
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	35.28	1,614,659.76
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	42.91	1,223,063.73
ROKU INC	9,122	72.00	656,784.00
SEA LTD-ADR	28,338	44.99	1,274,926.62
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	4.80	290,246.40
SNAP INC - A	91,303	11.17	1,019,854.51
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	153.38	1,973,540.46
THE WALT DISNEY CO	140,071	111.60	15,631,923.60
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	88.93	2,986,536.19
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	9.83	1,743,969.79
AMAZON.COM	719,107	169.51	121,895,827.57
AUTOZONE INC	1,368	2,727.83	3,731,671.44
BATH & BODY WORKS INC	13,528	45.40	614,171.20
BEST BUY COMPANY INC	15,285	73.75	1,127,268.75
BURLINGTON STORES INC	5,108	195.17	996,928.36
CARMAX INC	10,695	71.88	768,756.60
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	169.15	837,292.50
EBAY	41,952	43.45	1,822,814.40
ETSY INC	10,294	76.57	788,211.58
GENUINE PARTS CO	9,903	142.93	1,415,435.79
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	40.98	286,860.00
HOME DEPOT	77,067	362.35	27,925,227.45
LKQ CORP	19,286	50.04	965,071.44
LOWES COMPANIES	44,328	226.85	10,055,806.80
MERCADOLIBRE INC	3,573	1,768.78	6,319,850.94
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,051.05	4,810,655.85
POOL CORP	2,664	387.30	1,031,767.20
ROSS STORES INC	25,425	144.08	3,663,234.00
TJX COMPANIES INC	88,680	98.04	8,694,187.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	236.49	1,855,500.54
ULTA BEAUTY INC	3,920	532.09	2,085,792.80
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	21.58	539,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,608	723.99	25,055,845.92
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	141.50	2,304,610.50
DOLLAR TREE INC	16,318	143.37	2,339,511.66
KROGER CO	50,664	47.64	2,413,632.96
SYSCO CORP	40,090	79.50	3,187,155.00
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,073	149.61	5,546,491.53

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	21.98	1,133,442.66
WALMART INC	115,924	170.36	19,748,812.64
ALTRIA GROUP INC	139,093	40.18	5,588,756.74
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	53.65	2,179,155.70
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	57.87	1,389,227.22
BUNGE GLOBAL SA	11,604	91.68	1,063,854.72
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	41.45	657,770.05
CELSIUS HOLDINGS INC	14,251	64.41	917,906.91
COCA-COLA CO	321,355	59.39	19,085,273.45
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	67.60	1,040,634.40
CONAGRA BRANDS INC	33,324	27.21	906,746.04
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	243.84	3,200,643.84
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	42.61	564,241.62
GENERAL MILLS INC	43,531	64.10	2,790,337.10
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	191.16	2,091,672.72
HORMEL FOODS CORP	23,338	28.99	676,568.62
JM SMUCKER CO	7,850	124.09	974,106.50
KELLANOVA	18,819	55.47	1,043,889.93
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	30.97	2,513,308.41
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	34.81	2,400,636.84
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	101.23	1,202,207.48
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	66.15	1,196,785.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	62.15	911,678.35
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	71.98	7,588,923.38
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	55.02	3,210,306.96
PEPSICO INC	105,521	166.32	17,550,252.72
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	89.65	10,666,825.95
TYSON FOODS INC	23,306	53.12	1,238,014.72
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	97.78	1,891,651.88
CLOROX COMPANY	9,570	151.05	1,445,548.50
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	83.48	4,905,368.28
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	146.37	2,484,338.01
KENVUE INC	133,461	19.05	2,542,432.05
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	118.29	3,179,280.33
PROCTER & GAMBLE CO	183,167	157.51	28,850,634.17
ABBOTT LABORATORIES	133,298	114.01	15,197,304.98
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	308.77	1,621,968.81
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	41.22	1,713,762.72
BECTON DICKINSON & CO	22,142	240.76	5,330,907.92
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	65.82	7,379,804.22
CARDINAL HEALTH	19,151	104.45	2,000,321.95
CENCORA INC	14,346	231.72	3,324,255.12

CENTENE CORP	40,934	78.74	3,223,143.16
COOPER COS INC/THE	3,504	372.01	1,303,523.04
CVS HEALTH CORP	99,034	77.10	7,635,521.40
DAVITA INC	4,627	122.22	565,511.94
DEXCOM INC	28,772	117.05	3,367,762.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	86.10	3,878,977.20
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	512.63	9,346,270.16
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	86.02	2,573,804.42
HCA HEALTHCARE INC	15,457	308.55	4,769,257.35
HENRY SCHEIN INC	8,755	75.65	662,315.75
HOLOGIC INC	18,875	73.79	1,392,786.25
HUMANA INC	9,818	366.92	3,602,420.56
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	555.54	3,426,570.72
INSULET CORP	5,246	191.01	1,002,038.46
INTUITIVE SURGICAL INC	27,005	378.63	10,224,903.15
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	216.64	1,418,558.72
MCKESSON CORP	10,179	511.06	5,202,079.74
MEDTRONIC PLC	102,632	84.42	8,664,193.44
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	401.72	1,825,817.40
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	124.00	1,076,196.00
RESMED INC	10,920	180.46	1,970,623.20
STERIS PLC	8,172	231.23	1,889,611.56
STRYKER CORP	26,379	349.30	9,214,184.70
TELEFLEX INC	3,934	251.07	987,709.38
THE CIGNA GROUP	22,963	341.09	7,832,449.67
UNITEDHEALTH GROUP INC	72,060	521.55	37,582,893.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	162.16	757,611.52
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	219.35	2,468,784.25
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	124.71	1,902,326.34
ABBVIE INC	137,931	177.49	24,481,373.19
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	134.84	2,938,298.44
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	147.00	1,417,521.00
AMGEN	40,959	283.70	11,620,068.30
AVANTOR INC	49,647	23.76	1,179,612.72
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	340.52	630,983.56
BIO-TECHNE CORP	12,980	71.61	929,497.80
BIOGEN INC	10,740	219.08	2,352,919.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	88.77	1,312,286.91
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	161,137	49.86	8,034,290.82
CATALENT INC	13,739	58.14	798,785.46
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	244.96	1,029,811.84
DANAHER CORP	54,787	250.00	13,696,750.00

ELI LILLY & CO	62,580	782.06	48,941,314.80
EXACT SCIENCES CORP	12,208	60.97	744,321.76
GILEAD SCIENCES INC	96,270	71.58	6,891,006.60
ILLUMINA INC	11,423	143.41	1,638,172.43
INCYTE CORP	15,212	57.96	881,687.52
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	238.60	3,301,269.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	126.78	630,223.38
JOHNSON & JOHNSON	187,036	156.55	29,280,485.80
MERCK & CO	198,157	127.79	25,322,483.03
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,187.44	1,931,964.88
MODERNA INC	24,153	88.37	2,134,400.61
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	132.31	892,034.02
PFIZER	432,739	27.62	11,952,251.18
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	948.05	7,894,412.35
REPLIGEN CORP	4,353	208.42	907,252.26
REVVITY INC	8,524	102.46	873,369.04
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	29.92	900,083.36
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	13.02	1,199,675.82
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,059	547.84	16,467,522.56
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	214.73	776,893.14
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	422.20	8,391,647.20
VIATRIS INC	89,720	13.06	1,171,743.20
WATERS CORP	4,749	325.21	1,544,422.29
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	362.05	2,087,942.35
ZOETIS INC	35,994	188.39	6,780,909.66
BANK OF AMERICA CORP	549,785	34.09	18,742,170.65
CITIGROUP	151,597	54.85	8,315,095.45
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	31.56	1,247,314.32
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	33.93	1,846,470.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,514.99	1,160,482.34
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	12.87	1,468,621.44
JPMORGAN CHASE & CO	224,007	179.03	40,103,973.21
KEY CORP	71,223	14.07	1,002,107.61
M & T BANK CORP	11,807	138.31	1,633,026.17
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	148.85	4,414,593.30
REGIONS FINL CORP	70,810	18.48	1,308,568.80
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	36.10	3,838,946.20
US BANCORP	123,942	41.49	5,142,353.58
WELLS FARGO & CO	281,146	51.91	14,594,288.86
ALLY FINANCIAL INC	21,529	35.98	774,613.42
AMERICAN EXPRESS	48,875	212.56	10,388,870.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	397.80	3,109,204.80

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,972	112.71	3,603,564.12
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	134.97	1,724,916.60
BANK NEW YORK CO	61,254	55.15	3,378,158.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	405.99	41,125,569.03
BLACKROCK INC	11,583	794.00	9,196,902.00
BLACKSTONE INC	55,334	127.89	7,076,665.26
BLOCK INC	45,824	65.64	3,007,887.36
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	137.23	4,130,211.31
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	44.58	698,524.02
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	186.69	1,643,432.07
CME GROUP INC	27,997	212.26	5,942,643.22
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	180.31	2,271,004.45
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	110.49	2,097,873.63
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	34.21	957,298.43
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	458.42	1,443,106.16
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,733	63.65	3,165,505.45
FISERV INC	46,319	148.04	6,857,064.76
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	271.62	1,375,483.68
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	27.27	710,928.90
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	52.28	225,662.06
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	134.19	2,784,308.31
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,712	384.44	9,884,721.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	137.12	6,050,008.64
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	172.48	899,138.24
KKR & CO INC	44,805	95.66	4,286,046.30
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,530	257.66	1,682,519.80
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	219.04	702,461.28
MASTERCARD INC-CLASS A	64,870	468.13	30,367,593.10
MOODY'S CORP	13,287	370.76	4,926,288.12
MORGAN STANLEY	96,993	86.50	8,389,894.50
MSCI INC	5,952	568.75	3,385,200.00
NASDAQ INC	24,183	55.42	1,340,221.86
NORTHERN TRUST CORP	15,902	79.95	1,271,364.90
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	59.14	4,688,974.04
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	108.86	1,720,641.16
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	118.49	1,834,936.14
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	14.00	446,782.00
S&P GLOBAL INC	25,151	423.57	10,653,209.07
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	64.40	7,540,918.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	65.87	629,058.50
STATE STREET CORP	26,059	72.49	1,889,016.91
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	39.56	1,154,993.76

TOAST INC-CLASS A	20,341	22.42	456,045.22
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	101.51	919,782.11
VISA INC-CLASS A SHARES	124,044	278.56	34,553,696.64
AFLAC	43,196	79.38	3,428,898.48
ALLSTATE CORP	20,722	161.78	3,352,405.16
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	123.44	780,017.36
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	70.04	3,819,561.36
AON PLC	15,249	311.24	4,746,098.76
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	86.11	2,560,653.07
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,412	239.22	4,165,298.64
ASSURANT INC	4,726	173.72	821,000.72
BROWN & BROWN INC	20,155	82.69	1,666,616.95
CHUBB LTD	32,057	250.90	8,043,101.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	111.86	1,242,764.60
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	359.81	779,348.46
EVEREST GROUP LTD	3,288	367.87	1,209,556.56
FNF GROUP	20,461	52.39	1,071,951.79
GLOBE LIFE INC	9,068	125.53	1,138,306.04
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	93.06	2,301,466.86
LOEWS CORP	12,757	74.34	948,355.38
MARKEL GROUP INC	1,007	1,461.50	1,471,730.50
MARSH & MCLENNAN COS	38,224	200.30	7,656,267.20
METLIFE INC	48,925	68.77	3,364,572.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	80.04	1,483,621.44
PROGRESSIVE CORP	45,236	189.09	8,553,675.24
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	107.28	2,845,172.88
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	217.53	3,729,986.91
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,724	277.31	2,419,252.44
WR BERKLEY CORP	17,572	82.61	1,451,622.92
WEYERHAEUSER CO	52,615	32.99	1,735,768.85
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	369.48	17,865,466.44
ADOBE INC	35,550	546.66	19,433,763.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	109.19	1,253,937.96
ANSYS INC	6,794	329.85	2,241,000.90
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	182.75	437,503.50
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	207.84	2,376,858.24
AUTODESK INC	15,965	258.30	4,123,759.50
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	53.16	787,459.08
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	63.49	472,556.07
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,442	290.30	6,224,612.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,767	162.77	1,427,004.59
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	98.52	1,998,281.16

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,439	77.00	3,113,803.00
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	33.96	417,708.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,357	329.24	6,043,858.68
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	260.43	807,333.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	129.74	2,695,997.20
DOCUSIGN INC	14,969	50.22	751,743.18
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	25.08	578,545.44
DYNATRACE INC	22,028	51.09	1,125,410.52
EPAM SYSTEMS INC	4,768	311.98	1,487,520.64
FAIR ISAAC CORP	1,816	1,282.06	2,328,220.96
FORTINET INC	53,321	68.48	3,651,422.08
GARTNER INC	6,453	448.61	2,894,880.33
GEN DIGITAL INC	43,555	21.36	930,334.80
GODADDY INC - CLASS A	11,388	109.98	1,252,452.24
HUBSPOT INC	3,646	613.50	2,236,821.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,606	187.64	13,060,869.84
INTUIT INC	21,468	655.74	14,077,426.32
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	243.81	1,144,444.14
MICROSOFT CORP	546,594	404.06	220,856,771.64
MONDAY.COM LTD	1,631	225.30	367,464.30
MONGODB INC	5,325	465.06	2,476,444.50
OKTA INC	11,505	88.86	1,022,334.30
ORACLE CORP	129,011	111.31	14,360,214.41
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	24.44	3,590,700.36
PALO ALTO NETWORKS INC	23,561	366.41	8,632,986.01
PTC INC	8,226	178.19	1,465,790.94
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	545.57	4,613,339.92
SALESFORCE INC	74,662	289.72	21,631,074.64
SERVICENOW INC	15,631	765.00	11,957,715.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,702	230.31	4,998,187.62
SPLUNK INC	12,924	155.37	2,008,001.88
SYNOPSYS INC	11,896	552.91	6,577,417.36
TWILIO INC - A	12,842	58.59	752,412.78
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	440.98	1,472,432.22
UIPATH INC - CLASS A	28,419	24.96	709,338.24
UNITY SOFTWARE INC	16,437	33.90	557,214.30
VERISIGN INC	6,723	194.24	1,305,875.52
WIX.COM LTD	5,010	127.26	637,572.60
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	302.67	4,973,473.44
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	62.12	1,027,899.64
ZSCALER INC	7,204	252.75	1,820,811.00
AMPHENOL CORPORATION	48,409	105.52	5,108,117.68

APPLE INC	1,210,717	182.31	220,725,816.27
ARISTA NETWORKS INC	20,702	261.75	5,418,748.50
CDW CORP/DE	10,931	241.37	2,638,415.47
CISCO SYSTEMS	312,372	48.44	15,131,299.68
CORNING	58,221	31.91	1,857,832.11
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	84.21	1,526,222.04
F5 INC	4,851	182.35	884,579.85
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	14.93	1,454,659.76
HP INC	68,329	28.58	1,952,842.82
JABIL INC	11,304	138.50	1,565,604.00
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	36.92	934,851.32
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	155.22	2,147,934.36
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	320.49	4,217,327.91
NETAPP INC	15,191	85.71	1,302,020.61
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,662	87.52	1,545,778.24
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,534	803.32	2,838,932.88
TE CONNECTIVITY LTD	25,075	142.40	3,570,680.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	432.26	1,435,103.20
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	60.29	1,068,218.22
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	54.00	1,392,660.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	275.46	1,146,464.52
AT&T INC	548,004	16.97	9,299,627.88
LIBERTY GLOBAL LTD-C	18,869	18.95	357,567.55
T-MOBILE US INC	42,307	160.41	6,786,465.87
VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	40.49	13,048,104.95
AES CORP	54,375	16.77	911,868.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	48.35	1,004,616.30
AMEREN CORPORATION	20,898	69.51	1,452,619.98
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	81.35	3,312,572.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	122.82	1,776,959.76
ATMOS ENERGY CORP	11,302	113.95	1,287,862.90
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	27.88	1,323,352.08
CMS ENERGY CORP	23,697	57.27	1,357,127.19
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	87.32	2,416,581.00
CONSTELLATION ENERGY	25,114	131.16	3,293,952.24
DOMINION ENERGY INC	68,588	45.86	3,145,445.68
DTE ENERGY COMPANY	15,851	107.80	1,708,737.80
DUKE ENERGY CORP	60,351	91.88	5,545,049.88
EDISON INTL	30,900	66.31	2,048,979.00
ENTERGY CORP	16,181	100.15	1,620,527.15
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	36.19	738,239.81
EVERGY INC	18,475	50.03	924,304.25

EVERSOURCE ENERGY	27,450	58.87	1,615,981.50
EXELON CORP	73,907	34.91	2,580,093.37
FIRSTENERGY CORP	39,425	37.39	1,474,100.75
NEXTERA ENERGY INC	161,719	57.03	9,222,834.57
NISOURCE INC	32,351	25.90	837,890.90
NRG ENERGY INC	19,068	51.90	989,629.20
PG&E CORP	148,742	16.43	2,443,831.06
PPL CORPORATION	58,459	26.64	1,557,347.76
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	59.79	2,407,504.14
SEMPRA	49,744	70.49	3,506,454.56
SOUTHERN CO	86,478	66.48	5,749,057.44
VISTRA CORP	22,676	45.58	1,033,572.08
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	78.07	1,830,507.29
XCEL ENERGY INC	46,180	59.07	2,727,852.60
ADVANCED MICRO DEVICES	126,574	173.87	22,007,421.38
ANALOG DEVICES	39,233	188.24	7,385,219.92
APPLIED MATERIALS	64,814	199.57	12,934,929.98
BROADCOM INC	34,367	1,245.48	42,803,411.16
ENPHASE ENERGY INC	9,617	131.87	1,268,193.79
ENTEGRIS INC	10,321	136.81	1,412,016.01
FIRST SOLAR INC	7,921	156.97	1,243,398.97
INTEL CORP	328,277	43.51	14,283,332.27
KLA CORP	10,294	661.35	6,807,936.90
LAM RESEARCH CORP	10,237	926.03	9,479,769.11
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	73.24	804,028.72
MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	66.29	4,222,275.26
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	81.61	3,322,995.98
MICRON TECHNOLOGY	85,302	79.50	6,781,509.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	730.50	2,579,395.50
NVIDIA CORP	191,277	726.13	138,891,968.01
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	232.16	4,483,009.60
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	78.64	2,517,345.04
QORVO INC	6,249	112.17	700,950.33
QUALCOMM	85,393	152.69	13,038,657.17
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	103.75	1,166,357.50
TERADYNE INC	12,318	102.24	1,259,392.32
TEXAS INSTRUMENTS	69,576	160.38	11,158,598.88
CBRE GROUP INC-A	22,995	93.13	2,141,524.35
COSTAR GROUP INC	33,027	81.40	2,688,397.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.24	319,788.00
ZILLOW GROUP INC-C	11,809	54.80	647,133.20
	26,298,707		3,355,594,118.46

	アメリカドル 小計			(503,439,785,592)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,380	22.40	1,218,112.00
	CAMECO CORP	31,793	56.86	1,807,749.98
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,871	85.16	7,397,934.36
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.50	2,615,385.50
	ENBRIDGE	159,113	46.46	7,392,389.98
	IMPERIAL OIL	16,488	80.75	1,331,406.00
	KEYERA CORP	18,607	32.74	609,193.18
	MEG ENERGY CORP	27,250	25.87	704,957.50
	PARKLAND CORP	14,896	45.71	680,896.16
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	45.91	1,750,594.21
	SUNCOR ENERGY	98,973	44.58	4,412,216.34
	TC ENERGY CORP	75,669	53.32	4,034,671.08
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	57.23	1,431,265.07
	AGNICO EAGLE MINES	36,100	64.46	2,327,006.00
	BARRICK GOLD CORP	133,727	19.74	2,639,770.98
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,689	58.38	857,543.82
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	12.12	525,523.20
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	147.12	2,301,103.92
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	14.47	750,226.09
	KINROSS GOLD CORP	108,451	6.83	740,720.33
	LUNDIN MINING CORP	31,977	11.69	373,811.13
	NUTRIEN LTD	37,152	68.92	2,560,515.84
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	17.67	396,090.72
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	52.22	1,847,856.92
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	107.53	376,892.65
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	59.91	1,911,488.46
	CAE INC	25,999	25.66	667,134.34
	STANTEC INC	9,001	112.57	1,013,242.57
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	124.58	649,435.54
	WSP GLOBAL INC	9,951	207.95	2,069,310.45
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	22.59	735,959.61
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	49.85	696,454.35
	RB GLOBAL INC	14,445	92.98	1,343,096.10
	THOMSON REUTERS CORP	13,225	216.26	2,860,038.50
	AIR CANADA	13,805	18.00	248,490.00
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	175.06	7,394,009.22
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	115.19	8,423,268.75
	TFI INTERNATIONAL INC	5,837	197.06	1,150,239.22
	MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	74.11	1,501,023.94
	BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	89.79	275,655.30
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	46.56	457,219.20

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	104.11	2,402,130.03
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	140.01	631,865.13
DOLLARAMA INC	22,000	103.34	2,273,480.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	62,154	82.00	5,096,628.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	34.66	240,193.80
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	137.76	1,778,894.88
METRO INC	18,840	71.02	1,338,016.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	173.65	907,494.90
SAPUTO INC	20,898	28.22	589,741.56
BANK MONTREAL	56,278	127.03	7,148,994.34
BANK NOVA SCOTIA	96,990	63.86	6,193,781.40
CANADIAN IMPERIAL BANK	76,913	61.93	4,763,222.09
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	103.71	2,500,551.81
ROYAL BANK OF CANADA	106,365	131.94	14,033,798.10
TORONTO-DOMINION BANK	140,926	80.87	11,396,685.62
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	55.08	1,597,375.08
BROOKFIELD CORP	104,769	54.43	5,702,576.67
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.10	269,743.50
ONEX CORP	6,603	102.74	678,392.22
TMX GROUP LTD	23,425	34.18	800,666.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,374.97	2,411,697.38
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	41.78	993,862.64
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	92.64	646,349.28
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	228.67	3,031,020.85
MANULIFE FINANCIAL CORP	146,284	33.30	4,871,257.20
POWER CORP OF CANADA	43,577	38.32	1,669,870.64
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	72.77	3,173,790.78
CGI INC - CL A	16,084	154.80	2,489,803.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,651	3,710.83	6,126,580.33
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	117.05	817,477.20
OPEN TEXT CORP	20,463	53.93	1,103,569.59
SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	109.62	10,318,530.60
BCE INC	6,203	50.83	315,298.49
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.77	482,904.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	61.55	1,716,075.55
TELUS CORP	32,908	23.94	787,817.52
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	8.12	420,762.16
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	28.25	689,158.75
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	34.20	386,289.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	30.18	311,578.32
EMERA INC	17,459	48.38	844,666.42
FORTIS INC	35,547	52.95	1,882,213.65

	HYDRO ONE LTD	20,587	40.58	835,420.46
	NORTHLAND POWER INC	17,854	24.00	428,496.00
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	222.99	599,843.10
	カナダドル 小計	3,159,497		200,178,464.05 (22,297,879,110)
ユーロ	ENI	174,687	14.15	2,472,519.79
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	14.35	569,149.70
	NESTE OIL OYJ	32,766	27.32	895,167.12
	OMV AG	12,549	40.66	510,242.34
	REPSOL SA	89,536	13.58	1,216,346.56
	TENARIS SA	40,648	15.08	613,175.08
	TOTALENERGIES SE	180,093	59.89	10,785,769.77
	AIR LIQUIDE	40,571	171.10	6,941,698.10
	AKZO NOBEL	12,357	69.16	854,610.12
	ARCELORMITTAL	42,704	25.63	1,094,503.52
	ARKEMA	4,369	98.30	429,472.70
	BASF SE	70,406	46.59	3,280,215.54
	COVESTRO AG	14,454	48.17	696,249.18
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	103.02	1,412,095.14
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.34	278,161.76
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	85.32	918,469.80
	OCI NV	7,248	26.48	191,927.04
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	37.98	740,761.92
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.20	472,292.80
	SYENSQO SA	5,356	85.13	455,956.28
	SYMRISE AG	10,018	97.96	981,363.28
	UMICORE	17,605	20.67	363,895.35
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	28.91	1,223,586.84
	VOESTALPINE AG	7,152	25.74	184,092.48
	WACKER CHEMIE AG	1,770	101.50	179,655.00
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,593	36.39	603,819.27
	AIRBUS SE	46,092	146.34	6,745,103.28
	ALSTOM	24,388	11.69	285,217.66
	BOUYGUES ORD	16,606	34.30	569,585.80
	BRENTAG SE	12,514	80.32	1,005,124.48
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	46,183	35.55	1,641,805.65
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	184.30	392,559.00
	EIFFAGE	5,924	96.66	572,613.84
	FERROVIAL SE	37,026	34.81	1,288,875.06
	GEA GROUP AG	13,382	37.77	505,438.14
	IMCD NV	4,641	142.65	662,038.65
	KINGSPAN GROUP PLC	12,398	82.00	1,016,636.00

KNORR-BREMSE AG	5,022	58.74	294,992.28
KONE OYJ-B	26,369	47.00	1,239,343.00
LEGRAND SA	19,340	92.02	1,779,666.80
LEONARDO SPA	31,340	18.77	588,251.80
METSO CORPORATION	51,970	10.39	540,228.15
MTU AERO ENGINES AG	3,962	227.00	899,374.00
PRYSMIAN SPA	21,155	43.70	924,473.50
RATIONAL AG	483	764.50	369,253.50
RHEINMETALL AG	3,820	388.20	1,482,924.00
SAFRAN SA	26,619	187.88	5,001,177.72
SAINT-GOBAIN	36,177	69.13	2,500,916.01
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	201.90	8,510,085.00
SIEMENS	58,485	169.22	9,896,831.70
SIEMENS ENERGY AG	36,841	13.89	511,905.69
THALES SA	8,524	140.65	1,198,900.60
VINCI S.A.	39,327	113.24	4,453,389.48
WARTSILA OYJ	41,917	14.64	613,874.46
BUREAU VERITAS SA	25,073	25.27	633,594.71
RANDSTAD NV	10,680	51.62	551,301.60
TELEPERFORMANCE	4,734	135.30	640,510.20
WOLTERS KLUWER	20,863	143.95	3,003,228.85
ADP	2,382	121.30	288,936.60
AENA SME SA	5,508	167.20	920,937.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.41	336,036.97
DHL GROUP	74,810	42.72	3,195,883.20
GETLINK	21,115	15.30	323,165.07
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,957	104.10	2,806,223.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	98.05	489,367.55
CONTINENTAL AG	8,168	77.06	629,426.08
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	80.62	826,677.48
FERRARI NV	9,370	363.00	3,401,310.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	59,903	67.38	4,036,264.14
MICHELIN	56,445	33.28	1,878,489.60
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	47.47	557,535.15
RENAULT SA	11,597	38.28	443,991.14
STELLANTIS NV	176,696	23.77	4,200,947.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	119.66	1,834,148.48
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	135.75	337,474.50
ADIDAS AG	12,783	176.24	2,252,875.92
HERMES INTERNATIONAL	2,530	2,199.00	5,563,470.00
KERING	5,534	428.10	2,369,105.40
LVMH	21,429	815.80	17,481,778.20

MONCLER SPA	14,605	62.52	913,104.60
PUMA SE	9,220	42.21	389,176.20
SEB SA	2,282	113.20	258,322.40
ACCOR	14,436	36.98	533,843.28
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	60.50	2,224,706.00
DELIVERY HERO SE	13,414	22.59	303,089.33
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	39.38	319,293.04
SODEXO	6,173	76.46	471,987.58
BOLLORE SE	83,646	6.16	515,677.59
PUBLICIS GROUPE	17,217	97.38	1,676,591.46
SCOUT24 SE	3,716	66.00	245,256.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	26.87	1,768,744.62
VIVENDI SE	61,243	10.30	631,109.11
D' IETEREN GROUP	2,217	172.80	383,097.60
INDITEX	81,082	39.60	3,210,847.20
PROSUS	112,590	28.94	3,258,917.55
ZALANDO SE	17,664	19.82	350,100.48
CARREFOUR	39,746	15.21	604,536.66
HELLOFRESH SE	13,805	12.39	171,112.97
JERONIMO MARTINS	9,821	21.80	214,097.80
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.93	360,088.19
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	27.31	1,936,633.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	69,428	57.81	4,013,632.68
DANONE (GROUPE)	47,639	61.30	2,920,270.70
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	9.97	337,681.83
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	73.70	701,034.40
HEINEKEN NV	23,160	88.94	2,059,850.40
JDE PEET'S BV	7,000	22.56	157,920.00
KERRY GROUP PLC-A	14,010	76.62	1,073,446.20
LOTUS BAKERIES	4	9,110.00	36,440.00
PERNOD-RICARD	15,339	157.15	2,410,523.85
REMY COINTREAU	1,032	98.94	102,106.08
BEIERSDORF AG	7,430	137.25	1,019,767.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	63.18	554,720.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	70.34	802,931.10
LOREAL	18,546	442.40	8,204,750.40
AMPLIFON SPA	11,650	31.86	371,169.00
BIOMERIEUX	3,044	103.80	315,967.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	111.40	382,102.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	90.26	186,838.20
ESSILORLUXOTTICA	22,901	187.42	4,292,105.42
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	38.99	662,245.15

FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	26.44	890,737.16
KONINKLIJKE PHILIPS	54,179	18.92	1,025,066.68
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	55.08	1,187,910.36
ARGENX SE	4,935	365.60	1,804,236.00
BAYER	78,462	28.61	2,244,797.82
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	57.84	591,124.80
GRIFOLS SA	27,685	10.60	293,599.42
IPSEN	3,532	104.90	370,506.80
MERCK KGAA	11,170	155.70	1,739,169.00
ORION OYJ-CLASS B	10,139	39.98	405,357.22
QIAGEN N.V.	16,526	39.96	660,378.96
RECORDATI SPA	10,887	51.02	555,454.74
SANOFI	87,091	86.46	7,529,887.86
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	337.70	615,964.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	253.80	399,481.20
UCB (GROUPE)	9,389	94.90	891,016.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	14.98	414,859.72
AIB GROUP PLC	88,299	4.06	358,493.94
BANCO BILBAO VIZCAYA	475,753	9.01	4,289,389.04
BANCO BPM SPA	124,090	4.91	610,026.44
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.67	4,492,192.86
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	8.46	747,677.88
BNP PARIBAS	82,197	54.38	4,469,872.86
CAIXABANK	336,789	3.96	1,334,694.80
COMMERZBANK AG	81,889	10.82	886,038.98
CREDIT AGRICOLE SA	66,984	12.23	819,214.32
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	39.21	994,992.96
FINECOBANK SPA	41,585	13.08	544,139.72
ING GROEP NV-CVA	290,125	12.38	3,592,908.00
INTESA SANPAOLO	1,145,097	2.82	3,234,899.02
KBC GROEP NV	18,057	63.10	1,139,396.70
MEDIOBANCA	53,422	11.69	624,770.29
NORDEA BANK ABP	236,636	10.98	2,598,736.55
SOCIETE GENERALE	53,019	22.00	1,166,683.09
UNICREDIT SPA	124,385	29.79	3,705,429.15
ADYEN NV	1,609	1,507.80	2,426,050.20
AMUNDI SA	4,626	60.35	279,179.10
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,178	11.98	1,931,234.79
DEUTSCHE BOERSE	14,123	187.65	2,650,180.95
EDENRED	20,131	55.48	1,116,867.88
EURAZEO SA	3,357	78.30	262,853.10
EURONEXT NV	6,480	82.15	532,332.00

EXOR NV	7,825	98.36	769,667.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.68	601,840.20
NEXI SPA	48,458	7.21	349,769.84
SOFINA	1,238	218.20	270,131.60
WORLDLINE SA	20,332	12.02	244,492.30
AEGON LTD	148,741	5.37	799,334.13
AGEAS	11,086	39.11	433,573.46
ALLIANZ SE-REG	31,143	247.10	7,695,435.30
ASR NEDERLAND NV	11,959	43.22	516,867.98
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	20.87	1,486,695.32
AXA SA	136,364	30.98	4,224,556.72
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	228.80	1,019,304.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	408.70	4,256,201.80
NN GROUP NV	16,208	37.42	606,503.36
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.03	461,961.22
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	41.53	1,375,971.96
TALANX AG	5,053	65.70	331,982.10
BECHTLE AG	7,659	49.23	377,052.57
CAPGEMINI SA	12,235	219.70	2,688,029.50
DASSAULT SYSTEMES SA	55,391	43.45	2,407,015.90
NEMETSCHEK SE	5,455	86.36	471,093.80
SAP SE	79,638	165.08	13,146,641.04
NOKIA OYJ	396,129	3.28	1,303,066.34
CELLNEX TELECOM SA	41,890	33.17	1,389,491.30
DEUTSCHE TELEKOM	253,485	22.18	5,623,564.72
ELISA A	10,227	42.34	433,011.18
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.65	323,493.75
KPN (KON.)	216,358	3.31	717,875.84
ORANGE	153,281	10.76	1,650,223.24
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.27	237,094.71
TELEFONICA	373,259	3.56	1,329,175.29
ACCIONA SA	2,181	109.15	238,056.15
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	21.14	114,938.18
E.ON SE	166,881	11.75	1,961,686.15
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	14.15	307,790.80
ELIA GROUP SA/NV	987	105.00	103,635.00
ENAGAS	21,663	14.47	313,571.92
ENDESA	25,972	16.48	428,018.56
ENEL	640,374	5.87	3,761,556.87
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	303,675	3.76	1,144,247.40
ENGIE	146,393	14.32	2,096,640.54
FORTUM OYJ	32,550	11.14	362,607.00

	IBERDROLA SA	476,876	10.77	5,138,338.90
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	22.94	229,629.40
	REDEIA CORP SA	30,678	14.72	451,580.16
	RWE STAMM	44,929	31.80	1,428,742.20
	SNAM SPA	147,559	4.38	646,751.09
	TERNA SPA	95,819	7.35	704,652.92
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	29.24	1,455,596.44
	VERBUND AG	6,430	64.20	412,806.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	581.30	1,976,420.00
	ASML HOLDING NV	31,384	874.60	27,448,446.40
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	161.90	1,029,198.30
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	33.46	3,247,962.20
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	42.56	2,140,423.59
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	71.30	376,107.50
	VONOVIA SE	52,580	26.66	1,401,782.80
	ユーロ 小計	14,071,960		387,094,404.14 (62,635,745,533)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.72	6,208,031.92
	SHELL PLC-NEW	513,920	24.97	12,832,582.40
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	18.02	1,681,939.19
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	17.85	532,929.60
	CRH PLC	55,581	61.28	3,406,003.68
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	50.40	550,569.60
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	13.00	228,852.00
	GLENCORE PLC	793,369	3.99	3,169,905.83
	MONDI PLC	37,918	13.75	521,372.50
	RIO TINTO PLC REG	88,047	55.15	4,855,792.05
	ASHTED GROUP PLC	33,317	54.00	1,799,118.00
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	12.42	2,981,383.74
	BUNZL PLC	22,799	32.15	732,987.85
	DCC PLC	6,622	57.48	380,632.56
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	6.10	617,616.52
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	3.23	2,055,893.79
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.44	435,397.82
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	104.55	576,488.70
	EXPERIAN PLC	67,859	33.96	2,304,491.64
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	44.30	615,327.00
	RELX PLC	152,781	34.02	5,197,609.62
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.27	777,885.85
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.78	349,905.56
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	47.20	328,134.40
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	13.38	398,551.76

PERSIMMON PLC	25,686	14.22	365,254.92
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.45	384,799.52
COMPASS GROUP PLC	129,701	21.91	2,841,748.91
ENTAIN PLC	49,630	9.33	463,246.42
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	170.85	2,228,225.70
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	77.60	881,768.80
PEARSON	55,305	9.69	536,347.89
WHITBREAD PLC	17,434	34.82	607,051.88
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	7.21	522,885.79
INFORMA PLC	110,598	8.17	903,585.66
WPP PLC	85,821	7.82	671,120.22
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.12	231,850.82
KINGFISHER PLC	153,717	2.27	349,859.89
NEXT PLC	11,023	84.70	933,648.10
OCADO GROUP PLC	54,753	5.36	293,476.08
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.53	375,880.89
TESCO PLC	525,585	2.79	1,469,535.66
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	22.86	588,416.40
BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,690	24.13	4,192,008.15
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	24.62	442,175.20
DIAGEO	174,682	29.27	5,113,815.55
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	18.45	1,263,419.10
HALEON PLC	452,525	3.23	1,461,655.75
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	57.66	3,264,766.86
UNILEVER PLC	193,307	40.29	7,789,305.56
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.17	766,206.15
ASTRAZENECA	118,805	100.94	11,992,176.70
GSK PLC	319,416	16.76	5,354,689.82
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.87	355,961.25
BARCLAYS	1,129,529	1.46	1,657,244.94
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,521,101	6.38	9,716,793.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.43	2,085,901.63
NATWEST GROUP PLC	426,244	2.29	978,229.98
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	5.94	1,130,685.41
3I GROUP PLC	74,757	24.76	1,850,983.32
ABRDN PLC	153,430	1.64	252,085.49
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.29	274,423.38
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,529	88.88	2,891,177.52
M&G PLC	131,539	2.24	295,041.97
SCHRODERS PLC	39,932	4.08	163,042.35
ST JAMES'S PLACE PLC	40,934	6.55	268,199.56
WISE PLC - A	49,048	8.50	416,908.00

	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	25.89	420,841.95
	AVIVA PLC	193,334	4.32	836,169.55
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.40	982,139.36
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.05	257,555.05
	PRUDENTIAL	212,226	8.34	1,770,813.74
	SAGE GROUP PLC	76,660	11.78	903,054.80
	HALMA PLC	31,069	22.53	699,984.57
	BT GROUP PLC	464,863	1.06	493,684.50
	VODAFONE GROUP PLC	1,971,971	0.65	1,294,204.56
	CENTRICA PLC	453,631	1.39	631,000.72
	NATIONAL GRID PLC	285,439	10.16	2,900,060.24
	SEVERN TRENT PLC	17,468	25.54	446,132.72
	SSE PLC	81,692	15.95	1,303,395.86
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.43	527,549.40
	イギリスポンド 小計	21,142,844		145,631,590.97 (27,575,341,750)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	11.07	192,595.86
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	624.50	358,463.00
	GIVAUDAN-REG	678	3,667.00	2,486,226.00
	HOLCIM LTD	38,804	67.74	2,628,582.96
	SIG GROUP AG	26,203	18.02	472,178.06
	SIKA AG-BR	12,257	254.30	3,116,955.10
	ABB LTD	124,889	40.04	5,000,555.56
	GEBERIT AG-REG	2,530	512.40	1,296,372.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	222.60	455,884.80
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	231.20	714,870.40
	VAT GROUP AG	1,956	429.50	840,102.00
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	36.65	544,472.40
	SGS SA	10,147	84.62	858,639.14
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	282.10	1,066,620.10
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	137.05	5,615,623.75
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	217.70	540,549.10
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	41.95	165,199.10
	AVOLTA AG	7,820	35.54	277,922.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,299.00	363,720.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	111,000.00	888,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	11,200.00	918,400.00
	NESTLE SA - REGISTERED	207,970	97.15	20,204,285.50
	ALCON INC	38,399	68.46	2,628,795.54
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	284.30	1,105,074.10
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	144.65	1,235,311.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	65.65	121,452.50

	LONZA GROUP AG-REG	5,536	457.10	2,530,505.60
	NOVARTIS	160,992	88.44	14,238,132.48
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	241.60	535,144.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,241	228.20	12,605,996.20
	SANDOZ GROUP AG	30,458	28.71	874,449.18
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	106.50	264,865.50
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	49.42	755,582.38
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,230.00	2,244,750.00
	UBS GROUP AG	249,657	24.48	6,111,603.36
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	143.20	610,604.80
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	123.20	364,056.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	638.00	1,351,922.00
	SWISS RE LTD	22,063	100.95	2,227,259.85
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,919	441.40	4,819,646.60
	TEMENOS AG - REG	5,150	60.62	312,193.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	15,069	76.56	1,153,682.64
	SWISSCOM	1,856	509.40	945,446.40
	BKW AG	1,744	133.20	232,300.80
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	85.75	486,974.25
	スイスフラン 小計	1,170,963		106,761,965.81 (18,201,847,550)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	277.50	6,174,930.00
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	403.30	2,170,963.90
	SCA SV CELLULOSA B	55,976	139.85	7,828,243.60
	ALFA LAVAL AB	18,955	378.60	7,176,363.00
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	287.00	21,805,399.00
	ATLAS COPCO A	207,097	176.80	36,614,749.60
	ATLAS COPCO B	132,940	154.10	20,486,054.00
	BEIJER REF AB	26,868	144.70	3,887,799.60
	EPIROC AB-A	53,479	195.85	10,473,862.15
	EPIROC AB-B	28,804	173.50	4,997,494.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	78.62	3,043,537.44
	INDUTRADE AB	22,644	279.00	6,317,676.00
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	265.00	3,710,530.00
	LIFCO AB-B SHS	17,970	273.50	4,914,795.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	58.42	7,176,780.16
	SAAB AB-B	6,388	792.20	5,060,573.60
	SANDVIK AB	75,334	224.10	16,882,349.40
	SKANSKA B	25,507	186.75	4,763,432.25
	SKF AB-B	21,050	218.40	4,597,320.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	277.20	3,746,080.80
	VOLVO B	114,238	270.00	30,844,260.00

	SECURITAS B	28,375	106.95	3,034,706.25	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	38.60	1,923,785.40	
	EVOLUTION AB	13,186	1,311.60	17,294,757.60	
	HENNES & MAURITZ B	60,983	142.38	8,682,759.54	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	239.20	11,834,180.80	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	205.30	3,653,518.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	254.40	3,646,824.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	133,009	153.80	20,456,784.20	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	122.75	14,820,344.00	
	SWEDBANK AB-A	58,652	217.90	12,780,270.80	
	EQT AB	31,471	279.10	8,783,556.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	341.60	4,037,028.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	341.40	3,812,755.20	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	255.40	32,828,605.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	559.80	4,075,344.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	55.63	11,943,149.07	
	HEXAGON AB-B SHS	148,878	118.25	17,604,823.50	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	83.44	3,901,821.28	
	TELIA CO AB	123,760	24.45	3,025,932.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	66.90	3,793,230.00	
	SAGAX AB-B	17,402	252.60	4,395,745.20	
	スウェーデンクローナ 小計	2,444,789		409,003,115.24 (5,885,554,828)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	261.30	4,730,836.50	
	EQUINOR ASA	66,436	266.05	17,675,297.80	
	NORSK HYDRO	100,517	58.30	5,860,141.10	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	355.00	4,436,790.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	655.00	5,662,475.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	114.60	2,190,808.20	
	MOWI ASA	31,968	201.90	6,454,339.20	
	ORKLA	77,073	75.00	5,780,475.00	
	SALMAR ASA	5,423	632.40	3,429,505.20	
	DNB BANK ASA	71,795	206.10	14,796,949.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	172.60	3,205,872.40	
	TELENOR ASA	51,193	114.15	5,843,680.95	
	ノルウェークローネ 小計	481,344		80,067,170.85 (1,143,359,199)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	30,112	373.50	11,246,832.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,204.00	1,664,020.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	72,778	188.54	13,721,564.12	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	10,400.00	2,277,600.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	10,535.00	3,223,710.00	

	DSV A/S	14,203	1,143.00	16,234,029.00
	PANDORA A/S	4,873	1,134.00	5,525,982.00
	CARLSBERG AS-B	6,810	944.80	6,434,088.00
	COLOPLAST-B	11,791	894.00	10,541,154.00
	DEMANT A/S	8,512	366.00	3,115,392.00
	GENMAB A/S	5,815	1,989.00	11,566,035.00
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	850.90	215,302,376.10
	DANSKE BANK A/S	58,346	193.55	11,292,868.30
	TRYG A/S	29,772	145.55	4,333,314.60
	ORSTED A/S	12,910	397.20	5,127,852.00
	デンマーククローネ 小計	510,231		321,606,817.12 (6,978,867,931)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	37.59	775,444.11
	SANTOS	280,929	7.37	2,070,446.73
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	30.70	4,332,844.50
	BHP GROUP LTD	388,318	45.61	17,711,183.98
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	22.85	794,494.50
	FORTESCUE LTD	122,505	28.40	3,479,142.00
	IGO LTD	56,345	7.49	422,024.05
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,852	57.30	2,168,919.60
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	59.75	860,937.75
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	13.16	969,655.12
	ORICA LTD	38,288	16.73	640,558.24
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.71	777,189.35
	RIO TINTO LTD	28,272	128.96	3,645,957.12
	SOUTH32 LTD	346,773	2.88	998,706.24
	REECE LTD	16,814	23.12	388,739.68
	BRAMBLES LTD	108,007	15.28	1,650,346.96
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	26.21	1,163,094.96
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.91	467,600.81
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.82	494,700.00
	TRANSURBAN GROUP	224,973	13.09	2,944,896.57
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	44.32	2,048,027.20
	IDP EDUCATION LTD	17,793	20.52	365,112.36
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.05	919,165.65
	CAR GROUP LTD	29,334	34.54	1,013,196.36
	REA GROUP LTD	3,586	185.08	663,696.88
	SEEK LTD	28,001	25.35	709,825.35
WESFARMERS LTD	84,329	62.95	5,308,510.55	
COLES GROUP LTD	108,486	16.13	1,749,879.18	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.46	600,059.46	
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	35.98	3,312,714.58	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.40	729,144.00	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	334.54	1,600,104.82	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	52.23	632,348.61	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	31.94	1,336,018.26	
	CSL LIMITED	37,640	284.00	10,689,760.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	28.42	6,775,981.66	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	116.28	15,176,051.64	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	257,277	33.07	8,508,150.39	
	WESTPAC BANKING	276,117	24.57	6,784,194.69	
	ASX LTD	14,549	65.12	947,430.88	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,475	192.70	5,872,532.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	34.02	469,884.24	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	6.08	1,013,304.96	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.75	870,686.25	
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	16.11	1,676,777.13	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	14.37	1,363,195.68	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	80.01	1,104,218.01	
	XERO LTD	11,340	117.50	1,332,450.00	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.86	1,190,682.62	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.73	955,769.13	
	オーストラリアドル 小計	5,256,243		132,475,755.31 (13,014,418,201)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.15	672,057.15	
	EBOS GROUP LTD	14,283	37.36	533,612.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	24.13	964,717.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	218,816	5.19	1,135,655.04	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.78	438,076.14	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.72	632,311.68	
	ニュージーランドドル 小計	530,697		4,376,430.29 (403,069,229)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,996	42.40	9,709,430.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	84.70	9,062,900.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	7.16	658,720.00	
	MTR CORP	125,000	25.40	3,175,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	13.50	1,620,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	45.65	7,943,100.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	24.50	4,851,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	13.38	1,952,142.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.74	3,120,346.74	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	19.64	5,528,660.00	
	HANG SENG BANK	59,400	82.90	4,924,260.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	251.80	22,233,940.00	

	AIA GROUP LTD	897,200	64.30	57,689,960.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	45.10	1,691,250.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	64.20	6,548,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.92	5,355,569.44	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	45.30	5,073,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	36.00	4,391,856.00	
	ESR GROUP LTD	157,000	9.98	1,566,860.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	8.42	1,456,660.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.50	2,692,402.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	9.62	1,311,927.50	
	SINO LAND CO	315,400	8.10	2,554,740.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	73.00	7,665,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	63.10	2,807,950.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	15.34	1,475,708.00	
	WHARF HOLDINGS	161,000	26.30	4,234,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	25.60	3,148,800.00	
	香港ドル 小計	5,890,453		184,444,482.08 (3,537,645,166)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	26.52	212,160.00	
	KEPPEL LTD	112,800	7.34	827,952.00	
	SEATRIUM LTD	2,152,791	0.09	200,209.56	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.91	576,334.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.32	792,990.24	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	1.04	304,512.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.24	578,664.00	
	DBS GROUP	141,600	33.87	4,795,992.00	
	OCBC BANK	257,100	13.26	3,409,146.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	29.19	2,743,860.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.37	618,420.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	777,443	2.38	1,850,314.34	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.76	484,416.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.94	764,694.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.08	260,224.00	
UOL GROUP LIMITED	47,500	6.08	288,800.00		
	シンガポールドル 小計	4,771,366		18,708,688.14 (2,086,767,075)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	18.21	1,082,165.67	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	738.00	1,583,748.00	
	BANK HAPUALIM BM	98,310	31.82	3,128,224.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	27.56	3,100,830.72	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	17.62	1,753,190.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	133.80	1,672,901.40	

	NICE LTD	4,991	808.10	4,033,227.10	
	AZRIELI GROUP	1,537	234.90	361,041.30	
	イスラエルシェケル 小計	390,926		16,715,328.39 (694,608,814)	
	合 計	86,120,020		667,894,889,978 (667,894,889,978)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権 証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	
	カナダドル 小計		1,490.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資信託受 益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	672,983.20	
	オーストラリアドル 小計		83,290	672,983.20 (66,113,869)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,875,950.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,875,950.00 (55,160,721)	
投資信託受益証券合計			398,290	121,274,590 (121,274,590)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,491,357.84	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	859,854.82	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	6,790,947.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	697,921.32	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,067,521.76	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	758,406.24	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	745,143.84	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,488,471.70	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,336	3,451,269.92	
		EQUINIX INC	7,333	6,278,734.59	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	932,476.20	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,553,876.55	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,225,100.85	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,221,658.01	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	817,713.05	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	776,747.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,119,563.56	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,471,761.60	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,585,701.48	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	940,218.11	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,187,718.15			

	PROLOGIS INC	71,288	9,509,106.32
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,335,167.44
	REALTY INCOME CORP	64,068	3,352,678.44
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	760,793.91
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	1,847,344.40
	SIMON PROPERTY GROUP	25,979	3,895,810.84
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,094,990.00
	UDR INC	23,815	859,245.20
	VENTAS INC	31,565	1,381,284.40
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,204,207.79
	WELLTOWER INC	41,060	3,823,917.80
	WP CAREY INC	16,024	919,777.60
アメリカドル 小計		903,342	73,446,488.83 (11,019,176,719)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	246,060.45
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	287,029.70
カナダドル 小計		20,377	533,090.15 (59,380,911)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	206,220.72
	GECINA SA	3,139	292,711.75
	KLEPIERRE	17,225	407,888.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	732,059.10
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	332,664.64
ユーロ 小計		48,695	1,971,544.21 (319,015,568)
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	363,289.20
	SEGRO PLC	78,133	663,661.70
イギリスポンド 小計		134,422	1,026,950.90 (194,453,152)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	739,547.40
	GOODMAN GROUP	135,303	3,871,018.83
	GPT GROUP	167,884	763,872.20
	MIRVAC GROUP	266,683	613,370.90
	SCENTRE GROUP	381,283	1,162,913.15
	STOCKLAND	207,412	972,762.28
	VICINITY CENTERS	305,149	625,555.45
オーストラリアドル 小計		1,557,804	8,749,040.21 (859,505,710)
香港ドル	LINK REIT	166,900	6,442,340.00
香港ドル 小計		166,900	6,442,340.00 (123,564,081)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	789,903.64
		338,529	663,516.84

	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST			
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	438,942.95	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	310,200.00	
	シンガポールドル 小計	1,125,856	2,202,563.43 (245,673,924)	
	投資証券合計	3,957,396	12,820,770,065 (12,820,770,065)	
	合計		12,942,044,655 (12,942,044,655)	

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 589銘柄	97.9%				73.9%
	投資証券 33銘柄				2.1%	1.6%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%				3.3%
	新株予約権 証券 1銘柄					
	投資証券 2銘柄				0.3%	0.0%
ユーロ	株式 220銘柄	99.5%				9.2%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.3%				4.1%
	投資証券 2銘柄				0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%				2.7%
スウェーデン クローナ	株式 42銘柄	100.0%				0.9%
ノルウェー クローネ	株式 12銘柄	100.0%				0.2%
デンマーク クローネ	株式 15銘柄	100.0%				1.0%
オーストラ リアドル	株式 50銘柄	93.4%				1.9%
	投資信託受 益証券 1銘柄			0.5%		0.0%
	投資証券 7銘柄				6.2%	0.1%
ニュージー ランドドル	株式 6銘柄	100.0%				0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	95.2%				0.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄			1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄				3.3%	0.0%

シンガポールドル	株式	16銘柄	89.5%			0.3%
	投資証券	4銘柄			10.5%	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。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	330,567,544
コール・ローン	26,872,035
株式	14,932,612,094
投資信託受益証券	6,160,265
投資証券	307,904,908
派生商品評価勘定	21,584,591
未収入金	61,713
未収配当金	12,917,366
差入委託証拠金	172,963,320
流動資産合計	15,811,643,836
資産合計	15,811,643,836
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,791
前受金	21,574,827
未払解約金	23,030
未払利息	5
流動負債合計	21,632,653
負債合計	21,632,653
純資産の部	
元本等	
元本	9,921,890,927
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,868,120,256
元本等合計	15,790,011,183
純資産合計	15,790,011,183
負債純資産合計	15,811,643,836

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2024年 2月19日現在	
	<p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,921,890,927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 1.5914円 (1万口当たり純資産額) (15,914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 2月19日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2024年 2月19日現在
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	8,916,232,437円
期中追加設定元本額	2,050,104,657円
期中一部解約元本額	1,044,446,167円
期末元本額	9,921,890,927円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	161,342,006円
コア投資戦略ファンド(成長型)	383,688,908円
コア投資戦略ファンド(切替型)	174,406,729円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	97,504,297円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	6,361,227,949円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	162,607,345円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	40,092,169円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,473,855,266円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	67,166,258円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,969,917,122	
投資信託受益証券	647,272	
投資証券	33,132,338	
合計	2,002,402,188	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式ESGリーダーズ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 2月19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	500,897,971	-		522,472,798	21,574,827
合計		500,897,971	-		522,472,798	21,574,827

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年 2月19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	25,269,245	-		25,244,256	24,989
	アメリカドル	20,285,250	-		20,250,931	34,319
	カナダドル	1,671,045	-		1,670,611	434
	ユーロ	1,614,230	-		1,617,907	3,677
	スイスフラン	1,698,720	-		1,704,807	6,087
	売建	1,499,800	-		1,499,838	38
	アメリカドル	1,499,800	-		1,499,838	38
合計		26,769,045	-		26,744,094	25,027

(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	BAKER HUGHES CO	3,429	29.15	99,955.35	
	CHENIERE ENERGY INC	802	160.37	128,616.74	
	HALLIBURTON CO	2,909	35.31	102,716.79	
	HF SINCLAIR CORP	505	60.11	30,355.55	
	KINDER MORGAN INC	6,619	17.11	113,251.09	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,374	170.01	233,593.74	
	ONEOK INC	2,038	71.99	146,715.62	
	PHILLIPS 66	1,503	143.81	216,146.43	
	SCHLUMBERGER	4,750	48.57	230,707.50	
	TARGA RESOURCES CORP	787	96.94	76,291.78	
	VALERO ENERGY CORP	1,253	139.54	174,843.62	
	WILLIAMS COS	4,284	34.31	146,984.04	
	AMCOR PLC	4,384	9.04	39,631.36	
	AVERY DENNISON CORP	251	208.83	52,416.33	
	BALL CORP	1,175	62.09	72,955.75	
	ECOLAB INC	879	215.38	189,319.02	
	INT'L PAPER CO	1,067	35.80	38,198.60	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	928	81.19	75,344.32	
	LINDE PLC	1,673	431.63	722,116.99	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	829	97.70	80,993.30	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	213	539.87	114,992.31	
	NEWMONT CORPORATION	3,951	33.43	132,081.93	
	NUCOR CORP	855	185.58	158,670.90	
	PPG INDUSTRIES INC	779	141.91	110,547.89	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	857	309.08	264,881.56	
	STEEL DYNAMICS INC	548	123.34	67,590.32	
	WESTROCK CO	968	43.71	42,311.28	
	3 M COMPANY	1,919	91.25	175,108.75	
	AECOM	408	89.19	36,389.52	
	ALLEGION PLC	283	132.42	37,474.86	
	AXON ENTERPRISE INC	214	269.80	57,737.20	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	427	183.79	78,478.33	
	CARRIER GLOBAL CORP	2,696	54.00	145,584.00	
	CATERPILLAR	1,749	321.91	563,020.59	
	CUMMINS INC	506	266.48	134,838.88	
	DOVER CORP	514	161.46	82,990.44	
	EATON CORP	1,376	277.52	381,867.52	

EMERSON ELECTRIC CO	1,922	106.15	204,020.30
FASTENAL CO	1,888	70.24	132,613.12
FERGUSON PLC	712	198.99	141,680.88
FORTIVE CORP	1,182	84.32	99,666.24
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	79.31	34,737.78
GRACO INC	519	88.15	45,749.85
GRAINGER (WW) INC	153	935.80	143,177.40
IDEX CORP	287	227.47	65,283.89
ILLINOIS TOOL WORKS	1,013	253.92	257,220.96
INGERSOLL-RAND INC	1,398	89.47	125,079.06
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,413	56.86	137,203.18
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	673	211.98	142,662.54
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	448.41	48,428.28
MASCO CORP	695	73.16	50,846.20
OTIS WORLDWIDE CORP	1,391	91.24	126,914.84
OWENS CORNING	353	139.95	49,402.35
PENTAIR PLC	473	74.92	35,437.16
QUANTA SERVICES INC	487	211.44	102,971.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	382	279.72	106,853.04
TORO CO	322	93.76	30,190.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	796	272.17	216,647.32
UNITED RENTALS INC	240	650.31	156,074.40
XYLEM INC	852	123.79	105,469.08
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,414	252.97	357,699.58
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	434	197.92	85,897.28
CINTAS CORP	313	614.66	192,388.58
DAYFORCE INC	453	73.26	33,186.78
PAYCHEX INC	1,126	123.38	138,925.88
PAYLOCITY HOLDING CORP	129	177.39	22,883.31
ROBERT HALF INC	369	80.84	29,829.96
TRANSUNION	597	75.07	44,816.79
WASTE MANAGEMENT INC	1,358	201.54	273,691.32
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	72.25	27,021.50
CSX CORP	6,877	36.72	252,523.44
DELTA AIR LINES INC	457	40.12	18,334.84
EXPEDITORS INTL WASH INC	559	124.16	69,405.44
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	317	211.70	67,108.90
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	56.82	30,000.96
NORFOLK SOUTHERN CORP	800	252.04	201,632.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	350	423.45	148,207.50
UNION PACIFIC CORP	2,089	246.59	515,126.51
UNITED PARCEL SERVICE B	2,479	148.41	367,908.39

APTIV PLC	915	78.96	72,248.40
BORGWARNER INC	783	30.61	23,967.63
LEAR CORP	205	136.30	27,941.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,859	16.30	30,301.70
TESLA INC	9,792	199.95	1,957,910.40
DECKERS OUTDOOR CORP	81	862.98	69,901.38
HASBRO INC	452	50.78	22,952.56
LULULEMON ATHLETICA INC	397	449.60	178,491.20
NIKE B	4,196	103.51	434,327.96
NVR INC	12	7,390.65	88,687.80
PULTE GROUP INC	693	101.45	70,304.85
VF CORP	952	16.65	15,850.80
BOOKING HOLDINGS INC	121	3,716.84	449,737.64
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	890	197.57	175,837.30
MCDONALD'S CORP	2,498	292.02	729,465.96
VAIL RESORTS INC	114	225.48	25,704.72
YUM BRANDS INC	910	134.55	122,440.50
ALPHABET INC-CL A	20,311	140.52	2,854,101.72
ALPHABET INC-CL C	17,897	141.76	2,537,078.72
COMCAST CORP-CL A	14,109	41.24	581,855.16
ELECTRONIC ARTS INC	902	142.28	128,336.56
FOX CORP - CLASS A	918	30.44	27,943.92
FOX CORP- CLASS B	492	27.95	13,751.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	32.45	37,642.00
OMNICOM GROUP	623	87.51	54,518.73
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,923	4.80	9,230.40
SNAP INC - A	3,077	11.17	34,370.09
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	565	153.38	86,659.70
THE WALT DISNEY CO	6,272	111.60	699,955.20
AUTOZONE INC	62	2,727.83	169,125.46
BEST BUY COMPANY INC	593	73.75	43,733.75
BURLINGTON STORES INC	211	195.17	41,180.87
CARMAX INC	544	71.88	39,102.72
EBAY	1,946	43.45	84,553.70
GENUINE PARTS CO	499	142.93	71,322.07
HOME DEPOT	3,436	362.35	1,245,034.60
LKQ CORP	787	50.04	39,381.48
LOWES COMPANIES	1,985	226.85	450,297.25
MERCADOLIBRE INC	151	1,768.78	267,085.78
POOL CORP	154	387.30	59,644.20
TJX COMPANIES INC	3,922	98.04	384,512.88
TRACTOR SUPPLY COMPANY	387	236.49	91,521.63

ULTA BEAUTY INC	182	532.09	96,840.38
KROGER CO	2,283	47.64	108,762.12
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,538	149.61	230,100.18
BUNGE GLOBAL SA	565	91.68	51,799.20
CAMPBELL SOUP CO (US)	623	41.45	25,823.35
COCA-COLA CO	14,160	59.39	840,962.40
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	685	67.60	46,306.00
CONAGRA BRANDS INC	1,859	27.21	50,583.39
DARLING INGREDIENTS INC	500	42.61	21,305.00
GENERAL MILLS INC	2,033	64.10	130,315.30
HORMEL FOODS CORP	878	28.99	25,453.22
JM SMUCKER CO	330	124.09	40,949.70
KELLANOVA	944	55.47	52,363.68
KEURIG DR PEPPER INC	3,592	30.97	111,244.24
LAMB WESTON HOLDINGS INC	450	101.23	45,553.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	932	66.15	61,651.80
PEPSICO INC	4,713	166.32	783,866.16
CHURCH & DWIGHT CO INC	895	97.78	87,513.10
CLOROX COMPANY	452	151.05	68,274.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,676	83.48	223,392.48
KIMBERLY-CLARK CORP	1,196	118.29	141,474.84
PROCTER & GAMBLE CO	8,079	157.51	1,272,523.29
ALIGN TECHNOLOGY INC	218	308.77	67,311.86
CENCORA INC	557	231.72	129,068.04
COOPER COS INC/THE	150	372.01	55,801.50
DAVITA INC	138	122.22	16,866.36
DEXCOM INC	1,386	117.05	162,231.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,128	86.10	183,220.80
ELEVANCE HEALTH INC	808	512.63	414,205.04
HCA HEALTHCARE INC	706	308.55	217,836.30
HOLOGIC INC	908	73.79	67,001.32
HUMANA INC	418	366.92	153,372.56
IDEXX LABORATORIES INC	297	555.54	164,995.38
INSULET CORP	273	191.01	52,145.73
LABORATORY CRP OF AMER	330	216.64	71,491.20
MOLINA HEALTHCARE INC	215	401.72	86,369.80
QUEST DIAGNOSTICS	343	124.00	42,532.00
STERIS PLC	353	231.23	81,624.19
TELEFLEX INC	130	251.07	32,639.10
THE CIGNA GROUP	1,017	341.09	346,888.53
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	710	124.71	88,544.10
AGILENT TECHNOLOGIES	1,012	134.84	136,458.08

AMGEN	1,834	283.70	520,305.80
AVANTOR INC	2,087	23.76	49,587.12
BIO-TECHNE CORP	460	71.61	32,940.60
BIOGEN INC	523	219.08	114,578.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	7,161	49.86	357,047.46
DANAHER CORP	2,405	250.00	601,250.00
ELI LILLY & CO	2,766	782.06	2,163,177.96
GILEAD SCIENCES INC	4,271	71.58	305,718.18
ILLUMINA INC	483	143.41	69,267.03
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	201	126.78	25,482.78
JOHNSON & JOHNSON	8,255	156.55	1,292,320.25
MERCK & CO	8,699	127.79	1,111,645.21
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	78	1,187.44	92,620.32
REPLIGEN CORP	163	208.42	33,972.46
WATERS CORP	222	325.21	72,196.62
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	250	362.05	90,512.50
ZOETIS INC	1,578	188.39	297,279.42
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	31.56	45,541.08
HUNTINGTON BANCSHARES INC	5,371	12.87	69,124.77
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,308	148.85	194,695.80
REGIONS FINL CORP	3,528	18.48	65,197.44
TRUIST FINANCIAL CORP	4,584	36.10	165,482.40
US BANCORP	5,255	41.49	218,029.95
ALLY FINANCIAL INC	1,015	35.98	36,519.70
AMERICAN EXPRESS	2,165	212.56	460,192.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	358	397.80	142,412.40
BANK NEW YORK CO	2,545	55.15	140,356.75
BLACKROCK INC	512	794.00	406,528.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	324	186.69	60,487.56
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	779	110.49	86,071.71
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	34.21	38,554.67
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	142	458.42	65,095.64
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	2,115	63.65	134,619.75
FISERV INC	2,061	148.04	305,110.44
FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	27.27	28,115.37
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,934	137.12	265,190.08
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	257.66	59,777.12
MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	219.04	25,408.64
MASTERCARD INC-CLASS A	2,883	468.13	1,349,618.79
MOODY'S CORP	554	370.76	205,401.04
MORGAN STANLEY	4,314	86.50	373,161.00
NASDAQ INC	1,242	55.42	68,831.64

NORTHERN TRUST CORP	780	79.95	62,361.00
PRICE T ROWE GROUP INC	805	108.86	87,632.30
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	690	118.49	81,758.10
S&P GLOBAL INC	1,115	423.57	472,280.55
SCHWAB (CHARLES) CORP	5,220	64.40	336,168.00
STATE STREET CORP	1,059	72.49	76,766.91
SYNCHRONY FINANCIAL	1,453	39.56	57,480.68
VISA INC-CLASS A SHARES	5,508	278.56	1,534,308.48
AFLAC	1,993	79.38	158,204.34
ALLSTATE CORP	896	161.78	144,954.88
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,252	86.11	107,809.72
ASSURANT INC	219	173.72	38,044.68
HARTFORD FINANCIAL SVCS	954	93.06	88,779.24
MARSH & MCLENNAN COS	1,693	200.30	339,107.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	80.04	58,749.36
PROGRESSIVE CORP	2,012	189.09	380,449.08
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,226	107.28	131,525.28
TRAVELERS COS INC/THE	771	217.53	167,715.63
WILLIS TOWERS WATSON PLC	376	277.31	104,268.56
WEYERHAEUSER CO	2,610	32.99	86,103.90
ACCENTURE PLC-CL A	2,151	369.48	794,751.48
ADOBE INC	1,561	546.66	853,336.26
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	483	109.19	52,738.77
ANSYS INC	301	329.85	99,284.85
AUTODESK INC	750	258.30	193,725.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	913	290.30	265,043.90
DOCUSIGN INC	624	50.22	31,337.28
FAIR ISAAC CORP	90	1,282.06	115,385.40
GARTNER INC	274	448.61	122,919.14
GEN DIGITAL INC	1,758	21.36	37,550.88
HUBSPOT INC	160	613.50	98,160.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	3,123	187.64	585,999.72
INTUIT INC	961	655.74	630,166.14
MICROSOFT CORP	24,175	404.06	9,768,150.50
PTC INC	430	178.19	76,621.70
SALESFORCE INC	3,335	289.72	966,216.20
SERVICENOW INC	700	765.00	535,500.00
SPLUNK INC	576	155.37	89,493.12
SYNOPSYS INC	530	552.91	293,042.30
TWILIO INC - A	549	58.59	32,165.91
WORKDAY INC-CLASS A	709	302.67	214,593.03
ZSCALER INC	269	252.75	67,989.75

	HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	4,640	14.93	69,275.20
	HP INC	3,046	28.58	87,054.68
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	634	155.22	98,409.48
	NETAPP INC	661	85.71	56,654.31
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	745	87.52	65,202.40
	TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	60.29	44,192.57
	WESTERN DIGITAL CORP	987	54.00	53,298.00
	LIBERTY GLOBAL LTD-C	799	18.95	15,141.05
	VERIZON COMMUNICATIONS	14,411	40.49	583,501.39
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	652	122.82	80,078.64
	ATMOS ENERGY CORP	528	113.95	60,165.60
	CMS ENERGY CORP	902	57.27	51,657.54
	CONSOLIDATED EDISON INC	1,188	87.32	103,736.16
	EDISON INTL	1,297	66.31	86,004.07
	ESSENTIAL UTILITIES INC	767	36.19	27,757.73
	EVERSOURCE ENERGY	1,194	58.87	70,290.78
	EXELON CORP	3,513	34.91	122,638.83
	SEMPRA	2,167	70.49	152,751.83
	APPLIED MATERIALS	2,868	199.57	572,366.76
	INTEL CORP	14,356	43.51	624,629.56
	LAM RESEARCH CORP	444	926.03	411,157.32
	MARVELL TECHNOLOGY INC	3,034	66.29	201,123.86
	NVIDIA CORP	8,467	726.13	6,148,142.71
	NXP SEMICONDUCTORS NV	887	232.16	205,925.92
	TEXAS INSTRUMENTS	3,111	160.38	498,942.18
	CBRE GROUP INC-A	1,114	93.13	103,746.82
	アメリカドル 小計	506,187		75,898,224.44 (11,387,010,612)
カナダドル	CAMECO CORP	1,597	56.86	90,805.42
	ENBRIDGE	7,168	46.46	333,025.28
	KEYERA CORP	573	32.74	18,760.02
	PARKLAND CORP	413	45.71	18,878.23
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,000	45.91	91,820.00
	AGNICO EAGLE MINES	1,640	64.46	105,714.40
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	14.47	23,065.18
	KINROSS GOLD CORP	3,375	6.83	23,051.25
	LUNDIN MINING CORP	1,764	11.69	20,621.16
	NUTRIEN LTD	1,767	68.92	121,781.64
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	257	107.53	27,635.21
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,617	59.91	96,874.47
	CAE INC	1,167	25.66	29,945.22
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	340	124.58	42,357.20

	RB GLOBAL INC	570	92.98	52,998.60
	THOMSON REUTERS CORP	571	216.26	123,484.46
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,892	175.06	331,213.52
	MAGNA INTERNATIONAL INC	1,075	74.11	79,668.25
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	546	46.56	25,421.76
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	140.01	20,021.43
	DOLLARAMA INC	997	103.34	103,029.98
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,651	82.00	217,382.00
	METRO INC	705	71.02	50,069.10
	BANK MONTREAL	2,394	127.03	304,109.82
	BANK NOVA SCOTIA	4,019	63.86	256,653.34
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,167	103.71	121,029.57
	TORONTO-DOMINION BANK	6,234	80.87	504,143.58
	BROOKFIELD CORP	4,943	54.43	269,047.49
	INTACT FINANCIAL CORP	597	228.67	136,515.99
	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,069	72.77	150,561.13
	OPEN TEXT CORP	1,049	53.93	56,572.57
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,125	109.62	452,182.50
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,342	61.55	82,600.10
	TELUS CORP	1,700	23.94	40,698.00
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	2,113	8.12	17,157.56
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	407	34.20	13,919.40
	FORTIS INC	1,705	52.95	90,279.75
	HYDRO ONE LTD	1,129	40.58	45,814.82
	FIRSTSERVICE CORP	187	222.99	41,699.13
	カナダドル 小計	69,602		4,630,608.53 (515,803,484)
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	14.35	20,606.60
	NESTE OIL OYJ	1,576	27.32	43,056.32
	OMV AG	448	40.66	18,215.68
	REPSOL SA	4,227	13.58	57,423.79
	TENARIS SA	1,751	15.08	26,413.83
	TOTALENERGIES SE	7,817	59.89	468,160.13
	AKZO NOBEL	535	69.16	37,000.60
	COVESTRO AG	600	48.17	28,902.00
	DSM-FIRMENICH AG	659	103.02	67,890.18
	EVONIK INDUSTRIES AG	657	17.34	11,395.66
	HEIDELBERG MATERIALS AG	527	85.32	44,963.64
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	816	37.98	30,991.68
	STORA ENSO OYJ R	2,074	11.20	23,228.80
	SYMRISE AG	509	97.96	49,861.64
	UMICORE	562	20.67	11,616.54

UPM KYMMENE OYJ	1,804	28.91	52,153.64
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	766	36.39	27,874.74
BOUYGUES ORD	586	34.30	20,099.80
BRENTAG SE	540	80.32	43,372.80
EIFFAGE	297	96.66	28,708.02
GEA GROUP AG	399	37.77	15,070.23
KINGSPAN GROUP PLC	591	82.00	48,462.00
KNORR-BREMSE AG	224	58.74	13,157.76
METSO CORPORATION	2,196	10.39	22,827.42
PRYSMIAN SPA	964	43.70	42,126.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,897	201.90	383,004.30
WARTSILA OYJ	1,323	14.64	19,375.33
TELEPERFORMANCE	171	135.30	23,136.30
WOLTERS KLUWER	872	143.95	125,524.40
ADP	92	121.30	11,159.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,000	7.41	14,822.00
DHL GROUP	3,416	42.72	145,931.52
GETLINK	1,366	15.30	20,906.63
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,094	104.10	113,885.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	160	98.05	15,688.00
MICHELIN	2,420	33.28	80,537.60
ADIDAS AG	588	176.24	103,629.12
HERMES INTERNATIONAL	107	2,199.00	235,293.00
KERING	264	428.10	113,018.40
LVMH	947	815.80	772,562.60
MONCLER SPA	637	62.52	39,825.24
PUMA SE	276	42.21	11,649.96
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,678	60.50	101,519.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,674	26.87	71,850.38
PROSUS	5,121	28.94	148,227.34
ZALANDO SE	648	19.82	12,843.36
CARREFOUR	2,101	15.21	31,956.21
HELLOFRESH SE	519	12.39	6,433.00
JERONIMO MARTINS	863	21.80	18,813.40
KESKO OYJ-B SHS	689	17.93	12,353.77
KONINKLIJKE AHOLD NV	3,274	27.31	89,429.31
DANONE (GROUPE)	2,251	61.30	137,986.30
JDE PEET'S BV	322	22.56	7,264.32
KERRY GROUP PLC-A	466	76.62	35,704.92
BEIERSDORF AG	341	137.25	46,802.25
HENKEL AG & CO KGAA	380	63.18	24,008.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	70.34	36,928.50

LOREAL	828	442.40	366,307.20
MERCK KGAA	460	155.70	71,622.00
BNP PARIBAS	3,526	54.38	191,743.88
COMMERZBANK AG	3,996	10.82	43,236.72
CREDIT AGRICOLE SA	3,742	12.23	45,764.66
FINECOBANK SPA	1,888	13.08	24,704.48
ING GROEP NV-CVA	12,430	12.38	153,933.12
KBC GROEP NV	872	63.10	55,023.20
MEDIOBANCA	1,829	11.69	21,390.15
SOCIETE GENERALE	2,317	22.00	50,985.58
DEUTSCHE BOERSE	623	187.65	116,905.95
NEXI SPA	1,449	7.21	10,458.88
WORLDFINE SA	855	12.02	10,281.37
ASSICURAZIONI GENERALI	3,503	20.87	73,107.61
AXA SA	6,017	30.98	186,406.66
MUENCHENER RUECKVERSICH.	458	408.70	187,184.60
NN GROUP NV	822	37.42	30,759.24
POSTE ITALIANE SPA	1,615	10.03	16,206.52
DASSAULT SYSTEMES SA	2,343	43.45	101,815.06
NOKIA OYJ	20,946	3.28	68,901.86
ELISA A	400	42.34	16,936.00
KPN (KON.)	13,550	3.31	44,958.90
ORANGE	7,097	10.76	76,406.30
ENEL	27,557	5.87	161,869.81
IBERDROLA SA	20,716	10.77	223,214.90
NATURGY ENERGY GROUP SA	460	22.94	10,552.40
REDEIA CORP SA	1,048	14.72	15,426.56
TERNA SPA	4,688	7.35	34,475.55
VERBUND AG	197	64.20	12,647.40
ASML HOLDING NV	1,378	874.60	1,205,198.80
STMICROELECTRONICS NV	2,450	42.56	104,284.25
LEG IMMOBILIEN SE	314	71.30	22,388.20
VONOVIA SE	2,780	26.66	74,114.80
ユーロ 小計	225,197		8,094,862.77 (1,309,829,744)
イギリスポンド			
ANGLO AMERICAN PLC	4,500	18.02	81,099.00
ANTOFAGASTA PLC	1,772	17.85	31,630.20
CRH PLC	2,454	61.28	150,381.12
CRODA INTERNATIONAL PLC	412	50.40	20,764.80
ENDEAVOUR MINING PLC	600	13.00	7,800.00
MONDI PLC	1,465	13.75	20,143.75
ASHTREAD GROUP PLC	1,493	54.00	80,622.00

	DCC PLC	443	57.48	25,463.64
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	247	104.55	25,823.85
	INTERTEK GROUP PLC	614	44.30	27,200.20
	RELX PLC	6,671	34.02	226,947.42
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.78	12,485.36
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	47.20	13,404.80
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	13.38	17,253.26
	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.45	13,381.08
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,840	7.21	20,493.44
	INFORMA PLC	4,350	8.17	35,539.50
	WPP PLC	3,240	7.82	25,336.80
	KINGFISHER PLC	5,110	2.27	11,630.36
	OCADO GROUP PLC	1,843	5.36	9,878.48
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.53	11,463.81
	TESCO PLC	26,205	2.79	73,269.18
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	22.86	29,763.72
	COCA-COLA HBC AG-CDI	941	24.62	23,167.42
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,395	57.66	138,095.70
	UNILEVER PLC	8,591	40.29	346,174.34
	ASTRAZENECA	5,313	100.94	536,294.22
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	66,743	6.38	426,354.28
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	205,503	0.43	88,777.29
	3I GROUP PLC	3,489	24.76	86,387.64
	ABRDN PLC	6,887	1.64	11,315.34
	SCHRODERS PLC	2,334	4.08	9,529.72
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,915	6.55	12,547.08
	ADMIRAL GROUP PLC	1,040	25.89	26,925.60
	LEGAL & GENERAL GROUP	21,968	2.40	52,767.13
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	5.05	11,716.00
	PRUDENTIAL	9,930	8.34	82,855.92
	SAGE GROUP PLC	3,200	11.78	37,696.00
	BT GROUP PLC	20,577	1.06	21,852.77
	VODAFONE GROUP PLC	74,642	0.65	48,987.54
	NATIONAL GRID PLC	12,780	10.16	129,844.80
	イギリスボンド 小計	534,022		3,063,064.56 (579,991,274)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	11.07	6,520.23
	GIVAUDAN-REG	32	3,667.00	117,344.00
	SIG GROUP AG	1,000	18.02	18,020.00
	SIKA AG-BR	523	254.30	132,998.90
	ABB LTD	5,707	40.04	228,508.28
	GEBERIT AG-REG	104	512.40	53,289.60

	VAT GROUP AG	83	429.50	35,648.50
	SGS SA	475	84.62	40,194.50
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	206	282.10	58,112.60
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	7	11,200.00	78,400.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	284.30	44,635.10
	LONZA GROUP AG-REG	266	457.10	121,588.60
	NOVARTIS	7,026	88.44	621,379.44
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	106.50	15,336.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	700	49.42	34,594.00
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	143.20	22,912.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	92	638.00	58,696.00
	SWISS RE LTD	1,048	100.95	105,795.60
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	500	441.40	220,700.00
	TEMENOS AG - REG	200	60.62	12,124.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	508	76.56	38,892.48
	SWISSCOM	102	509.40	51,958.80
	スイスフラン 小計	19,629		2,117,648.63 (361,037,914)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	963	277.50	267,232.50
	HOLMEN AB-B SHARES	294	403.30	118,570.20
	SCA SV CELLULOSA B	2,552	139.85	356,897.20
	ALFA LAVAL AB	1,050	378.60	397,530.00
	ASSA ABLOY AB-B	3,519	287.00	1,009,953.00
	ATLAS COPCO A	9,427	176.80	1,666,693.60
	ATLAS COPCO B	5,624	154.10	866,658.40
	BEIJER REF AB	1,031	144.70	149,185.70
	EPIROC AB-A	1,948	195.85	381,515.80
	EPIROC AB-B	1,045	173.50	181,307.50
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,379	78.62	108,416.98
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,447	58.42	259,793.74
	SANDVIK AB	3,813	224.10	854,493.30
	SKF AB-B	1,022	218.40	223,204.80
	HENNES & MAURITZ B	1,899	142.38	270,379.62
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,790	239.20	428,168.00
	SVENSKA HANDELSBK A	4,600	122.75	564,650.00
	EQT AB	1,233	279.10	344,130.30
	TELE2 AB-B SHS	1,519	83.44	126,745.36
	TELIA CO AB	7,952	24.45	194,426.40
	スウェーデンクローナ 小計	57,107		8,769,952.40 (126,199,615)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	887	261.30	231,773.10
	EQUINOR ASA	3,240	266.05	862,002.00

	NORSK HYDRO	4,021	58.30	234,424.30	
	MOWI ASA	1,979	201.90	399,560.10	
	ORKLA	2,110	75.00	158,250.00	
	SALMAR ASA	202	632.40	127,744.80	
	DNB BANK ASA	3,363	206.10	693,114.30	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	172.60	104,250.40	
	TELENOR ASA	2,114	114.15	241,313.10	
	ノルウェークローネ 小計	18,520		3,052,432.10 (43,588,730)	
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S	1,278	373.50	477,333.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	50	2,204.00	110,200.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	3,527	188.54	664,980.58	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	10,400.00	83,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	10,535.00	189,630.00	
	DSV A/S	665	1,143.00	760,095.00	
	PANDORA A/S	241	1,134.00	273,294.00	
	COLOPLAST-B	468	894.00	418,392.00	
	GENMAB A/S	242	1,989.00	481,338.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	11,146	850.90	9,484,131.40	
	ORSTED A/S	553	397.20	219,651.60	
	デンマーククローネ 小計	18,196		13,162,245.58 (285,620,729)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	6,729	30.70	206,580.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	22.85	27,808.45	
	FORTESCUE LTD	6,047	28.40	171,734.80	
	IGO LTD	2,596	7.49	19,444.04	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,729	57.30	99,071.70	
	MINERAL RESOURCES LTD	565	59.75	33,758.75	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	13.16	53,153.24	
	ORICA LTD	1,151	16.73	19,256.23	
	PILBARA MINERALS LTD	9,000	3.71	33,390.00	
	BRAMBLES LTD	4,243	15.28	64,833.04	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	26.21	42,407.78	
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.91	18,365.27	
	TRANSURBAN GROUP	10,540	13.09	137,968.60	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,252	44.32	99,808.64	
	IDP EDUCATION LTD	654	20.52	13,420.08	
	REA GROUP LTD	218	185.08	40,347.44	
	SEEK LTD	1,757	25.35	44,539.95	
	COLES GROUP LTD	5,201	16.13	83,892.13	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	5.46	18,416.58	
COCHLEAR LIMITED	213	334.54	71,257.02		

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	705	52.23	36,822.15	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,432	31.94	45,738.08	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	10,315	28.42	293,152.30	
	ASX LTD	680	65.12	44,281.60	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,290	192.70	248,583.00	
	QBE INSURANCE GROUP	4,375	16.11	70,481.25	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	14.37	64,090.20	
	XERO LTD	498	117.50	58,515.00	
	TELSTRA GROUP LTD	12,031	3.86	46,439.66	
	オーストラリアドル 小計	103,625		2,207,557.28 (216,870,427)	
ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	527	37.36	19,688.72	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	5.19	29,603.76	
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.78	15,858.42	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	5.72	22,902.88	
	ニュージーランドドル 小計	12,574		88,053.78 (8,109,753)	
香港ドル	MTR CORP	4,000	25.40	101,600.00	
	WH GROUP LTD	24,000	4.74	113,760.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	11,500	19.64	225,860.00	
	HANG SENG BANK	2,400	82.90	198,960.00	
	AIA GROUP LTD	38,400	64.30	2,469,120.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	48,000	5.92	284,160.00	
	SINO LAND CO	10,000	8.10	81,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	1,500	63.10	94,650.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	3,800	15.34	58,292.00	
	香港ドル 小計	143,600		3,627,402.00 (69,573,570)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	4,300	7.34	31,562.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	4,400	29.19	128,436.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	9.37	22,488.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	2.94	22,932.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	6.08	7,904.00	
	シンガポールドル 小計	20,200		213,322.00 (23,793,935)	
イスラエルシェケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,525	27.56	124,709.00	
	イスラエルシェケル 小計	4,525		124,709.00 (5,182,307)	
	合 計	1,732,984		14,932,612,094 (14,932,612,094)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	5,334	43,098.72	
	オーストラリアドル 小計		5,334	43,098.72 (4,234,018)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	11,000	100,430.00	
	香港ドル 小計		11,000	100,430.00 (1,926,247)	
投資信託受益証券合計			16,334	6,160,265 (6,160,265)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,605	300,343.65	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	27,243.60	
		BOSTON PROPERTIES	522	35,161.92	
		CROWN CASTLE INC	1,449	156,810.78	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,033	140,715.26	
		EQUINIX INC	321	274,849.83	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,586	27,215.76	
		IRON MOUNTAIN INC	950	64,581.00	
		PROLOGIS INC	3,167	422,446.13	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	356	73,620.80	
		WELLTOWER INC	1,778	165,585.14	
	アメリカドル 小計		14,227	1,688,573.87 (253,336,737)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	278	13,997.30	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	550	10,191.50	
	カナダドル 小計		828	24,188.80 (2,694,390)	
	ユーロ	GECINA SA	121	11,283.25	
		KLEPIERRE	568	13,450.24	
	ユーロ 小計		689	24,733.49 (4,002,126)	
	イギリスポンド	SEGRO PLC	3,574	30,357.55	
	イギリスポンド 小計		3,574	30,357.55 (5,748,202)	
オーストラリアドル	DEXUS	2,715	21,339.90		
	GOODMAN GROUP	5,797	165,852.17		
	GPT GROUP	4,863	22,126.65		
	MIRVAC GROUP	19,765	45,459.50		
	SCENTRE GROUP	15,450	47,122.50		
	STOCKLAND	10,932	51,271.08		
	VICINITY CENTERS	9,869	20,231.45		
オーストラリアドル 小計		69,391	373,403.25 (36,683,135)		

シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	24,885	48,774.60	
シンガポールドル 小計		24,885	48,774.60 (5,440,318)	
投資証券合計		113,594	307,904,908 (307,904,908)	
合計			314,065,173 (314,065,173)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 273銘柄	97.8%			74.7%
	投資証券 11銘柄			2.2%	1.7%
カナダドル	株式 39銘柄	99.5%			3.4%
	投資証券 2銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 90銘柄	99.7%			8.6%
	投資証券 2銘柄			0.3%	0.0%
イギリスポンド	株式 41銘柄	99.0%			3.8%
	投資証券 1銘柄			1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 22銘柄	100.0%			2.4%
スウェーデンクローナ	株式 20銘柄	100.0%			0.8%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%			1.9%
オーストラリアドル	株式 29銘柄	84.1%			1.4%
	投資信託受益証券 1銘柄		1.6%		0.0%
	投資証券 7銘柄			14.2%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 4銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 9銘柄	97.3%			0.5%
	投資信託受益証券 1銘柄		2.7%		0.0%
シンガポールドル	株式 5銘柄	81.4%			0.2%
	投資証券 1銘柄			18.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 1銘柄	100.0%			0.0%

(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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,473,074,283
コール・ローン	290,172,135
株式	169,885,992,207
投資信託受益証券	530,762,607
投資証券	184,415,878
派生商品評価勘定	259,302,178
未収配当金	229,229,755
差入委託証拠金	1,549,629,540
流動資産合計	181,402,578,583
資産合計	181,402,578,583
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,599,835
前受金	254,916,723
未払金	1,281
未払解約金	140,836,167
未払利息	62
流動負債合計	400,354,068
負債合計	400,354,068
純資産の部	
元本等	
元本	43,538,931,402
剰余金	
剰余金又は欠損金()	137,463,293,113
元本等合計	181,002,224,515
純資産合計	181,002,224,515
負債純資産合計	181,402,578,583

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

2024年 2月19日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,538,931,402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 4.1573円 (1万口当たり純資産額) (41,573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 2月19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>
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 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	36,009,544,669円
期中追加設定元本額	11,519,697,454円
期中一部解約元本額	3,990,310,721円
期末元本額	43,538,931,402円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,466,813,325円
世界経済インデックスファンド	10,762,908,770円
D C 新興国株式インデックス・オープン	6,129,943,219円
D C 世界経済インデックスファンド	7,484,453,410円
新興国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	77,428,554円
コア投資戦略ファンド (安定型)	60,817,634円
コア投資戦略ファンド (成長型)	142,991,154円
分散投資コア戦略ファンド A	310,316,270円
分散投資コア戦略ファンド S	1,419,462,050円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,234,668,009円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	787,646,654円
コア投資戦略ファンド (切替型)	64,979,797円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	362,127,009円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,139,404円
S M T インデックスバランス・オープン	88,073,578円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	35,711,445円
外国株式 S M T B セレクション (S M A 専用)	2,461,319,140円
S M T 世界経済インデックス・オープン	265,874,454円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,164,850,634円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	193,778,137円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,957,933円
グローバル経済コア	533,768,281円
M y S M T 新興国株式インデックス (ノーロード)	304,198,379円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	57,500,179円

区分	2024年 2月19日現在
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・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	102,512,085円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	98,499,700円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	44,001,118円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	52,580,506円
10資産分散投資ファンド	13,305,211円
グローバル10資産バランスファンド	12,986,563円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	43,544円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,554,457,323円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	90,583,611円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	85,071,139円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	12,585,591円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,089,233円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,769,149,484
投資信託受益証券	44,410,658
投資証券	4,258,906
合計	9,817,819,048

(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 2月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	10,123,070,959	-	10,377,987,682	254,916,723
合計		10,123,070,959	-	10,377,987,682	254,916,723

(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 2月19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	167,472,719	-	167,196,749	275,970
	アメリカドル	167,472,719	-	167,196,749	275,970
	売建	23,319,119	-	23,257,529	61,590
	ブラジルリアル	3,399,593	-	3,395,825	3,768

	カタールリアル	19,919,526	-	19,861,704	57,822
	合計	190,791,838	-	190,454,278	214,380

(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	1.88	262,211.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	15.25	258,182.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,749	83.69	1,318,033.81	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	18.48	1,345,916.88	
	NIO INC - ADR	231,271	6.14	1,420,003.94	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	36.94	1,114,073.46	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	14.17	1,123,227.56	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	41.34	2,747,125.68	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	27.17	333,729.11	
	IQIYI INC-ADR	59,454	3.59	213,439.86	
	JOYY INC	6,185	33.14	204,970.90	
	KANZHUN LTD	38,815	14.87	577,179.05	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	10.12	1,149,095.64	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	WEIBO CORP-SPON ADR	29,249	9.30	272,015.70	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	-	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	97,780	135.26	13,225,722.80	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	16.88	922,930.88	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	58.11	859,330.68	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	903,900	1.17	1,057,563.00	
	CREDICORP LTD	10,882	170.21	1,852,225.22	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	28,533	2.57	73,329.81	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	15.21	315,653.13	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.04	288,417.24		

	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	19.62	153,722.70
	KE HOLDINGS INC	114,048	14.11	1,609,217.28
	アメリカドル 小計	2,418,156		32,697,318.23 (4,905,578,654)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	13.42	35,754,382.62
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	86.83	42,450,492.36
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	216.64	7,582,400.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	32.79	5,854,720.08
	ALFA S.A.B. -A	313,500	13.16	4,125,660.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	150.06	15,306,120.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	516.79	17,351,224.25
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	155.00	8,230,500.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	266.28	15,971,474.40
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	180.21	7,692,263.85
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	68.01	56,263,312.80
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	189.96	15,552,975.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	227.14	71,126,619.60
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	315.02	8,177,919.20
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	77.77	14,138,586.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	37.85	6,881,130.00
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	67.61	9,647,947.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	187.58	77,339,234.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	54.18	14,720,706.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	15.59	54,897,690.60
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	20.15	4,455,165.00	
	メキシコペソ 小計	10,152,540		493,520,522.76 (4,348,409,326)
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	18.94	3,070,174.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	44.30	28,090,630.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	42.69	31,080,027.60
	PRIO SA	130,000	45.40	5,902,000.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	29.83	4,531,177.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	19.04	1,892,576.00
	GERDAU SA-PREF	155,590	21.21	3,300,063.90
	SUZANO SA	121,779	53.05	6,460,375.95
	VALE SA	550,487	67.68	37,256,960.16
	WEG SA	255,844	33.40	8,545,189.60
	CCR SA	248,600	13.27	3,298,922.00
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	51.86	7,122,452.40
	RUMO SA	244,300	23.43	5,723,949.00
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	14.40	3,116,836.80
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	2.04	623,220.00

	MAGAZINE LUIZA SA-RIGHTS	29,263	0.12	3,511.56	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	24.26	4,196,980.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.13	1,475,838.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	25.24	4,777,427.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	13.60	4,075,920.00	
	AMBEV SA	756,200	12.76	9,649,112.00	
	JBS SA	110,000	22.45	2,469,500.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	16.32	1,637,026.56	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	3.48	3,637,135.92	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	26.42	2,528,394.00	
	HYPERA SA	54,500	33.22	1,810,490.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	12.28	4,003,562.44	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	13.48	11,163,893.36	
	BANCO DO BRASIL S.A.	156,500	57.87	9,056,655.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	34.54	26,950,905.74	
	ITAUSA SA	824,701	10.46	8,626,372.46	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	12.73	11,296,716.57	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	32.66	3,556,674.00	
	TOTVS SA	57,900	30.84	1,785,636.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	52.66	4,707,804.00	
	TIM SA	96,100	17.40	1,672,140.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	46.84	1,733,080.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	42.50	8,997,250.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.66	2,469,902.82	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	81.44	4,112,720.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	10.21	2,088,966.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	35.86	975,392.00	
	ENEVA SA	102,200	12.36	1,263,192.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	40.76	1,885,150.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	33.90	5,596,890.00	
	ブラジルリアル 小計	12,338,905		298,218,792.04 (9,005,104,110)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,114.00	552,846,222.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,639.00	222,846,635.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	42,390.00	900,829,890.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	62.00	152,593,656.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	11.65	493,571,262.80	
	FALABELLA SA	70,837	2,339.90	165,751,496.30	
	CENCOSUD SA	306,432	1,765.00	540,852,480.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	114.10	865,243,462.30	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	27,140.00	189,681,460.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	48.93	565,149,769.17	

	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	99.74	348,223,758.10	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	57.84	148,144,319.52	
	チリペソ 小計	70,645,682		5,145,734,411.19 (794,367,603)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	34,000.00	1,723,732,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	31,000.00	1,908,515,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	16,800.00	848,584,800.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,480,831,800.00 (171,942,958)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	27.20	141,467.20	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	37.02	751,320.90	
	OPAP SA	20,586	16.31	335,757.66	
	JUMBO SA	19,341	26.68	516,017.88	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.68	443,753.24	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.90	812,555.90	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	7.16	958,945.96	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.95	446,583.05	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.46	352,746.22	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.78	658,407.76	
	ユーロ 小計	1,085,841		5,417,555.77 (876,614,699)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	167.00	23,812,530.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	49.12	12,715,596.16	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	22.24	2,959,410.08	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	24.02	403,127.66	
	SASA POLYESTER SANAYI	368,879	44.44	16,392,982.76	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	58.30	11,609,395.60	
	KOC HOLDING AS	89,884	171.10	15,379,152.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	53.05	15,848,581.40	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	841.00	6,039,221.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	282.50	24,468,737.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	964.50	15,788,865.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	257.50	8,137,772.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	390.25	31,699,227.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	41.48	24,314,870.84	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	79.90	16,888,622.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	27.84	10,703,449.92	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	23.86	8,855,090.22	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	68.15	9,751,651.65	
	トルコリラ 小計	3,427,184		255,768,284.49 (1,247,919,036)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	847.00	11,267,641.00	

	MONETA MONEY BANK AS	60,710	102.00	6,192,420.00	
	CEZ AS	25,283	822.00	20,782,626.00	
	チェココルナ 小計	99,296		38,242,687.00	(243,189,070)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,960.00	131,788,080.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,745.00	280,081,045.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	17,225.00	689,361,725.00	
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		1,101,230,850.00	(458,670,357)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	67.83	6,985,065.57	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	113.45	2,290,101.70	
	BUDIMEX	2,656	681.00	1,808,736.00	
	LPP SA	230	16,180.00	3,721,400.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	114.50	767,608.00	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	11.17	403,395.15	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	31.80	2,664,681.00	
	PEPCO GROUP NV	22,887	21.56	493,443.72	
	DINO POLSKA SA	9,471	445.40	4,218,383.40	
	BANK PEKAO SA	27,684	163.25	4,519,413.00	
	M BANK SA	1,423	629.40	895,636.20	
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	53.84	7,015,190.48	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	505.00	3,708,215.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	48.16	4,167,236.64	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	7.95	794,008.80	
	ポーランドズロチ 小計	638,082		44,452,514.66	(1,656,989,710)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13	
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-	
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12	
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	7,220	0.00	-	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01	
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-	
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-	
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11	
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-	
	ロシアルーブル 小計	760,525,356		76.00	(123)

香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	8.48	2,789,920.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	6.62	1,602,040.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.18	16,174,092.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	29.90	17,207,450.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	6.80	149,600.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	5.67	21,546,000.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	15.68	6,726,720.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.88	1,319,200.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	16.44	3,904,500.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	5.79	3,216,345.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.93	2,133,040.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.33	3,507,300.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	21.35	1,153,754.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	11.04	2,583,360.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	3.55	1,292,200.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	11.42	2,797,900.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	7.89	1,428,090.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.74	10,624,700.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.19	877,250.00
	BOC AVIATION LTD	23,800	58.10	1,382,780.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	3.26	1,779,960.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.68	2,598,080.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.62	3,810,040.00
	CITIC LTD	1,038,000	7.85	8,148,300.00
	CRRC CORP LTD-H	936,000	3.77	3,528,720.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.86	1,399,680.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	18.18	1,418,040.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	5.83	932,800.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	18.34	3,053,610.00
	WEICHAJ POWER CO LTD-H	408,800	13.66	5,584,208.00
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	20.60	1,283,380.00
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	2.73	1,051,252.02
	AIR CHINA LIMITED-H	630,000	4.29	2,702,700.00
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	9.42	3,631,852.74
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	3.03	1,811,940.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	8.33	4,315,356.50	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.80	1,203,715.20	
JD LOGISTICS INC	326,200	7.77	2,534,574.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.65	2,463,300.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	113.10	1,979,250.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.70	1,767,000.00	
BYD CO LTD-H	169,000	190.00	32,110,000.00	

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.08	819,280.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	36.65	2,140,360.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	8.29	7,858,920.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	8.81	4,349,937.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	3.35	1,200,452.40
LI AUTO INC-CLASS A	190,542	126.70	24,141,671.40
MINTH GROUP LTD	176,000	11.50	2,024,000.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	37.50	6,268,575.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	12.18	2,850,120.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	23.15	2,007,105.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	78.40	15,585,920.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.86	1,690,680.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	24.15	7,500,990.00
LI NING CO LTD	380,000	21.25	8,075,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	70.20	11,147,760.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	4.31	711,150.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	25.45	1,119,800.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	14.20	3,322,800.00
MEITUAN-CLASS B	833,450	74.65	62,217,042.50
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	71.40	17,457,300.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	17.50	2,919,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	8.08	638,320.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	325.00	28,488,525.00
BAIDU INC-CLASS A	379,500	106.90	40,568,550.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	81.85	3,404,960.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	24.45	1,261,620.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.75	2,219,000.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	22.00	3,766,400.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	45.10	16,795,240.00
NETEASE INC	313,630	171.50	53,787,545.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,083,100	291.80	316,048,580.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,643,588	73.00	192,981,924.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	86.25	776,250.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	12.12	3,054,240.00
JD.COM INC - CL A	379,111	95.75	36,299,878.25
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	34.65	1,486,623.60
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	19.20	1,240,320.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	5.64	2,312,400.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	14.08	1,295,360.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	3.40	2,665,600.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	30.25	5,851,862.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	12.42	666,954.00

ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	100.04	1,520,608.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	3.80	2,143,200.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	19.34	11,159,180.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	31.65	7,785,900.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	44.85	15,634,710.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	5.48	1,068,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	8.00	3,328,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	49.85	5,782,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	4.65	372,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.47	4,362,720.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	25.25	2,209,375.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	23.35	583,750.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	28.05	2,114,970.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	7.27	479,820.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	4.78	1,908,176.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	12.00	1,540,800.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	21.60	4,129,920.00
3SBIO INC	445,500	5.51	2,454,705.00
AKESO INC	61,000	43.90	2,677,900.00
BEIGENE LTD	110,905	90.50	10,036,902.50
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	12.04	2,973,880.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.21	8,620,473.60
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.11	1,732,290.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.43	1,666,980.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	13.98	3,103,560.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	13.48	1,644,560.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	40.10	8,140,300.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	13.60	992,800.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.15	6,208,650.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	63,688	40.80	2,598,470.40
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	17.28	10,851,840.00
ZAI LAB LTD	128,250	16.16	2,072,520.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	3.13	12,316,550.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.01	40,445,972.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.88	6,692,798.00
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.99	6,245,148.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,201,620	4.72	71,751,646.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.38	892,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	30.80	19,155,228.40
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.67	1,800,648.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	10,851,515	3.93	42,646,453.95

POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	4.11	4,418,250.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.78	648,960.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.95	1,907,850.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	9.62	3,378,544.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	14.72	4,206,608.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.00	1,440,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.13	720,318.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.71	1,325,212.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.26	2,463,160.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	9.75	12,870,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	15.62	6,038,692.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	6.50	1,196,156.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	14.56	1,534,624.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.50	4,695,000.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.65	11,553,829.20
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,058,000	34.90	36,924,200.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	13.34	1,548,774.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	4.72	1,302,720.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	7.06	894,502.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	8.13	4,008,090.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	18.28	1,307,020.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	30.90	4,959,450.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	16.20	1,085,400.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	5.22	360,180.00
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	8.38	9,955,440.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	50.55	6,040,725.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,554,200	13.42	34,277,364.00
ZTE CORP-H	82,908	14.86	1,232,012.88
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.89	6,302,980.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	28.10	1,671,950.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.76	1,073,600.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	2.20	3,141,600.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	6.83	3,185,512.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	4.82	2,178,640.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.99	1,991,340.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	22.35	4,398,480.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	15.48	3,984,552.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	58.00	6,786,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	4.34	1,935,640.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.06	2,858,240.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.97	3,819,560.00
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-

	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	15.06	963,840.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.03	3,243,470.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	16.36	1,472,400.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	4.07	3,646,667.09	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	12.92	1,181,585.68	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	11.94	6,979,407.60	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	5.75	1,293,750.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	24.90	13,473,663.90	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	23.05	2,742,950.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	6.37	2,009,735.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	6.07	2,069,870.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	6.30	456,750.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	9.38	3,222,030.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	5.47	1,753,682.00	
	香港ドル 小計	133,620,496		1,676,520,097.21 (32,155,655,464)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	1.87	773,559.16	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	22.30	1,971,320.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.88	2,864,832.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.61	3,492,536.00	
	GAMUDA BHD	161,910	5.11	827,360.10	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.46	827,411.16	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	8.05	863,612.05	
	MISC BHD	217,540	7.65	1,664,181.00	
	GENTING BHD	271,600	4.91	1,333,556.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.85	1,053,645.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.51	458,209.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.99	1,078,656.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	22.54	2,575,104.84	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	121.70	2,214,940.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.02	1,103,669.60	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.80	723,840.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.50	1,111,707.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.19	2,917,966.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.39	1,320,073.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	6.41	5,897,212.82	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.40	2,353,064.80	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.43	8,312,592.15	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.41	11,219,481.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.62	1,232,730.14	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.78	1,504,227.42	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.30	2,141,400.00	

	MAXIS BHD	267,900	3.78	1,012,662.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.80	1,575,001.60
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.92	2,659,328.00
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	11.18	4,939,044.50
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.23	887,281.00
	マレーシアリングット 小計	12,193,769		72,910,204.44 (2,288,629,444)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	5.95	10,193,540.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	155.00	31,124,000.00
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	35.75	60,224,450.00
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	58.50	17,175,892.50
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	23.50	4,850,400.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	37.25	18,108,491.50
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	30.75	6,233,025.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	265.00	34,556,000.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	63.25	41,422,425.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.65	6,250,050.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	5.70	4,614,150.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.94	3,192,582.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	31.00	26,317,078.00
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	34.25	6,240,350.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	10.90	9,157,471.50
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	18.40	14,580,160.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	25.00	4,440,000.00
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	55.00	52,602,000.00
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	33.25	7,910,507.50
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	18.20	10,126,480.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	21.00	6,155,100.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	27.75	52,394,775.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	243.00	20,096,100.00
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	120.00	15,984,000.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	15.70	6,886,805.00
	SCB X PCL-NVDR	151,200	103.50	15,649,200.00
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.87	16,319,864.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	42.75	4,339,125.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	44.75	4,018,550.00
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	77.50	38,440,000.00
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	213.00	43,409,400.00
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	72.75	8,864,587.50
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.45	13,000,736.10
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	38.25	8,411,175.00
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	51.25	3,495,250.00

	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	43.25	30,019,825.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	63.50	24,028,400.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.45	6,496,400.00	
	タイパーツ 小計	29,576,840		687,328,345.60 (2,873,032,484)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	46.00	10,945,240.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	709.00	38,576,690.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	39.65	23,239,776.95	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	905.00	32,837,925.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	280.00	42,876,400.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	259.00	15,801,590.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	118.00	11,276,080.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	115.00	27,002,230.00	
	BDO UNIBANK INC	394,773	154.30	60,913,473.90	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	59.05	9,523,997.35	
	PLDT INC	10,460	1,300.00	13,598,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	369.00	19,623,420.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	34.25	43,870,825.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	34.00	52,813,900.00	
	フィリピンペソ 小計	4,913,210		402,899,548.20 (1,080,133,398)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,520.00	5,448,996,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,250.00	4,670,925,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	7,900.00	8,718,440,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,530.00	1,508,274,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	1,010.00	2,921,131,090.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	7,975.00	6,013,150,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,400.00	3,895,912,800.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,500.00	2,566,876,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	5,200.00	17,041,960,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	83.00	11,175,112,032.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,770.00	8,694,199,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	4,800.00	4,575,840,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,450.00	6,863,130,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,425.00	2,756,967,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	2,830.00	3,275,442,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,485.00	6,219,922,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	9,950.00	93,226,525,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	7,200.00	43,932,902,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	6,000.00	15,507,600,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	6,150.00	67,406,472,300.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	880.00	2,499,728,000.00		

	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	4,160.00	30,367,168,000.00	
	インドネシアルピア 小計	197,657,308		349,286,673,622.00 (3,353,152,066)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	71,100.00	368,298,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	72,500.00	463,057,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	127,100.00	1,276,592,400.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	33,600.00	614,073,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	36,800.00	411,755,200.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	464,500.00	559,258,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	95,100.00	512,493,900.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	155,200.00	294,569,600.00	
	LG CHEM LTD	8,087	504,000.00	4,075,848,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	313,500.00	274,939,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	137,300.00	317,986,800.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	442,000.00	5,208,970,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	69,700.00	162,958,600.00	
	SKC CO LTD	1,432	82,800.00	118,569,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	48,700.00	589,172,600.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	15,370.00	1,260,386,110.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	254,000.00	2,090,928,000.00	
	ECOPRO CO LTD	3,133	640,000.00	2,005,120,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	48,700.00	321,079,100.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	141,300.00	823,213,800.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	22,500.00	334,102,500.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	110,400.00	233,496,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	119,900.00	751,653,100.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	33,750.00	329,670,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	63,000.00	181,629,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	51,300.00	688,240,800.00	
	L&F CO LTD	4,327	151,800.00	656,838,600.00	
	LG CORP	16,658	96,500.00	1,607,497,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	7,369	410,000.00	3,021,290,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	303,000.00	1,441,674,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	57,300.00	495,473,100.00	
	SAMSUNG C&T CORP	11,910	163,800.00	1,950,858,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	30,300	24,450.00	740,835,000.00		
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	7,300.00	694,733,700.00		
SK INC	6,394	194,000.00	1,240,436,000.00		
SK SQUARE CO LTD	11,660	65,500.00	763,730,000.00		
HMM CO LTD	35,545	17,830.00	633,767,350.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	179,300.00	500,784,900.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	23,100.00	619,588,200.00		

HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	18,150	55,500.00	1,007,325,000.00	
HANON SYSTEMS	19,000	6,470.00	122,930,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	230,500.00	2,339,114,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	252,500.00	5,920,620,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	162,800.00	983,637,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	157,200.00	542,182,800.00	
KIA CORP	45,204	115,800.00	5,234,623,200.00	
COWAY CO LTD	9,036	57,000.00	515,052,000.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	68,600.00	206,966,200.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	99,300.00	1,713,322,200.00	
KANGWON LAND INC	28,528	17,010.00	485,261,280.00	
HYBE CO LTD	4,975	208,500.00	1,037,287,500.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	4,193	76,600.00	321,183,800.00	
KAKAO CORP	52,020	58,400.00	3,037,968,000.00	
KRAFTON INC	3,793	237,500.00	900,837,500.00	
NAVER CORP	21,578	205,000.00	4,423,490,000.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	213,000.00	577,017,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	64,700.00	159,485,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	35,400.00	163,017,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	60,700.00	264,834,100.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	302,500.00	556,297,500.00	
KT&G CORP	19,456	90,900.00	1,768,550,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	97,200.00	305,402,400.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	125,000.00	470,250,000.00	
LG H&H CO LTD	1,321	336,500.00	444,516,500.00	
HLB INC	23,903	68,600.00	1,639,745,800.00	
CELLTRION INC	24,444	182,200.00	4,453,696,800.00	
CELLTRION PHARM INC	2,169	103,000.00	223,407,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,202	335,500.00	403,271,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	828,000.00	2,214,900,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	85,400.00	273,023,800.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	64,800.00	136,080,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,854	62,600.00	867,260,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	55,700.00	2,854,569,300.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,720.00	388,687,600.00	
KAKAOBANK CORP	35,459	30,100.00	1,067,315,900.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	67,700.00	4,373,352,300.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	44,500.00	3,016,121,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	14,750.00	1,678,756,500.00	
KAKAOPAY CORP	3,065	49,400.00	151,411,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	69,600.00	320,299,200.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	74,800.00	1,269,730,000.00	

	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	8,950.00	277,584,250.00
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	11,580.00	140,199,060.00
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	41,200.00	657,016,400.00
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	100,000.00	1,007,400,000.00
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	304,000.00	1,867,776,000.00
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	80,300.00	974,119,300.00
	POSCO DX CO LTD	9,010	61,000.00	549,610,000.00
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	157,600.00	1,147,958,400.00
	COSMOAM&T CO LTD	3,978	175,800.00	699,332,400.00
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	11,840.00	453,483,840.00
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	195,200.00	526,259,200.00
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	136,100.00	1,256,611,300.00
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	771,665	72,800.00	56,177,212,000.00
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	133,027	62,500.00	8,314,187,500.00
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	404,500.00	3,568,903,500.00
	LG UPLUS CORP	22,125	10,150.00	224,568,750.00
	SK TELECOM	9,563	52,100.00	498,232,300.00
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	21,100.00	933,464,000.00
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	75,400.00	545,745,200.00
	SK HYNIX INC	87,370	146,800.00	12,825,916,000.00
	韓国ウォン 小計	2,530,822		190,113,946,040.00 (21,444,853,113)
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	73.80	17,582,112.00
	ASIA CEMENT CORP	454,176	39.60	17,985,369.60
	CHINA STEEL	1,779,261	24.90	44,303,598.90
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	57.40	31,114,301.40
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	73.00	43,641,152.00
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	61.10	47,092,947.20
	TAIWAN CEMENT	1,268,419	31.90	40,462,566.10
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	1,045.00	19,392,065.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	30.85	11,168,563.80
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,405.00	12,645,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	36.05	18,104,778.65
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	20.25	9,416,250.00
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	31.55	12,178,300.00
	EVERGREEN MARINE	183,215	148.00	27,115,820.00
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.45	13,900,400.00
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	47.30	3,530,235.50
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	46.90	10,177,300.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	46.55	8,242,189.55
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	539.00	21,526,043.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	169.00	13,334,269.00

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	350.00	10,850,000.00
POU CHEN	273,780	30.45	8,336,601.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	650.00	35,139,000.00
MOMO.COM INC	6,600	431.00	2,844,600.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	265.00	23,464,160.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	73.50	57,065,032.50
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	315.00	7,875,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	17.60	10,707,452.80
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	28.25	87,299,195.25
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,474,537	24.65	60,997,337.05
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	26.85	44,392,662.30
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	21.75	33,024,351.75
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,720,087	37.90	65,191,297.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	19.60	35,112,302.40
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	17.15	34,311,164.65
TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	13.40	10,702,848.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	25.60	38,782,105.60
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	44.20	30,497,337.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	287,702	171.00	49,197,042.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,433,822	27.15	38,928,267.30
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	44.55	68,208,589.35
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	12.35	31,816,391.10
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	65.90	89,192,420.90
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.30	16,034,487.80
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	558.00	47,988,000.00
ACER INC	617,803	48.65	30,056,115.95
ADVANTECH CO LTD	76,261	380.50	29,017,310.50
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	479.50	60,940,614.00
AUO CORP	1,268,072	17.90	22,698,488.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	196.00	23,265,200.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	36.85	29,692,256.00
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	291.50	88,296,224.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	226.00	32,544,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	381.00	28,575,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,056,248	101.50	208,709,172.00
INNOLUX CORP	1,320,576	15.65	20,667,014.40
INVENTEC CO LTD	455,511	58.10	26,465,189.10
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,390.00	35,945,600.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	110.00	38,879,720.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	191.00	19,100,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	228.00	4,788,000.00
PEGATRON CORP	340,474	84.70	28,838,147.80

	QUANTA COMPUTER INC	408,270	248.50	101,455,095.00
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	74.10	14,975,610.00
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	182.00	38,402,000.00
	WISTRON CORP	427,000	126.00	53,802,000.00
	WIWYNN CORP	16,000	2,285.00	36,560,000.00
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	89.40	23,305,864.80
	YAGEO CORPORATION	64,588	543.00	35,071,284.00
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	98.00	13,516,356.00
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	122.00	71,286,430.00
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	79.60	17,193,600.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	98.00	24,029,600.00
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	4,185.00	50,220,000.00
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	137.00	70,461,155.00
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,925.00	35,100,000.00
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,520.00	19,760,000.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	562.00	23,604,000.00
	MEDIATEK INC	241,804	970.00	234,549,880.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	65.90	17,068,100.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	514.00	49,367,130.00
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,275.00	10,200,000.00
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	27.30	15,724,800.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	473.50	40,694,484.00
	SILERGY CORP	53,000	404.00	21,412,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,979,389	683.00	2,717,922,687.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	48.85	83,093,850.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	74.80	14,062,400.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	363,030	27.15	9,856,264.50
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	36.20	10,102,587.40
	新台湾ドル 小計	56,347,050		5,942,146,138.50 (28,417,125,478)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	654.70	61,247,185.00
	COAL INDIA LTD	295,479	479.85	141,785,598.15
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	565.60	33,610,780.00
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	186.80	111,526,324.80
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	274.50	148,163,571.00
	PETRONET LNG LTD	83,779	277.60	23,257,050.40
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	494,885	2,921.35	1,445,732,294.75
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	585.25	43,035,188.25
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,432.65	37,866,372.15
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	3,007.70	202,126,463.10
	BERGER PAINTS INDIA LTD	35,338	562.70	19,884,692.60
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,104.40	98,576,409.20

HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	515.50	92,609,575.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	769.80	53,712,025.20
JSW STEEL LTD	99,332	820.50	81,501,906.00
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,643.95	46,631,628.15
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,709.75	79,016,310.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	26,292.95	36,468,321.65
SRF LTD	19,164	2,379.30	45,596,905.20
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	3,960.60	39,653,527.20
TATA STEEL LTD	1,137,948	142.35	161,986,897.80
ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	9,915.25	196,837,543.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	491.10	34,205,606.10
VEDANTA LTD	107,173	266.85	28,599,115.05
ABB LTD INDIA	5,256	4,521.75	23,766,318.00
ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	3,223.00	74,135,446.00
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	174.25	42,163,795.25
ASTRAL LTD	19,918	1,967.20	39,182,689.60
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	188.10	95,442,880.50
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	430.30	30,295,701.80
CUMMINS INDIA LTD	20,968	2,617.65	54,886,885.20
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,398.40	49,875,334.40
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	3,078.25	111,789,727.00
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	3,389.00	364,622,510.00
POLYCAB INDIA LTD	7,354	4,667.00	34,321,118.00
SIEMENS INDIA LTD	11,025	4,396.80	48,474,720.00
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	46.76	70,140,000.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	941.05	21,637,562.65
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,306.95	136,683,444.90
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	979.40	25,910,027.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	3,045.75	80,563,133.25
BAJAJ AUTO LTD	9,644	8,325.80	80,294,015.20
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,338.95	20,655,267.45
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,134.30	34,394,244.60
EICHER MOTORS LTD	26,253	3,930.55	103,188,729.15
HERO MOTOCORP LTD	13,719	4,895.00	67,154,505.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,835.55	275,538,081.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	11,367.65	242,460,606.85
MRF LTD	432	148,170.45	64,009,634.40
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	114.05	59,446,851.75
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	614.10	36,409,374.90
TATA MOTORS LTD	277,381	938.75	260,391,413.75
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	619.95	46,496,250.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,671.25	77,654,280.00

TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,138.10	88,205,177.40
PAGE INDUSTRIES LTD	886	36,324.50	32,183,507.00
TITAN CO LTD	56,531	3,656.60	206,711,254.60
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	537.40	88,400,687.80
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	495.80	21,780,494.00
ZOMATO LTD	842,242	156.70	131,979,321.40
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	5,270.15	75,658,273.40
TRENT LTD	37,950	4,021.80	152,627,310.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,687.20	105,424,422.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	4,914.15	74,179,094.25
ITC LTD	480,447	404.75	194,460,923.25
MARICO LTD	81,711	523.45	42,771,622.95
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,487.60	128,011,896.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,147.15	106,959,118.85
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,126.00	65,961,080.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,421.60	114,236,932.80
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,576.85	66,998,100.00
DABUR INDIA LTD	79,726	544.40	43,402,834.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,239.55	78,582,511.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,375.05	307,573,725.10
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,601.15	96,125,946.30
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	868.30	104,361,845.30
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,033.75	36,610,256.25
CIPLA LTD	88,546	1,440.20	127,523,949.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,728.20	81,766,882.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	6,316.20	115,719,100.20
LUPIN LTD	26,552	1,620.65	43,031,498.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,510.45	219,250,880.20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	2,640.65	32,268,743.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	581.35	17,518,400.90
AXIS BANK LTD	359,795	1,069.25	384,710,803.75
BANDHAN BANK LTD	74,811	200.95	15,033,270.45
BANK OF BARODA	248,313	275.55	68,422,647.15
HDFC BANK LTD	461,405	1,419.90	655,148,959.50
ICICI BANK LTD	847,011	1,022.80	866,322,850.80
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	82.89	44,016,910.92
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,494.10	72,262,146.50
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,735.90	323,476,285.50
STATE BANK OF INDIA	268,868	754.75	202,928,123.00
YES BANK LTD	2,352,478	28.42	66,857,424.76
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	6,621.25	292,473,855.00
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,575.55	86,655,250.00

	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	8,859.25	26,533,453.75	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,143.70	96,068,512.60	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	3,875.30	54,924,626.90	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	271.95	128,137,944.90	
	MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,356.90	16,856,768.70	
	ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	37,520	341.50	12,813,080.00	
	POWER FINANCE CORPORATION	205,755	433.90	89,277,094.50	
	REC LTD	186,584	473.60	88,366,182.40	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	718.05	43,582,044.75	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	2,449.15	133,956,259.25	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	592.30	82,998,999.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,645.35	55,334,765.85	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	512.15	23,208,589.40	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,508.45	109,718,619.20	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,668.00	272,424,432.00	
	INFOSYS LTD	532,498	1,702.40	906,524,595.20	
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,582.15	87,634,172.85	
	MPHASIS LTD	19,317	2,798.40	54,056,692.80	
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	7,991	8,869.40	70,875,375.40	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	4,129.20	629,120,782.80	
	TATA ELXSI LTD	4,179	7,510.30	31,385,543.70	
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,303.25	123,544,190.25	
	WIPRO LTD	182,000	543.10	98,844,200.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	1,119.85	401,998,153.75	
	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,810.95	35,900,272.80	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,906.05	81,159,609.00	
	ADANI POWER LTD	167,705	563.60	94,518,538.00	
	GAIL INDIA LTD	504,548	182.45	92,054,782.60	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	439.65	11,749,206.60	
	NTPC LTD	664,141	337.65	224,247,208.65	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	274.85	220,149,353.00	
	TATA POWER CO LTD	199,512	376.15	75,046,438.80	
	DLF LTD	87,983	863.55	75,977,719.65	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,303.30	68,550,814.60	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,072.75	44,993,280.50	
	インドルピー 小計	22,070,264		16,676,742,459.38 (30,351,671,276)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.02	959,822.28	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.94	1,850,736.20	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.73	768,434.17	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	12.03	3,403,515.57	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.95	2,630,916.84	

	DUKHAN BANK	319,751	3.90	1,249,586.90
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.39	2,740,013.09
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.88	2,334,119.04
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	20.28	5,263,978.20
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	15.20	11,267,790.40
	OOREDOO QSC	72,800	10.90	793,520.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	16.87	1,628,157.44
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.98	620,187.61
	カタールリアル 小計	4,842,933		35,510,777.74 (1,463,754,258)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	182.99	6,261,368.83
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	727.76	7,271,050.16
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	325.44	21,948,649.92
	GOLD FIELDS LTD	144,200	254.53	36,703,226.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	107.03	10,688,122.83
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	68.07	10,268,155.29
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	557.85	9,862,230.15
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	111.46	5,357,770.74
	SASOL LTD	88,115	151.65	13,362,639.75
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	21.41	8,455,322.84
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	231.96	11,668,283.88
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,305.37	101,114,573.67
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	19.86	9,444,979.08
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	68.05	11,998,303.80
	BID CORP LTD	58,066	443.34	25,742,980.44
	CLICKS GROUP LTD	35,422	293.01	10,379,000.22
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	260.84	22,229,828.16
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	199.19	11,190,892.58
	ABSA GROUP LTD	140,135	166.25	23,297,443.75
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,025.46	29,571,716.00
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	228.00	14,389,308.00
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	208.01	42,354,788.19
	FIRSTRAND LTD	816,636	64.20	52,428,031.20
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	475.59	8,173,965.33
	REMGRO LTD	74,679	150.60	11,246,657.40
	DISCOVERY LIMITED	98,779	134.65	13,300,592.35
OLD MUTUAL LTD	974,656	11.84	11,539,927.04	
OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	40.35	9,597,812.40	
SANLAM LTD	307,490	72.52	22,299,174.80	
MTN GROUP LTD	255,377	91.00	23,239,307.00	
VODACOM GROUP	79,334	93.00	7,378,062.00	
NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	125.33	8,439,220.88	

	南アフリカランド 小計	5,373,831		611,203,384.68 (4,865,178,942)
アラブ首長国連邦 ディールハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.64	1,371,865.44
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.27	1,410,828.42
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.73	1,656,202.06
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.72	4,110,869.60
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	11.22	2,084,462.82
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	6.53	3,429,190.32
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	18.20	4,918,732.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	14.58	10,556,197.02
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	19.00	10,612,184.00
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.03	3,650,929.93
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	8.18	9,068,904.24
	アラブ首長国連邦ディールハム 小計	5,964,783		52,870,365.85 (2,162,926,666)
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.59	191,767.89
	BOUBYAN BANK K.S.C	162,047	0.61	99,982.99
	GULF BANK	155,178	0.28	44,380.90
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.78	1,012,404.12
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,204,993	0.97	1,173,663.18
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.51	151,680.13
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.83	118,140.22
	クウェートディナール 小計	3,577,240		2,792,019.43 (1,362,673,003)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.70	982,890.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	38.07	3,388,230.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	13.04	834,560.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	6.75	604,125.00
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	8.28	828,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	24.19	2,327,078.00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	9.91	2,356,518.72
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	10.93	870,028.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	23.61	233,739.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	22.84	709,182.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	28.35	793,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.70	936,510.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	24.23	713,331.20
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.31	2,331,545.00
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	21.11	441,832.30
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	20.22	416,532.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	9.74	898,028.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	18.70	388,960.00	

CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	46.14	475,242.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	34.87	390,544.00
GEM CO LTD-A	289,800	5.15	1,492,470.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	18.43	457,543.18
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	12.38	459,298.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.49	1,104,775.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.19	1,822,299.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	47.06	1,054,144.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.52	700,720.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.92	235,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	10.46	233,258.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	54.39	551,514.60
LB GROUP CO LTD-A	15,300	17.76	271,728.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	11.85	558,135.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	14.11	1,117,512.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.05	59,475.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	15.00	714,000.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	10.11	489,829.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	14.95	829,351.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	21.80	158,093.60
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	26.45	474,513.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	2.93	839,738.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	16.72	271,532.80
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	6.03	661,358.34
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.87	531,738.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	9.43	464,899.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	43.57	470,556.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	37.30	35,808.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	14.99	748,001.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	36.93	367,084.20
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	45.86	522,804.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	13.11	128,478.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.24	1,074,384.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	74.54	3,003,962.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.78	395,058.56
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	41.88	690,391.80
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	47.50	86,450.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	42.65	174,865.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	26.10	976,140.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	25.67	190,214.70
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	17.85	2,309,790.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	12.50	3,363,750.00

AEEC AVIATION POWER CO-A	11,400	33.18	378,252.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	35.85	555,675.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	28.89	242,676.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	12.02	769,280.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	31.40	1,733,751.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.15	1,296,665.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	6.40	1,472,640.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.12	2,879,488.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	162.84	6,477,775.20
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.89	1,094,362.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	14.67	633,744.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	35.20	1,389,449.60
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	4.95	112,860.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	60.11	144,264.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	7.34	147,614.74
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	111.50	420,355.00
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	18.62	107,996.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	26.08	686,425.60
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	54.50	624,352.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	12.04	494,844.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	13.86	666,666.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.21	1,062,189.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	9.07	328,334.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	22.47	1,887,030.60
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	73.67	437,599.80
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	39.88	499,855.92
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	31.71	370,214.25
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	12.40	500,960.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.96	809,472.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	82.00	225,664.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	14.17	593,723.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.04	1,966,268.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	62.05	1,761,785.65
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	7.95	199,227.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	85.53	855,300.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	13.56	551,892.00
TBEA CO LTD-A	29,274	14.63	428,278.62
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	15.72	679,104.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.08	1,212,352.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	19.57	618,412.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	59.24	489,322.40
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	23.40	170,820.00

ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	6.45	581,790.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.74	619,974.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	33.75	371,250.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.37	1,664,883.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.03	1,997,413.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.78	151,200.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.06	1,846,010.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.43	1,192,515.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	37.55	1,993,905.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	35.30	187,760.70
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.30	235,320.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	12.21	680,097.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	6.88	150,259.20
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	59.29	640,332.00
BYD CO LTD -A	17,000	181.17	3,079,890.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	137.94	1,241,460.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.58	588,720.16
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	41.17	761,645.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	16.76	574,868.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	90.64	761,376.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	15.85	464,405.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	52.31	36,617.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.58	621,108.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.34	837,680.36
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	33.00	92,400.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	36.14	1,572,090.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	23.29	646,530.40
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	37.81	299,908.92
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	65.24	502,348.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	23.95	2,421,345.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	58.32	466,560.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	26.28	688,536.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	10.30	344,844.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	17.70	433,650.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	7.60	407,360.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.01	837,794.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	195.14	565,906.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	23.52	383,376.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	10.53	240,084.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.29	263,835.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	84.45	1,749,804.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.83	754,715.00

DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	25.33	564,631.03
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	42.63	605,175.48
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	33.92	362,944.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	220.00	352,000.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	42.84	94,248.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	55.69	1,019,127.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	76.56	229,680.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	5.25	312,375.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	57.84	456,936.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	37.36	2,019,569.52
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	16.55	453,470.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	41.42	704,140.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	28.57	2,245,030.60
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	28.18	966,630.36
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	51.35	888,355.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	98.50	896,350.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	56.68	317,408.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	24.69	283,935.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	21.41	149,870.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,706.00	22,178,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	153.66	2,827,344.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	37.81	1,268,827.98
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	8.56	229,408.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	22.20	1,114,440.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	225.20	2,112,376.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	46.82	533,748.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	19.69	751,370.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	133.59	5,543,985.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	31.98	322,998.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	13.83	73,299.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	16.91	502,227.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	14.12	1,295,495.88
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.08	465,280.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	61.08	173,345.04
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	31.68	307,929.60
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,694	8.16	177,023.04
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	14.99	221,852.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	5.41	134,384.40
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	20.06	144,612.54
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	297.38	4,430,962.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	61.22	122,440.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	91.60	1,720,248.00

BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	83,180	29.50	2,453,810.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	43.77	1,243,068.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	62.76	658,164.12
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	42.62	686,182.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	44.98	247,390.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	62.18	563,786.06
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	120.13	264,286.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	56.11	572,322.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	51.40	763,290.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	57.80	1,282,755.40
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	42.80	342,400.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	18.98	357,773.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	318.35	662,168.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	41.87	1,637,200.74
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	13.91	385,056.62
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	32.69	623,659.82
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.89	441,649.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	23.59	256,659.20
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	30.94	216,580.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	20.75	195,880.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	26.17	293,941.44
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	17.61	299,370.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	53.12	874,567.68
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	49.42	491,234.80
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	3,900	215.98	842,322.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	13.45	121,319.00
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	20.07	1,334,655.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	16.90	588,931.20
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.96	4,087,116.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.99	289,420.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	12.35	1,943,890.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	6.01	3,076,519.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	10.70	1,205,890.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.28	1,672,507.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	8.17	1,205,075.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	20.79	1,212,057.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.33	288,015.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.80	849,320.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.15	2,631,195.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	31.40	5,840,400.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.95	1,080,720.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.69	1,079,174.20

HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.97	712,818.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	5.16	2,985,576.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	16.05	3,298,275.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	9.67	1,154,598.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.69	663,635.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	6.96	3,043,608.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.06	374,850.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.34	820,996.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.89	452,333.70
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.34	106,266.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	7.62	355,854.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.94	399,520.40
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	21.25	2,997,950.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	22.91	552,131.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	13.27	1,558,256.29
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.00	57,600.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.58	335,916.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.96	845,976.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.08	1,043,808.32
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.20	1,845,820.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.86	1,074,378.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.71	1,020,255.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	125.29	676,566.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	14.21	447,615.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.64	644,482.80
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.61	349,359.36
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.48	928,256.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	7.10	2,183,960.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.96	451,440.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.82	429,134.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.72	2,115,456.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	26.02	2,607,204.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	42.78	4,483,344.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.17	192,873.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	22.04	90,364.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	235.38	1,135,237.74
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	7.27	250,073.46
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	27.80	896,994.80
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	5.39	300,223.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	21.75	360,223.50
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	43.55	470,340.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	6.82	226,424.00

SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	58.23	174,690.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	42.62	406,211.22
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	52.79	290,345.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	11.39	150,006.30
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	19.05	721,995.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	3.88	2,384,648.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	18.73	376,473.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	24.22	678,160.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	9.18	319,464.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	47.10	428,610.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	15.70	2,592,070.00
GOERTEK INC -A	26,900	16.20	435,780.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.26	263,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	36.10	252,700.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	30.38	598,850.56
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.44	192,192.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	28.94	1,344,263.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	98.03	169,395.84
NINESTAR CORP-A	18,543	19.70	365,297.10
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	15.00	364,500.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	55.68	265,036.80
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	148.00	952,380.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	13.77	392,445.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.16	466,752.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.18	431,460.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	16.73	306,828.20
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	34.61	145,362.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	6.15	330,316.50
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	104.85	492,795.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	27.01	425,407.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.50	530,250.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	127.00	1,104,900.00
ZTE CORP-A	76,400	24.00	1,833,600.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.56	1,927,968.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	8.22	1,428,636.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.58	1,105,154.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	24.64	4,432,243.20
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	17.55	975,780.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.42	1,395,394.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	14.06	2,487,214.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	15.40	1,421,420.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	122.77	871,298.69

AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	53.32	540,558.16		
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	115.40	1,318,098.80		
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	40.78	857,684.96		
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	68.53	429,820.16		
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	23.60	499,564.80		
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	18.66	139,950.00		
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	26.50	197,001.00		
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	76.72	3,155,110.00		
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	50.00	375,000.00		
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	17.61	602,297.22		
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	23.98	714,604.00		
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	8.27	190,094.22		
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	20.21	2,027,871.40		
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	49.90	1,050,644.50		
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	250.30	775,930.00		
SG MICRO CORP-A	4,095	70.77	289,803.15		
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	61.50	485,850.00		
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	138.85	388,780.00		
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	116.17	475,832.32		
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	12.07	445,081.25		
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	7.79	255,122.50		
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	21.56	484,366.96		
TONGWEI CO LTD-A	66,600	25.98	1,730,268.00		
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	24.05	611,302.90		
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	54.99	377,176.41		
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	87.19	635,615.10		
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	39.46	560,332.00		
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	34.29	583,684.38		
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	9.12	498,864.00		
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	10.06	540,222.00		
GEMDALE CORP-A	45,500	4.04	183,820.00		
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.79	1,981,412.00		
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	9.97	815,546.00		
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	9.74	124,672.00		
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	3.04	241,072.00		
オフショア人民元 小計	26,437,269		333,429,568.19 (6,938,936,057)		
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	9.05	406,697.95	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	31.95	13,299,954.30	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	38.90	458,047.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	12.62	402,931.36	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	128.20	4,796,346.60	

SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	31.30	1,478,643.30	
SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	50.40	10,626,537.60	
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	159.80	1,493,970.20	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	79.00	11,370,786.00	
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	21.16	1,805,434.68	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	9.79	1,012,589.49	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	38.60	1,971,649.40	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	234.00	984,438.00	
JARIR MARKETING CO	125,000	15.38	1,922,500.00	
NAHDI MEDICAL CO	6,431	144.80	931,208.80	
ALMARAI CO	30,130	59.20	1,783,696.00	
SAVOLA	36,289	55.10	1,999,523.90	
DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	179.40	1,225,840.20	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	321.00	3,761,157.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	124.20	1,977,760.80	
AL RAJHI BANK	307,532	89.50	27,524,114.00	
ALINMA BANK	161,322	43.80	7,065,903.60	
ARAB NATIONAL BANK	86,031	25.95	2,232,504.45	
BANK AL-JAZIRA	97,894	19.70	1,928,511.80	
BANK ALBILAD	89,702	48.35	4,337,091.70	
BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	38.70	3,670,114.50	
RIYAD BANK	234,479	30.00	7,034,370.00	
SAUDI AWWAL BANK	147,895	37.95	5,612,615.25	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	16.88	1,192,403.20	
THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	41.45	20,342,582.30	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	228.20	2,500,387.40	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	230.00	3,271,290.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,260	145.20	908,952.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	372.80	1,646,657.60	
ELM CO	4,094	1,033.80	4,232,377.20	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	54.20	2,647,344.80	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.74	1,243,579.92	
SAUDI TELECOM CO	339,167	41.55	14,092,388.85	
ACWA POWER CO	16,922	251.20	4,250,806.40	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	72.00	1,157,832.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	20.04	3,248,664.36	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	13.00	1,312,883.00	
サウジアラビアリアル 小計	4,025,738		185,163,087.41 (7,419,484,912)	
合計	1,370,738,654		169,885,992,207 (169,885,992,207)	

(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	16,760,524.00		
	メキシコペソ 小計		97,360	16,760,524.00 (147,676,976)		
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		200,300	7,294,926.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		45,900	1,333,395.00	
		ENERGISA SA-UNITS		37,400	1,893,188.00	
		KLABIN SA-UNIT		100,000	2,165,000.00	
ブラジルリアル 小計		383,600	12,686,509.00 (383,085,631)			
投資信託受益証券合計			480,960	530,762,607 (530,762,607)		
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	11,829,340.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	125,911	9,100,847.08		
	メキシコペソ 小計		517,611	20,930,187.08 (184,415,878)		
投資証券合計			517,611	184,415,878 (184,415,878)		
合計				715,178,485 (715,178,485)		

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 31銘柄	100.0%			2.9%
メキシコペソ	株式 21銘柄	92.9%			2.5%
	投資信託受益証券 1銘柄		3.2%		0.1%
	投資証券 2銘柄			3.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 45銘柄	95.9%			5.3%
	投資信託受益証券 4銘柄		4.1%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
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 15銘柄	100.0%			1.0%

ロシアルーブル	株式	14銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	182銘柄	100.0%		18.8%
マレーシアリングギ ット	株式	31銘柄	100.0%		1.3%
タイバーツ	株式	38銘柄	100.0%		1.7%
フィリピンペソ	株式	14銘柄	100.0%		0.6%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%		2.0%
韓国ウォン	株式	101銘柄	100.0%		12.6%
新台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%		16.7%
インドルピー	株式	131銘柄	100.0%		17.8%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%		0.9%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%		2.9%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	11銘柄	100.0%		1.3%
クウェートディナ ール	株式	7銘柄	100.0%		0.8%
オフショア人民元	株式	347銘柄	100.0%		4.1%
サウジアラビアリア ール	株式	42銘柄	100.0%		4.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,238,382,027
投資証券	109,173,773,450
未収入金	97,887,304
未収配当金	1,005,508,250
前払金	217,534,440
差入委託証拠金	216,934,978
流動資産合計	113,950,020,449
資産合計	113,950,020,449
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	217,644,660
未払金	307,418,974
未払解約金	258,817,907
未払利息	694
流動負債合計	783,882,235
負債合計	783,882,235
純資産の部	
元本等	

2024年 2月19日現在	
項目	金額（円）
元本	56,969,505,835
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,196,632,379
元本等合計	113,166,138,214
純資産合計	113,166,138,214
負債純資産合計	113,950,020,449

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月19日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,969,505,835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 1.9864円 (1万口当たり純資産額) (19,864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 2月19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。 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。</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 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	62,078,472,542円
期中追加設定元本額	12,363,024,214円
期中一部解約元本額	17,471,990,921円
期末元本額	56,969,505,835円
期末元本額の内訳	
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	1,846,315,521円
SBI 資産設計オープン（分配型）	6,797,767円
SMT J-REITインデックス・オープン	17,027,045,420円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	27,795,142,024円
コア投資戦略ファンド（安定型）	994,368,691円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	1,879,598,173円
コア投資戦略ファンド（切替型）	737,523,051円
SMT インデックスバランス・オープン	22,019,122円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	211,531,584円
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	12,574,431円
グローバル経済コア	359,850,864円
SBI 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,108,666円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	526,962,705円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	133,905,607円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	792,910,359円
10 資産分散投資ファンド	23,441,503円
グローバル10 資産バランスファンド	24,398,137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）	343,864,018円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,730,244円
SMTAM9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	689,306,473円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,714,990円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	508,447,336円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	280,282,128円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	6,768,801,065	
合計	6,768,801,065	

(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 2月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	4,189,964,440	-	3,972,430,000	217,534,440
合計		4,189,964,440	-	3,972,430,000	217,534,440

(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	2,281	262,086,900	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,595	318,876,500	
	S O S i L A 物流リート投資法人	5,599	628,767,700	
	東海道リート投資法人	1,917	240,200,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,875	2,266,875,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,197	1,714,290,300	
	産業ファンド投資法人	17,123	2,148,936,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,011	3,363,860,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	5,887	2,272,382,000	
	G L P 投資法人	37,908	4,700,592,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,518	1,619,533,000	
	日本プロロジスリート投資法人	19,550	4,971,565,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,070	1,113,660,000	
	O n e リート投資法人	1,958	514,954,000	

イオンリート投資法人	13,766	1,812,982,200	
ヒューリックリート投資法人	10,500	1,570,800,000	
日本リート投資法人	3,645	1,173,690,000	
積水ハウス・リート投資法人	33,722	2,488,683,600	
トーセイ・リート投資法人	2,363	323,258,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,767	357,773,100	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,058	313,445,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	36,291	5,436,391,800	
いちごホテルリート投資法人	1,859	205,977,200	
ラサールロジポート投資法人	14,345	2,045,597,000	
スターアジア不動産投資法人	17,295	971,979,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,730	209,157,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,668	1,986,234,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,716	126,126,000	
投資法人みらい	15,401	676,873,950	
三菱地所物流リート投資法人	3,875	1,360,125,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,831	687,934,400	
ザイマックス・リート投資法人	1,820	211,484,000	
タカラレーベン不動産投資法人	5,321	530,503,700	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,917	598,890,600	
日本ビルファンド投資法人	13,092	7,580,268,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,528	6,155,952,000	
日本都市ファンド投資法人	53,792	4,975,760,000	
オリックス不動産投資法人	22,360	3,617,848,000	
日本プライムリアルティ投資法人	7,675	2,521,237,500	
N T T 都市開発リート投資法人	11,378	1,368,773,400	
東急リアル・エステート投資法人	7,524	1,214,373,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,287	872,621,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	25,104	3,512,049,600	
森トラストリート投資法人	21,631	1,524,985,500	
インヴィンシブル投資法人	54,336	3,352,531,200	
フロンティア不動産投資法人	4,164	1,740,552,000	
平和不動産リート投資法人	8,385	1,106,820,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,189	1,846,854,100	
福岡リート投資法人	5,804	966,366,000	
K D X 不動産投資法人	32,295	4,786,119,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,196	720,046,800	
大和証券オフィス投資法人	2,325	1,369,425,000	
阪急阪神リート投資法人	5,351	733,087,000	
スターツプロシード投資法人	1,945	375,385,000	
大和ハウスリート投資法人	16,916	4,039,540,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,567	2,749,904,400	

	大和証券リビング投資法人	16,526	1,675,736,400
	ジャパンエクセレント投資法人	9,753	1,143,051,600
	合計	709,502	109,173,773,450

(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 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	358,349,002
コール・ローン	94,265,344
投資証券	110,649,213,814
派生商品評価勘定	499,589
未収入金	317,114,727
未収配当金	184,791,747
流動資産合計	111,604,234,223
資産合計	111,604,234,223
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	145,861
未払解約金	400,844,568
未払利息	20
流動負債合計	400,990,449
負債合計	400,990,449
純資産の部	
元本等	
元本	39,464,790,965
剰余金	
剰余金又は欠損金()	71,738,452,809
元本等合計	111,203,243,774
純資産合計	111,203,243,774
負債純資産合計	111,604,234,223

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。

2024年 2月19日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,464,790,965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 2.8178円 (1万口当たり純資産額) (28,178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 2月19日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	35,000,748,719円
期中追加設定元本額	11,157,956,059円
期中一部解約元本額	6,693,913,813円
期末元本額	39,464,790,965円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	52,864,691円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	92,963,651円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,519,472,730円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,715,922円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,262,427,621円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,324,894,071円
コア投資戦略ファンド（安定型）	448,238,308円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,227,996,779円
分散投資コア戦略ファンドA	1,006,149,778円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	555,506,587円
SMT インデックスバランス・オープン	103,139,388円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,352,489円
グローバル経済コア	271,701,542円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,755,532円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	404,702,572円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	104,627,417円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	221,427,848円
10資産分散投資ファンド	12,954,787円
グローバル10資産バランスファンド	18,754,885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）	1,088,396,314円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	210,545,197円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	72,443,734円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	61,280,541円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	46,833,700円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	89,154,296円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,759,157円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,287,825円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	86,789,890円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	85,929,475円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	78,969,031円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	59,670,797円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	12,320,124,705
合計	12,320,124,705

(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 2月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	472,366,295	-	472,012,567	353,728
	アメリカドル	387,483,000	-	386,992,854	490,146
	カナダドル	17,768,640	-	17,819,856	51,216
	ユーロ	30,715,970	-	30,740,233	24,263
	オーストラリアドル	15,650,240	-	15,716,416	66,176
	香港ドル	1,788,855	-	1,783,516	5,339
	シンガポールドル	18,959,590	-	18,959,692	102
合計		472,366,295	-	472,012,567	353,728

（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	50,933	858,221.05	
		AGREE REALTY CORP	56,031	3,195,447.93	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	37,332	647,710.20	
		ALEXANDER'S INC	1,336	299,611.36	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	87,273	10,409,923.44	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	90,744.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	24,346	530,255.88	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	177,285	6,103,922.55	
		AMERICOLD REALTY TRUST	148,555	4,037,724.90	
		APARTMENT INCOME REIT CO	81,449	2,580,304.32	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	70,959	543,545.94	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	118,612	1,889,489.16	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	35,039	399,794.99	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	27,540.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	78,564	13,915,255.68	

BOSTON PROPERTIES	80,482	5,421,267.52	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	69,167.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	81,494	344,719.62	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	167,555	3,875,547.15	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	104,379	1,631,443.77	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	82,150.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	59,516	5,723,058.56	
CARETRUST REIT INC	67,667	1,534,010.89	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	14,237	332,718.69	
CENTERSPACE	8,999	504,663.92	
CHATHAM LODGING TRUST	25,562	268,401.00	
CITY OFFICE REIT INC	15,298	72,665.50	
CLIPPER REALTY INC	7,300	35,916.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	407,306.20	
COPT DEFENSE PROPERTIES	62,548	1,506,155.84	
COUSINS PROPERTIES INC	84,601	1,997,429.61	
CTO REALTY GROWTH INC	12,400	203,732.00	
CUBESMART	125,340	5,444,769.60	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	113,933	1,047,044.27	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	368,800	228,656.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	168,414	22,941,355.08	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	345,728.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,870	1,263,212.50	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	49,968	583,626.24	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	25,825	4,718,485.75	
ELME COMMUNITIES	50,407	711,242.77	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	75,879	764,101.53	
EPR PROPERTIES	41,990	1,771,138.20	
EQUINIX INC	52,113	44,620,713.99	
EQUITY COMMONWEALTH	59,311	1,100,812.16	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	103,898	6,875,969.64	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,924	11,461,167.72	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	86,970	2,147,289.30	
ESSEX PROPERTY TRUST	35,842	8,436,131.54	
EXTRA SPACE STORAGE INC	117,410	16,621,733.70	
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	322,840.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	40,948	4,111,998.16	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	73,732	4,036,089.68	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	49,703	1,170,505.65	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	108,496.28	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	148,838	6,725,989.22	

GETTY REALTY CORP	27,420	743,630.40
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	17,832	226,466.40
GLADSTONE LAND CORP	16,220	218,807.80
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	362,037.78
GLOBAL NET LEASE INC	105,265	848,435.90
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	212,303	3,048,671.08
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	304,944	5,232,839.04
HIGHWOODS PROPERTIES INC	58,249	1,377,588.85
HOST HOTELS AND RESORTS INC	393,217	7,754,239.24
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,572	482,647.00
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	125,256	1,948,983.36
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	134,985.62
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	15,563	1,431,796.00
INVENTRUST PROPERTIES CORP	36,169	927,373.16
INVITATION HOMES INC	317,636	10,386,697.20
IRON MOUNTAIN INC	161,311	10,965,921.78
JBG SMITH PROPERTIES	47,755	782,704.45
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	50,719.60
KILROY REALTY CORPORATION	59,470	2,156,382.20
KIMCO REALTY CORP	370,680	7,276,448.40
KITE REALTY GROUP TRUST	122,289	2,626,767.72
LTC PROPERTIES INC	22,450	707,399.50
LXP INDUSTRIAL TRUST	162,604	1,403,272.52
MACERICH CO/THE	120,093	2,068,001.46
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	47,604.34
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	333,202	1,186,199.12
MID-AMERICA APARTMENT COMM	65,043	8,401,604.31
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	41,567	1,525,924.57
NATL HEALTH INVESTORS INC	23,847	1,270,091.22
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	231,417.12
NETSTREIT CORP	34,578	599,236.74
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,875	107,632.50
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	430,644.48
NNN REIT INC	101,694	4,149,115.20
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	86,476.26
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	136,562	4,226,593.90
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	176,623.46
ORION OFFICE REIT INC	34,844	168,296.52
PARAMOUNT GROUP INC	100,128	486,622.08
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	114,531	1,724,836.86
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	278,540.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	65,387	1,051,422.96
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	66,351	2,292,427.05

PHYSICIANS REALTY TRUST	132,935	1,539,387.30	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	473,784.91	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	484,394.72	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	186,318.40	
PRIME US REIT	295,000	35,105.00	
PROLOGIS INC	513,201	68,455,881.39	
PUBLIC STORAGE	88,006	24,775,449.12	
REALTY INCOME CORP	462,463	24,200,688.79	
REGENCY CENTERS CORP	91,570	5,568,371.70	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	67,817	869,413.94	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	117,668	6,244,640.76	
RLJ LODGING TRUST	86,118	1,007,580.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	33,239	3,863,701.36	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	128,885	1,772,168.75	
SAFEHOLD INC	23,595	501,157.80	
SAUL CENTERS INC	6,846	254,945.04	
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	697,414.75	
SIMON PROPERTY GROUP	181,443	27,209,192.28	
SITE CENTERS CORP	99,154	1,406,003.72	
SL GREEN REALTY CORP	35,863	1,682,691.96	
STAG INDUSTRIAL INC	101,210	3,957,311.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,155	435,835.95	
SUN COMMUNITIES INC	69,483	9,032,790.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	114,627	1,250,580.57	
TANGER INC	58,543	1,676,671.52	
TERRENO REALTY CORP	46,773	2,932,667.10	
UDR INC	168,680	6,085,974.40	
UMH PROPERTIES INC	33,009	483,581.85	
UNITI GROUP INC	126,444	644,864.40	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	310,174.81	
URBAN EDGE PROPERTIES	64,372	1,114,923.04	
VENTAS INC	222,165	9,721,940.40	
VERIS RESIDENTIAL INC	41,292	647,045.64	
VICI PROPERTIES INC	574,933	16,977,771.49	
VORNADO REALTY TRUST	90,043	2,348,321.44	
WELLTOWER INC	307,828	28,668,021.64	
WHITESTONE REIT	25,954	323,386.84	
WP CAREY INC	121,890	6,996,486.00	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	56,605	748,884.15	
アメリカドル 小計	14,465,277	574,288,591.35 (86,160,517,360)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	672,570.15

	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	186,832.80	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,593	994,056.09	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	146,680.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	60,500.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,706	2,351,647.10	
	CHOICE PROPERTIES REIT	90,496	1,224,410.88	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	371,280.69	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	400,421.20	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	73,332	990,715.32	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,339	42,818.78	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,799	950,215.56	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,135	1,279,984.50	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	737,673.60	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	595,503.80	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	28,157	552,721.91	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	189,366.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	109,626.56	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	127,479.40	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	259,036.80	
	PRIMARIS REIT	30,375	422,820.00	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	87,840.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	80,439	1,490,534.67	
	SLATE GROCERY REIT	16,578	199,433.34	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	37,957	912,486.28	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,486	41,495.50	
	カナダドル 小計	882,834	15,398,150.93 (1,715,200,032)	
ユーロ	AEDIFICA	26,505	1,476,328.50	
	ALTAREA	1,959	150,647.10	
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	289,749.42	
	CARMILA	32,392	482,640.80	
	COFINIMMO	19,925	1,246,308.75	
	COVIVIO(FP)	27,273	1,133,465.88	
	CROMWELL REIT EUR	170,400	235,152.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	509,800.00	
	GECINA SA	28,616	2,668,442.00	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	237,170.00	
	ICADE	17,487	536,151.42	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	73,155.35	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,544	794,590.20
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,940	269,799.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	270,000	279,720.00
	KLEPIERRE	108,732	2,574,773.76
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,953	124,506.72
	MERCIALYS	47,914	487,764.52
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	190,427	1,745,263.45
	MONTEA NV	8,126	620,013.80
	NSI NV	7,359	144,530.76
	RETAIL ESTATES	6,645	396,706.50
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	741,663.92
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	55,951	3,917,689.02
	VASTNED RETAIL	10,650	223,117.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	96,620	2,488,931.20
	WERELDHAVE NV	24,249	327,846.48
	XIOR STUDENT HOUSING NV	14,983	391,805.45
	ユーロ 小計	1,489,812	24,567,733.50 (3,975,304,957)
イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	118,093.24
	AEW UK REIT PLC	68,000	61,880.00
	ASSURA PLC	1,624,807	683,393.82
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	297,044.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	111,609	1,194,216.30
	BRITISH LAND CO PLC	518,437	1,943,101.87
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	70,341.48
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	158,136.30
	DERWENT LONDON PLC	61,030	1,210,835.20
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	288,069.37
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	143,805	544,158.12
	HAMMERSON PLC	2,065,550	538,695.44
	HELICAL PLC	65,400	123,475.20
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	194,803.57
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	418,966	2,704,006.56
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	85,461.05
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	618,093	1,162,632.93
	LXI REIT PLC	952,623	965,959.72
	NEWRIVER REIT PL	196,000	148,176.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	220,980.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730,219	667,055.05
	PRS REIT PLC/THE	260,002	197,601.52

	REGIONAL REIT LTD	222,000	48,951.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,385	986,253.12
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	97,502.50
	SEGRO PLC	684,274	5,812,223.35
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,088,715	1,437,103.80
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	668,157	513,144.57
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347,000	269,272.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	111,807.30
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,069,790	1,687,058.83
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	453,930	306,402.75
	UNITE GROUP PLC	218,857	2,192,947.14
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	261,651	333,343.37
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	198,864.33
	WORKSPACE GROUP PLC	70,057	357,290.70
	イギリスポンド 小計	16,599,014	28,081,948.29 (5,317,316,908)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	224,474	242,431.92
	ABACUS STORAGE KING	347,779	429,507.06
	ARENA REIT	192,648	697,385.76
	BWP TRUST	291,007	1,024,344.64
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	892,898.32
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	1,077,191.40
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	254,911.25
	CHARTER HALL GROUP	263,653	3,274,570.26
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,694	1,435,204.14
	CHARTER HALL RETAIL REIT	270,438	1,033,073.16
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	577,868.50
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	267,776.00
	DEXUS	599,530	4,712,305.80
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	327,700.00
	GDI PROPERTY GROUP	315,597	203,560.06
	GOODMAN GROUP	959,513	27,451,666.93
	GPT GROUP	1,066,015	4,850,368.25
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	326,203.50
	HEALTHCO REIT	300,321	411,439.77
	HMC CAPITAL LTD	128,494	837,780.88
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	947,280	1,203,045.60
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	306,063.88
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	194,242	936,246.44
	MIRVAC GROUP	2,199,457	5,058,751.10
	NATIONAL STORAGE REIT	680,136	1,584,716.88
	REGION RE GROUP	618,902	1,411,096.56
	RURAL FUNDS GROUP	222,079	473,028.27

	SCENTRE GROUP	2,893,163	8,824,147.15
	STOCKLAND	1,330,631	6,240,659.39
	VICINITY CENTERS	2,179,714	4,468,413.70
	WAYPOINT REIT LTD	338,821	867,381.76
オーストラリアドル 小計		19,187,383	81,701,738.33 (8,026,378,773)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	507,278	578,296.92
	GOODMAN PROPERTY TRUST	585,524	1,258,876.60
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	923,753	780,571.28
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	693,097	845,578.34
ニュージーランドドル 小計		2,709,652	3,463,323.14 (318,972,061)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	2,053,920.00
	FORTUNE REIT	875,000	3,928,750.00
	LINK REIT	1,418,800	54,765,680.00
	PROSPERITY REIT	752,000	947,520.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,043,460.00
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,411,192.80
香港ドル 小計		6,080,460	64,150,522.80 (1,230,407,027)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	486,272.00
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,982,418	5,511,122.04
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,358,877	1,263,755.61
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	495,280.17
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,819,144	5,525,522.24
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	389,942.00
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60
	ESR-LOGOS REIT	3,205,364	1,025,716.48
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	351,000.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	583,862	1,302,012.26
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,611,896	1,805,323.52
	KEPPEL DC REIT	729,603	1,291,397.31
	KEPPEL REIT	1,231,400	1,102,103.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	809,950	485,970.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,153,263	2,756,298.57
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,855,485	2,876,001.75
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,283,473	1,809,696.93
	PARAGON REIT	761,500	639,660.00
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	233,000	864,430.00
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	295,800	199,665.00
STARHILL GLOBAL REIT	863,000	418,555.00	

	SUNTEC REIT	1,220,500	1,427,985.00
シンガポールドル 小計		24,139,556	32,074,413.48 (3,577,580,079)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	93,474,400.00
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	66,720	258,873,600.00
	JR REIT XXVII	95,683	388,472,980.00
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	123,350,050.00
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	227,949,600.00
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	49,854,915.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	46,380	303,325,200.00
	SK REITS CO LTD	75,914	290,371,050.00
韓国ウォン 小計		425,799	1,735,671,795.00 (195,783,778)
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	621,000.00
	REIT 1 LTD	103,500	1,635,300.00
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	914,250.00
イスラエルシェケル 小計		578,500	3,170,550.00 (131,752,839)
合計		86,558,287	110,649,213,814 (110,649,213,814)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 139銘柄	100.0%	77.9%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.6%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.6%
イギリスポンド	投資証券 38銘柄	100.0%	4.8%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.3%
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%	1.1%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.2%
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 2月19日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,388,761
コール・ローン	71,605,140
投資信託受益証券	28,123,525,977
流動資産合計	28,196,519,878
資産合計	
28,196,519,878	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	587,829,156
未払金	4,175,387
未払解約金	3,252,791
未払利息	15
流動負債合計	595,257,349
負債合計	
595,257,349	
純資産の部	
元本等	
元本	22,149,364,689
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,451,897,840
元本等合計	27,601,262,529
純資産合計	
27,601,262,529	
負債純資産合計	
28,196,519,878	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月19日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

2024年 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,149,364,689口

		2024年 2月19日現在
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)	1,2461円 (12,461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 2月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	25,393,569,450円
期中追加設定元本額	2,877,626,643円
期中一部解約元本額	6,121,831,404円
期末元本額	22,149,364,689円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,624,197,759円

区分	2024年 2月19日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,655,968,565円
分散投資コア戦略ファンドA	2,114,521,968円
分散投資コア戦略ファンドS	7,752,717,524円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,204,574,837円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	316,330,899円
グローバル経済コア	1,176,023,088円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,153,505,684円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	719,469,911円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	183,841,968円
グローバル10資産バランスファンド	40,695,873円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	612,686,931円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	521,612,735円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,216,947円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19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	1,122,872,590
合計	1,122,872,590

(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 2月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,777,377,299	-	28,365,206,455	587,829,156
	アメリカドル	27,777,377,299	-	28,365,206,455	587,829,156
合計		27,777,377,299	-	28,365,206,455	587,829,156

(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	4,923,895	187,452,682.65	
		アメリカドル 小計	4,923,895	187,452,682.65 (28,123,525,977)	

合計	4,923,895	28,123,525,977 (28,123,525,977)	
----	-----------	------------------------------------	--

(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。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	538,423,815
社債券	25,072,375,500
流動資産合計	25,610,799,315
資産合計	25,610,799,315
負債の部	
流動負債	
未払解約金	39,999
未払利息	115
流動負債合計	40,114
負債合計	40,114
純資産の部	
元本等	
元本	24,898,753,550
剰余金	
剰余金又は欠損金()	712,005,651
元本等合計	25,610,759,201
純資産合計	25,610,759,201
負債純資産合計	25,610,799,315

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月19日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

	2024年 2月19日現在
--	---------------

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,898,753,550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 1.0286円 (1万口当たり純資産額) (10,286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 2月19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、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

	2024年 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年 2月18日
期首元本額		40,079,354,802円
期中追加設定元本額		524,490,123円
期中一部解約元本額		15,705,091,375円
期末元本額		24,898,753,550円
期末元本額の内訳		
サテライト投資戦略ファンド（株式型）		230,727,977円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（SMA専用）		170,334,888円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）		13,162,795,195円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）		11,093,522,119円

区分	2024年 2月19日現在
F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	241,373,371円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		211,707,800
合計		211,707,800

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「ピクテ マルチストラテジー リンク 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
社債券	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	23,995,000,000	25,072,375,500	
合計		23,995,000,000	25,072,375,500	

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。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

項目	2024年 2月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	666,670,281
社債券	20,772,901,749
流動資産合計	21,439,572,030
資産合計	21,439,572,030
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	381,764,200
未払解約金	60,000
未払利息	143
流動負債合計	381,824,343
負債合計	381,824,343
純資産の部	
元本等	
元本	17,155,779,609
剰余金	

	2024年 2月19日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	3,901,968,078
元本等合計	21,057,747,687
純資産合計	21,057,747,687
負債純資産合計	21,439,572,030

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,155,779,609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 1.2274円 (1万口当たり純資産額) (12,274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 2月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	18,894,924,082円
期中追加設定元本額	2,500,809,882円
期中一部解約元本額	4,239,954,355円
期末元本額	17,155,779,609円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,038,198,934円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,422,379,083円
コア投資戦略ファンド(切替型)	663,730,659円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	12,977,419,098円
米国株式LSファンド(SMA専用)	138,189,650円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	251,470,560円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	62,565,558円
F O F s 用 米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	334,709,884円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券	3,149,594,643	
合計	3,149,594,643	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式LS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 2月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	20,099,544,000	-	20,481,308,200	381,764,200
	アメリカドル	20,099,544,000	-	20,481,308,200	381,764,200
	合計	20,099,544,000	-	20,481,308,200	381,764,200

(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
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/27	95,000,000.00	138,458,320.00	
		アメリカドル 小計	95,000,000.00	138,458,320.00 (20,772,901,749)	
合計				20,772,901,749 (20,772,901,749)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	社債券 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。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2024年 2月19日現在
項目	金額（円）
流動資産	
コール・ローン	137,661,397
社債券	16,644,694,000
流動資産合計	16,782,355,397
資産合計	16,782,355,397
負債の部	
流動負債	
未払解約金	210,130
未払利息	29
流動負債合計	210,159
負債合計	210,159
純資産の部	
元本等	
元本	13,526,605,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,255,539,623
元本等合計	16,782,145,238
純資産合計	16,782,145,238
負債純資産合計	16,782,355,397

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月19日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,526,605,615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 1.2407円 (1万口当たり純資産額) (12,407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 2月19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、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。
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 2月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	2024年 2月19日現在
	「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。 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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	19,485,803,008円
期中追加設定元本額	1,213,559,809円
期中一部解約元本額	7,172,757,202円
期末元本額	13,526,605,615円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	882,072,289円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,214,581,639円
コア投資戦略ファンド(切替型)	552,179,939円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	230,431,272円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	9,896,504,606円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	215,030,778円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	54,352,537円
コモディティLSアルファ・ファンド(SMA専用)	131,711,405円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	349,741,150円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券		242,160,000
合計		242,160,000

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「コモディティLSアルファ・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
社債券	ソシエテ・ジェネラル 0% 2024/05/31	1,600,000,000	1,609,600,000	

STAR HELIOS 0% 07/16/ 24	12,030,000,000	15,035,094,000	
合計	13,630,000,000	16,644,694,000	

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。

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2024年 2月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,701,116,818
国債証券	11,702,739,700
派生商品評価勘定	285,662,573
未収入金	4,052,370
差入委託証拠金	2,826,347,072
流動資産合計	20,519,918,533
資産合計	20,519,918,533
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,555,493
前受金	223,767,466
未払金	734,614
未払解約金	600,450
未払利息	1,223
流動負債合計	269,659,246
負債合計	269,659,246
純資産の部	
元本等	
元本	18,005,041,829
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,245,217,458
元本等合計	20,250,259,287
純資産合計	20,250,259,287
負債純資産合計	20,519,918,533

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段（外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場）によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

2024年 2月19日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)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 2月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,005,041,829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 1.1247円 (1万口当たり純資産額) (11,247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 2月19日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2024年 2月19日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	5,483,012,464円
期中追加設定元本額	14,415,686,407円
期中一部解約元本額	1,893,657,042円
期末元本額	18,005,041,829円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	344,838,529円
コア投資戦略ファンド（成長型）	470,003,414円
分散投資コア戦略ファンドA	3,027,614,598円
分散投資コア戦略ファンドS	6,382,953,534円
コア投資戦略ファンド（切替型）	226,527,080円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	142,281,202円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,822,564,896円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	82,859,039円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,385,380円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標コース）（適格機関投資家専用）	201,058,139円
FOFs用GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	283,956,018円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	11,539,000	
合計	11,539,000	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

(2024年 2月19日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	11,457,949,697	-	11,430,994,322	26,955,375
	売建	19,295,247,692	-	19,044,524,851	250,722,841
合計		30,753,197,389	-	30,475,519,173	223,767,466

(注)1.時価の算定方法

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

- 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。
- 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 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 2月19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	6,669,819,815	-	6,702,885,191	33,065,376
	アメリカドル	2,582,824,783	-	2,595,988,188	13,163,405
	カナダドル	230,224,246	-	231,088,467	864,221
	ユーロ	1,021,893,768	-	1,026,847,627	4,953,859
	スウェーデンクローナ	788,071,574	-	789,983,353	1,911,779
	ノルウェークローネ	1,013,690,342	-	1,018,020,634	4,330,292
	ニュージーランドドル	1,033,115,102	-	1,040,956,922	7,841,820
	売建	8,143,510,893	-	8,159,212,235	15,701,342
	イギリスポンド	1,467,411,438	-	1,474,380,243	6,968,805
	スイスフラン	5,967,360,865	-	5,970,238,973	2,878,108
	オーストラリアドル	708,738,590	-	714,593,019	5,854,429
	合計		14,813,330,708	-	14,862,097,426

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第1145回国庫短期証券	1,700,000,000	1,700,222,700	
	第1152回国庫短期証券	7,000,000,000	7,001,365,000	
	第1183回国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,350,000	
	第1189回国庫短期証券	2,000,000,000	2,000,802,000	
合計		11,700,000,000	11,702,739,700	

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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

項目	2024年 2月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	58,819,383
社債券	7,476,310,100
流動資産合計	7,535,129,483
資産合計	7,535,129,483
負債の部	
流動負債	
未払金	39,762,800
未払解約金	59,988
未払利息	12
流動負債合計	39,822,800
負債合計	39,822,800
純資産の部	
元本等	
元本	8,288,047,447
剰余金	
剰余金又は欠損金()	792,740,764
元本等合計	7,495,306,683
純資産合計	7,495,306,683
負債純資産合計	7,535,129,483

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月19日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)に基づき、時価で評価しております。 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。

(貸借対照表に関する注記)

	2024年 2月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,288,047,447口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 792,740,764円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.9044円 (9,044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 2月19日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2024年 2月19日現在	
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。
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 2月19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 2月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	9,300,432,418円
期中追加設定元本額	2,092,333,876円
期中一部解約元本額	3,104,718,847円
期末元本額	8,288,047,447円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	445,375,786円
コア投資戦略ファンド(成長型)	607,209,558円
コア投資戦略ファンド(切替型)	274,686,394円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	174,857,855円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	5,180,706,394円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	106,915,299円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	26,303,695円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	125,585,084円
F O F s 用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS (適格機関投資家専用)	131,649,390円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1,214,757,992円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年 2月19日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
社債券	40,610,000	

合計	40,610,000
----	------------

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド」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
社債券	STAR HELIOS 0% 10/18/ 24	8,273,000,000	7,476,310,100	
合計		8,273,000,000	7,476,310,100	

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。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2024年2月20日から2024年8月19日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2024年 2月19日現在）	第10期中間計算期間 （2024年 8月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	169,614,748	251,535,958
投資信託受益証券	4,221,579,198	4,018,589,423
投資証券	870,166,375	978,521,035
親投資信託受益証券	4,176,150,909	4,156,658,392
未収入金	45,713,067	-
未収利息	-	1,502
流動資産合計	9,483,224,297	9,405,306,310
資産合計	9,483,224,297	9,405,306,310
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,299,726	11,326,134
未払受託者報酬	2,532,313	2,606,730
未払委託者報酬	72,424,076	74,552,483
未払利息	36	-
その他未払費用	253,167	260,613
流動負債合計	81,509,318	88,745,960
負債合計	81,509,318	88,745,960
純資産の部		
元本等		
元本	6,257,846,873	5,937,362,958
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,143,868,106	3,379,197,392
（分配準備積立金）	3,171,581,610	2,995,269,756
元本等合計	9,401,714,979	9,316,560,350
純資産合計	9,401,714,979	9,316,560,350
負債純資産合計	9,483,224,297	9,405,306,310

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 2023年 2月18日 至 2023年 8月17日	第10期中間計算期間 自 2024年 2月20日 至 2024年 8月19日
営業収益		
受取配当金	2,256,859	2,829,332
受取利息	167	68,892
有価証券売買等損益	736,317,556	489,305,328
その他収益	503,685	-
営業収益合計	739,078,267	492,203,552
営業費用		
支払利息	69,614	833
受託者報酬	2,447,731	2,606,730
委託者報酬	70,005,056	74,552,483
その他費用	244,717	260,613
営業費用合計	72,767,118	77,420,659
営業利益又は営業損失（ ）	666,311,149	414,782,893
経常利益又は経常損失（ ）	666,311,149	414,782,893
中間純利益又は中間純損失（ ）	666,311,149	414,782,893
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	24,237,401	20,779,132
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,945,736,211	3,143,868,106
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,668,039	16,412,246
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,668,039	16,412,246
剰余金減少額又は欠損金増加額	123,713,866	175,086,721
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	123,713,866	175,086,721
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,476,764,132	3,379,197,392

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
	(2)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。
	(3)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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
3. 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2月18日から翌年2月17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10期中間計算期間は2024年 2月20日から2024年 8月19日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第9期 (2024年 2月19日現在)	第10期中間計算期間 (2024年 8月19日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,257,846,873口	5,937,362,958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) 1.5024円 (15,024円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5691円 (15,691円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第10期中間計算期間 (2024年 8月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第9期 自 2023年 2月18日 至 2024年 2月19日	第10期中間計算期間 自 2024年 2月20日 至 2024年 8月19日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	6,970,541,061円	6,257,846,873円
期中追加設定元本額	62,444,897円	27,952,723円

区分	第9期	第10期中間計算期間
	自 2023年 2月18日 至 2024年 2月19日	自 2024年 2月20日 至 2024年 8月19日
期中一部解約元本額	775,139,085円	348,436,638円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,275,053,792
株式	659,888,874,850
派生商品評価勘定	83,965,800
未収配当金	802,434,723
未収利息	25,537
前払金	113,675,000
差入委託証拠金	474,583,547
流動資産合計	665,638,613,249
資産合計	665,638,613,249
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	197,743,650
未払金	3,622,200
未払解約金	377,507,508
流動負債合計	578,873,358
負債合計	578,873,358
純資産の部	
元本等	
元本	242,272,516,397
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	422,787,223,494
元本等合計	665,059,739,891
純資産合計	665,059,739,891
負債純資産合計	665,638,613,249

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2024年 8月19日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,272,516,397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) 2.7451円 (27,451円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月19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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	243,047,559,097円
期中追加設定元本額	23,178,050,762円
期中一部解約元本額	23,953,093,462円
期末元本額	242,272,516,397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)	271,129,612円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,245,390,485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	10,468,290,503円
世界経済インデックスファンド	6,509,777,942円
日本株式インデックス・オープン	2,771,497,937円

区分	2024年 8月19日現在
DCマイセレクション25	4,874,134,812円
DCマイセレクション50	16,642,821,858円
DCマイセレクション75	18,570,217,203円
DC日本株式インデックス・オープン	6,028,001,802円
DCマイセレクションS25	3,056,178,379円
DCマイセレクションS50	9,805,532,195円
DCマイセレクションS75	9,060,008,173円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,645,810,471円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,552,199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	456,865,744円
DC世界経済インデックスファンド	3,604,176,417円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	385,142,404円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,324,370円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,080,617円
マイセレクション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）	94,833,600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）	13,847,950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）	40,653,860円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	384,040,994円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	282,502,868円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,941,347,721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）	163,518,990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）	361,173,654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	1,861,513,601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）	681,274,621円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	418,920,281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）	188,284,894円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,666,708円
SMT インデックスバランス・オープン	46,607,531円
国内株式SMTBセレクション（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
SMT 世界経済インデックス・オープン	55,159,509円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	258,212,810円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	41,782,262円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,537,242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）	34,594,697円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,962,014,714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）	372,043,887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	66,331,460円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	69,883,293円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	30,807,037円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	39,020,679円
10資産分散投資ファンド	112,487,071円
グローバル10資産バランスファンド	45,940,970円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,010,043円

区分	2024年 8月19日現在
DCターゲット・イヤーフンド（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）	44,050,864,651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）	235,012,844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）	50,613,872,369円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,914,471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）	227,016,443円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,028,035,000	-	4,914,360,000	113,675,000
合計		5,028,035,000	-	4,914,360,000	113,675,000

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	100,294,829
株式	15,050,366,000
投資証券	75,400,500
派生商品評価勘定	11,839,202
未収配当金	16,074,750
未収利息	599
差入委託証拠金	11,294,345
流動資産合計	15,265,270,225
資産合計	15,265,270,225
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	150,954
前受金	11,693,000
未払解約金	8,272
流動負債合計	11,852,226
負債合計	11,852,226
純資産の部	

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	10,086,361,273
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,167,056,726
元本等合計	15,253,417,999
純資産合計	15,253,417,999
負債純資産合計	15,265,270,225

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、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。</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19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,086,361,273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 1.5123円 (1万口当たり純資産額) (15,123円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19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>

2024年 8月19日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	9,556,826,518円
期中追加設定元本額	1,680,808,076円
期中一部解約元本額	1,151,273,321円
期末元本額	10,086,361,273円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	170,318,012円
コア投資戦略ファンド（成長型）	402,453,080円
コア投資戦略ファンド（切替型）	130,833,051円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,686,023,037円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	84,681,133円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	111,664,227円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	38,162,596円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	1,342,849,354円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	51,163,545円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	68,213,238円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月19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	130,219,000	-	141,912,000	11,693,000
合計		130,219,000	-	141,912,000	11,693,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド

貸借対照表

2024年 8月19日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	604,856,627

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
株式	44,132,725,250
未収配当金	10,316,600
未収利息	3,613
流動資産合計	44,747,902,090
資産合計	44,747,902,090
負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,835,135
流動負債合計	20,835,135
負債合計	20,835,135
純資産の部	
元本等	
元本	7,560,434,276
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,166,632,679
元本等合計	44,727,066,955
純資産合計	44,727,066,955
負債純資産合計	44,747,902,090

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19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. 収益及び費用の計上基準	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,560,434,276口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 5.9159円 (1万口当たり純資産額) (59,159円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	5,378,689,568円
期中追加設定元本額	2,536,705,096円
期中一部解約元本額	354,960,388円
期末元本額	7,560,434,276円
期末元本額の内訳	
DC日本株式エクセレント・フォーカス	5,245,973,739円
コア投資戦略ファンド（安定型）	39,419,591円
コア投資戦略ファンド（成長型）	96,061,665円
コア投資戦略ファンド（切替型）	34,006,568円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,918,619,120円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	21,267,790円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	29,030,367円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	9,524,459円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	150,817,252円
FOFs用 日本株式エクセレント・フォーカスS（適格機関投資家専用）	15,509,129円
日本株式エクセレント・フォーカスVA（適格機関投資家専用）	204,596円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	17,804,050,006
コール・ローン	1,416,666,612
株式	715,128,827,123
投資信託受益証券	123,155,374
投資証券	13,888,962,739
派生商品評価勘定	492,572,823
未収入金	253,532
未収配当金	743,529,450
未収利息	8,462
差入委託証拠金	7,167,265,205
流動資産合計	756,765,291,326
資産合計	756,765,291,326
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	79,369,677
前受金	417,529,173
未払解約金	743,021,873
流動負債合計	1,239,920,723
負債合計	1,239,920,723
純資産の部	
元本等	
元本	115,798,488,175
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	639,726,882,428
元本等合計	755,525,370,603
純資産合計	755,525,370,603

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	756,765,291,326

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		115,798,488,175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)	6.5245円 (65,245円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		2024年 8月19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ぬ。	
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つた場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	115,185,099,865円
期中追加設定元本額	6,867,263,480円
期中一部解約元本額	6,253,875,170円
期末元本額	115,798,488,175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）	1,400,934,903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	34,600,574,264円
世界経済インデックスファンド	14,704,997,435円
外国株式インデックス・オープン	874,395,015円
D C マイセレクション 2 5	516,505,353円
D C マイセレクション 5 0	2,988,839,435円
D C マイセレクション 7 5	3,934,896,146円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,285,796,753円
D C マイセレクション S 2 5	323,844,569円
D C マイセレクション S 5 0	1,778,811,783円
D C マイセレクション S 7 5	1,916,230,278円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	12,801,707円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	125,584,978円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	103,304,257円
D C 世界経済インデックスファンド	8,445,940,151円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	848,819,318円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,832,407円
マイセレクション 7 5 V A 1（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 V A 1（適格機関投資家専用）	12,074,409円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,298,276円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	22,984,679円

区分	2024年 8月19日現在
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）	17,444,435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）	104,400,078円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	822,866,265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）	28,387,461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）	682,105,655円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,145,877,420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）	1,541,465,786円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	970,385,220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）	424,801,646円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,386,799円
SMT インデックスバランス・オープン	103,007,818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	266,810,726円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,247,578,567円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	201,983,404円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,526,722円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,744,928,319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）	14,817,269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）	77,253,196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	167,653,716円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	187,070,044円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	83,423,572円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	104,899,902円
10資産分散投資ファンド	59,825,165円
グローバル10資産バランスファンド	18,502,990円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,364,070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
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）	43,650,994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）	343,608,475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）	675,481,034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）	73,537,028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）	81,837,561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

区分	2024年 8月19日現在
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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	25,931,661,523	-	26,349,190,696	417,529,173
合計		25,931,661,523	-	26,349,190,696	417,529,173

（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19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	792,643,200	-	788,317,173	4,326,027
	アメリカドル	792,643,200	-	788,317,173	4,326,027
合計		792,643,200	-	788,317,173	4,326,027

（注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	516,154,737
コール・ローン	13,597,863
株式	15,395,526,076
投資信託受益証券	4,165,400
投資証券	303,864,272
派生商品評価勘定	26,730,953
未収入金	10,617

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
未収配当金	14,766,996
未収利息	81
差入委託証拠金	221,507,325
流動資産合計	16,496,324,320
資産合計	16,496,324,320
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,659,974
前受金	25,149,544
未払解約金	1,647,069
流動負債合計	28,456,587
負債合計	28,456,587
純資産の部	
元本等	
元本	9,562,719,297
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,905,148,436
元本等合計	16,467,867,733
純資産合計	16,467,867,733
負債純資産合計	16,496,324,320

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2024年 8月19日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,562,719,297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 1.7221円 (1万口当たり純資産額) (17,221円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	9,921,890,927円
期中追加設定元本額	987,155,245円
期中一部解約元本額	1,346,326,875円
期末元本額	9,562,719,297円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	140,997,633円

区分	2024年 8月19日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	345,177,988円
コア投資戦略ファンド（切替型）	106,492,082円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	84,973,097円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	6,061,565,880円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	97,597,489円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	36,726,438円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,633,320,650円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	55,868,040円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月19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	744,365,058	-	769,514,602	25,149,544
合計		744,365,058	-	769,514,602	25,149,544

(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19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	46,417,500	-	46,338,935	78,565
	アメリカドル	37,790,600	-	37,712,495	78,105
	スウェーデンク ローナ	4,253,700	-	4,253,220	480
	デンマーククロー ネ	4,373,200	-	4,373,220	20
合計		46,417,500	-	46,338,935	78,565

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,612,093,355
コール・ローン	693,733,390
株式	194,446,884,044
投資信託受益証券	435,853,203
投資証券	188,141,498
派生商品評価勘定	224,155,889
未収入金	21,947,020
未収配当金	624,441,086
未収利息	4,144
差入委託証拠金	1,987,072,897
流動資産合計	210,234,326,526
資産合計	210,234,326,526
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,475,165
前受金	195,250,588
未払金	4,892,447
未払解約金	483,636,314
流動負債合計	714,254,514
負債合計	714,254,514
純資産の部	
元本等	
元本	46,598,665,971
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	162,921,406,041
元本等合計	209,520,072,012
純資産合計	209,520,072,012
負債純資産合計	210,234,326,526

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

2024年 8月19日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,598,665,971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 4.4963円 (1万口当たり純資産額) (44,963円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	43,538,931,402円

区分	2024年 8月19日現在
期中追加設定元本額	4,556,369,892円
期中一部解約元本額	1,496,635,323円
期末元本額	46,598,665,971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	7,165,196,144円
世界経済インデックスファンド	13,028,588,130円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,317,568,022円
DC世界経済インデックスファンド	7,684,124,589円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	79,202,420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）	1,357,906,873円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	809,338,575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）	368,367,063円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,565,720円
SMT インデックスバランス・オープン	88,227,071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	294,532,678円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,376,667,644円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	222,922,575円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,563,213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）	522,535,718円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	37,412,206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	121,342,120円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	128,078,965円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	57,161,634円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	72,087,417円
10資産分散投資ファンド	17,829,869円
グローバル10資産バランスファンド	26,510,212円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,169,981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）	80,208,379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）	12,981,876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）	21,149,043円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 8月19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	14,300,804,345	-	14,496,054,933	195,250,588
合計		14,300,804,345	-	14,496,054,933	195,250,588

（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19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	291,457,200	-	289,887,336	1,569,864
	アメリカドル	291,457,200	-	289,887,336	1,569,864
合計		291,457,200	-	289,887,336	1,569,864

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2024年 8月19日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,377,626,371
投資証券	125,218,621,500
派生商品評価勘定	120,336,740
未収入金	21,656,124
未収配当金	1,024,362,210
未収利息	26,150
差入委託証拠金	373,064,738
流動資産合計	131,135,693,833
資産合計	131,135,693,833
負債の部	
流動負債	
前受金	121,039,640
未払解約金	218,444,085
流動負債合計	339,483,725
負債合計	339,483,725
純資産の部	
元本等	
元本	62,971,630,654
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,824,579,454
元本等合計	130,796,210,108
純資産合計	130,796,210,108
負債純資産合計	131,135,693,833

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19日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2024年 8月19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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引 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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 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19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	62,971,630,654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) 2.0771円 (20,771円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月19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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	56,969,505,835円
期中追加設定元本額	9,094,080,928円
期中一部解約元本額	3,091,956,109円
期末元本額	62,971,630,654円
期末元本額の内訳	

区分	2024年 8月19日現在
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,836,155,106円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,991,491円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,361,978,049円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	33,798,386,510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
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	22,041,951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	15,748,085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）	19,257,736円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	501,503,763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）	1,159,068,357円
10資産分散投資ファンド	32,910,504円
グローバル10資産バランスファンド	53,659,576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）	347,951,453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）	86,110,756円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	497,005,972円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	273,993,475円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 8月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引				
	買建	5,431,870,360	-	5,552,910,000	121,039,640
合計		5,431,870,360	-	5,552,910,000	121,039,640

（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。

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19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	487,621,382
コール・ローン	126,662,271
投資証券	122,309,151,463
派生商品評価勘定	304,156
未収入金	11,182,250
未収配当金	209,545,318

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
未収利息	756
流動資産合計	123,144,467,596
資産合計	123,144,467,596
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,752
未払金	287,633,483
未払解約金	183,635,489
流動負債合計	471,284,724
負債合計	471,284,724
純資産の部	
元本等	
元本	39,986,696,793
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	82,686,486,079
元本等合計	122,673,182,872
純資産合計	122,673,182,872
負債純資産合計	123,144,467,596

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,986,696,793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 3.0678円 (1万口当たり純資産額) (30,678円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	39,464,790,965円
期中追加設定元本額	3,494,685,724円
期中一部解約元本額	2,972,779,896円
期末元本額	39,986,696,793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)	1,512,071,341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	10,942,389,004円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	19,668,007,619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	103,761,801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	11,278,924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)	16,150,139円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	248,706,308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)	319,300,971円
10資産分散投資ファンド	17,488,240円
グローバル10資産バランスファンド	39,282,699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)	1,202,758,273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)	189,825,793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)	49,048,617円
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

区分	2024年 8月19日現在
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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 8月19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	190,388,540	-	190,397,192	8,652
	アメリカドル	143,443,600	-	143,449,517	5,917
	ユーロ	16,312,600	-	16,311,770	830
	オーストラリアドル	30,632,340	-	30,635,905	3,565
	売建	59,182,530	-	58,902,778	279,752
	ユーロ	7,360,740	-	7,341,025	19,715
	イギリスポンド	9,777,210	-	9,763,638	13,572
	オーストラリアドル	5,915,340	-	5,930,262	14,922
	香港ドル	36,129,240	-	35,867,853	261,387
合計		249,571,070	-	249,299,970	288,404

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,344,233
コール・ローン	63,971,129
投資信託受益証券	31,177,947,659
派生商品評価勘定	1,131,528,964
未収利息	382
流動資産合計	32,380,792,367
資産合計	32,380,792,367
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,412,645
流動負債合計	2,412,645
負債合計	2,412,645

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	21,501,925,337
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,876,454,385
元本等合計	32,378,379,722
純資産合計	32,378,379,722
負債純資産合計	32,380,792,367

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,501,925,337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 1.5058円 (1万口当たり純資産額) (15,058円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2024年 8月19日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	22,149,364,689円
期中追加設定元本額	1,320,206,992円
期中一部解約元本額	1,967,646,344円
期末元本額	21,501,925,337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	1,644,391,644円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	2,979,728,528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	84,183,817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）	71,781,919円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 8月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	売建	31,012,940,568	-	29,881,411,604
	アメリカドル	31,012,940,568	-	29,881,411,604
合計		31,012,940,568	-	29,881,411,604

(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。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	607,606,548
社債券	26,294,830,220
未収利息	3,629
流動資産合計	26,902,440,397
資産合計	26,902,440,397
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,300,016
流動負債合計	1,300,016
負債合計	1,300,016
純資産の部	
元本等	
元本	25,926,278,849
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	974,861,532
元本等合計	26,901,140,381
純資産合計	26,901,140,381
負債純資産合計	26,902,440,397

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19日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,926,278,849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 1.0376円 (1万口当たり純資産額) (10,376円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	24,898,753,550円
期中追加設定元本額	1,538,748,258円
期中一部解約元本額	511,222,959円
期末元本額	25,926,278,849円
期末元本額の内訳	
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	230,727,977円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（SMA専用）	100,844,761円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	14,482,928,781円
F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	10,827,893,045円
F O F s用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	283,884,285円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

米国株式LSマザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	550
コール・ローン	1,349,410,913
社債券	18,220,668,278
派生商品評価勘定	527,281,700
未収利息	8,060
流動資産合計	20,097,369,501
資産合計	20,097,369,501
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,377,510
流動負債合計	11,377,510
負債合計	11,377,510
純資産の部	
元本等	
元本	15,927,786,120
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,158,205,871
元本等合計	20,085,991,991
純資産合計	20,085,991,991
負債純資産合計	20,097,369,501

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>為替予約取引</p>

2024年 8月19日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	15,927,786,120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 1.2611円 (1万口当たり純資産額) (12,611円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年 8月19日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	17,155,779,609円
期中追加設定元本額	1,191,241,906円
期中一部解約元本額	2,419,235,395円
期末元本額	15,927,786,120円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	958,616,493円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,358,649,623円
コア投資戦略ファンド(切替型)	690,831,497円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円

区分	2024年 8月19日現在
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	11,867,571,832円
米国株式LSファンド（SMA専用）	84,618,097円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	330,202,295円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	66,793,057円
FOFs用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	303,387,043円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 8月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	18,360,455,300	-	17,833,173,600	527,281,700
	アメリカドル	18,360,455,300	-	17,833,173,600	527,281,700
合計		18,360,455,300	-	17,833,173,600	527,281,700

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	80,397,650
社債券	18,551,375,000
未収入金	128,550,000
未収利息	480
流動資産合計	18,760,323,130
資産合計	18,760,323,130
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,383,386
流動負債合計	11,383,386
負債合計	11,383,386
純資産の部	
元本等	
元本	14,698,600,405
剰余金	
剰余金又は欠損金()	4,050,339,339
元本等合計	18,748,939,744
純資産合計	18,748,939,744
負債純資産合計	18,760,323,130

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19日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,698,600,405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 1.2756円 (1万口当たり純資産額) (12,756円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	13,526,605,615円
期中追加設定元本額	1,306,097,379円
期中一部解約元本額	134,102,589円
期末元本額	14,698,600,405円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	882,072,289円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,246,194,696円
コア投資戦略ファンド（切替型）	630,331,255円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	224,010,293円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	10,942,658,304円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	298,118,206円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,352,537円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	82,976,607円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	337,886,218円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,208,752,528
国債証券	14,684,588,600
派生商品評価勘定	273,913,617
未収入金	78,677,048
未収利息	60,984
前払金	103,860,953
差入委託証拠金	2,683,185,616
流動資産合計	28,033,039,346
資産合計	28,033,039,346
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	335,401,518
未払金	19,720,087
未払解約金	800,000
流動負債合計	355,921,605
負債合計	355,921,605
純資産の部	
元本等	
元本	24,777,086,720
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,900,031,021
元本等合計	27,677,117,741
純資産合計	27,677,117,741
負債純資産合計	28,033,039,346

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19日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段（外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場）によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

	2024年 8月19日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	24,777,086,720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 1.1170円 (1万口当たり純資産額) (11,170円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引 のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	18,005,041,829円
期中追加設定元本額	7,487,337,528円
期中一部解約元本額	715,292,637円
期末元本額	24,777,086,720円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	703,909,048円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,020,054,992円
分散投資コア戦略ファンドA	2,532,180,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,197,597,298円
コア投資戦略ファンド（切替型）	514,526,859円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	249,943,144円
ヘッジファンドSMTBセクション（SMA専用）	12,747,842,941円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	247,276,768円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	49,812,978円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標 コース）（適格機関投資家専用）	185,361,470円
FOFs用GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	328,580,855円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 8月19日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	15,264,114,770	-	15,332,860,159	68,745,389
	売建	24,411,082,056	-	24,583,688,398	172,606,342
合計		39,675,196,826	-	39,916,548,557	103,860,953

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年 8月19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	15,293,849,265	-	15,442,155,734	148,306,469	
	アメリカドル	5,367,153,989	-	5,388,305,448	21,151,459	
	イギリスポンド	2,048,328,430	-	2,085,248,286	36,919,856	
	ノルウェークロネ	2,942,644,079	-	2,989,272,849	46,628,770	
	オーストラリアドル	1,001,463,144	-	1,020,304,525	18,841,381	
	ニュージーランドドル	3,934,259,623	-	3,959,024,626	24,765,003	
	売建	12,162,137,483	-	12,268,045,820	105,908,337	
	カナダドル	2,630,388,532	-	2,657,751,895	27,363,363	
	ユーロ	4,380,874,377	-	4,439,762,648	58,888,271	
	スイスフラン	4,583,151,823	-	4,598,095,400	14,943,577	
	スウェーデンクローナ	567,722,751	-	572,435,877	4,713,126	
	合計		27,455,986,748	-	27,710,201,554	42,398,132

(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。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2024年 8月19日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	81,883,366
社債券	8,232,337,200
未収利息	489
流動資産合計	8,314,221,055
資産合計	8,314,221,055
負債の部	
流動負債	
未払解約金	456,262
流動負債合計	456,262
負債合計	456,262
純資産の部	
元本等	
元本	9,472,767,842
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,159,003,049
元本等合計	8,313,764,793
純資産合計	8,313,764,793
負債純資産合計	8,314,221,055

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19日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,472,767,842口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,159,003,049円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.8776円 (8,776円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 8月19日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 8月19日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 2月20日
期首元本額	8,288,047,447円
期中追加設定元本額	1,747,726,890円
期中一部解約元本額	563,006,495円
期末元本額	9,472,767,842円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	445,375,786円
コア投資戦略ファンド（成長型）	620,692,705円
コア投資戦略ファンド（切替型）	323,897,610円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	174,857,855円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,259,211,395円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	153,758,178円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	26,303,695円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（SMA専用）	98,359,724円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS（適格機関投資家専用）	132,722,773円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,237,588,121円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

【純資産額計算書】

（2024年 9月30日現在）

資産総額	9,418,548,462円
負債総額	28,971,685円
純資産総額（ - ）	9,389,576,777円
発行済口数	5,905,831,030口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5899円
（1万口当たり純資産額）	（15,899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）

日本株式ESGセレクト・リーダーズ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	17,689,086,820円
負債総額	909,555,306円
純資産総額（ - ）	16,779,531,514円
発行済口数	10,944,169,353口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5332円
（1万口当たり純資産額）	（15,332円）

日本株式エクセレント・フォーカス 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	47,037,694,841円
負債総額	254,887,693円
純資産総額（ - ）	46,782,807,148円
発行済口数	7,706,139,051口

1口当たり純資産額（ / ）	6.0708円
（1万口当たり純資産額）	（60,708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）

外国株式ESGリーダーズ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	18,364,201,795円
負債総額	10,630,748円
純資産総額（ - ）	18,353,571,047円
発行済口数	10,641,483,766口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7247円
（1万口当たり純資産額）	（17,247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）

J-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	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）

ピクテ マルチストラテジー リンク 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	24,462,683,934円
負債総額	468,485,500円
純資産総額（ - ）	23,994,198,434円
発行済口数	22,890,338,024口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0482円
（1万口当たり純資産額）	（10,482円）

米国株式LS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	15,718,093,837円
負債総額	583,619,998円
純資産総額（ - ）	15,134,473,839円
発行済口数	12,437,707,216口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2168円
（1万口当たり純資産額）	（12,168円）

コモディティLSアルファ・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	15,846,428,969円
負債総額	565,085,256円
純資産総額（ - ）	15,281,343,713円
発行済口数	12,083,813,590口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2646円
（1万口当たり純資産額）	（12,646円）

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

資産総額	24,770,644,687円
負債総額	759,628,647円
純資産総額（ - ）	24,011,016,040円
発行済口数	21,700,375,414口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1065円
（1万口当たり純資産額）	（11,065円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 9月30日現在)

資産総額	7,127,862,295円
負債総額	19,988円
純資産総額（ - ）	7,127,842,307円
発行済口数	8,153,024,523口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8743円
（1万口当たり純資産額）	（8,743円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存

在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年 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19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いません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年11月19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。
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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4月25日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 中島紀子

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」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2023年2月18日から2024年2月19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、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2024年2月20日から2024年8月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2024年8月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月20日から2024年8月19日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。