

## 【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】	2025年1月21日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	SMT インデックスバランス・オープン
【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】

SMT インデックスバランス・オープン

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

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

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

### （６）【申込単位】

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

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

**( 7 ) 【申込期間】**

2025年 1月22日から2025年 7月18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、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### <信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「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。

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

## [ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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



る旨の記載があるものをいう。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

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

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

#### [ 特殊型 ]

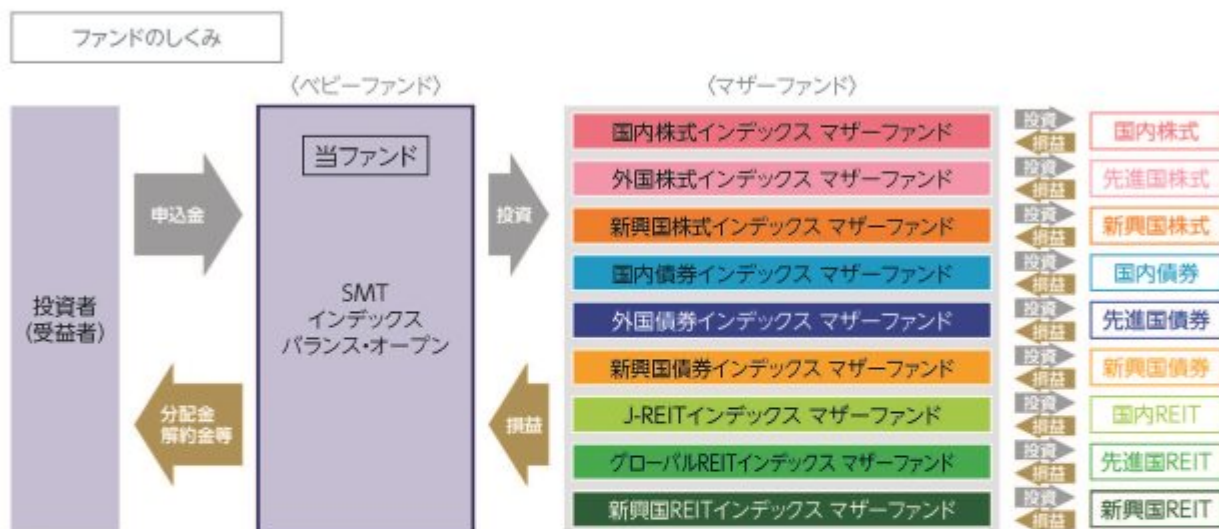
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

### ? DR(預託証券)とは

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

### ? REITとは

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

## ポートフォリオ構築プロセス

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

ポートフォリオ構築

ファンドマネジャー

●基本資産配分比率に従って、各資産のマザーファンドへ資金を配分

リバランス実施

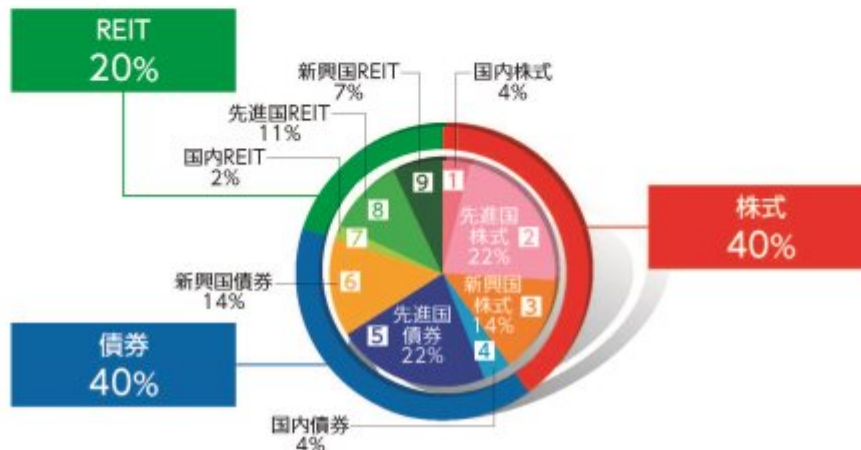
ファンドマネジャー

●資産配分比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合、リバランスを実施

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

**特色2** 株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

基本資産配分比率  
(2024年11月末現在)



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

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

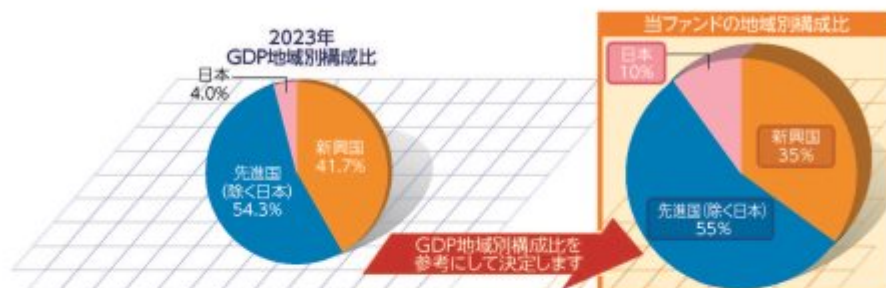
※資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

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

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

### 特色3 世界経済全体の発展を享受します。

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



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

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

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

※当ファンドの地域別構成比は、2024年11月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

#### 分配方針

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

#### 主な投資制限

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

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

#### (2) 【ファンドの沿革】

2014年11月28日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



#### 委託会社の概況（2024年11月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

#### ロ．委託会社の沿革

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

#### ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

### 基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 投資対象

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

### 投資態度

- イ．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）、債券及び不動産投資信託証券（以下「REIT」という場合があります。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。
- ロ．株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整します。
- ハ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別（国内、先進国及び新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定するものとします。また、マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ニ．マザーファンド受益証券の基本組入比率は世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回見直しを行う予定です。
- ホ．実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ヘ．投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。以下本項において同じ。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ト．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 1. 有価証券
  - 2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。）
  - 3. 金銭債権
  - 4. 約束手形

## ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

## 1. 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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



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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### （参考）マザーファンドの概要

##### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

##### (2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

#### 3．運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

ては、上記の運用ができない場合があります。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

### 3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

す。

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

## 「J-REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

外貨建資産への投資は行いません。

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

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

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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



込み、円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

## 「新興国REITインデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

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

#### (2)投資態度

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

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

### 3. 運用制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

株式への投資は行いません。

同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が10%

を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

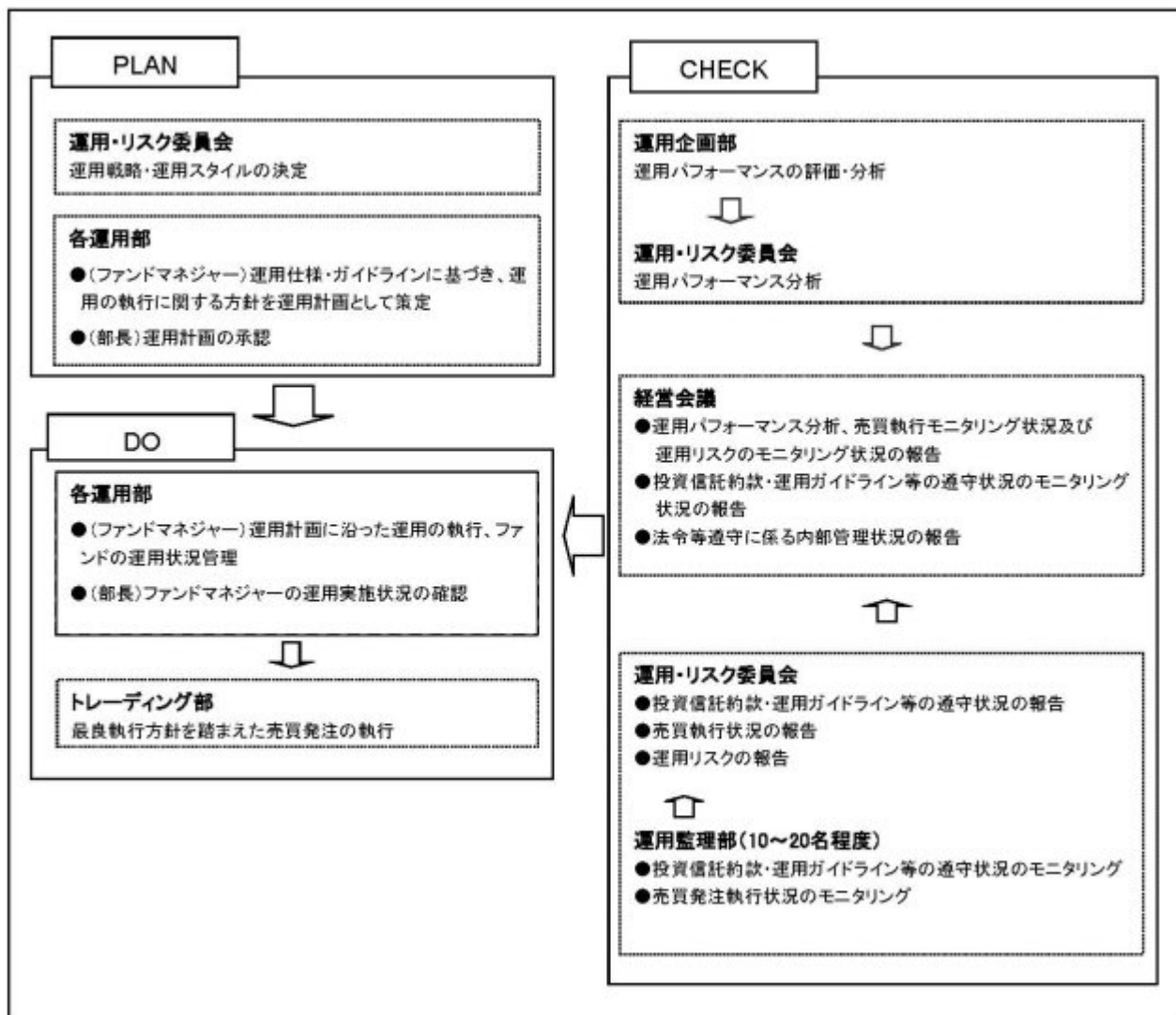
外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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

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

#### （４）【分配方針】

- ・年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### <約款に定める投資制限>

##### イ．株式等への投資割合

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

##### ロ．投資信託証券への投資割合

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

##### ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

##### ニ．投資する株式等の範囲

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

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

##### ホ．信用取引の指図範囲

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

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

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

#### ヘ．先物取引等の運用指図、目的及び範囲

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

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

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

#### ト．スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

(イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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

(イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

(ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日

が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

- (八) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (二) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

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

#### ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

#### ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (八) 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。
- (二) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ．資金の借入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

##### イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

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。

#### リートの価格変動リスク

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

#### 為替変動リスク

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

#### 金利変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### カントリーリスク

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

#### 流動性リスク

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

#### 有価証券の貸付等に係るリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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

はありません。

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

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が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12月～2024年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPXが算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、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時価総額です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は債権は、株式会社JPX(以下「JPX」という)の知的財産であり、有数の算出、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債権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、販売及び取扱い等活動に直接するいかなる措置に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデュシャリー・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、野村フィデュシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの権限、販売あるいは販売促進を行っておりません。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何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPMorgan Global Emerging Markets Index (配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が低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。本指数は行務を営んで使用してはなりません。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## （2）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

## （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.55%（税抜0.5%）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

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

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

2025年1月21日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

## 二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

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

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

上記は、2024年11月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## (参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.63%	0.54%	0.09%

※対象期間は2024年4月23日～2024年10月21日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

以下は、2024年11月29日現在の状況について記載してあります。

## 【SMT インデックスバランス・オープン】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,833,191,032	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		26,385,400	0.92
合計(純資産総額)		2,859,576,432	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	96,551,953	6.9337	669,462,277	7.0815	683,732,655	23.91
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	161,674,259	3.6183	584,985,972	3.6014	582,253,676	20.36
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	87,002,296	4.8007	417,671,923	4.5279	393,937,696	13.78
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	167,985,932	2.3215	389,979,342	2.2828	383,478,285	13.41
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	102,431,814	3.3202	340,094,109	3.3411	342,234,933	11.97
日本	親投資信託受益証券	新興国REITインデックス マザーファンド	207,808,475	0.9295	193,157,978	0.9097	189,043,369	6.61
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	46,034,864	2.8124	129,468,452	2.8147	129,574,331	4.53
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	65,502,507	1.3126	85,978,591	1.3042	85,428,369	2.99
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	21,651,017	2.0342	44,042,499	2.0095	43,507,718	1.52

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.08
合計	99.08

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2015年 4月20日)	1,069,183,722	1,069,183,722	10,012	10,012
第2期計算期間末	(2015年10月20日)	1,758,605,423	1,758,605,423	9,509	9,509
第3期計算期間末	(2016年 4月20日)	2,345,268,549	2,345,268,549	9,025	9,025
第4期計算期間末	(2016年10月20日)	2,640,506,750	2,640,506,750	8,729	8,729
第5期計算期間末	(2017年 4月20日)	3,071,863,389	3,071,863,389	9,344	9,344
第6期計算期間末	(2017年10月20日)	3,210,063,471	3,210,063,471	10,386	10,386
第7期計算期間末	(2018年 4月20日)	3,051,290,712	3,051,290,712	10,234	10,234
第8期計算期間末	(2018年10月22日)	2,916,459,886	2,916,459,886	10,043	10,043
第9期計算期間末	(2019年 4月22日)	2,897,788,604	2,897,788,604	10,631	10,631
第10期計算期間末	(2019年10月21日)	2,862,769,922	2,862,769,922	10,703	10,703
第11期計算期間末	(2020年 4月20日)	2,311,876,858	2,311,876,858	9,578	9,578
第12期計算期間末	(2020年10月20日)	2,413,136,341	2,413,136,341	10,586	10,586
第13期計算期間末	(2021年 4月20日)	2,520,767,080	2,520,767,080	12,311	12,311
第14期計算期間末	(2021年10月20日)	2,749,895,621	2,749,895,621	13,320	13,320
第15期計算期間末	(2022年 4月20日)	2,792,857,082	2,792,857,082	13,960	13,960
第16期計算期間末	(2022年10月20日)	2,684,376,098	2,684,376,098	13,327	13,327
第17期計算期間末	(2023年 4月20日)	2,616,683,538	2,616,683,538	13,549	13,549
第18期計算期間末	(2023年10月20日)	2,682,687,407	2,682,687,407	14,410	14,410
第19期計算期間末	(2024年 4月22日)	2,859,938,837	2,859,938,837	16,189	16,189
第20期計算期間末	(2024年10月21日)	2,931,553,491	2,931,553,491	17,450	17,450
	2023年11月末日	2,768,285,918		15,041	
	12月末日	2,692,726,525		15,244	
	2024年 1月末日	2,677,702,257		15,633	
	2月末日	2,730,791,292		16,105	
	3月末日	2,910,119,274		16,486	
	4月末日	2,950,044,134		16,719	
	5月末日	3,110,137,407		16,866	
	6月末日	3,224,130,499		17,498	
	7月末日	3,117,273,420		16,904	
	8月末日	2,811,115,887		16,603	
	9月末日	2,850,541,793		16,920	

10月末日	2,964,629,864		17,648
11月末日	2,859,576,432		17,312

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

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

第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	4.5
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	1.7
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	6.4
第19期計算期間	2023年10月21日～2024年 4月22日	12.3
第20期計算期間	2024年 4月23日～2024年10月21日	7.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2014年11月28日～2015年 4月20日	1,226,719,421	158,784,152	1,067,935,269
第2期計算期間	2015年 4月21日～2015年10月20日	1,116,037,756	334,592,586	1,849,380,439
第3期計算期間	2015年10月21日～2016年 4月20日	1,083,752,766	334,386,357	2,598,746,848
第4期計算期間	2016年 4月21日～2016年10月20日	602,284,502	175,969,377	3,025,061,973
第5期計算期間	2016年10月21日～2017年 4月20日	856,851,109	594,236,350	3,287,676,732
第6期計算期間	2017年 4月21日～2017年10月20日	584,835,788	781,663,341	3,090,849,179
第7期計算期間	2017年10月21日～2018年 4月20日	473,012,411	582,449,995	2,981,411,595
第8期計算期間	2018年 4月21日～2018年10月22日	199,195,642	276,588,300	2,904,018,937
第9期計算期間	2018年10月23日～2019年 4月22日	166,800,463	345,148,199	2,725,671,201
第10期計算期間	2019年 4月23日～2019年10月21日	156,918,897	207,929,245	2,674,660,853
第11期計算期間	2019年10月22日～2020年 4月20日	163,015,795	423,953,521	2,413,723,127
第12期計算期間	2020年 4月21日～2020年10月20日	126,592,041	260,782,440	2,279,532,728
第13期計算期間	2020年10月21日～2021年 4月20日	92,056,120	324,043,645	2,047,545,203
第14期計算期間	2021年 4月21日～2021年10月20日	106,905,068	90,001,351	2,064,448,920
第15期計算期間	2021年10月21日～2022年 4月20日	85,522,955	149,318,352	2,000,653,523
第16期計算期間	2022年 4月21日～2022年10月20日	91,167,976	77,540,998	2,014,280,501
第17期計算期間	2022年10月21日～2023年 4月20日	68,352,579	151,322,378	1,931,310,702
第18期計算期間	2023年 4月21日～2023年10月20日	64,015,814	133,663,352	1,861,663,164
第19期計算期間	2023年10月21日～2024年 4月22日	137,192,336	232,222,034	1,766,633,466
第20期計算期間	2024年 4月23日～2024年10月21日	128,917,345	215,593,912	1,679,956,899

(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	686,413,204,800	98.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,344,620,422	1.77
合計(純資産総額)		698,757,825,222	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	12,376,980,000	1.77

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,499,700	3,329.46	31,628,911,362	2,551.50	24,238,484,550	3.47
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,542,700	1,629.93	18,813,889,376	1,792.00	20,684,518,400	2.96
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,258,000	2,515.43	15,741,573,940	3,007.00	18,817,806,000	2.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,647,700	3,241.69	15,066,420,897	3,751.00	17,433,522,700	2.49
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,433,300	7,936.96	11,376,047,575	10,385.00	14,884,820,500	2.13
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,671,700	3,336.47	12,250,524,202	3,686.00	13,533,886,200	1.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	178,800	69,546.08	12,434,840,790	64,720.00	11,571,936,000	1.66
日本	株式	任天堂	その他製品	1,128,200	8,253.06	9,311,108,271	8,810.00	9,939,442,000	1.42
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,718,400	5,354.36	9,200,939,005	5,564.00	9,561,177,600	1.37
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,270,900	7,269.11	9,238,323,842	7,384.00	9,384,325,600	1.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,375,600	3,130.04	7,435,731,183	3,784.00	8,989,270,400	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	1,605,200	5,887.69	9,450,921,447	5,554.00	8,915,280,800	1.28
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,494,400	3,325.05	11,619,054,720	2,525.50	8,825,107,200	1.26
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	378,200	34,652.96	13,105,749,555	23,310.00	8,815,842,000	1.26
日本	株式	三井物産	卸売業	2,778,000	3,966.45	11,018,812,173	3,136.00	8,711,808,000	1.25
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	53,311,900	151.88	8,097,264,497	153.40	8,178,045,460	1.17
日本	株式	第一三共	医薬品	1,691,500	5,409.48	9,150,141,560	4,749.00	8,032,933,500	1.15
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	884,100	8,916.67	7,883,234,772	8,936.00	7,900,317,600	1.13
日本	株式	三菱重工業	機械	3,156,300	1,351.17	4,264,716,666	2,197.50	6,935,969,250	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	349,200	18,660.43	6,516,225,334	19,260.00	6,725,592,000	0.96
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,318,300	4,301.96	5,671,283,478	4,950.00	6,525,585,000	0.93
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,594,700	4,110.08	6,554,348,048	4,083.00	6,511,160,100	0.93
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	28,679,600	187.60	5,380,416,880	193.10	5,538,030,760	0.79
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,234,100	1,715.62	7,264,131,118	1,291.50	5,468,340,150	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,088,600	2,038.52	4,257,664,052	2,604.00	5,438,714,400	0.78
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	106,300	40,629.70	4,318,937,314	51,110.00	5,432,993,000	0.78
日本	株式	富士通	電気機器	1,660,900	2,277.55	3,782,788,050	2,866.00	4,760,139,400	0.68

日本	株式	三菱電機	電気機器	1,835,800	2,667.05	4,896,178,765	2,547.00	4,675,782,600	0.67
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	563,200	5,963.22	3,358,489,790	8,240.00	4,640,768,000	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,069,200	4,382.03	4,685,273,067	4,219.00	4,510,954,800	0.65

(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	0.25
		建設業	2.14
		食料品	3.12
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.13
		化学	5.24
		医薬品	4.50
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.81
		金属製品	0.49
		機械	5.45
		電気機器	17.01
		輸送用機器	6.82
		精密機器	2.39
		その他製品	2.57
		電気・ガス業	1.27
		陸運業	2.34
		海運業	0.64
		空運業	0.35
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.53
		卸売業	6.62
		小売業	4.57
		銀行業	8.62
証券、商品先物取引業	0.87		
保険業	3.24		
その他金融業	1.21		
不動産業	1.78		
サービス業	5.06		
	小計	98.23	
合計		98.23	

(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	462円		12,178,131,100	12,376,980,000	1.77

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	601,783,154,490	84.95
地方債証券	日本	36,015,529,227	5.08
特殊債券	日本	36,878,562,886	5.21
	国際機関	297,516,000	0.04
	小計	37,176,078,886	5.25
社債券	日本	30,623,700,000	4.32
	フランス	1,389,726,000	0.20
	オーストラリア	99,418,000	0.01
	韓国	99,251,000	0.01
	小計	32,212,095,000	4.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,185,134,928	0.17
合計(純資産総額)		708,371,992,531	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.46	6,469,413,300	98.30	6,458,572,800	0.100	2028/3/20	0.91
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	6,660,000,000	95.31	6,348,310,100	95.87	6,385,541,400	0.400	2033/6/20	0.90
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	6,340,000,000	98.92	6,272,004,000	98.83	6,266,139,000	0.005	2026/12/20	0.88
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	6,170,000,000	96.65	5,963,836,000	97.25	6,000,510,100	0.500	2032/12/20	0.85
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,100,000,000	96.24	5,870,931,600	96.98	5,916,207,000	0.500	2033/3/20	0.84

日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	99.31	5,859,467,000	99.14	5,849,496,000	0.100	2026/9/20	0.83
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	6,060,000,000	95.66	5,797,405,400	95.91	5,812,327,800	0.100	2031/6/20	0.82
日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	5,830,000,000	99.42	5,796,186,000	99.33	5,790,939,000	0.005	2026/3/20	0.82
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	6,027,000,000	94.86	5,717,546,900	95.39	5,749,275,840	0.100	2031/12/20	0.81
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	99.08	5,697,387,500	98.90	5,686,807,500	0.100	2027/3/20	0.80
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	5,865,000,000	96.67	5,669,861,500	96.64	5,667,936,000	0.100	2030/6/20	0.80
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	5,890,000,000	95.03	5,597,294,500	95.49	5,624,419,900	0.200	2032/6/20	0.79
日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	5,660,000,000	98.27	5,562,256,700	98.94	5,600,117,200	0.800	2033/9/20	0.79
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	5,810,000,000	95.90	5,572,117,400	96.15	5,586,315,000	0.100	2031/3/20	0.79
日本	国債証券	第373回利付国債（10年）	5,730,000,000	96.26	5,516,019,400	96.96	5,555,922,600	0.600	2033/12/20	0.78
日本	国債証券	第375回利付国債（10年）	5,500,000,000	101.82	5,600,435,000	100.78	5,543,065,000	1.100	2034/6/20	0.78
日本	国債証券	第368回利付国債（10年）	5,740,000,000	94.75	5,438,650,000	95.21	5,465,054,000	0.200	2032/9/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	5,580,000,000	96.07	5,360,970,000	96.32	5,374,767,600	0.100	2030/12/20	0.76
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	5,450,000,000	98.75	5,382,211,400	98.51	5,369,285,500	0.005	2027/6/20	0.76
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	5,400,000,000	98.90	5,340,984,000	98.60	5,324,886,000	0.100	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	5,510,000,000	95.22	5,246,987,400	95.79	5,278,414,700	0.200	2032/3/20	0.75
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	5,320,000,000	97.65	5,195,287,100	98.38	5,233,922,400	0.800	2034/3/20	0.74
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,325,000,000	98.29	5,234,346,200	98.12	5,225,209,500	0.100	2028/6/20	0.74
日本	国債証券	第151回利付国債（5年）	5,250,000,000	98.77	5,185,502,500	98.68	5,181,015,000	0.005	2027/3/20	0.73
日本	国債証券	第158回利付国債（5年）	5,260,000,000	98.39	5,175,586,600	98.30	5,170,790,400	0.100	2028/3/20	0.73
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	5,290,000,000	96.34	5,096,386,000	96.46	5,103,104,300	0.100	2030/9/20	0.72
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	98.65	5,090,494,800	98.45	5,080,432,800	0.100	2027/12/20	0.72
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,070,000,000	95.08	4,820,901,000	95.67	4,850,469,000	0.100	2031/9/20	0.68
日本	国債証券	第376回利付国債（10年）	4,900,000,000	99.01	4,851,712,400	98.66	4,834,683,000	0.900	2034/9/20	0.68
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	4,880,000,000	99.20	4,841,057,600	99.02	4,832,517,600	0.100	2026/12/20	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.95
地方債証券	5.08
特殊債券	5.25
社債券	4.55
合計	99.83

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	601,752,396,499	72.05
	イギリス	28,823,398,575	3.45
	カナダ	27,340,069,951	3.27
	スイス	21,517,512,353	2.58
	フランス	19,512,945,074	2.34
	ドイツ	17,841,667,430	2.14
	アイルランド	15,636,852,982	1.87
	オーストラリア	14,104,009,557	1.69
	オランダ	12,629,011,105	1.51
	デンマーク	6,431,768,420	0.77
	スウェーデン	6,246,200,297	0.75
	スペイン	5,272,096,470	0.63
	イタリア	4,254,853,899	0.51
	香港	2,884,678,914	0.35
	シンガポール	2,465,838,896	0.30
	フィンランド	1,949,342,728	0.23
	イスラエル	1,775,647,218	0.21
	ベルギー	1,495,938,217	0.18
	ルクセンブルク	1,251,403,519	0.15
	ケイマン	1,209,018,095	0.14
	ノルウェー	1,179,846,623	0.14
	ジャージー	1,166,687,303	0.14
	バミューダ	930,515,981	0.11
	キュラソー	726,721,236	0.09
	リベリア	695,692,779	0.08
	ニュージーランド	623,987,592	0.07
	オーストリア	360,928,924	0.04
	パナマ	329,157,389	0.04
	ポルトガル	291,887,271	0.03
	マン島	76,257,277	0.01
	小計	800,776,332,574	95.88
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	59,283,356	0.01
	香港	57,964,725	0.01
	小計	117,248,081	0.01
投資証券	アメリカ	13,645,900,296	1.63
	オーストラリア	954,293,909	0.11
	フランス	296,340,618	0.04
	イギリス	214,123,325	0.03
	シンガポール	204,844,412	0.02
	香港	154,898,016	0.02
	ベルギー	42,433,958	0.01
	カナダ	23,972,472	0.00
	小計	15,536,807,006	1.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,768,951,820	2.25
合計(純資産総額)		835,199,339,481	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	14,053,867,050	1.68
	買建	カナダ	462,189,672	0.06
	買建	ドイツ	2,475,304,577	0.30
	買建	イギリス	1,096,663,230	0.13
	買建	オーストラリア	540,141,576	0.06

(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		5,070,023,226	0.61

(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	1,217,224	29,063.31	35,376,560,788	35,413.34	43,105,977,349	5.16

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,963,841	17,213.00	33,803,596,311	20,401.15	40,064,617,959	4.80
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	565,406	64,803.12	36,640,076,259	63,761.51	36,051,141,793	4.32
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	756,235	27,457.02	20,763,959,969	31,013.24	23,453,303,299	2.81
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	174,791	72,641.60	12,697,098,955	85,801.20	14,997,278,948	1.80
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	469,065	26,521.19	12,440,164,614	25,509.73	11,965,721,596	1.43
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	230,394	26,867.03	6,190,002,676	50,179.83	11,561,133,734	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	402,416	26,780.46	10,776,888,972	25,749.40	10,361,973,287	1.24
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	227,781	30,202.26	6,879,502,443	37,653.34	8,576,716,486	1.03
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	354,961	21,446.10	7,612,530,098	24,068.65	8,543,434,131	1.02
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	106,308	61,368.67	6,523,981,436	72,819.47	7,741,293,195	0.93
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	64,845	122,486.93	7,942,665,226	118,811.76	7,704,348,616	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,878	76,316.65	5,638,121,485	91,707.20	6,775,144,610	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	133,734	41,236.98	5,514,786,488	47,437.87	6,344,057,176	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	355,687	17,335.10	6,165,869,714	17,736.06	6,308,488,961	0.76
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	66,022	67,353.64	4,446,822,469	80,250.96	5,298,328,960	0.63
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,586	123,042.80	4,378,601,320	144,944.04	5,157,978,857	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	79,596	49,794.92	3,963,476,469	64,394.62	5,125,554,221	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,519	24,636.94	4,619,895,402	27,036.72	5,069,899,898	0.61
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	355,106	9,878.64	3,507,967,288	13,849.99	4,918,214,975	0.59
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	193,182	21,866.98	4,224,308,246	23,424.99	4,525,287,577	0.54
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,199	98,139.27	3,356,265,134	132,250.23	4,522,825,670	0.54
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	258,516	19,515.90	5,045,172,473	15,953.78	4,124,308,424	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	558,868	5,936.14	3,317,519,360	7,200.84	4,024,324,526	0.48
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	141,776	23,639.52	3,351,517,937	27,597.47	3,912,660,211	0.47

アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	76,537	40,633.47	3,109,964,230	49,745.70	3,807,387,207	0.46
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	133,133	18,957.12	2,523,818,748	27,540.19	3,666,509,180	0.44
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	137,468	23,916.40	3,287,740,830	24,436.46	3,359,231,476	0.40
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,142	141,742.00	4,555,871,484	102,349.68	3,289,723,415	0.39
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	329,211	9,369.53	3,084,552,883	9,712.17	3,197,355,897	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別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	4.03
		素材	3.30
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	1.60
		運輸	1.52
		自動車・自動車部品	1.90
		耐久消費財・アパレル	1.11
		消費者サービス	1.99
		メディア・娯楽	6.44
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.95
		生活必需品流通・小売り	1.81
		食品・飲料・タバコ	2.80
		家庭用品・パーソナル用品	1.47
		ヘルスケア機器・サービス	3.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.77
		銀行	5.67
		金融サービス	7.28
		保険	3.06
		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	9.98
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.67		
電気通信サービス	1.16		
公益事業	2.62		
半導体・半導体製造装置	8.55		
不動産管理・開発	0.29		
		小計	95.88
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.01
投資証券			1.86
合計			97.75



(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	310	アメリカドル	90,897,218.5	13,701,846,717	93,232,500	14,053,867,050	1.68
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	14	カナダドル	4,173,639	448,874,874	4,297,440	462,189,672	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	41	スイスフラン	4,903,057	838,324,686	4,799,050	820,541,569	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	218	ユーロ	10,631,000.1	1,692,455,216	10,394,240	1,654,763,008	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	26	オーストラリアドル	5,399,057	529,323,548	5,509,400	540,141,576	0.06
	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	69	イギリスポンド	5,740,853.75	1,099,316,085	5,727,000	1,096,663,230	0.13

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	28,100,000.00	4,262,322,800	4,234,071,171	0.51
	カナダドル	買建	1,300,000.00	140,715,900	139,773,530	0.02
	ユーロ	買建	2,600,000.00	416,273,000	413,801,700	0.05
	イギリスポンド	買建	850,000.00	163,425,250	162,698,245	0.02
	スイスフラン	買建	700,000.00	120,274,700	119,678,580	0.01

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

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	168,578,096,037	45.27
	中国	40,364,642,252	10.84
	フランス	26,762,103,522	7.19
	イタリア	25,074,722,796	6.73
	ドイツ	20,956,262,590	5.63
	イギリス	18,618,569,860	5.00

スペイン	16,214,552,043	4.35
カナダ	6,983,090,654	1.88
ベルギー	5,661,678,451	1.52
オランダ	4,788,303,324	1.29
オーストラリア	4,607,196,347	1.24
オーストリア	3,993,205,905	1.07
メキシコ	2,599,630,985	0.70
ポルトガル	2,121,502,306	0.57
ポーランド	1,835,858,734	0.49
マレーシア	1,809,257,317	0.49
フィンランド	1,794,753,888	0.48
アイルランド	1,718,822,278	0.46
シンガポール	1,479,328,109	0.40
イスラエル	1,151,045,713	0.31
ニュージーランド	1,002,089,206	0.27
デンマーク	952,072,216	0.26
スウェーデン	595,909,649	0.16
ノルウェー	558,919,873	0.15
小計	360,221,614,055	96.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	12,160,478,732	3.27
合計(純資産総額)	372,382,092,787	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	3,218,485,100	0.86
	買建	ドイツ	2,970,624,240	0.80

(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		7,762,018,908	2.08

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	15,500,000	14,007.63	2,171,182,994	14,392.13	2,230,781,228	1.500	2026/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	13,402.11	2,157,740,936	13,637.25	2,195,598,760	0.375	2027/7/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	14,924.14	2,111,766,260	15,177.33	2,147,593,519	4.375	2028/8/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	14,186.04	2,156,279,172	14,107.43	2,144,330,680	2.625	2029/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/15/26	13,000,000	15,316.32	1,991,122,106	15,114.62	1,964,901,783	4.375	2026/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,779.46	1,878,140,576	14,164.26	1,930,588,717	3.375	2033/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	14,085.15	1,862,057,894	14,411.27	1,905,170,422	2.875	2028/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	14,281.22	1,756,591,143	14,357.39	1,765,959,733	1.625	2026/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 1% 07/31/28	13,000,000	13,087.89	1,701,426,463	13,462.08	1,750,070,798	1.000	2028/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	14,870.84	1,725,017,829	14,788.71	1,715,490,683	4.000	2034/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,094.77	1,647,679,640	14,437.47	1,687,741,041	2.375	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	14,373.65	1,591,163,362	14,679.19	1,624,986,409	3.875	2033/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	13,051.08	1,570,045,037	13,492.99	1,623,207,481	1.125	2028/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,939.32	1,561,204,754	14,324.12	1,604,302,273	3.500	2033/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,068.62	1,518,232,553	12,533.20	1,576,677,389	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	14,143.06	1,523,207,859	14,508.72	1,562,589,682	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	10,550,000	14,294.34	1,508,053,179	14,590.86	1,539,336,420	4.250	2054/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	13,757.96	1,485,860,662	14,194.87	1,533,047,002	0.625	2026/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,467.55	1,461,197,123	12,910.93	1,513,162,160	1.875	2032/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,945.92	1,494,592,994	15,125.52	1,512,552,248	4.500	2026/7/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	14,171.91	1,475,296,384	14,513.43	1,510,848,648	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,887.85	1,420,598,191	12,384.23	1,479,915,858	0.625	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.875% 11/30/25	9,700,000	15,241.12	1,478,389,095	15,142.88	1,468,860,211	4.875	2025/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	14,994.21	1,427,449,150	15,175.27	1,444,686,507	4.625	2026/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	9,270,000	15,018.65	1,392,228,862	15,364.29	1,424,269,888	4.500	2033/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/31	10,980,000	12,554.74	1,378,511,070	12,912.70	1,417,815,152	1.625	2031/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/29	10,200,000	13,583.73	1,385,541,162	13,696.43	1,397,036,531	1.750	2029/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,394.36	1,352,831,146	13,799.48	1,393,747,635	2.875	2032/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,002.96	1,338,330,808	12,499.34	1,393,677,418	0.875	2030/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 4.5% 04/15/27	9,150,000	15,162.18	1,387,340,316	15,172.62	1,388,295,528	4.500	2027/4/15	0.37

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.73
合計	96.73

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	82	アメリカ ドル	8,805,011.26	1,327,267,397	8,811,797.08	1,328,290,292	0.36

アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	52	アメリカドル	5,763,552.07	868,797,839	5,767,125	869,336,422	0.23
アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	57	アメリカドル	6,764,409.6	1,019,667,103	6,772,312.5	1,020,858,386	0.27
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	33	ユーロ	3,527,819.3	561,628,832	3,530,010	561,977,592	0.15
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	40	ユーロ	4,769,524	759,308,221	4,783,200	761,485,440	0.20
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	77	ユーロ	10,289,551.7	1,638,096,631	10,346,490	1,647,161,208	0.44

(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	25,100,000.00	3,823,016,875	3,776,433,050	1.01
	カナダドル	買建	2,590,000.00	281,780,089	278,168,590	0.07
	ユーロ	買建	15,080,000.00	2,424,258,212	2,397,534,516	0.64
	イギリスポンド	買建	2,160,000.00	416,788,465	412,808,832	0.11
	オフショア人民元	買建	43,200,000.00	908,543,403	897,073,920	0.24

(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	42,290,014,661	19.32
	台湾	39,711,113,148	18.14
	ケイマン	34,402,881,168	15.72
	中国	21,913,273,482	10.01
	韓国	21,185,788,287	9.68
	サウジアラビア	8,597,861,274	3.93
	ブラジル	8,078,341,957	3.69
	南アフリカ	6,064,968,337	2.77
	メキシコ	3,550,135,419	1.62
	インドネシア	3,352,922,330	1.53
	マレーシア	3,191,664,061	1.46
	タイ	3,118,746,226	1.42
	アラブ首長国連邦	2,682,449,056	1.23
	香港	1,764,157,983	0.81
	カタール	1,739,250,858	0.79
	ポーランド	1,673,554,059	0.76

	クウェート	1,575,729,373	0.72
	トルコ	1,429,204,513	0.65
	フィリピン	1,150,629,294	0.53
	ギリシャ	964,060,473	0.44
	チリ	902,782,526	0.41
	バミューダ	776,777,512	0.35
	アメリカ	710,581,661	0.32
	ハンガリー	543,606,964	0.25
	ルクセンブルク	358,520,158	0.16
	イギリス	336,655,447	0.15
	チェコ	301,011,121	0.14
	コロンビア	222,662,509	0.10
	エジプト	111,243,452	0.05
	シンガポール	80,225,891	0.04
	ペルー	67,414,289	0.03
	ロシア	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	212,848,227,489	97.23
投資信託受益証券	ブラジル	309,534,674	0.14
	メキシコ	115,642,017	0.05
	小計	425,176,691	0.19
投資証券	メキシコ	193,548,448	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,444,752,296	2.49
合計(純資産総額)		218,911,704,924	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	5,384,499,125	2.46

(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		30,889,195	0.01

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	4,533,389	5,039.98	22,848,234,111	4,653.95	21,098,183,870	9.64
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,194,800	8,140.31	9,726,043,687	7,748.00	9,257,310,400	4.23
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	879,794	6,169.92	5,428,266,570	6,005.09	5,283,250,949	2.41
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,995,288	1,800.68	5,393,583,980	1,615.45	4,838,761,962	2.21
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	1,042,664	3,151.40	3,285,852,029	3,209.29	3,346,212,191	1.53
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	904,050	3,715.16	3,358,695,823	3,335.51	3,015,471,432	1.38
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,105,776	2,298.36	2,541,471,328	2,275.71	2,516,432,689	1.15
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	961,368	2,256.89	2,169,702,560	2,302.74	2,213,785,836	1.01
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	2,289,248	1,009.06	2,310,004,437	905.32	2,072,505,204	0.95
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	613,702	3,280.33	2,013,149,705	3,324.83	2,040,458,196	0.93
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	17,701,620	119.66	2,118,341,507	113.31	2,005,850,219	0.92
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	127,681	17,692.03	2,258,937,250	14,893.11	1,901,567,433	0.87
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	100,741	21,618.72	2,177,891,701	17,431.02	1,756,018,386	0.80
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	277,804	5,927.42	1,646,662,097	5,811.65	1,614,500,728	0.74
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	2,824,200	548.28	1,548,458,504	539.45	1,523,527,399	0.70
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	472,159	2,811.24	1,327,354,055	2,793.02	1,318,752,599	0.60
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	354,607	3,770.76	1,337,137,892	3,662.22	1,298,648,848	0.59
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	167,114	7,429.23	1,241,528,817	7,604.00	1,270,736,444	0.58
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	3,008.16	1,338,363,919	2,754.41	1,225,469,087	0.56
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	1,075,496	1,127.84	1,212,989,285	1,103.48	1,186,799,081	0.54
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,791,515	94.03	1,202,792,497	88.13	1,127,360,987	0.51
ケイマン	株式	TRIP.COM GROUP LTD	消費者サービス	114,607	10,132.29	1,161,232,224	9,704.37	1,112,188,733	0.51
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	34,013.30	1,108,765,745	33,957.24	1,106,938,272	0.51
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,238,000	961.35	1,190,160,259	867.77	1,074,306,688	0.49
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	500,000	2,295.77	1,147,885,100	2,039.51	1,019,756,100	0.47

中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	14,349,200	73.02	1,047,848,895	69.34	995,039,534	0.45
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	10,195,000	95.71	975,788,938	95.00	968,525,000	0.44
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	187,000	5,400.35	1,009,866,572	4,885.11	913,516,318	0.42
ブラジル	株式	VALE SA	素材	621,587	1,519.73	944,646,519	1,442.02	896,346,928	0.41
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	338,630	2,312.77	783,176,014	2,564.58	868,446,434	0.40

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.54
		素材	5.87
		資本財	4.82
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	3.51
		耐久消費財・アパレル	1.18
		消費者サービス	3.06
		メディア・娯楽	6.27
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.13
		生活必需品流通・小売り	1.13
		食品・飲料・タバコ	2.96
		家庭用品・パーソナル用品	0.64
		ヘルスケア機器・サービス	0.84
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.54
		銀行	17.46
		金融サービス	2.70
		保険	3.03
		ソフトウェア・サービス	2.67
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.64
電気通信サービス	2.74		
公益事業	2.64		
半導体・半導体製造装置	12.57		
不動産管理・開発	1.48		
	小計	97.23	
投資信託受益証券			0.19
投資証券			0.09
合計			97.51

(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	661	アメリカドル	37,064,227	5,587,061,577	35,720,440	5,384,499,125	2.46

(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	205,000.00	31,098,500	30,889,195	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。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	マレーシア	15,149,789,906	9.88
	中国	15,059,224,989	9.82
	インドネシア	14,970,520,784	9.76
	メキシコ	14,782,766,143	9.64
	タイ	14,556,082,130	9.49
	南アフリカ	12,808,230,472	8.35
	ブラジル	11,408,342,962	7.44
	ポーランド	11,043,939,054	7.20
	チェコ	8,235,538,912	5.37
	インド	7,726,400,980	5.04
	コロンビア	5,921,911,952	3.86
	ルーマニア	5,437,631,220	3.54
	ハンガリー	3,890,689,475	2.54
	ペルー	3,163,518,795	2.06
	チリ	2,705,536,748	1.76
	トルコ	957,151,218	0.62
	ドミニカ共和国	369,928,493	0.24
ウルグアイ	282,542,245	0.18	
	小計	148,469,746,478	96.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,944,659,507	3.22
	合計(純資産総額)	153,414,405,985	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## その他の資産の投資状況



資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,355,007,098	0.88

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	82,500,000	2,181.55	1,799,785,770	2,178.44	1,797,217,805	0.000	2026/1/1	1.17
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	195,700,000	867.56	1,697,819,818	868.82	1,700,284,652	10.500	2026/12/21	1.11
マレーシア	国債証券	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000	3,699.36	1,616,623,359	3,720.66	1,625,930,014	4.893	2038/6/8	1.06
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,052.37	1,600,854,948	2,041.32	1,592,234,451	0.000	2026/7/1	1.04
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	68,000,000	2,330.95	1,585,047,285	2,337.84	1,589,732,694	0.000	2025/7/1	1.04
メキシコ	国債証券	MBONO 7% 09/03/26	225,600,000	702.52	1,584,907,263	703.92	1,588,052,911	7.000	2026/9/3	1.04
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	193,600,000	793.36	1,535,952,676	800.43	1,549,637,608	8.000	2030/1/31	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	191,000,000	754.45	1,441,001,888	764.92	1,461,015,404	8.875	2035/2/28	0.95
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000	673.05	1,413,423,367	675.80	1,419,200,768	5.500	2027/3/4	0.93
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000	669.38	1,411,061,111	665.15	1,402,145,484	7.750	2031/5/29	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000	706.36	1,323,027,978	719.12	1,346,926,869	9.000	2040/1/31	0.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	173,500,000	767.18	1,331,066,081	775.33	1,345,203,060	8.250	2032/3/31	0.88
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	41,200,000	3,165.79	1,304,307,610	3,177.88	1,309,289,680	2.632	2031/4/15	0.85
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	38,000,000	3,413.47	1,297,120,027	3,418.16	1,298,904,309	3.733	2028/6/15	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000	670.66	1,265,550,595	683.50	1,289,769,622	8.750	2048/2/28	0.84
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000	3,293.69	1,281,246,812	3,311.55	1,288,196,627	2.750	2029/10/25	0.84
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	46,100,000,000	2.70	1,245,773,374	2.68	1,238,394,593	7.250	2034/10/18	0.81
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	699.36	1,225,993,855	702.01	1,230,635,460	5.750	2026/3/5	0.80
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	51,300,000	2,374.97	1,218,362,213	2,343.81	1,202,378,241	10.000	2027/1/1	0.78
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000	2.27	1,231,384,852	2.20	1,193,465,803	7.250	2050/10/26	0.78
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	64,500,000	1,819.50	1,173,581,953	1,794.44	1,157,414,561	0.000	2027/7/1	0.75
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000	3,412.53	1,156,850,631	3,413.53	1,157,187,054	3.955	2025/9/15	0.75
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,294.56	1,179,407,857	2,235.87	1,149,238,245	10.000	2029/1/1	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	30,100,000	3,791.29	1,141,179,497	3,815.74	1,148,539,242	6.000	2033/10/25	0.75
ポーランド	国債証券	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000	3,980.20	1,134,358,763	3,990.29	1,137,234,176	7.500	2028/7/25	0.74

メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 03/01/29	160,000,000	704.63	1,127,420,697	703.32	1,125,322,536	8.500	2029/3/1	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	193,000,000	595.07	1,148,501,229	582.72	1,124,666,124	7.750	2042/11/13	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	159,000,000	701.30	1,115,082,661	702.34	1,116,733,033	7.500	2027/6/3	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000	704.73	1,089,522,798	703.74	1,087,993,020	8.500	2029/5/31	0.71
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	705.64	1,028,124,030	716.48	1,043,917,370	8.500	2037/1/31	0.68

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.78
合計	96.78

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	メキシコペソ	買建	29,360,000.00	220,345,701	215,346,792	0.14
	チェココルナ	買建	18,320,000.00	117,317,090	115,188,832	0.08
	ハンガリーフォリント	買建	143,470,000.00	56,792,633	55,151,729	0.04
	ポーランドズロチ	買建	4,200,000.00	157,185,387	154,764,960	0.10
	マレーシアリングット	買建	6,300,000.00	217,021,262	213,566,220	0.14
	タイバーツ	買建	46,530,000.00	206,856,815	204,522,615	0.13
	南アフリカランド	買建	22,140,000.00	187,747,528	183,826,206	0.12
	オフショア人民元	買建	10,240,000.00	217,253,075	212,639,744	0.14

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

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

#### J - REITインデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	91,791,462,700	96.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,612,786,162	3.79
合計(純資産総額)		95,404,248,862	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	3,572,712,500	3.74

(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。

## 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	55,560	129,884.95	7,216,408,055	125,500	6,972,780,000	7.31
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	9,784	563,962.41	5,517,808,306	554,000	5,420,336,000	5.68
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	49,392	92,292.44	4,558,508,488	91,300	4,509,489,600	4.73
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	30,491	141,110.09	4,302,587,881	141,700	4,320,574,700	4.53
日本	投資証券	G L P 投資法人	31,995	129,196.38	4,133,638,459	127,300	4,072,963,500	4.27
日本	投資証券	K D X 不動産投資法人	26,649	146,713.61	3,909,771,051	147,300	3,925,397,700	4.11
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,594	245,711.85	4,077,342,502	236,100	3,917,843,400	4.11
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	52,481	63,305.2	3,322,320,249	63,600	3,337,791,600	3.50
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,285	232,115.3	3,315,767,190	233,000	3,328,405,000	3.49
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,979	160,348.3	3,043,250,522	166,700	3,163,799,300	3.32
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,308	138,900.48	2,959,691,493	136,500	2,908,542,000	3.05
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,361	303,463.53	2,840,722,152	295,000	2,761,495,000	2.89
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,994	68,496.41	2,396,963,701	68,200	2,386,590,800	2.50
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,514	336,962.37	2,194,972,897	330,500	2,152,877,000	2.26
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	20,763	99,411.54	2,064,081,937	101,200	2,101,215,600	2.20
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	28,623	73,498.95	2,103,760,595	73,100	2,092,341,300	2.19
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,440	114,505.43	1,996,974,813	114,600	1,998,624,000	2.09
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,289	590,969.93	1,943,700,117	581,000	1,910,909,000	2.00
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,195	144,202.25	1,758,546,450	143,900	1,754,860,500	1.84
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,400	274,241.14	1,755,143,334	263,800	1,688,320,000	1.77
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	4,630	324,509.48	1,502,478,906	321,000	1,486,230,000	1.56
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,684	126,602.07	1,479,218,623	126,100	1,473,352,400	1.54
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,201	127,481.86	1,427,924,378	124,900	1,399,004,900	1.47
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	3,534	404,951.19	1,431,097,512	395,000	1,395,930,000	1.46
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,823	290,229.06	1,399,774,803	288,300	1,390,470,900	1.46
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,068	91,502.73	1,287,260,429	90,900	1,278,781,200	1.34
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	3,947	305,980.04	1,207,703,221	300,000	1,184,100,000	1.24
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,289	354,458.77	1,165,814,921	348,000	1,144,572,000	1.20
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	18,360	61,399.55	1,127,295,773	60,900	1,118,124,000	1.17
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,417	131,807.23	1,109,421,462	132,800	1,117,777,600	1.17

(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	96.21
合計	96.21

(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	2,149円		3,593,173,500	3,572,712,500	3.74

(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。

## 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	112,964,873,976	80.03
	オーストラリア	10,007,545,647	7.09
	イギリス	5,724,112,608	4.06
	シンガポール	3,971,849,062	2.81
	フランス	2,384,537,298	1.69
	カナダ	1,766,271,139	1.25
	ベルギー	1,176,900,884	0.83
	香港	1,094,710,918	0.78
	スペイン	600,694,827	0.43
	ガーンジー	241,133,474	0.17
	韓国	227,121,864	0.16
	オランダ	183,292,270	0.13
	イスラエル	166,945,036	0.12
	ニュージーランド	115,418,427	0.08
	アイルランド	52,211,660	0.04
	ドイツ	38,228,696	0.03
イタリア	12,749,102	0.01	
	小計	140,728,596,888	99.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		422,707,210	0.30
合計(純資産総額)		141,151,304,098	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		10,547,530	0.01

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

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	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	557,253	17,457.19	9,728,076,738	17,757.17	9,895,237,369	7.01
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	57,073	138,828.52	7,923,360,419	147,589.53	8,423,377,474	5.97
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	348,101	20,830.76	7,251,208,595	20,998.08	7,309,453,342	5.18
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	185,097	27,433.17	5,077,797,949	29,436.50	5,448,609,173	3.86
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	184,786	26,986.56	4,986,739,930	27,698.47	5,118,290,401	3.63
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	94,728	51,153.61	4,845,680,020	52,964.00	5,017,174,398	3.55
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	523,689	8,667.55	4,539,100,592	8,791.15	4,603,832,113	3.26
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,053,189	3,500.30	3,686,479,104	3,748.06	3,947,425,253	2.80
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	127,454	25,271.56	3,220,961,536	26,029.78	3,317,599,988	2.35
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	176,423	18,036.04	3,181,972,461	18,727.93	3,304,038,935	2.34
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	632,711	4,732.24	2,994,146,351	4,914.12	3,109,220,310	2.20
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,466	35,232.56	3,011,186,222	35,847.47	3,063,740,674	2.17
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	249,054	9,820.03	2,445,719,338	9,728.75	2,422,986,493	1.72
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	205,851	11,083.40	2,281,529,133	11,679.33	2,404,202,830	1.70
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,581	45,924.44	1,771,811,143	47,157.50	1,819,383,569	1.29
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	342,336	5,079.93	1,739,045,655	5,217.11	1,786,005,048	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,252	23,988.76	1,685,258,620	24,902.24	1,749,432,726	1.24
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	405,746	3,757.94	1,524,772,451	3,886.07	1,576,760,280	1.12
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	93,595	17,190.38	1,608,934,514	16,659.78	1,559,272,558	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	423,798	3,430.84	1,453,984,147	3,352.45	1,420,764,826	1.01
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	70,579	18,890.73	1,333,289,313	19,379.13	1,367,759,927	0.97
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	165,632	7,501.11	1,242,423,952	7,787.22	1,289,814,214	0.91
アメリカ	投資証券	UDR INC	181,213	6,704.50	1,214,942,633	6,983.78	1,265,552,486	0.90
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	64,413	18,349.15	1,181,923,815	19,148.50	1,233,412,472	0.87
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,607	10,769.01	1,212,666,741	10,866.84	1,223,682,995	0.87
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	815,755	1,493.29	1,218,159,613	1,494.38	1,219,054,450	0.86
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	424,510	2,714.79	1,152,455,573	2,778.13	1,179,347,447	0.84
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	132,300	8,548.14	1,130,919,203	8,669.05	1,146,916,294	0.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,142,176	337.26	1,059,756,148	364.70	1,145,979,238	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	98,816	11,189.24	1,105,676,709	11,442.67	1,130,719,215	0.80

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.70
合計	99.70

(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	70,000.00	10,619,000	10,547,530	0.01

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

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

## 新興国REITインデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	南アフリカ	140,810,340	26.07
	インド	105,030,291	19.45
	メキシコ	103,867,910	19.23
	トルコ	49,062,831	9.08
	マレーシア	41,217,237	7.63
	タイ	40,356,382	7.47
	サウジアラビア	29,484,070	5.46
	フィリピン	20,941,054	3.88
	香港	2,905,500	0.54
	小計	533,675,615	98.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,393,626	1.18
合計(純資産総額)		540,069,241	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
インド	投資証券	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	83,399	693.12	57,805,831	666.00	55,544,176	10.28
メキシコ	投資証券	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	99,319	496.72	49,334,331	450.54	44,747,572	8.29
メキシコ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	268,600	168.18	45,175,446	156.55	42,049,478	7.79

南アフリカ	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	329,583	110.53	36,431,808	108.62	35,800,360	6.63
南アフリカ	投資証券	REDEFINE PROPERTIES LTD	674,187	41.23	27,799,089	37.98	25,608,858	4.74
インド	投資証券	NEXUS SELECT TRUST	82,910	257.51	21,350,401	255.88	21,215,052	3.93
メキシコ	投資証券	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	73,341	239.69	17,579,469	232.76	17,070,860	3.16
南アフリカ	投資証券	VUKILE PROPERTY FUND LTD	97,185	155.35	15,098,127	149.27	14,507,155	2.69
インド	投資証券	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	27,651	518.27	14,330,866	515.55	14,255,633	2.64
インド	投資証券	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	20,922	659.50	13,798,218	669.88	14,015,430	2.60
南アフリカ	投資証券	RESILIENT REIT LTD	27,942	467.89	13,073,952	490.72	13,711,706	2.54
南アフリカ	投資証券	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	35,975	351.85	12,658,135	366.43	13,182,560	2.44
マレーシア	投資証券	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	192,800	60.77	11,717,036	62.13	11,978,869	2.22
タイ	投資証券	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	222,800	55.24	12,308,212	53.68	11,959,904	2.21
トルコ	投資証券	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	183,602	42.51	7,806,655	52.80	9,694,329	1.80
マレーシア	投資証券	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	133,800	73.67	9,857,653	69.93	9,357,956	1.73
南アフリカ	投資証券	EQUITES PROPERTY FUND LTD	77,297	122.86	9,497,289	120.45	9,310,563	1.72
フィリピン	投資証券	AREIT INC	90,320	100.20	9,050,660	100.72	9,097,074	1.68
タイ	投資証券	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	142,600	60.72	8,658,672	55.88	7,968,488	1.48
マレーシア	投資証券	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	133,500	61.11	8,158,522	58.73	7,841,246	1.45
サウジアラビア	投資証券	AL RAJHI REIT	21,814	341.70	7,453,844	338.48	7,383,690	1.37
南アフリカ	投資証券	ATTACQ LTD	67,086	108.29	7,264,743	109.62	7,354,155	1.36
タイ	投資証券	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	158,700	47.96	7,611,252	45.32	7,192,284	1.33
タイ	投資証券	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,800	46.64	7,499,712	43.78	7,039,824	1.30
フィリピン	投資証券	RL COMMERCIAL REIT INC	412,700	15.44	6,372,952	15.08	6,224,497	1.15
南アフリカ	投資証券	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	250,024	23.40	5,852,387	24.15	6,039,830	1.12
マレーシア	投資証券	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	107,700	50.24	5,411,718	50.92	5,484,849	1.02
南アフリカ	投資証券	FAIRVEST LTD-B	129,040	39.15	5,052,045	40.90	5,277,775	0.98
南アフリカ	投資証券	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	41,727	124.36	5,189,458	124.95	5,213,789	0.97
トルコ	投資証券	YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	19,198	242.00	4,645,984	266.83	5,122,710	0.95

(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	98.82
合計	98.82

(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

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

	<p>当初設定日：2014年11月28日 作成基準日：2024年11月29日</p>	 <p>SMTインデックスシリーズ</p>
---	--	--

#### 基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 17,312円

純資産総額 28.60億円

#### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

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

#### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	期間利益
外国株式インデックスマザーファンド	23.9%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ソフトウェア開発	-	-	1.2%
		NVIDIA CORP	アメリカ	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	1.1%
外国債券インデックスマザーファンド	20.4%	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.1%
		T 0.375% 07/31/27	アメリカ	国債	-	0.375%	2027/07/31	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	13.8%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体/半導体製造装置	-	-	1.3%
		TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン島	株式	メディア/娯楽	-	-	0.6%
新興国債券インデックスマザーファンド	13.4%	BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	国債	-	0.000%	2026/01/01	0.2%
		SAGB 10.5% 12/21/26	東アフリカ	国債	-	10.500%	2026/12/21	0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	12.0%	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.8%
		EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	-	-	-	0.7%
新興国REITインデックスマザーファンド	6.6%	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	インド	投資証券	-	-	-	0.7%
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	メキシコ	投資証券	-	-	-	0.5%
国内株式インデックスマザーファンド	4.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	3.0%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.0%
		第371回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.400%	2033/06/20	0.0%
J-REITインデックスマザーファンド	1.5%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%
		三井物産リアルエステイト投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

#### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】



#### < 申込手続 >

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

#### < 申込コース >

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

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

**< 受付不可日 >**

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

**< 一部解約受付の中止等 >**

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

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

**< 一部解約の制限 >**

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

**< その他 >**

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

**< 問い合わせ先 >**

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

**3【資産管理等の概要】****（1）【資産の評価】****< 基準価額の算出方法 >**

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

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

#### < 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

#### < 主要な投資対象資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

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

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2014年11月28日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、こ

の投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### （４）【計算期間】

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

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

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

#### （５）【その他】

##### <投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうち、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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

##### <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

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

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失

い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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20期計算期間(2024年4月23日から2024年10月21日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【SMT インデックスバランス・オープン】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2024年4月22日現在)	第20期 (2024年10月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	30,392,987	33,523,831
親投資信託受益証券	2,831,229,614	2,903,020,788
未収入金	6,820,000	11,520,000
未収利息	55	198
流動資産合計	2,868,442,656	2,948,064,817
資産合計	2,868,442,656	2,948,064,817
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	750,854	8,233,088
未払受託者報酬	767,634	819,637
未払委託者報酬	6,908,630	7,376,703
その他未払費用	76,701	81,898
流動負債合計	8,503,819	16,511,326
負債合計	8,503,819	16,511,326
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,766,633,466	1,679,956,899
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,093,305,371	1,251,596,592
（分配準備積立金）	932,815,986	1,027,157,777
元本等合計	2,859,938,837	2,931,553,491
純資産合計	2,859,938,837	2,931,553,491
負債純資産合計	2,868,442,656	2,948,064,817

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2023年10月21日	自	2024年 4月23日
	至	2024年 4月22日	至	2024年10月21日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1,804		21,735
有価証券売買等損益		324,835,266		223,281,174
営業収益合計		324,837,070		223,302,909
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,042		-
受託者報酬		767,634		819,637
委託者報酬		6,908,630		7,376,703
その他費用		76,701		81,898
営業費用合計		7,755,007		8,278,238
営業利益又は営業損失（ ）		317,082,063		215,024,671
経常利益又は経常損失（ ）		317,082,063		215,024,671
当期純利益又は当期純損失（ ）		317,082,063		215,024,671
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（ ）		22,881,368		13,541,462
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		821,024,243		1,093,305,371
剰余金増加額又は欠損金減少額		80,544,176		91,058,853
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		80,544,176		91,058,853
剰余金減少額又は欠損金増加額		102,463,743		134,250,841
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		102,463,743		134,250,841
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,093,305,371		1,251,596,592

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年4月21日から10月20日まで、及び10月21日から翌年4月20日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2024年4月23日から2024年10月21日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2024年4月22日現在)	第20期 (2024年10月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,766,633,466口	1,679,956,899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) 1.6189円 (16,189円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7450円 (17,450円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2023年10月21日 至 2024年4月22日			第20期 自 2024年4月23日 至 2024年10月21日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	40,536,843円	費用控除後の配当等収益額	A	43,179,989円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	245,090,035円	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	158,303,220円
収益調整金額	C	323,791,126円	収益調整金額	C	369,870,174円
分配準備積立金額	D	647,189,108円	分配準備積立金額	D	825,674,568円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,256,607,112円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,397,027,951円
当ファンドの期末残存口数	F	1,766,633,466口	当ファンドの期末残存口数	F	1,679,956,899口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,113円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,315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20期 自 2024年4月23日 至 2024年10月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2024年10月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第20期 (2024年10月21日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （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19期 自 2023年10月21日 至 2024年 4月22日	第20期 自 2024年 4月23日 至 2024年10月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,861,663,164円	1,766,633,466円
期中追加設定元本額	137,192,336円	128,917,345円
期中一部解約元本額	232,222,034円	215,593,912円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第19期 (2024年 4月22日現在)	第20期 (2024年10月21日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	304,813,897	211,172,480
合計	304,813,897	211,172,480

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	21,839,127	44,429,519	
	グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	103,056,405	342,188,487	
	新興国株式インデックス マザーファンド	87,576,626	420,429,108	
	国内株式インデックス マザーファンド	46,307,453	130,239,711	
	外国株式インデックス マザーファンド	101,455,756	703,463,775	
	国内債券インデックス マザーファンド	65,579,341	86,099,116	
	外国債券インデックス マザーファンド	162,801,823	589,065,836	
	新興国債券インデックス マザーファンド	169,111,625	392,592,637	
	新興国R E I Tインデックス マザーファンド	209,265,841	194,512,599	
合計		966,993,997	2,903,020,788	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年10月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,252,227,329
株式	669,849,525,470
派生商品評価勘定	256,709,500
未収入金	65,400
未収配当金	6,558,644,782
未収利息	31,054
差入委託証拠金	752,420,548
流動資産合計	682,669,624,083
資産合計	682,669,624,083
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	55,986,450
前受金	200,970,000
未払解約金	263,008,821
流動負債合計	519,965,271
負債合計	519,965,271
純資産の部	
元本等	
元本	242,539,964,422
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	439,609,694,390
元本等合計	682,149,658,812
純資産合計	682,149,658,812
負債純資産合計	682,669,624,083

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年10月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  先物取引

2024年10月21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10月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,539,964,422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) 2.8125円 (28,125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10月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年10月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	232,518,945,423円
期中追加設定元本額	22,218,544,611円
期中一部解約元本額	12,197,525,612円
期末元本額	242,539,964,422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）	266,955,882円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,244,598,845円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,048,778円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,430,349,390円
世界経済インデックスファンド	6,703,138,010円
日本株式インデックス・オープン	2,755,711,804円
DCマイセレクション25	4,804,675,629円
DCマイセレクション50	16,272,207,883円
DCマイセレクション75	18,549,787,436円
DC日本株式インデックス・オープン	5,985,960,879円
DCマイセレクションS25	3,060,447,143円
DCマイセレクションS50	9,708,527,569円
DCマイセレクションS75	9,119,479,370円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,649,605,096円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	36,728,488円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	544,539,232円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	452,138,100円
DC世界経済インデックスファンド	3,676,225,164円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	368,262,646円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,619,540円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,000,015円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,766,275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）	94,729,733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）	10,958,717円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	44,283,873円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,720,342円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	39,769,603円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	327,152,297円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	278,007,925円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,881,328,790円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,160,360円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	8,564,188円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	282,897,327円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	153,877,689円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	210,869,880円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,840,106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）	357,792,978円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,288,351,923円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,639,607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）	690,885,494円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	421,266,213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）	188,411,427円



区分	2024年10月21日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,678,199円
SMT インデックスバランス・オープン	46,307,453円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,079,196,674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	57,316,384円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	269,629,245円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	43,746,148円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,897,362円
グローバル経済コア	298,699,552円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	35,474,095円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	3,067,457,008円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	29,055,783円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	399,701,359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	65,799,236円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	69,686,342円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,810,374円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	40,991,132円
10資産分散投資ファンド	113,203,408円
グローバル10資産バランスファンド	49,413,571円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,683,456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	191,747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	37,278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	209,883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	61,362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	49,828円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,495円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	31,325円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	2,711,843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）	43,888,843,039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）	233,068,257円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	303,747,371円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	22,160,349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）	51,013,074,054円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,323,634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）	229,181,929円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		12,597,399,535
合計		12,597,399,535

(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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,843,455,000	-	12,044,425,000	200,970,000
合計		11,843,455,000	-	12,044,425,000	200,970,000

(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)	
極洋	10,300	4,185.00	43,105,500	
ニッスイ	249,100	918.70	228,848,170	
マルハニチロ	37,000	3,028.00	112,036,000	
雪国まいたけ	21,200	1,033.00	21,899,600	
カネコ種苗	7,000	1,371.00	9,597,000	
サカタのタネ	28,300	3,585.00	101,455,500	
ホクト	19,900	1,832.00	36,456,800	
ホクリヨウ	900	1,030.00	927,000	
住石ホールディングス	35,200	854.00	30,060,800	
日鉄鉱業	10,000	4,385.00	43,850,000	
I N P E X	752,900	1,999.00	1,505,047,100	
石油資源開発	144,500	1,143.00	165,163,500	
K & O エナジーグループ	11,300	3,260.00	36,838,000	
ショーボンドホールディングス	33,900	5,485.00	185,941,500	
ミライト・ワン	75,200	2,151.00	161,755,200	
タマホーム	15,700	3,825.00	60,052,500	
サンヨーホームズ	600	713.00	427,800	
日本アクア	2,700	829.00	2,238,300	
ファーストコーポレーション	1,500	829.00	1,243,500	
ベステラ	1,300	929.00	1,207,700	
キャンディル	1,000	531.00	531,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,100	1,171.00	1,288,100	
第一カッター興業	7,200	1,480.00	10,656,000	
安藤・間	144,300	1,135.00	163,780,500	
東急建設	78,000	700.00	54,600,000	
コムシスホールディングス	79,500	3,109.00	247,165,500	
ビーアールホールディングス	36,500	353.00	12,884,500	
高松コンストラクショングループ	18,500	2,930.00	54,205,000	
東建コーポレーション	6,300	10,690.00	67,347,000	
ソネック	600	883.00	529,800	
ヤマウラ	12,600	1,230.00	15,498,000	
オリエンタル白石	92,200	377.00	34,759,400	
大成建設	159,600	6,191.00	988,083,600	

大林組	623,200	1,858.00	1,157,905,600
清水建設	494,100	979.30	483,872,130
長谷工コーポレーション	159,900	1,898.50	303,570,150
松井建設	16,300	818.00	13,333,400
銭高組	600	3,385.00	2,031,000
鹿島建設	386,400	2,655.00	1,025,892,000
不動テトラ	12,100	2,155.00	26,075,500
大末建設	1,500	1,601.00	2,401,500
鉄建建設	12,500	2,408.00	30,100,000
西松建設	33,200	4,991.00	165,701,200
三井住友建設	129,700	395.00	51,231,500
大豊建設	6,000	3,460.00	20,760,000
佐田建設	2,400	855.00	2,052,000
ナカノフドー建設	2,700	494.00	1,333,800
奥村組	28,300	4,410.00	124,803,000
東鉄工業	21,600	3,285.00	70,956,000
イチケン	900	2,454.00	2,208,600
富士ピー・エス	1,700	419.00	712,300
浅沼組	64,400	681.00	43,856,400
戸田建設	235,800	934.80	220,425,840
熊谷組	28,800	3,560.00	102,528,000
北野建設	700	3,905.00	2,733,500
植木組	1,100	1,517.00	1,668,700
矢作建設工業	23,700	1,512.00	35,834,400
ピーエス・コンストラクション	22,100	1,016.00	22,453,600
日本ハウスホールディングス	37,200	336.00	12,499,200
新日本建設	24,500	1,599.00	39,175,500
東亜道路工業	33,500	1,280.00	42,880,000
日本道路	20,400	1,616.00	32,966,400
東亜建設工業	52,600	1,010.00	53,126,000
日本国土開発	49,600	510.00	25,296,000
若築建設	6,000	3,505.00	21,030,000
東洋建設	43,900	1,327.00	58,255,300
五洋建設	247,000	643.20	158,870,400
世紀東急工業	22,400	1,500.00	33,600,000
福田組	6,600	5,750.00	37,950,000
住友林業	150,600	6,539.00	984,773,400
日本基礎技術	2,300	687.00	1,580,100
巴コーポレーション	4,700	865.00	4,065,500
大和ハウス工業	481,900	4,520.00	2,178,188,000
ライト工業	32,100	2,264.00	72,674,400
積水ハウス	528,500	3,835.00	2,026,797,500

日特建設	16,600	1,020.00	16,932,000
北陸電気工事	11,900	1,215.00	14,458,500
ユアテック	38,400	1,505.00	57,792,000
日本リーテック	13,600	1,055.00	14,348,000
四電工	21,900	1,270.00	27,813,000
中電工	27,000	3,255.00	87,885,000
関電工	109,100	2,228.00	243,074,800
きんでん	121,200	3,238.00	392,445,600
東京エネシス	16,300	1,186.00	19,331,800
トーエネック	29,000	922.00	26,738,000
住友電設	16,600	4,500.00	74,700,000
日本電設工業	32,700	1,859.00	60,789,300
エクシオグループ	170,300	1,555.50	264,901,650
新日本空調	11,300	3,445.00	38,928,500
九電工	37,700	6,182.00	233,061,400
三機工業	37,600	2,467.00	92,759,200
日揮ホールディングス	172,400	1,305.50	225,068,200
中外炉工業	5,700	2,652.00	15,116,400
ヤマト	3,100	929.00	2,879,900
太平電業	11,000	5,340.00	58,740,000
高砂熱学工業	46,700	4,900.00	228,830,000
三晃金属工業	500	4,035.00	2,017,500
朝日工業社	16,300	1,318.00	21,483,400
明星工業	33,700	1,260.00	42,462,000
大気社	20,100	4,835.00	97,183,500
ダイダン	22,900	3,035.00	69,501,500
日比谷総合設備	12,600	3,670.00	46,242,000
飛島ホールディングス	18,000	1,550.00	27,900,000
フィル・カンパニー	3,400	791.00	2,689,400
テスホールディングス	37,500	288.00	10,800,000
インフロニア・ホールディングス	200,900	1,178.50	236,760,650
東洋エンジニアリング	25,600	768.00	19,660,800
レイズネクスト	25,200	1,586.00	39,967,200
ニッポン	52,400	2,192.00	114,860,800
日清製粉グループ本社	161,800	1,762.00	285,091,600
日東富士製粉	3,100	6,810.00	21,111,000
昭和産業	16,400	2,876.00	47,166,400
鳥越製粉	3,300	680.00	2,244,000
中部飼料	24,200	1,401.00	33,904,200
フィード・ワン	25,600	856.00	21,913,600
東洋精糖	700	1,390.00	973,000
日本甜菜製糖	10,200	2,570.00	26,214,000

DM三井製糖ホールディングス	17,300	3,220.00	55,706,000
塩水港精糖	4,900	273.00	1,337,700
ウェルネオシュガー	8,700	2,215.00	19,270,500
森永製菓	73,200	2,871.00	210,157,200
中村屋	4,400	3,295.00	14,498,000
江崎グリコ	50,000	4,436.00	221,800,000
名糖産業	6,900	1,851.00	12,771,900
井村屋グループ	10,400	2,426.00	25,230,400
不二家	12,000	2,688.00	32,256,000
山崎製パン	117,100	2,717.50	318,219,250
第一屋製パン	800	603.00	482,400
モロゾフ	5,700	4,630.00	26,391,000
亀田製菓	10,000	4,265.00	42,650,000
寿スピリッツ	82,700	1,992.00	164,738,400
カルビー	80,100	3,395.00	271,939,500
森永乳業	61,100	3,490.00	213,239,000
六甲バター	12,800	1,508.00	19,302,400
ヤクルト本社	250,000	3,347.00	836,750,000
明治ホールディングス	214,500	3,540.00	759,330,000
雪印メグミルク	42,300	2,625.00	111,037,500
プリマハム	23,500	2,263.00	53,180,500
日本ハム	75,200	5,216.00	392,243,200
林兼産業	1,300	472.00	613,600
丸大食品	17,600	1,687.00	29,691,200
S Foods	19,300	2,812.00	54,271,600
柿安本店	6,800	2,620.00	17,816,000
伊藤ハム米久ホールディングス	26,700	3,835.00	102,394,500
サッポロホールディングス	57,600	7,317.00	421,459,200
アサヒグループホールディングス	1,313,700	1,752.00	2,301,602,400
キリンホールディングス	728,700	2,207.50	1,608,605,250
シマダヤ	5,700	1,519.00	8,658,300
宝ホールディングス	118,000	1,211.50	142,957,000
オエノンホールディングス	56,600	415.00	23,489,000
養命酒製造	5,800	2,502.00	14,511,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	123,300	1,941.00	239,325,300
ライフドリンク カンパニー	14,000	1,707.00	23,898,000
サントリー食品インターナショナル	123,200	5,255.00	647,416,000
ダイドーグループホールディングス	19,800	3,030.00	59,994,000
伊藤園	59,100	3,317.00	196,034,700
キーコーヒー	19,600	2,014.00	39,474,400
ユニカフェ	1,200	941.00	1,129,200
日清オイリオグループ	24,600	5,250.00	129,150,000

不二製油グループ本社	40,700	3,176.00	129,263,200
かどや製油	500	3,585.00	1,792,500
J・オイルミルズ	20,000	2,080.00	41,600,000
キッコーマン	579,700	1,671.50	968,968,550
味の素	411,200	5,629.00	2,314,644,800
ブルドックソース	9,300	1,733.00	16,116,900
キューピー	94,000	3,531.00	331,914,000
ハウス食品グループ本社	60,100	3,001.00	180,360,100
カゴメ	75,000	3,198.00	239,850,000
アリアケジャパン	17,400	5,270.00	91,698,000
ピエトロ	500	1,764.00	882,000
エバラ食品工業	4,200	2,934.00	12,322,800
やまみ	500	4,085.00	2,042,500
ニチレイ	80,200	4,285.00	343,657,000
東洋水産	88,400	8,795.00	777,478,000
イトアンドホールディングス	8,300	2,204.00	18,293,200
大冷	500	1,912.00	956,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	1,492.00	11,936,000
日清食品ホールディングス	184,500	4,075.00	751,837,500
一正蒲鉾	1,600	740.00	1,184,000
フジッコ	18,000	1,710.00	30,780,000
ロック・フィールド	21,400	1,468.00	31,415,200
日本たばこ産業	1,063,100	4,094.00	4,352,331,400
ケンコーマヨネーズ	12,000	2,195.00	26,340,000
わらべや日洋ホールディングス	11,700	2,117.00	24,768,900
なとり	11,000	2,120.00	23,320,000
イフジ産業	700	1,408.00	985,600
ファーマフーズ	23,200	855.00	19,836,000
ユーグレナ	108,700	429.00	46,632,300
紀文食品	15,200	1,108.00	16,841,600
ピクルスホールディングス	10,300	1,082.00	11,144,600
ミヨシ油脂	1,500	1,585.00	2,377,500
理研ビタミン	15,100	2,610.00	39,411,000
片倉工業	16,600	2,005.00	33,283,000
ゲンゼ	12,700	5,400.00	68,580,000
東洋紡	77,300	976.00	75,444,800
ユニチカ	58,900	292.00	17,198,800
富士紡ホールディングス	7,900	4,660.00	36,814,000
倉敷紡績	12,700	4,735.00	60,134,500
シキボウ	12,800	1,012.00	12,953,600
日本毛織	45,900	1,268.00	58,201,200
トーア紡コーポレーション	1,600	394.00	630,400

帝国繊維	20,300	2,709.00	54,992,700
帝人	171,300	1,399.50	239,734,350
東レ	1,192,900	823.80	982,711,020
住江織物	800	2,083.00	1,666,400
日本フェルト	2,900	478.00	1,386,200
イチカワ	700	1,602.00	1,121,400
日東製網	400	1,446.00	578,400
アツギ	2,700	898.00	2,424,600
ダイニック	1,200	751.00	901,200
セーレン	34,500	2,572.00	88,734,000
ソトー	1,300	651.00	846,300
東海染工	400	692.00	276,800
小松マテーレ	25,900	771.00	19,968,900
ワコールホールディングス	33,200	4,642.00	154,114,400
ホギメディカル	23,400	4,815.00	112,671,000
T S Iホールディングス	53,400	976.00	52,118,400
マツオカコーポレーション	1,200	1,765.00	2,118,000
ワールド	25,200	2,044.00	51,508,800
三陽商会	8,400	2,713.00	22,789,200
ナイガイ	1,500	243.00	364,500
オンワードホールディングス	105,000	526.00	55,230,000
ルックホールディングス	5,700	2,544.00	14,500,800
ゴールドウイン	31,500	8,422.00	265,293,000
デサント	30,700	4,345.00	133,391,500
キング	1,500	749.00	1,123,500
ヤマトインターナショナル	3,100	317.00	982,700
特種東海製紙	9,500	3,665.00	34,817,500
王子ホールディングス	741,400	568.00	421,115,200
日本製紙	100,400	920.00	92,368,000
三菱製紙	5,200	504.00	2,620,800
北越コーポレーション	87,500	1,548.00	135,450,000
中越パルプ工業	1,500	1,266.00	1,899,000
大王製紙	78,600	893.30	70,213,380
阿波製紙	1,000	446.00	446,000
レンゴー	162,100	943.90	153,006,190
トモク	10,300	2,378.00	24,493,400
ザ・パック	13,200	3,735.00	49,302,000
北の達人コーポレーション	75,000	161.00	12,075,000
クラレ	259,400	2,037.00	528,397,800
旭化成	1,204,000	1,044.00	1,256,976,000
共和レザー	2,200	645.00	1,419,000
巴川コーポレーション	1,100	695.00	764,500

レゾナック・ホールディングス	159,700	3,700.00	590,890,000
住友化学	1,320,600	410.10	541,578,060
住友精化	8,400	5,000.00	42,000,000
日産化学	83,000	5,316.00	441,228,000
ラサ工業	6,900	2,805.00	19,354,500
クレハ	36,800	2,842.00	104,585,600
多木化学	6,900	3,685.00	25,426,500
テイカ	14,600	1,657.00	24,192,200
石原産業	29,500	1,470.00	43,365,000
片倉コープアグリ	900	966.00	869,400
日本曹達	41,600	2,492.00	103,667,200
東ソー	237,600	1,899.00	451,202,400
トクヤマ	57,500	2,753.00	158,297,500
セントラル硝子	19,000	3,470.00	65,930,000
東亜合成	85,600	1,610.00	137,816,000
大阪ソーダ	62,000	1,750.00	108,500,000
関東電化工業	34,400	970.00	33,368,000
デンカ	64,700	2,159.50	139,719,650
信越化学工業	1,596,000	5,935.00	9,472,260,000
日本カーバイド工業	9,400	1,671.00	15,707,400
堺化学工業	13,600	2,650.00	36,040,000
第一稀元素化学工業	19,500	800.00	15,600,000
エア・ウォーター	167,900	1,950.50	327,488,950
日本酸素ホールディングス	172,700	5,182.00	894,931,400
日本化学工業	6,500	2,721.00	17,686,500
東邦アセチレン	4,000	338.00	1,352,000
日本パーカラライジング	79,300	1,312.00	104,041,600
高压ガス工業	25,800	880.00	22,704,000
チタン工業	500	858.00	429,000
四国化成ホールディングス	20,100	1,985.00	39,898,500
戸田工業	4,100	1,694.00	6,945,400
ステラ ケミファ	9,700	4,610.00	44,717,000
保土谷化学工業	5,600	4,185.00	23,436,000
日本触媒	103,600	1,737.50	180,005,000
大日精化工業	12,400	2,944.00	36,505,600
カネカ	43,900	3,750.00	164,625,000
三菱瓦斯化学	129,900	2,692.50	349,755,750
三井化学	146,800	3,547.00	520,699,600
東京応化工業	84,900	3,598.00	305,470,200
大阪有機化学工業	14,900	3,005.00	44,774,500
三菱ケミカルグループ	1,301,100	828.60	1,078,091,460
KHネオケム	32,100	2,041.00	65,516,100



ダイセル	220,800	1,331.00	293,884,800
住友ベークライト	49,800	3,960.00	197,208,000
積水化学工業	354,400	2,194.00	777,553,600
日本ゼオン	122,000	1,352.50	165,005,000
アイカ工業	44,900	3,305.00	148,394,500
UBE	84,700	2,550.00	215,985,000
積水樹脂	26,600	2,324.00	61,818,400
旭有機材	11,800	4,140.00	48,852,000
ニチバン	9,600	1,961.00	18,825,600
リケンテクノス	33,400	1,079.00	36,038,600
大倉工業	8,200	2,710.00	22,222,000
積水化成成品工業	25,000	395.00	9,875,000
群栄化学工業	4,200	2,765.00	11,613,000
タイガースポリマー	1,700	724.00	1,230,800
ミライアル	1,300	1,440.00	1,872,000
ダイキアクシス	1,600	730.00	1,168,000
ダイキョーニシカワ	39,300	629.00	24,719,700
竹本容器	1,400	856.00	1,198,400
森六ホールディングス	9,200	2,280.00	20,976,000
恵和	11,500	1,033.00	11,879,500
日本化薬	135,900	1,228.00	166,885,200
カーリット	19,200	1,278.00	24,537,600
日本精化	11,800	2,350.00	27,730,000
扶桑化学工業	18,900	3,915.00	73,993,500
トリケミカル研究所	21,600	3,170.00	68,472,000
ADEKA	62,100	2,782.50	172,793,250
日油	161,100	2,563.50	412,979,850
新日本理化	5,300	189.00	1,001,700
ハリマ化成グループ	13,900	848.00	11,787,200
花王	433,400	6,868.00	2,976,591,200
第一工業製薬	7,100	3,205.00	22,755,500
石原ケミカル	8,000	2,430.00	19,440,000
日華化学	1,500	1,222.00	1,833,000
ニイタカ	800	1,936.00	1,548,800
三洋化成工業	10,900	4,135.00	45,071,500
有機合成薬品工業	3,100	269.00	833,900
大日本塗料	19,700	1,042.00	20,527,400
日本ペイントホールディングス	787,500	1,038.50	817,818,750
関西ペイント	153,800	2,477.50	381,039,500
神東塗料	3,200	132.00	422,400
中国塗料	36,500	2,118.00	77,307,000
日本特殊塗料	2,700	1,169.00	3,156,300

藤倉化成	20,500	471.00	9,655,500
太陽ホールディングス	31,000	3,930.00	121,830,000
D I C	63,200	3,337.00	210,898,400
サカティンクス	39,600	1,573.00	62,290,800
a r t i e n c e	31,900	3,595.00	114,680,500
富士フィルムホールディングス	991,700	3,666.00	3,635,572,200
資生堂	372,100	3,408.00	1,268,116,800
ライオン	226,800	1,683.00	381,704,400
高砂香料工業	13,400	5,160.00	69,144,000
マンダム	38,500	1,260.00	48,510,000
ミルボン	28,600	3,142.00	89,861,200
コーセー	36,200	8,470.00	306,614,000
コタ	18,100	1,668.00	30,190,800
シーボン	500	1,261.00	630,500
ポーラ・オルビスホールディングス	91,300	1,519.00	138,684,700
ノエビアホールディングス	15,900	5,200.00	82,680,000
アジュバンホールディングス	900	841.00	756,900
新日本製薬	10,200	1,720.00	17,544,000
I - n e	5,900	1,755.00	10,354,500
アクシージア	11,700	587.00	6,867,900
エステー	13,800	1,482.00	20,451,600
アグロ カネショウ	6,200	1,359.00	8,425,800
コニシ	51,500	1,319.00	67,928,500
長谷川香料	34,100	3,365.00	114,746,500
小林製薬	46,700	5,762.00	269,085,400
荒川化学工業	15,100	1,378.00	20,807,800
メック	14,700	3,810.00	56,007,000
日本高純度化学	4,000	3,460.00	13,840,000
タカラバイオ	48,000	1,050.00	50,400,000
J C U	19,700	3,415.00	67,275,500
新田ゼラチン	2,600	908.00	2,360,800
O A T アグリオ	7,400	1,893.00	14,008,200
デクセリアルズ	132,000	2,407.00	317,724,000
アース製薬	16,200	5,290.00	85,698,000
北興化学工業	15,900	1,265.00	20,113,500
大成ラミック	5,200	2,617.00	13,608,400
クミアイ化学工業	70,800	813.00	57,560,400
日本農薬	32,700	625.00	20,437,500
アキレス	11,200	1,486.00	16,643,200
有沢製作所	31,200	1,400.00	43,680,000
日東電工	563,500	2,433.50	1,371,277,250
レック	22,800	1,314.00	29,959,200

三光合成	22,400	609.00	13,641,600
きもと	6,300	248.00	1,562,400
ZACROS	14,100	4,245.00	59,854,500
前澤化成工業	11,500	1,817.00	20,895,500
未来工業	6,400	3,485.00	22,304,000
ウェーブロックホールディングス	1,400	595.00	833,000
JSP	12,500	1,937.00	24,212,500
エフピコ	33,700	2,722.00	91,731,400
天馬	11,900	2,936.00	34,938,400
信越ポリマー	38,400	1,475.00	56,640,000
東リ	8,500	376.00	3,196,000
ニフコ	53,300	3,457.00	184,258,100
バルカー	14,900	3,350.00	49,915,000
ユニ・チャーム	371,200	4,878.00	1,810,713,600
ショーエイコーポレーション	1,200	572.00	686,400
協和キリン	215,300	2,639.00	568,176,700
武田薬品工業	1,577,100	4,294.00	6,772,067,400
アステラス製薬	1,563,100	1,785.00	2,790,133,500
住友ファーマ	132,200	623.00	82,360,600
塩野義製薬	650,100	2,098.00	1,363,909,800
わかもと製薬	4,000	248.00	992,000
日本新薬	46,700	4,203.00	196,280,100
中外製薬	557,800	7,003.00	3,906,273,400
科研製薬	30,500	3,869.00	118,004,500
エーザイ	216,700	5,263.00	1,140,492,100
ロート製薬	172,600	3,472.00	599,267,200
小野薬品工業	364,500	2,007.00	731,551,500
久光製薬	39,600	4,299.00	170,240,400
持田製薬	19,900	3,510.00	69,849,000
参天製薬	314,400	1,805.50	567,649,200
扶桑薬品工業	6,300	2,441.00	15,378,300
日本ケミファ	400	1,590.00	636,000
ツムラ	56,100	4,922.00	276,124,200
キッセイ薬品工業	29,500	3,835.00	113,132,500
生化学工業	30,200	869.00	26,243,800
栄研化学	30,700	2,552.00	78,346,400
鳥居薬品	9,600	3,940.00	37,824,000
JCRファーマ	60,300	684.00	41,245,200
東和薬品	27,400	3,085.00	84,529,000
富士製薬工業	13,200	1,315.00	17,358,000
ゼリア新薬工業	24,700	2,326.00	57,452,200
ネクセラファーマ	83,600	1,231.00	102,911,600

第一三共	1,552,400	4,919.00	7,636,255,600
杏林製薬	38,600	1,517.00	58,556,200
大幸薬品	40,400	389.00	15,715,600
ダイト	13,500	2,254.00	30,429,000
大塚ホールディングス	444,800	9,057.00	4,028,553,600
ペプチドリーム	86,400	2,968.00	256,435,200
セルソース	11,800	1,261.00	14,879,800
あすか製薬ホールディングス	18,300	2,238.00	40,955,400
サワイグループホールディングス	122,400	2,057.00	251,776,800
日本コークス工業	180,800	96.00	17,356,800
ニチレキグループ	23,200	2,402.00	55,726,400
ユシロ化学工業	9,200	1,596.00	14,683,200
ビーピー・カストロール	1,800	872.00	1,569,600
富士石油	51,900	344.00	17,853,600
MORESCO	1,400	1,219.00	1,706,600
出光興産	925,300	1,042.00	964,162,600
E N E O Sホールディングス	2,821,100	779.00	2,197,636,900
コスモエネルギーホールディングス	52,800	7,725.00	407,880,000
横浜ゴム	90,100	3,169.00	285,526,900
TOYO TIRE	102,400	2,140.00	219,136,000
ブリヂストン	521,600	5,630.00	2,936,608,000
住友ゴム工業	174,800	1,545.50	270,153,400
藤倉コンポジット	17,100	1,200.00	20,520,000
オカモト	8,300	5,290.00	43,907,000
フコク	9,400	1,760.00	16,544,000
ニッタ	18,100	3,725.00	67,422,500
住友理工	27,700	1,453.00	40,248,100
三ツ星ベルト	20,700	3,890.00	80,523,000
バンドー化学	26,400	1,780.00	46,992,000
日東紡績	22,600	6,960.00	157,296,000
A G C	173,400	4,660.00	808,044,000
日本板硝子	85,000	368.00	31,280,000
石塚硝子	700	2,407.00	1,684,900
日本山村硝子	1,400	1,496.00	2,094,400
日本電気硝子	66,100	3,361.00	222,162,100
オハラ	8,500	1,317.00	11,194,500
住友大阪セメント	29,700	3,968.00	117,849,600
太平洋セメント	102,100	3,441.00	351,326,100
日本ヒューム	15,600	1,350.00	21,060,000
日本コンクリート工業	34,600	331.00	11,452,600
三谷セキサン	7,500	5,790.00	43,425,000
アジアパイルホールディングス	25,300	807.00	20,417,100

東海カーボン	164,400	864.10	142,058,040
日本カーボン	10,200	4,505.00	45,951,000
東洋炭素	12,600	5,430.00	68,418,000
ノリタケ	19,700	3,980.00	78,406,000
TOTO	117,600	5,125.00	602,700,000
日本碍子	207,300	1,874.50	388,583,850
日本特殊陶業	145,600	4,167.00	606,715,200
MARUWA	6,600	41,850.00	276,210,000
品川リフラクトリーズ	21,900	1,754.00	38,412,600
黒崎播磨	14,500	2,282.00	33,089,000
ヨータイ	10,400	1,688.00	17,555,200
東京窯業	4,100	401.00	1,644,100
ニッカトー	1,700	522.00	887,400
フジインコーポレーテッド	47,900	2,353.00	112,708,700
クニミネ工業	1,100	1,028.00	1,130,800
エーアンドエーマテリアル	800	1,156.00	924,800
ニチアス	45,100	5,660.00	255,266,000
ニチハ	22,300	3,505.00	78,161,500
日本製鉄	869,300	3,058.00	2,658,319,400
神戸製鋼所	368,700	1,671.50	616,282,050
中山製鋼所	41,900	765.00	32,053,500
合同製鐵	10,300	4,050.00	41,715,000
JFEホールディングス	509,800	1,846.00	941,090,800
東京製鐵	51,500	1,944.00	100,116,000
共英製鋼	20,900	1,735.00	36,261,500
大和工業	34,600	7,142.00	247,113,200
東京鐵鋼	8,100	5,160.00	41,796,000
大阪製鐵	8,400	3,315.00	27,846,000
淀川製鋼所	19,000	5,550.00	105,450,000
中部鋼鈹	12,000	2,524.00	30,288,000
丸一鋼管	55,800	3,323.00	185,423,400
モリ工業	4,600	5,160.00	23,736,000
大同特殊鋼	115,500	1,353.50	156,329,250
日本高周波鋼業	1,600	383.00	612,800
日本冶金工業	13,400	4,380.00	58,692,000
山陽特殊製鋼	18,100	1,861.00	33,684,100
愛知製鋼	10,600	4,230.00	44,838,000
日本金属	1,000	668.00	668,000
大平洋金属	15,600	1,403.00	21,886,800
新日本電工	109,500	293.00	32,083,500
栗本鐵工所	8,500	3,920.00	33,320,000
虹技	500	1,131.00	565,500

三菱製鋼	13,600	1,347.00	18,319,200
日亜鋼業	4,100	313.00	1,283,300
日本精線	14,600	1,275.00	18,615,000
エンビプロ・ホールディングス	18,100	522.00	9,448,200
シンニッタン	5,000	208.00	1,040,000
新家工業	900	4,675.00	4,207,500
大紀アルミニウム工業所	23,700	1,116.00	26,449,200
日本軽金属ホールディングス	53,900	1,625.00	87,587,500
三井金属鉱業	53,500	4,896.00	261,936,000
三菱マテリアル	131,300	2,528.50	331,992,050
住友金属鉱山	212,700	4,424.00	940,984,800
D O W Aホールディングス	45,400	5,223.00	237,124,200
古河機械金属	24,500	1,675.00	41,037,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	32,000	2,422.00	77,504,000
東邦チタニウム	38,400	1,121.00	43,046,400
U A C J	25,800	5,140.00	132,612,000
C Kサンエツ	4,600	3,700.00	17,020,000
古河電気工業	61,200	3,580.00	219,096,000
住友電気工業	686,000	2,320.50	1,591,863,000
フジクラ	216,400	5,131.00	1,110,348,400
S W C C	20,600	5,300.00	109,180,000
カナレ電気	1,000	1,434.00	1,434,000
平河ヒューテック	12,100	1,548.00	18,730,800
リョービ	19,800	1,876.00	37,144,800
アーレスティ	4,900	565.00	2,768,500
A R Eホールディングス	69,100	1,813.00	125,278,300
稲葉製作所	10,200	1,759.00	17,941,800
宮地エンジニアリンググループ	18,400	2,014.00	37,057,600
トーカロ	52,900	1,825.00	96,542,500
アルファC o	1,400	1,175.00	1,645,000
S U M C O	349,000	1,495.50	521,929,500
川田テクノロジーズ	13,000	2,464.00	32,032,000
R S Technologies	14,000	4,010.00	56,140,000
ジェイテックコーポレーション	700	1,741.00	1,218,700
信和	2,500	742.00	1,855,000
東洋製罐グループホールディングス	105,200	2,240.00	235,648,000
ホッカンホールディングス	8,900	1,788.00	15,913,200
コロナ	10,200	967.00	9,863,400
横河ブリッジホールディングス	28,700	2,627.00	75,394,900
駒井ハルテック	700	1,625.00	1,137,500
高田機工	900	1,101.00	990,900
三和ホールディングス	182,600	3,674.00	670,872,400

文化シャッター	48,000	1,823.00	87,504,000
三協立山	23,100	765.00	17,671,500
アルインコ	14,000	971.00	13,594,000
東洋シャッター	900	788.00	709,200
L I X I L	286,300	1,646.00	471,249,800
日本フィルコン	2,600	528.00	1,372,800
ノーリツ	25,800	1,813.00	46,775,400
長府製作所	20,500	1,968.00	40,344,000
リンナイ	87,700	3,420.00	299,934,000
ダイニチ工業	2,000	605.00	1,210,000
日東精工	26,600	572.00	15,215,200
三洋工業	500	3,080.00	1,540,000
岡部	32,700	784.00	25,636,800
ジーテクト	23,400	1,558.00	36,457,200
東プレ	32,300	1,759.00	56,815,700
高周波熱錬	27,100	995.00	26,964,500
東京製網	11,900	1,111.00	13,220,900
サンコール	20,400	375.00	7,650,000
モリテック スチール	3,500	183.00	640,500
パイオラックス	22,200	2,458.00	54,567,600
エイチワン	18,900	931.00	17,595,900
日本発條	162,200	1,862.50	302,097,500
中央発條	13,600	1,221.00	16,605,600
アドバネクス	500	814.00	407,000
立川ブラインド工業	8,300	1,330.00	11,039,000
日本ドライケミカル	900	3,290.00	2,961,000
日本製鋼所	49,400	5,575.00	275,405,000
三浦工業	74,900	3,641.00	272,710,900
タクマ	60,700	1,608.00	97,605,600
ツガミ	38,300	1,446.00	55,381,800
オークマ	31,400	3,154.00	99,035,600
芝浦機械	16,900	3,800.00	64,220,000
アマダ	272,000	1,541.00	419,152,000
アイダエンジニアリング	41,500	780.00	32,370,000
F U J I	84,500	2,264.00	191,308,000
牧野フライス製作所	19,900	5,980.00	119,002,000
オーエスジー	79,100	1,823.50	144,238,850
ダイジェット工業	400	718.00	287,200
旭ダイヤモンド工業	41,400	856.00	35,438,400
D M G 森精機	113,200	2,902.00	328,506,400
ソディック	47,400	788.00	37,351,200
ディスコ	86,400	39,540.00	3,416,256,000

日東工器	8,300	2,542.00	21,098,600
日進工具	16,700	750.00	12,525,000
パンチ工業	3,900	431.00	1,680,900
富士ダイス	13,300	793.00	10,546,900
豊和工業	2,100	917.00	1,925,700
リケンNPR	19,500	2,341.00	45,649,500
東洋機械金属	3,200	625.00	2,000,000
エンシュウ	1,000	620.00	620,000
島精機製作所	28,600	1,152.00	32,947,200
オプトラン	29,500	1,906.00	56,227,000
イワキポンプ	12,000	2,912.00	34,944,000
フリー	16,900	1,071.00	18,099,900
ヤマシンフィルタ	42,700	478.00	20,410,600
日阪製作所	19,600	1,030.00	20,188,000
やまびこ	29,300	2,555.00	74,861,500
野村マイクロ・サイエンス	24,300	2,233.00	54,261,900
平田機工	8,600	5,010.00	43,086,000
PEGASUS	19,800	476.00	9,424,800
マルマエ	7,800	1,583.00	12,347,400
タツモ	12,800	3,575.00	45,760,000
ナプテスコ	112,600	2,464.50	277,502,700
三井海洋開発	22,700	3,160.00	71,732,000
レオン自動機	20,800	1,395.00	29,016,000
SMC	53,700	64,250.00	3,450,225,000
ホソカワミクロン	12,500	4,120.00	51,500,000
ユニオンツール	7,900	6,850.00	54,115,000
瑞光	12,900	1,370.00	17,673,000
オイレス工業	24,300	1,969.00	47,846,700
日精エー・エス・ビー機械	6,100	4,545.00	27,724,500
サトーホールディングス	24,600	2,160.00	53,136,000
技研製作所	16,900	1,862.00	31,467,800
日本エアテック	8,400	1,217.00	10,222,800
カワタ	1,200	802.00	962,400
日精樹脂工業	13,400	934.00	12,515,600
オカダアイヨン	1,300	2,065.00	2,684,500
ワイエイシイホールディングス	8,400	2,288.00	19,219,200
小松製作所	841,100	4,003.00	3,366,923,300
住友重機械工業	106,200	3,494.00	371,062,800
日立建機	71,500	3,452.00	246,818,000
日工	26,600	697.00	18,540,200
巴工業	7,000	3,970.00	27,790,000
井関農機	16,800	995.00	16,716,000



T O W A	60,000	2,021.00	121,260,000
丸山製作所	700	2,255.00	1,578,500
北川鉄工所	7,100	1,239.00	8,796,900
ローツェ	93,800	2,076.00	194,728,800
タカキタ	1,300	412.00	535,600
クボタ	938,200	1,994.00	1,870,770,800
荏原実業	8,600	4,060.00	34,916,000
三菱化工機	6,300	3,570.00	22,491,000
月島ホールディングス	24,300	1,381.00	33,558,300
帝国電機製作所	12,300	2,879.00	35,411,700
新東工業	36,300	1,003.00	36,408,900
澁谷工業	16,800	3,655.00	61,404,000
アイチ コーポレーション	24,800	1,273.00	31,570,400
小森コーポレーション	44,200	1,113.00	49,194,600
鶴見製作所	13,700	4,265.00	58,430,500
日本ギア工業	1,500	464.00	696,000
酒井重工業	7,000	2,432.00	17,024,000
荏原製作所	368,400	2,362.00	870,160,800
西島製作所	15,500	2,910.00	45,105,000
北越工業	18,100	1,861.00	33,684,100
ダイキン工業	214,200	18,790.00	4,024,818,000
オルガノ	21,600	7,350.00	158,760,000
トーヨーカネツ	6,100	4,340.00	26,474,000
栗田工業	100,400	5,871.00	589,448,400
椿本チエイン	73,800	1,917.00	141,474,600
大同工業	1,700	840.00	1,428,000
木村化工機	13,700	738.00	10,110,600
アネスト岩田	27,800	1,424.00	39,587,200
ダイフク	302,900	2,773.50	840,093,150
サムコ	4,300	3,445.00	14,813,500
加藤製作所	2,000	1,243.00	2,486,000
油研工業	700	2,128.00	1,489,600
タダノ	103,300	958.40	99,002,720
フジテック	41,900	4,962.00	207,907,800
C K D	49,600	2,758.00	136,796,800
平和	53,100	2,149.00	114,111,900
理想科学工業	14,400	3,360.00	48,384,000
S A N K Y O	172,800	2,130.00	368,064,000
日本金銭機械	21,700	924.00	20,050,800
マースグループホールディングス	9,100	3,245.00	29,529,500
フクシマガリレイ	11,700	5,720.00	66,924,000
オーイズミ	1,500	350.00	525,000

ダイコク電機	8,800	3,630.00	31,944,000
竹内製作所	32,600	4,770.00	155,502,000
アマノ	50,900	4,454.00	226,708,600
JUKI	27,900	398.00	11,104,200
ジャノメ	18,200	907.00	16,507,400
マックス	25,300	3,590.00	90,827,000
グローリー	43,100	2,521.00	108,655,100
新晃工業	18,100	4,505.00	81,540,500
大和冷機工業	27,500	1,441.00	39,627,500
セガサミーホールディングス	160,300	2,942.00	471,602,600
T P R	22,800	2,284.00	52,075,200
ツバキ・ナカシマ	44,300	697.00	30,877,100
ホシザキ	115,500	5,222.00	603,141,000
大豊工業	15,500	631.00	9,780,500
日本精工	332,200	699.50	232,373,900
NTN	389,300	252.10	98,142,530
ジェイテクト	159,700	1,012.00	161,616,400
不二越	13,300	3,195.00	42,493,500
日本トムソン	48,900	478.00	23,374,200
THK	103,500	2,512.00	259,992,000
ユーシン精機	14,200	670.00	9,514,000
前澤給装工業	12,900	1,300.00	16,770,000
イーグル工業	19,800	2,093.00	41,441,400
前澤工業	2,400	1,217.00	2,920,800
P I L L A R	16,600	4,480.00	74,368,000
キッツ	60,100	1,070.00	64,307,000
マキタ	204,700	4,815.00	985,630,500
三井E & S	89,100	1,118.00	99,613,800
カナデビア	158,400	1,017.00	161,092,800
三菱重工業	3,138,200	2,219.00	6,963,665,800
I H I	133,600	7,969.00	1,064,658,400
スター精密	30,300	1,975.00	59,842,500
日清紡ホールディングス	134,900	975.60	131,608,440
イビデン	93,600	4,952.00	463,507,200
コニカミノルタ	401,300	486.80	195,352,840
ブラザー工業	239,800	3,020.00	724,196,000
ミネベアミツミ	312,200	2,800.50	874,316,100
日立製作所	4,312,300	3,955.00	17,055,146,500
三菱電機	1,965,700	2,368.00	4,654,777,600
富士電機	109,100	8,105.00	884,255,500
東洋電機製造	1,400	1,140.00	1,596,000
安川電機	194,900	4,383.00	854,246,700

シンフォニアテクノロジー	19,800	5,120.00	101,376,000
明電舎	33,300	3,900.00	129,870,000
オリジン	900	1,230.00	1,107,000
山洋電気	7,800	9,190.00	71,682,000
デンヨー	13,700	2,575.00	35,277,500
PHCホールディングス	33,800	1,020.00	34,476,000
KOKUSAI ELECTRIC	93,900	2,970.00	278,883,000
ソシオネクスト	131,000	2,962.00	388,022,000
東芝テック	23,000	3,475.00	79,925,000
芝浦メカトロニクス	10,200	10,410.00	106,182,000
マブチモーター	78,900	2,230.00	175,947,000
ニデック	792,400	2,889.00	2,289,243,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,900	367.00	4,367,300
トレックス・セミコンダクター	9,400	1,527.00	14,353,800
東光高岳	10,900	1,814.00	19,772,600
ダブル・スコープ	51,400	343.00	17,630,200
ダイヘン	17,000	6,470.00	109,990,000
ヤーマン	35,200	870.00	30,624,000
JVCケンウッド	141,800	1,253.00	177,675,400
ミマキエンジニアリング	17,200	1,340.00	23,048,000
I - P E X	10,100	1,552.00	15,675,200
大崎電気工業	38,500	795.00	30,607,500
オムロン	137,000	6,230.00	853,510,000
日東工業	24,200	2,973.00	71,946,600
I D E C	26,500	2,506.00	66,409,000
正興電機製作所	1,400	1,329.00	1,860,600
不二電機工業	900	1,082.00	973,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	70,100	2,761.00	193,546,100
サクサ	900	2,454.00	2,208,600
メルコホールディングス	5,700	2,382.00	13,577,400
テクノメディカ	4,500	1,848.00	8,316,000
日本電気	235,700	13,330.00	3,141,881,000
富士通	1,651,300	3,059.00	5,051,326,700
沖電気工業	81,100	1,018.00	82,559,800
電気興業	7,200	1,974.00	14,212,800
サンケン電気	16,700	6,351.00	106,061,700
ナカヨ	600	1,114.00	668,400
アイホン	9,700	3,035.00	29,439,500
ルネサスエレクトロニクス	1,367,300	2,053.00	2,807,066,900
セイコーエプソン	230,200	2,791.00	642,488,200
ワコム	126,500	684.00	86,526,000
アルバック	39,400	7,272.00	286,516,800

アクセル	9,100	1,410.00	12,831,000
E I Z O	26,200	2,225.00	58,295,000
日本信号	40,900	952.00	38,936,800
京三製作所	37,600	562.00	21,131,200
能美防災	24,300	2,747.00	66,752,100
ホーチキ	13,500	2,159.00	29,146,500
星和電機	2,000	525.00	1,050,000
エレコム	43,100	1,473.00	63,486,300
パナソニック ホールディングス	2,120,000	1,276.00	2,705,120,000
シャープ	302,500	991.20	299,838,000
アンリツ	126,400	1,125.50	142,263,200
富士通ゼネラル	50,900	2,040.00	103,836,000
ソニーグループ	6,221,000	2,710.00	16,858,910,000
T D K	1,421,000	1,798.50	2,555,668,500
帝国通信工業	8,000	2,651.00	21,208,000
タムラ製作所	71,500	579.00	41,398,500
アルプスアルパイン	160,400	1,557.50	249,823,000
池上通信機	1,200	675.00	810,000
日本電波工業	21,700	1,081.00	23,457,700
鈴木	9,700	1,915.00	18,575,500
メイコー	17,900	6,160.00	110,264,000
日本トリム	4,100	3,615.00	14,821,500
フォスター電機	13,300	1,807.00	24,033,100
S M K	4,800	2,277.00	10,929,600
ヨコオ	16,000	1,575.00	25,200,000
ホシデン	40,900	2,191.00	89,611,900
ヒロセ電機	26,100	18,555.00	484,285,500
日本航空電子工業	42,900	2,598.00	111,454,200
T O A	20,400	980.00	19,992,000
マクセル	39,800	1,884.00	74,983,200
古野電気	23,500	2,271.00	53,368,500
スミダコーポレーション	24,400	933.00	22,765,200
アイコム	6,900	2,872.00	19,816,800
リオン	7,500	2,225.00	16,687,500
横河電機	196,300	3,581.00	702,950,300
新電元工業	6,900	2,423.00	16,718,700
アズビル	488,800	1,222.00	597,313,600
東亜ディーケーケー	2,000	778.00	1,556,000
日本光電工業	152,100	2,210.50	336,217,050
チノー	7,400	2,278.00	16,857,200
共和電業	3,900	416.00	1,622,400
日本電子材料	10,900	2,503.00	27,282,700

堀場製作所	33,700	9,433.00	317,892,100
アドバンテスト	509,000	8,181.00	4,164,129,000
小野測器	2,100	572.00	1,201,200
エスベック	14,300	2,665.00	38,109,500
キーエンス	177,800	66,890.00	11,893,042,000
日置電機	9,300	8,340.00	77,562,000
シスメックス	460,100	2,882.00	1,326,008,200
日本マイクロニクス	29,300	3,790.00	111,047,000
メガチップス	13,800	5,380.00	74,244,000
O B A R A G R O U P	11,200	4,205.00	47,096,000
澤藤電機	600	1,053.00	631,800
原田工業	2,000	540.00	1,080,000
コーセル	19,200	1,189.00	22,828,800
イリソ電子工業	16,400	2,580.00	42,312,000
オブテックスグループ	32,700	1,632.00	53,366,400
千代田インテグレ	6,200	3,535.00	21,917,000
レーザーテック	81,500	21,745.00	1,772,217,500
スタンレー電気	113,800	2,623.00	298,497,400
ウシオ電機	78,700	2,062.50	162,318,750
岡谷電機産業	3,700	233.00	862,100
ヘリオス テクノ ホールディング	4,100	952.00	3,903,200
エノモト	1,200	1,396.00	1,675,200
日本セラミック	16,400	2,583.00	42,361,200
遠藤照明	1,800	1,302.00	2,343,600
古河電池	13,200	1,377.00	18,176,400
山一電機	16,100	2,517.00	40,523,700
図研	14,900	3,790.00	56,471,000
日本電子	44,600	5,578.00	248,778,800
カシオ計算機	128,400	1,155.00	148,302,000
ファナック	859,800	3,958.00	3,403,088,400
日本シイエムケイ	42,300	412.00	17,427,600
エンプラス	5,200	6,800.00	35,360,000
大真空	26,900	615.00	16,543,500
ローム	322,100	1,710.00	550,791,000
浜松ホトニクス	285,400	2,002.50	571,513,500
三井ハイテック	78,900	879.90	69,424,110
新光電気工業	62,900	5,405.00	339,974,500
京セラ	1,104,100	1,698.50	1,875,313,850
太陽誘電	86,600	2,857.50	247,459,500
村田製作所	1,587,200	2,829.00	4,490,188,800
双葉電子工業	34,300	508.00	17,424,400
北陸電気工業	1,600	1,256.00	2,009,600

ニチコン	46,900	980.00	45,962,000
日本ケミコン	19,100	1,080.00	20,628,000
K O A	27,100	1,131.00	30,650,100
市光工業	32,600	444.00	14,474,400
小糸製作所	184,200	2,010.00	370,242,000
ミツバ	33,300	866.00	28,837,800
S C R E E Nホールディングス	60,700	9,830.00	596,681,000
キャノン電子	16,900	2,309.00	39,022,100
キャノン	886,200	5,022.00	4,450,496,400
リコー	445,500	1,641.50	731,288,250
象印マホービン	53,200	1,641.00	87,301,200
M U T O Hホールディングス	600	2,397.00	1,438,200
東京エレクトロン	376,000	23,720.00	8,918,720,000
イノテック	12,000	1,524.00	18,288,000
トヨタ紡織	74,800	1,910.00	142,868,000
芦森工業	800	2,500.00	2,000,000
ユニプレス	31,900	1,122.00	35,791,800
豊田自動織機	151,500	11,050.00	1,674,075,000
モリタホールディングス	31,200	1,989.00	62,056,800
三櫻工業	27,200	727.00	19,774,400
デンソー	1,465,900	2,083.50	3,054,202,650
東海理化電機製作所	50,100	1,963.00	98,346,300
川崎重工業	145,000	6,182.00	896,390,000
名村造船所	55,300	1,538.00	85,051,400
日本車輛製造	5,900	2,207.00	13,021,300
三菱ロジスネクスト	28,400	1,184.00	33,625,600
近畿車輛	500	1,461.00	730,500
日産自動車	2,337,800	399.10	933,015,980
いすゞ自動車	498,900	1,965.50	980,587,950
トヨタ自動車	9,445,100	2,541.50	24,004,721,650
日野自動車	267,200	459.50	122,778,400
三菱自動車工業	693,100	403.90	279,943,090
エフテック	2,700	527.00	1,422,900
レシップホールディングス	1,800	513.00	923,400
G M B	800	1,180.00	944,000
ファルテック	800	451.00	360,800
武蔵精密工業	43,400	1,958.00	84,977,200
日産車体	18,000	1,079.00	19,422,000
新明和工業	51,200	1,401.00	71,731,200
極東開発工業	29,300	2,536.00	74,304,800
トピー工業	14,400	1,970.00	28,368,000
ティラド	3,900	3,390.00	13,221,000

曙ブレーキ工業	108,400	123.00	13,333,200
タチエス	32,800	1,790.00	58,712,000
NOK	69,000	2,204.00	152,076,000
フタバ産業	47,700	700.00	33,390,000
カヤバ	16,800	4,845.00	81,396,000
大同メタル工業	34,800	496.00	17,260,800
プレス工業	71,000	555.00	39,405,000
ミクニ	4,900	329.00	1,612,100
太平洋工業	40,800	1,352.00	55,161,600
アイシン	376,200	1,598.50	601,355,700
マツダ	587,700	1,054.50	619,729,650
今仙電機製作所	2,500	535.00	1,337,500
本田技研工業	4,209,800	1,525.50	6,422,049,900
スズキ	1,305,300	1,505.50	1,965,129,150
S U B A R U	551,000	2,611.50	1,438,936,500
安永	1,700	533.00	906,100
ヤマハ発動機	749,900	1,353.50	1,014,989,650
T B K	4,300	282.00	1,212,600
エクセディ	29,100	3,600.00	104,760,000
豊田合成	50,900	2,555.50	130,074,950
愛三工業	29,500	1,401.00	41,329,500
盟和産業	600	1,188.00	712,800
日本プラスト	3,300	355.00	1,171,500
ヨロズ	16,700	1,128.00	18,837,600
エフ・シー・シー	31,400	2,370.00	74,418,000
シマノ	77,600	24,390.00	1,892,664,000
テイ・エス テック	63,300	1,726.50	109,287,450
ジャムコ	10,700	1,236.00	13,225,200
テルモ	990,500	2,945.00	2,917,022,500
クリエートメディック	1,200	935.00	1,122,000
日機装	46,000	1,014.00	46,644,000
日本エム・ディ・エム	14,100	690.00	9,729,000
島津製作所	236,100	4,637.00	1,094,795,700
J M S	16,400	483.00	7,921,200
長野計器	12,900	2,492.00	32,146,800
ブイ・テクノロジー	9,400	2,496.00	23,462,400
東京計器	13,600	3,100.00	42,160,000
愛知時計電機	7,700	1,995.00	15,361,500
インターアクション	10,700	1,122.00	12,005,400
オーバル	3,400	373.00	1,268,200
東京精密	36,400	7,888.00	287,123,200
マニー	71,100	1,752.00	124,567,200

ニコン	256,900	1,840.00	472,696,000
トプコン	86,400	1,586.50	137,073,600
オリンパス	1,017,200	2,835.50	2,884,270,600
理研計器	25,200	4,325.00	108,990,000
タムロン	24,500	4,450.00	109,025,000
H O Y A	349,800	20,330.00	7,111,434,000
シード	2,300	497.00	1,143,100
ノーリツ鋼機	16,800	3,990.00	67,032,000
A & Dホロンホールディングス	25,900	2,155.00	55,814,500
朝日インテック	216,600	2,492.00	539,767,200
シチズン時計	163,500	933.00	152,545,500
リズム	900	3,965.00	3,568,500
大研医器	3,300	499.00	1,646,700
メニコン	61,100	1,575.00	96,232,500
シンシア	400	464.00	185,600
松風	16,000	2,240.00	35,840,000
セイコーグループ	24,800	3,935.00	97,588,000
ニプロ	148,100	1,410.50	208,895,050
三井松島ホールディングス	14,800	4,570.00	67,636,000
K Y O R I T S U	5,700	151.00	860,700
中本パックス	1,300	1,697.00	2,206,100
パラマウントベッドホールディングス	36,900	2,528.00	93,283,200
トランザクション	11,700	2,616.00	30,607,200
粧美堂	1,000	509.00	509,000
ニホンフラッシュ	16,700	897.00	14,979,900
前田工織	31,700	1,787.00	56,647,900
永大産業	4,500	218.00	981,000
アートネイチャー	16,000	855.00	13,680,000
フルヤ金属	16,900	3,935.00	66,501,500
バンダイナムコホールディングス	482,400	3,194.00	1,540,785,600
アイフィスジャパン	1,100	574.00	631,400
S H O E I	50,000	2,337.00	116,850,000
フランスベッドホールディングス	23,000	1,280.00	29,440,000
パイロットコーポレーション	27,800	4,704.00	130,771,200
萩原工業	11,900	1,581.00	18,813,900
フジシールインターナショナル	36,000	2,541.00	91,476,000
タカラトミー	80,900	3,947.00	319,312,300
広済堂ホールディングス	57,500	530.00	30,475,000
エステールホールディングス	900	618.00	556,200
タカノ	1,400	732.00	1,024,800
プロネクサス	18,400	1,318.00	24,251,200
ホクシン	2,900	107.00	310,300



ウッドワン	1,400	785.00	1,099,000
TOPPANホールディングス	211,800	4,307.00	912,222,600
大日本印刷	368,400	2,592.00	954,892,800
共同印刷	5,000	3,405.00	17,025,000
NISSHA	30,400	1,829.00	55,601,600
光村印刷	300	1,516.00	454,800
TAKARA & COMPANY	10,500	2,655.00	27,877,500
アシックス	656,000	2,727.00	1,788,912,000
ツツミ	4,200	2,086.00	8,761,200
ローランド	13,100	3,940.00	51,614,000
小松ウオール工業	14,400	1,536.00	22,118,400
ヤマハ	324,600	1,256.50	407,859,900
河合楽器製作所	5,400	2,759.00	14,898,600
クリナップ	17,400	707.00	12,301,800
ピジョン	113,200	1,657.00	187,572,400
キングジム	15,700	855.00	13,423,500
リンテック	35,700	3,250.00	116,025,000
イトーキ	35,500	1,565.00	55,557,500
任天堂	1,121,700	8,051.00	9,030,806,700
三菱鉛筆	24,600	2,420.00	59,532,000
タカラスタANDARD	36,300	1,650.00	59,895,000
コクヨ	88,800	2,618.50	232,522,800
ナカバヤシ	19,100	522.00	9,970,200
グローブライド	15,900	1,882.00	29,923,800
オカムラ	53,500	1,997.00	106,839,500
美津濃	17,700	8,290.00	146,733,000
グリムス	7,900	2,771.00	21,890,900
東京電力ホールディングス	1,601,600	621.60	995,554,560
中部電力	654,700	1,699.50	1,112,662,650
関西電力	686,100	2,541.00	1,743,380,100
中国電力	308,700	1,048.50	323,671,950
北陸電力	181,700	924.00	167,890,800
東北電力	467,800	1,442.50	674,801,500
四国電力	165,500	1,236.00	204,558,000
九州電力	409,600	1,641.00	672,153,600
北海道電力	171,700	979.50	168,180,150
沖縄電力	45,400	1,013.00	45,990,200
電源開発	145,900	2,423.50	353,588,650
エフオン	12,900	364.00	4,695,600
イーレックス	31,600	649.00	20,508,400
レノバ	47,400	871.00	41,285,400
東京瓦斯	345,900	3,203.00	1,107,917,700

大阪瓦斯	354,100	3,181.00	1,126,392,100
東邦瓦斯	76,900	3,811.00	293,065,900
北海道瓦斯	53,000	589.00	31,217,000
広島ガス	37,500	383.00	14,362,500
西部ガスホールディングス	18,500	1,764.00	32,634,000
静岡ガス	40,500	1,012.00	40,986,000
メタウォーター	21,300	1,831.00	39,000,300
SBSホールディングス	15,800	2,575.00	40,685,000
東武鉄道	195,200	2,462.00	480,582,400
相鉄ホールディングス	63,600	2,319.50	147,520,200
東急	498,200	1,835.50	914,446,100
京浜急行電鉄	219,900	1,194.50	262,670,550
小田急電鉄	293,800	1,593.00	468,023,400
京王電鉄	85,400	3,443.00	294,032,200
京成電鉄	114,600	3,885.00	445,221,000
富士急行	21,900	2,536.00	55,538,400
東日本旅客鉄道	979,200	3,011.00	2,948,371,200
西日本旅客鉄道	421,500	2,718.50	1,145,847,750
東海旅客鉄道	684,400	3,188.00	2,181,867,200
西武ホールディングス	214,900	3,297.00	708,525,300
鴻池運輸	30,300	2,556.00	77,446,800
西日本鉄道	47,500	2,255.50	107,136,250
ハマキョウレックス	60,800	1,300.00	79,040,000
サカイ引越センター	19,700	2,456.00	48,383,200
近鉄グループホールディングス	177,400	3,602.00	638,994,800
阪急阪神ホールディングス	236,500	4,196.00	992,354,000
南海電気鉄道	79,100	2,277.50	180,150,250
京阪ホールディングス	97,800	2,856.00	279,316,800
神戸電鉄	4,800	2,406.00	11,548,800
名古屋鉄道	183,000	1,704.00	311,832,000
山陽電気鉄道	13,400	2,028.00	27,175,200
ヤマトホールディングス	215,600	1,626.00	350,565,600
山九	42,800	4,856.00	207,836,800
丸運	2,200	464.00	1,020,800
丸全昭和運輸	11,000	5,730.00	63,030,000
センコーグループホールディングス	93,900	1,356.00	127,328,400
トナミホールディングス	3,900	5,950.00	23,205,000
ニッコンホールディングス	109,200	1,900.50	207,534,600
日本石油輸送	400	2,736.00	1,094,400
福山通運	16,300	3,905.00	63,651,500
セイノーホールディングス	99,800	2,412.50	240,767,500
神奈川中央交通	5,000	3,400.00	17,000,000

A Z - C O M丸和ホールディングス	45,300	1,071.00	48,516,300
九州旅客鉄道	125,400	3,965.00	497,211,000
S Gホールディングス	297,800	1,509.00	449,380,200
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,200	7,633.00	505,304,600
日本郵船	459,500	5,238.00	2,406,861,000
商船三井	385,400	5,055.00	1,948,197,000
川崎汽船	403,800	2,161.00	872,611,800
N Sユナイテッド海運	9,700	4,620.00	44,814,000
飯野海運	65,500	1,278.00	83,709,000
共栄タンカー	1,000	1,140.00	1,140,000
乾汽船	21,200	1,151.00	24,401,200
日本航空	435,700	2,410.50	1,050,254,850
A N Aホールディングス	482,700	2,942.50	1,420,344,750
パスコ	700	2,129.00	1,490,300
トランコム	5,100	10,410.00	53,091,000
日新	13,500	4,325.00	58,387,500
三菱倉庫	42,300	5,207.00	220,256,100
三井倉庫ホールディングス	16,600	6,860.00	113,876,000
住友倉庫	47,400	2,707.00	128,311,800
澁澤倉庫	8,100	3,200.00	25,920,000
東陽倉庫	1,000	1,325.00	1,325,000
日本トランスシティ	35,700	966.00	34,486,200
ケイヒン	700	2,022.00	1,415,400
中央倉庫	9,500	1,655.00	15,722,500
川西倉庫	700	1,110.00	777,000
安田倉庫	12,100	1,710.00	20,691,000
ファイズホールディングス	600	841.00	504,600
東洋埠頭	1,100	1,267.00	1,393,700
上組	81,900	3,206.00	262,571,400
サンリツ	900	757.00	681,300
キムラユニティー	1,800	1,541.00	2,773,800
キューソー流通システム	11,800	1,891.00	22,313,800
東海運	2,200	321.00	706,200
エーアイティー	11,100	1,790.00	19,869,000
内外トランスライン	7,100	2,894.00	20,547,400
日本コンセプト	6,500	1,788.00	11,622,000
N E C ネットズエスアイ	69,500	2,683.00	186,468,500
クロスキャット	11,300	1,124.00	12,701,200
システナ	269,600	370.00	99,752,000
デジタルアーツ	11,300	5,270.00	59,551,000
日鉄ソリューションズ	60,800	3,570.00	217,056,000
キューブシステム	9,400	1,006.00	9,456,400

コア	7,900	1,947.00	15,381,300
手間いらず	3,000	3,320.00	9,960,000
ラクーンホールディングス	13,300	716.00	9,522,800
ソリトンシステムズ	9,200	1,298.00	11,941,600
ソフトクリエイイトホールディングス	14,700	2,075.00	30,502,500
T I S	188,400	3,750.00	706,500,000
テクミラホールディングス	1,800	329.00	592,200
グリー	59,700	483.00	28,835,100
G M Oペパボ	2,200	1,397.00	3,073,400
コーエーテクモホールディングス	111,700	1,570.00	175,369,000
三菱総合研究所	8,700	4,260.00	37,062,000
電算	500	1,410.00	705,000
A G S	1,600	812.00	1,299,200
ファインデックス	14,200	851.00	12,084,200
ブレインパッド	14,800	828.00	12,254,400
K L a b	43,300	190.00	8,227,000
ポールトゥウィンホールディングス	30,400	466.00	14,166,400
ネクソン	391,200	2,629.00	1,028,464,800
アイスタイル	59,600	465.00	27,714,000
エムアップホールディングス	21,800	1,322.00	28,819,600
エイチーム	11,900	654.00	7,782,600
エニグモ	22,700	315.00	7,150,500
テクノスジャパン	3,400	657.00	2,233,800
コロプラ	60,500	538.00	32,549,000
ブロードリーフ	71,600	596.00	42,673,600
クロス・マーケティンググループ	1,800	700.00	1,260,000
デジタルハーツホールディングス	11,100	868.00	9,634,800
メディアドゥ	8,100	1,299.00	10,521,900
じげん	52,000	617.00	32,084,000
ブイキューブ	24,600	227.00	5,584,200
エンカレッジ・テクノロジー	900	609.00	548,100
サイバーリンクス	1,500	756.00	1,134,000
フィックスターズ	17,900	1,530.00	27,387,000
C A R T A H O L D I N G S	10,100	1,455.00	14,695,500
オブティム	18,400	625.00	11,500,000
セレス	8,000	1,412.00	11,296,000
S H I F T	11,800	14,605.00	172,339,000
ティーガイア	18,600	2,667.00	49,606,200
セック	2,700	4,170.00	11,259,000
テクマトリックス	32,500	2,305.00	74,912,500
プロシップ	8,600	1,493.00	12,839,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,200	3,381.00	149,440,200

GMOペイメントゲートウェイ	40,700	9,171.00	373,259,700
ザッパラス	900	364.00	327,600
システムリサーチ	12,200	1,439.00	17,555,800
インターネットイニシアティブ	85,200	2,945.50	250,956,600
さくらインターネット	22,300	4,130.00	92,099,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,826.00	15,260,400
SRAホールディングス	9,100	4,320.00	39,312,000
システムインテグレータ	1,200	324.00	388,800
朝日ネット	19,200	634.00	12,172,800
eBASE	25,100	662.00	16,616,200
アバントグループ	22,500	2,219.00	49,927,500
アドソル日進	7,500	1,818.00	13,635,000
ODKソリューションズ	800	570.00	456,000
フリービット	7,800	1,179.00	9,196,200
コムチュア	25,700	1,904.00	48,932,800
アステリア	14,000	519.00	7,266,000
アイル	10,000	3,215.00	32,150,000
マークラインズ	10,500	2,950.00	30,975,000
メディカル・データ・ビジョン	21,300	530.00	11,289,000
gumi	29,000	310.00	8,990,000
ショーケース	900	292.00	262,800
モバイルファクトリー	800	868.00	694,400
テラスカイ	7,700	1,820.00	14,014,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	9,300	2,163.00	20,115,900
PCIホールディングス	100	1,003.00	100,300
アイビーシー	600	506.00	303,600
ネオジャパン	5,900	1,942.00	11,457,800
PR TIMES	3,600	1,579.00	5,684,400
ラクス	84,300	2,107.00	177,620,100
ランドコンピュータ	1,900	747.00	1,419,300
ダブルスタンダード	5,400	1,715.00	9,261,000
オープンドア	10,400	702.00	7,300,800
アカツキ	8,700	2,014.00	17,521,800
ベネフィットジャパン	200	1,133.00	226,600
Ubicomホールディングス	5,700	1,428.00	8,139,600
カナミックネットワーク	22,400	581.00	13,014,400
ノムラシステムコーポレーション	4,300	115.00	494,500
チェンジホールディングス	39,300	1,237.00	48,614,100
シンクロ・フード	2,500	490.00	1,225,000
オークネット	8,200	2,536.00	20,795,200
キャピタル・アセット・プランニング	800	710.00	568,000
セグエグループ	3,500	579.00	2,026,500

エイトレッド	600	1,651.00	990,600
マクロミル	35,000	821.00	28,735,000
ビーグリー	700	1,450.00	1,015,000
オロ	7,500	2,309.00	17,317,500
ユーザーローカル	7,500	1,816.00	13,620,000
テモナ	900	190.00	171,000
ニーズウェル	4,200	289.00	1,213,800
マネーフォワード	43,600	5,470.00	238,492,000
サインポスト	1,500	500.00	750,000
Sun Asterisk	12,700	545.00	6,921,500
プラスアルファ・コンサルティング	22,500	2,126.00	47,835,000
電算システムホールディングス	7,900	2,705.00	21,369,500
Appier Group	54,300	1,748.00	94,916,400
ビジョナル	21,100	8,080.00	170,488,000
ソルクシーズ	3,100	289.00	895,900
フェイス	1,100	394.00	433,400
ハイマックス	5,600	1,390.00	7,784,000
野村総合研究所	385,900	4,999.00	1,929,114,100
CEホールディングス	1,800	447.00	804,600
日本システム技術	16,500	1,838.00	30,327,000
インテージホールディングス	20,200	1,595.00	32,219,000
東邦システムサイエンス	8,300	1,466.00	12,167,800
ソースネクスト	81,600	208.00	16,972,800
シンプレクス・ホールディングス	27,100	2,357.00	63,874,700
HEROZ	7,000	1,352.00	9,464,000
ラクスル	43,100	1,281.00	55,211,100
メルカリ	87,000	2,372.00	206,364,000
I P S	5,100	2,348.00	11,974,800
F I G	4,500	308.00	1,386,000
システムサポート	6,900	1,897.00	13,089,300
イーソル	12,000	724.00	8,688,000
東海ソフト	600	1,260.00	756,000
ウイングアーク1st	18,500	3,245.00	60,032,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	6,000	815.00	4,890,000
サーバーワークス	3,700	2,327.00	8,609,900
東名	800	1,920.00	1,536,000
ヴィッツ	400	802.00	320,800
トビラシステムズ	1,100	780.00	858,000
Sansan	58,600	2,315.00	135,659,000
Link-Uグループ	800	494.00	395,200
ギフトィ	15,700	909.00	14,271,300
メドレー	19,600	4,115.00	80,654,000

ベース	8,700	3,050.00	26,535,000
JMDC	30,400	4,567.00	138,836,800
フォーカスシステムズ	11,900	1,107.00	13,173,300
クレスコ	29,200	1,268.00	37,025,600
フジ・メディア・ホールディングス	171,200	1,692.50	289,756,000
オービック	298,000	4,845.00	1,443,810,000
ジャストシステム	25,600	3,460.00	88,576,000
TDCソフト	33,400	1,225.00	40,915,000
LINEヤフー	2,537,300	427.90	1,085,710,670
トレンドマイクロ	93,600	8,058.00	754,228,800
IDホールディングス	12,000	1,430.00	17,160,000
日本オラクル	34,100	15,260.00	520,366,000
アルファシステムズ	4,700	3,260.00	15,322,000
フューチャー	44,300	1,765.00	78,189,500
CAC Holdings	10,900	1,758.00	19,162,200
トーセ	1,100	629.00	691,900
オービックビジネスコンサルタント	25,100	7,341.00	184,259,100
アイティフォー	22,800	1,344.00	30,643,200
東計電算	5,000	4,815.00	24,075,000
エクスネット	500	1,451.00	725,500
大塚商会	202,000	3,435.00	693,870,000
サイボウズ	24,500	2,140.00	52,430,000
電通総研	17,300	5,440.00	94,112,000
ACCESS	18,500	1,338.00	24,753,000
デジタルガレージ	28,500	3,090.00	88,065,000
EMシステムズ	29,700	547.00	16,245,900
ウェザーニューズ	5,500	5,720.00	31,460,000
CIJ	44,400	415.00	18,426,000
ビジネスエンジニアリング	4,200	4,110.00	17,262,000
日本エンタープライズ	4,100	108.00	442,800
WOWOW	13,400	1,024.00	13,721,600
スカラ	16,500	469.00	7,738,500
インテリジェント ウェイブ	2,000	880.00	1,760,000
ANYCOLOR	25,400	2,249.00	57,124,600
IMAGICA GROUP	17,900	509.00	9,111,100
ネットワンシステムズ	69,400	3,493.00	242,414,200
システムソフト	62,200	62.00	3,856,400
アルゴグラフィックス	16,300	5,240.00	85,412,000
マーベラス	29,000	575.00	16,675,000
エイベックス	30,300	1,523.00	46,146,900
BIPROGY	53,500	4,827.00	258,244,500
都築電気	9,400	2,421.00	22,757,400

TBSホールディングス	89,600	3,881.00	347,737,600
日本テレビホールディングス	157,800	2,389.50	377,063,100
朝日放送グループホールディングス	16,700	623.00	10,404,100
テレビ朝日ホールディングス	43,300	2,037.00	88,202,100
スカパーJ S A Tホールディングス	138,400	882.00	122,068,800
テレビ東京ホールディングス	12,800	3,570.00	45,696,000
日本BS放送	1,400	874.00	1,223,600
ビジョン	26,700	1,136.00	30,331,200
スマートバリュー	1,100	312.00	343,200
U-NEXT HOLDINGS	20,000	4,945.00	98,900,000
ワイヤレスゲート	1,900	244.00	463,600
日本通信	175,500	149.00	26,149,500
クロップス	500	982.00	491,000
日本電信電話	53,005,500	145.70	7,722,901,350
KDDI	1,310,700	4,739.00	6,211,407,300
ソフトバンク	28,482,000	187.30	5,334,678,600
光通信	17,600	31,350.00	551,760,000
エムティーアイ	12,200	1,199.00	14,627,800
GMOインターネットグループ	58,000	2,573.00	149,234,000
ファイバーゲート	9,600	1,035.00	9,936,000
アйдママーケティングコミュニケーション	1,100	215.00	236,500
KADOKAWA	94,200	3,377.00	318,113,400
学研ホールディングス	32,600	988.00	32,208,800
ゼンリン	30,500	845.00	25,772,500
昭文社ホールディングス	1,700	371.00	630,700
インプレスホールディングス	3,900	143.00	557,700
アイネット	10,800	1,568.00	16,934,400
松竹	9,300	9,785.00	91,000,500
東宝	99,100	5,826.00	577,356,600
東映	29,400	4,775.00	140,385,000
NTTデータグループ	465,900	2,414.00	1,124,682,600
ピー・シー・エー	10,200	2,228.00	22,725,600
ビジネスブレイン太田昭和	7,000	1,835.00	12,845,000
DTS	35,200	3,945.00	138,864,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,400	5,885.00	479,039,000
シーイーシー	22,500	1,841.00	41,422,500
カブコン	318,700	3,278.00	1,044,698,600
アイ・エス・ビー	8,400	1,490.00	12,516,000
SCSK	124,700	2,876.50	358,699,550
NSW	7,900	2,923.00	23,091,700
アイネス	13,900	1,614.00	22,434,600
TKC	31,800	3,945.00	125,451,000



富士ソフト	49,300	9,350.00	460,955,000
N S D	62,900	3,265.00	205,368,500
コナミグループ	66,700	14,010.00	934,467,000
福井コンピュータホールディングス	11,000	2,705.00	29,755,000
J B C Cホールディングス	11,800	4,025.00	47,495,000
ミロク情報サービス	16,200	1,852.00	30,002,400
ソフトバンクグループ	879,000	9,135.00	8,029,665,000
リョーサン菱洋ホールディングス	35,400	2,584.00	91,473,600
高千穂交易	7,400	4,160.00	30,784,000
オルパヘルスケアホールディングス	700	1,958.00	1,370,600
伊藤忠食品	4,200	7,030.00	29,526,000
エレマテック	16,900	1,730.00	29,237,000
あらた	28,800	3,560.00	102,528,000
トーメンデバイス	2,700	6,040.00	16,308,000
東京エレクトロン デバイス	18,700	3,550.00	66,385,000
円谷フィールズホールディングス	30,400	2,312.00	70,284,800
双日	209,300	3,334.00	697,806,200
アルフレッサ ホールディングス	188,700	2,315.00	436,840,500
横浜冷凍	47,300	957.00	45,266,100
ラサ商事	9,600	1,460.00	14,016,000
アルコニックス	24,800	1,376.00	34,124,800
神戸物産	145,400	4,184.00	608,353,600
ハイパー	900	317.00	285,300
あい ホールディングス	31,100	2,379.00	73,986,900
ディーブイエックス	1,100	922.00	1,014,200
ダイワボウホールディングス	83,200	2,790.00	232,128,000
マクニカホールディングス	133,500	1,979.00	264,196,500
ラクト・ジャパン	8,000	2,832.00	22,656,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,500	1,313.00	37,420,500
八洲電機	15,200	1,805.00	27,436,000
メディアスホールディングス	10,900	853.00	9,297,700
レスター	16,000	2,693.00	43,088,000
ジオリーブグループ	900	1,101.00	990,900
大光	2,100	617.00	1,295,700
O C H Iホールディングス	900	1,353.00	1,217,700
T O K A Iホールディングス	102,100	939.00	95,871,900
黒谷	1,100	568.00	624,800
C o m i n i x	800	880.00	704,000
三洋貿易	19,300	1,479.00	28,544,700
ビューティガレージ	5,900	1,542.00	9,097,800
ウイン・パートナーズ	12,200	1,244.00	15,176,800
ミタチ産業	1,100	1,170.00	1,287,000

シップヘルスケアホールディングス	67,600	2,351.50	158,961,400
明治電機工業	7,000	1,415.00	9,905,000
デリカフーズホールディングス	1,800	523.00	941,400
スターティアホールディングス	1,100	1,930.00	2,123,000
コメダホールディングス	46,100	2,816.00	129,817,600
ピーバンドットコム	500	371.00	185,500
アセンテック	7,200	691.00	4,975,200
富士興産	1,100	1,475.00	1,622,500
協栄産業	400	2,251.00	900,400
フルサト・マルカホールディングス	15,100	2,162.00	32,646,200
ヤマエグループホールディングス	16,600	1,938.00	32,170,800
小野建	18,900	1,527.00	28,860,300
南陽	1,700	1,054.00	1,791,800
佐島電機	13,100	1,932.00	25,309,200
エコートレーディング	800	932.00	745,600
伯東	10,800	4,585.00	49,518,000
コンドーテック	14,500	1,252.00	18,154,000
中山福	2,200	371.00	816,200
ナガイレーベン	23,700	2,349.00	55,671,300
三菱食品	17,400	5,000.00	87,000,000
松田産業	14,300	3,195.00	45,688,500
第一興商	72,700	1,865.50	135,621,850
メディバルホールディングス	191,100	2,530.50	483,578,550
S P K	8,300	1,998.00	16,583,400
萩原電気ホールディングス	8,100	3,440.00	27,864,000
アズワン	58,300	3,040.00	177,232,000
スズデン	6,600	1,846.00	12,183,600
尾家産業	1,000	1,945.00	1,945,000
シモジマ	12,600	1,348.00	16,984,800
ドウシシャ	17,400	2,187.00	38,053,800
小津産業	900	1,650.00	1,485,000
高速	11,200	2,567.00	28,750,400
たけびし	7,200	2,123.00	15,285,600
リックス	4,700	2,787.00	13,098,900
丸文	16,800	1,073.00	18,026,400
ハピネット	16,000	4,080.00	65,280,000
橋本総業ホールディングス	7,400	1,227.00	9,079,800
日本ライフライン	50,300	1,215.00	61,114,500
タカショー	16,400	495.00	8,118,000
I D O M	49,700	1,283.00	63,765,100
進和	11,500	2,609.00	30,003,500
エスケイジャパン	1,000	687.00	687,000

ダイترون	8,200	2,850.00	23,370,000
シークス	26,800	1,122.00	30,069,600
田中商事	1,200	697.00	836,400
オーハシテクニカ	9,900	1,740.00	17,226,000
白銅	5,300	2,338.00	12,391,400
ダイコー通産	400	1,190.00	476,000
伊藤忠商事	1,263,600	7,572.00	9,567,979,200
丸紅	1,559,300	2,394.50	3,733,743,850
高島	2,700	1,233.00	3,329,100
長瀬産業	84,000	3,167.00	266,028,000
蝶理	11,800	4,110.00	48,498,000
豊田通商	494,000	2,655.50	1,311,817,000
三共生興	26,100	596.00	15,555,600
兼松	78,600	2,348.00	184,552,800
ツカモトコーポレーション	600	1,112.00	667,200
三井物産	2,816,000	3,145.00	8,856,320,000
日本紙パルプ商事	90,000	688.00	61,920,000
カメイ	20,000	1,942.00	38,840,000
東都水産	300	6,090.00	1,827,000
OUGホールディングス	600	2,475.00	1,485,000
スターゼン	13,000	2,877.00	37,401,000
山善	57,000	1,342.00	76,494,000
椿本興業	11,700	1,869.00	21,867,300
住友商事	1,125,900	3,282.00	3,695,203,800
内田洋行	7,600	6,600.00	50,160,000
三菱商事	3,609,600	2,840.00	10,251,264,000
第一実業	17,700	2,291.00	40,550,700
キャノンマーケティングジャパン	43,500	4,660.00	202,710,000
西華産業	7,400	4,005.00	29,637,000
佐藤商事	13,000	1,406.00	18,278,000
東京産業	17,200	712.00	12,246,400
ユアサ商事	14,700	4,795.00	70,486,500
神鋼商事	4,700	6,370.00	29,939,000
トルク	2,900	230.00	667,000
阪和興業	33,800	5,130.00	173,394,000
正栄食品工業	12,500	4,460.00	55,750,000
カナデン	14,100	1,540.00	21,714,000
R Y O D E N	15,200	2,526.00	38,395,200
岩谷産業	171,200	2,023.00	346,337,600
ナイス	1,300	1,679.00	2,182,700
ニチモウ	1,300	1,867.00	2,427,100
極東貿易	11,200	1,484.00	16,620,800

アステナホールディングス	35,400	529.00	18,726,600	
三愛オブリ	43,900	1,876.00	82,356,400	
稲畑産業	37,000	3,290.00	121,730,000	
G S I クレオス	10,100	2,053.00	20,735,300	
明和産業	22,200	644.00	14,296,800	
クワザワホールディングス	1,500	605.00	907,500	
ワキタ	31,100	1,622.00	50,444,200	
東邦ホールディングス	50,800	4,768.00	242,214,400	
サンゲツ	43,300	2,831.00	122,582,300	
ミツウロコグループホールディングス	24,000	1,690.00	40,560,000	
シナネンホールディングス	5,200	6,140.00	31,928,000	
伊藤忠エネクス	46,600	1,559.00	72,649,400	
サンリオ	152,700	4,096.00	625,459,200	
サンワテクノス	9,600	1,973.00	18,940,800	
新光商事	25,300	958.00	24,237,400	
トーヨー	7,300	2,697.00	19,688,100	
三信電気	7,600	2,047.00	15,557,200	
東陽テクニカ	17,300	1,620.00	28,026,000	
モスフードサービス	27,700	3,595.00	99,581,500	
加賀電子	34,400	2,846.00	97,902,400	
ソーダニッカ	19,900	1,197.00	23,820,300	
立花エレテック	12,500	2,551.00	31,887,500	
フォーバル	7,400	1,357.00	10,041,800	
P A L T A C	25,100	4,331.00	108,708,100	
三谷産業	32,900	323.00	10,626,700	
西本Wismettacホールディングス	11,500	1,330.00	15,295,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	2,581.00	774,300	
コア商事ホールディングス	13,900	613.00	8,520,700	
K P P グループホールディングス	48,700	687.00	33,456,900	
ヤマタネ	8,300	3,215.00	26,684,500	
丸紅建材リース	300	2,832.00	849,600	
泉州電業	13,000	4,830.00	62,790,000	
トラスコ中山	39,500	2,304.00	91,008,000	
オートバックスセブン	65,400	1,453.50	95,058,900	
モリト	15,000	1,417.00	21,255,000	
加藤産業	23,300	4,165.00	97,044,500	
北恵	1,000	939.00	939,000	
イエローハット	29,900	2,576.00	77,022,400	
J K ホールディングス	14,500	1,053.00	15,268,500	
日伝	12,300	3,275.00	40,282,500	
北沢産業	2,500	343.00	857,500	
杉本商事	18,200	1,423.00	25,898,600	

因幡電機産業	48,700	3,775.00	183,842,500
東テク	18,800	2,668.00	50,158,400
ミスミグループ本社	284,000	2,553.50	725,194,000
アルテック	2,200	212.00	466,400
タキヒヨー	900	1,260.00	1,134,000
蔵王産業	700	2,470.00	1,729,000
スズケン	67,200	5,233.00	351,657,600
ジェコス	11,200	877.00	9,822,400
サンエー	28,800	2,956.00	85,132,800
カワチ薬品	14,800	2,572.00	38,065,600
エービーシー・マート	82,400	3,062.00	252,308,800
ハードオフコーポレーション	8,500	1,930.00	16,405,000
アスクル	45,600	2,013.00	91,792,800
ゲオホールディングス	21,300	1,537.00	32,738,100
アダストリア	22,800	3,935.00	89,718,000
くら寿司	22,100	3,935.00	86,963,500
キャンドウ	6,800	3,280.00	22,304,000
I Kホールディングス	2,200	362.00	796,400
パルグループホールディングス	37,000	3,220.00	119,140,000
エディオン	74,600	1,775.00	132,415,000
サーラコーポレーション	39,900	868.00	34,633,200
ワッツ	2,200	702.00	1,544,400
ハローズ	8,600	4,410.00	37,926,000
あみやき亭	13,800	1,722.00	23,763,600
大黒天物産	5,800	10,370.00	60,146,000
ハニーズホールディングス	16,900	1,761.00	29,760,900
ファーマライズホールディングス	1,500	633.00	949,500
アルペン	15,700	2,075.00	32,577,500
ハブ	1,700	757.00	1,286,900
クオールホールディングス	26,100	1,475.00	38,497,500
ジinzホールディングス	14,400	5,870.00	84,528,000
ビックカメラ	112,700	1,695.00	191,026,500
D C Mホールディングス	97,600	1,481.00	144,545,600
Monotaro	266,600	2,457.50	655,169,500
東京一番フーズ	1,800	500.00	900,000
きちりホールディングス	1,100	888.00	976,800
J . フロント リテイリング	216,000	1,573.50	339,876,000
ドトール・日レスホールディングス	33,500	2,228.00	74,638,000
マツキヨココカラ&カンパニー	342,100	2,096.00	717,041,600
ブロンコビリー	11,100	3,785.00	42,013,500
Z O Z O	119,900	5,382.00	645,301,800
トレジャー・ファクトリー	13,200	1,385.00	18,282,000

物語コーポレーション	31,500	3,705.00	116,707,500
三越伊勢丹ホールディングス	311,400	2,215.50	689,906,700
H a m e e	7,900	1,073.00	8,476,700
マーケットエンタープライズ	700	1,022.00	715,400
ウエルシアホールディングス	97,700	1,961.50	191,638,550
クリエイトSDホールディングス	26,800	3,120.00	83,616,000
丸善CHIホールディングス	5,800	323.00	1,873,400
ミサワ	1,400	658.00	921,200
ティーライフ	800	1,176.00	940,800
チムニー	1,200	1,282.00	1,538,400
シュッピン	17,300	1,082.00	18,718,600
オイシックス・ラ・大地	25,500	1,339.00	34,144,500
ネクステージ	43,200	1,443.00	62,337,600
ジョイフル本田	52,300	2,024.00	105,855,200
エターナルホスピタリティグループ	7,100	3,950.00	28,045,000
ホットランド	14,600	2,306.00	33,667,600
すかいらーくホールディングス	257,100	2,322.00	596,986,200
SFPホールディングス	9,100	1,944.00	17,690,400
綿半ホールディングス	14,800	1,693.00	25,056,400
ヨシックスホールディングス	4,900	3,450.00	16,905,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,900	827.00	43,748,300
B E E N O S	11,300	2,931.00	33,120,300
あさひ	17,700	1,570.00	27,789,000
日本調剤	12,700	1,434.00	18,211,800
コスモス薬品	31,900	7,847.00	250,319,300
トーエル	2,200	806.00	1,773,200
セブン&アイ・ホールディングス	1,903,600	2,237.50	4,259,305,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	127,300	1,186.00	150,977,800
ツルハホールディングス	39,500	8,787.00	347,086,500
サンマルクホールディングス	15,300	2,368.00	36,230,400
フェリシモ	1,300	890.00	1,157,000
トリドールホールディングス	52,800	3,941.00	208,084,800
T O K Y O B A S E	21,600	251.00	5,421,600
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,058.00	1,163,800
J Mホールディングス	14,300	3,030.00	43,329,000
サツドラホールディングス	2,000	798.00	1,596,000
アレンザホールディングス	14,400	1,096.00	15,782,400
串カツ田中ホールディングス	5,900	1,531.00	9,032,900
パロックジャパンリミテッド	15,100	782.00	11,808,200
クスリのアオキホールディングス	63,000	3,304.00	208,152,000
力の源ホールディングス	12,100	1,134.00	13,721,400

FOOD & LIFE COMPANIES	100,400	2,994.00	300,597,600	
メディカルシステムネットワーク	21,200	430.00	9,116,000	
はるやまホールディングス	2,500	550.00	1,375,000	
ノジマ	54,700	2,043.00	111,752,100	
カッパ・クリエイト	29,500	1,643.00	48,468,500	
良品計画	224,000	2,520.00	564,480,000	
パリミキホールディングス	5,900	326.00	1,923,400	
アドヴァングループ	16,500	868.00	14,322,000	
アルビス	6,300	2,671.00	16,827,300	
コナカ	4,800	229.00	1,099,200	
ハウス オブ ローゼ	700	1,492.00	1,044,400	
G - 7ホールディングス	20,700	1,652.00	34,196,400	
イオン北海道	55,700	894.00	49,795,800	
コジマ	36,600	1,074.00	39,308,400	
ヒマラヤ	1,800	878.00	1,580,400	
コーナン商事	23,100	3,660.00	84,546,000	
エコス	7,100	2,106.00	14,952,600	
ワタミ	19,900	945.00	18,805,500	
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	379,800	3,769.00	1,431,466,200	
西松屋チェーン	37,100	2,421.00	89,819,100	
ゼンショーホールディングス	95,800	7,777.00	745,036,600	
幸楽苑	13,900	1,292.00	17,958,800	
ハークスレイ	1,700	736.00	1,251,200	
サイゼリヤ	27,900	5,300.00	147,870,000	
V Tホールディングス	74,100	460.00	34,086,000	
魚力	6,700	2,395.00	16,046,500	
フジ・コーポレーション	9,100	1,931.00	17,572,100	
ユナイテッドアローズ	22,200	2,374.00	52,702,800	
ハイデイ日高	28,000	2,737.00	76,636,000	
京都きもの友禅ホールディングス	4,900	73.00	357,700	
コロワイド	96,600	1,670.00	161,322,000	
壱番屋	74,600	1,028.00	76,688,800	
PLANT	1,100	1,544.00	1,698,400	
スギホールディングス	113,800	2,680.00	304,984,000	
薬王堂ホールディングス	9,300	2,247.00	20,897,100	
スクロール	28,400	966.00	27,434,400	
ヨンドシーホールディングス	18,000	1,876.00	33,768,000	
木曽路	28,600	2,270.00	64,922,000	
S R Sホールディングス	31,300	1,196.00	37,434,800	
千趣会	38,000	315.00	11,970,000	
リテールパートナーズ	28,200	1,261.00	35,560,200	

上新電機	18,700	2,609.00	48,788,300
日本瓦斯	99,500	2,190.00	217,905,000
ロイヤルホールディングス	33,100	2,472.00	81,823,200
いなげや	18,300	1,167.00	21,356,100
チヨダ	18,400	1,314.00	24,177,600
ライフコーポレーション	19,700	3,325.00	65,502,500
リンガーハット	24,200	2,242.00	54,256,400
MrMaxHD	24,200	717.00	17,351,400
AOKIホールディングス	40,600	1,217.00	49,410,200
オークワ	27,100	916.00	24,823,600
コメリ	29,000	3,560.00	103,240,000
青山商事	40,500	1,344.00	54,432,000
しまむら	44,200	8,325.00	367,965,000
はせがわ	2,900	314.00	910,600
高島屋	239,500	1,222.50	292,788,750
松屋	31,900	830.00	26,477,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	95,900	2,076.00	199,088,400
近鉄百貨店	8,200	2,167.00	17,769,400
丸井グループ	124,800	2,403.00	299,894,400
アクシアル リテイリング	51,700	896.00	46,323,200
イオン	637,300	3,760.00	2,396,248,000
イズミ	33,300	3,291.00	109,590,300
平和堂	31,400	2,236.00	70,210,400
フジ	28,900	2,027.00	58,580,300
ヤオコー	22,300	9,371.00	208,973,300
ゼビオホールディングス	25,800	1,161.00	29,953,800
ケーズホールディングス	126,500	1,490.50	188,548,250
Olympicグループ	2,400	481.00	1,154,400
日産東京販売ホールディングス	6,700	432.00	2,894,400
シルバーライフ	5,500	750.00	4,125,000
Genky DrugStores	16,600	3,330.00	55,278,000
ナルミヤ・インターナショナル	900	1,245.00	1,120,500
ブックオフグループホールディングス	13,900	1,320.00	18,348,000
ギフトホールディングス	9,400	3,285.00	30,879,000
アインホールディングス	26,000	5,080.00	132,080,000
Genki Global Dining	10,700	4,185.00	44,779,500
ヤマダホールディングス	579,000	444.20	257,191,800
アーケランズ	56,100	1,685.00	94,528,500
ニトリホールディングス	68,500	20,855.00	1,428,567,500
グルメ杵屋	15,600	1,065.00	16,614,000
愛眼	3,000	155.00	465,000
ケーユーホールディングス	9,100	1,080.00	9,828,000



吉野家ホールディングス	69,400	3,154.00	218,887,600
松屋フーズホールディングス	8,900	6,740.00	59,986,000
サガミホールディングス	28,400	1,824.00	51,801,600
王将フードサービス	42,000	3,015.00	126,630,000
ミニストップ	13,700	1,697.00	23,248,900
アークス	34,600	2,488.00	86,084,800
パローホールディングス	36,000	2,113.00	76,068,000
ベルク	9,400	6,660.00	62,604,000
大庄	11,600	1,043.00	12,098,800
ファーストリテイリング	105,700	53,120.00	5,614,784,000
サンドラッグ	63,500	3,931.00	249,618,500
サックスパー ホールディングス	16,300	914.00	14,898,200
ヤマザワ	1,100	1,192.00	1,311,200
やまや	900	2,920.00	2,628,000
ペルーナ	45,700	720.00	32,904,000
いよぎんホールディングス	208,200	1,417.50	295,123,500
しずおかフィナンシャルグループ	385,400	1,277.00	492,155,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,300	1,472.00	216,825,600
楽天銀行	81,200	3,275.00	265,930,000
京都フィナンシャルグループ	220,300	2,314.50	509,884,350
島根銀行	1,100	476.00	523,600
じもとホールディングス	3,300	297.00	980,100
めぶきフィナンシャルグループ	810,900	582.20	472,105,980
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	4,220.00	94,528,000
九州フィナンシャルグループ	338,700	726.60	246,099,420
ゆうちょ銀行	1,922,900	1,399.50	2,691,098,550
富山第一銀行	55,500	1,089.00	60,439,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	930,900	781.00	727,032,900
西日本フィナンシャルホールディングス	97,900	1,712.00	167,604,800
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,666.00	25,989,600
第四北越フィナンシャルグループ	55,000	2,425.00	133,375,000
ひろぎんホールディングス	249,100	1,157.50	288,333,250
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,297.00	34,225,300
十六フィナンシャルグループ	22,700	4,075.00	92,502,500
北國フィナンシャルホールディングス	17,100	4,480.00	76,608,000
プロクレアホールディングス	20,000	1,777.00	35,540,000
あいちフィナンシャルグループ	35,900	2,282.00	81,923,800
あおぞら銀行	125,800	2,688.50	338,213,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,656,700	1,613.00	17,189,257,100
りそなホールディングス	2,006,800	1,033.50	2,074,027,800
三井住友トラストグループ	623,100	3,398.00	2,117,293,800
三井住友フィナンシャルグループ	3,648,600	3,202.00	11,682,817,200

千葉銀行	487,700	1,148.50	560,123,450
群馬銀行	339,600	884.60	300,410,160
武蔵野銀行	24,400	2,725.00	66,490,000
千葉興業銀行	41,300	1,117.00	46,132,100
筑波銀行	76,800	228.00	17,510,400
七十七銀行	50,900	4,055.00	206,399,500
秋田銀行	11,700	2,147.00	25,119,900
山形銀行	19,400	985.00	19,109,000
岩手銀行	11,100	2,334.00	25,907,400
東邦銀行	138,400	272.00	37,644,800
東北銀行	1,800	1,095.00	1,971,000
ふくおかフィナンシャルグループ	152,400	3,608.00	549,859,200
スルガ銀行	131,000	1,124.00	147,244,000
八十二銀行	375,500	849.70	319,062,350
山梨中央銀行	19,600	1,700.00	33,320,000
大垣共立銀行	33,400	1,830.00	61,122,000
福井銀行	15,600	1,838.00	28,672,800
清水銀行	7,000	1,446.00	10,122,000
富山銀行	600	1,585.00	951,000
滋賀銀行	29,100	3,370.00	98,067,000
南都銀行	26,300	3,020.00	79,426,000
百五銀行	164,600	561.00	92,340,600
紀陽銀行	62,600	1,798.00	112,554,800
ほくほくフィナンシャルグループ	108,300	1,645.50	178,207,650
山陰合同銀行	109,500	1,237.00	135,451,500
鳥取銀行	1,300	1,254.00	1,630,200
百十四銀行	17,200	2,551.00	43,877,200
四国銀行	25,700	948.00	24,363,600
阿波銀行	24,500	2,431.00	59,559,500
大分銀行	10,500	3,125.00	32,812,500
宮崎銀行	10,500	2,731.00	28,675,500
佐賀銀行	10,200	2,069.00	21,103,800
琉球銀行	37,200	1,003.00	37,311,600
セブン銀行	548,500	310.50	170,309,250
みずほフィナンシャルグループ	2,362,000	3,180.00	7,511,160,000
高知銀行	1,300	787.00	1,023,100
山口フィナンシャルグループ	171,600	1,544.00	264,950,400
名古屋銀行	11,100	5,970.00	66,267,000
北洋銀行	265,100	407.00	107,895,700
大光銀行	1,200	1,318.00	1,581,600
愛媛銀行	23,600	1,046.00	24,685,600
トマト銀行	1,300	1,122.00	1,458,600

京葉銀行	72,000	695.00	50,040,000
栃木銀行	87,400	265.00	23,161,000
北日本銀行	5,700	2,532.00	14,432,400
東和銀行	32,100	587.00	18,842,700
福島銀行	3,900	241.00	939,900
大東銀行	1,600	698.00	1,116,800
トモニホールディングス	165,600	401.00	66,405,600
フィデアホールディングス	18,100	1,441.00	26,082,100
池田泉州ホールディングス	242,700	331.00	80,333,700
F P G	62,400	2,472.00	154,252,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	28,400	1,036.00	29,422,400
マーキュリアホールディングス	1,700	894.00	1,519,800
S B Iホールディングス	281,100	3,374.00	948,431,400
ジャフコ グループ	52,200	2,013.00	105,078,600
大和証券グループ本社	1,355,600	1,052.50	1,426,769,000
野村ホールディングス	2,942,800	792.00	2,330,697,600
岡三証券グループ	153,700	628.00	96,523,600
丸三証券	58,300	940.00	54,802,000
東洋証券	46,600	483.00	22,507,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207,900	489.00	101,663,100
光世証券	1,000	414.00	414,000
水戸証券	48,100	468.00	22,510,800
いちよし証券	32,800	692.00	22,697,600
松井証券	86,200	801.00	69,046,200
マネックスグループ	171,500	667.00	114,390,500
極東証券	24,000	1,328.00	31,872,000
岩井コスモホールディングス	20,000	2,053.00	41,060,000
アイザワ証券グループ	25,300	1,799.00	45,514,700
マネーパートナーズグループ	4,100	222.00	910,200
スパークス・グループ	19,500	1,346.00	26,247,000
かんぼ生命保険	178,200	2,572.00	458,330,400
F P パートナー	7,700	2,950.00	22,715,000
S O M P Oホールディングス	789,700	3,292.00	2,599,692,400
アニコム ホールディングス	59,400	691.00	41,045,400
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,175,300	3,507.00	4,121,777,100
第一生命ホールディングス	822,800	3,868.00	3,182,590,400
東京海上ホールディングス	1,708,500	5,655.00	9,661,567,500
T & Dホールディングス	469,900	2,535.50	1,191,431,450
アドバンスクリエイト	13,600	780.00	10,608,000
N E X Y Z . G r o u p	2,000	797.00	1,594,000
全国保証	45,900	5,601.00	257,085,900
あんしん保証	4,300	180.00	774,000

イントラスト	2,200	747.00	1,643,400
日本モーゲージサービス	3,400	434.00	1,475,600
C a s a	2,100	854.00	1,793,400
S B I アルヒ	17,500	828.00	14,490,000
プレミアグループ	29,900	2,258.00	67,514,200
ネットプロテクションズホールディングス	60,400	372.00	22,468,800
クレディセゾン	111,100	3,529.00	392,071,900
芙蓉総合リース	16,200	10,875.00	176,175,000
みずほリース	147,200	1,001.00	147,347,200
東京センチュリー	131,100	1,592.50	208,776,750
日本証券金融	64,700	2,086.00	134,964,200
アイフル	259,500	318.00	82,521,000
リコーリース	16,700	5,010.00	83,667,000
イオンフィナンシャルサービス	101,000	1,221.00	123,321,000
アコム	314,000	368.40	115,677,600
ジャックス	18,800	3,870.00	72,756,000
オリエントコーポレーション	57,800	926.00	53,522,800
オリックス	1,049,600	3,265.00	3,426,944,000
三菱HCキャピタル	780,300	1,005.00	784,201,500
九州リースサービス	2,100	1,001.00	2,102,100
日本取引所グループ	902,600	1,825.00	1,647,245,000
イー・ギャランティ	29,000	1,526.00	44,254,000
アサックス	2,400	712.00	1,708,800
NECキャピタルソリューション	8,800	3,760.00	33,088,000
r o b o t h o m e	52,600	136.00	7,153,600
大東建託	64,100	16,725.00	1,072,072,500
サムティホールディングス	34,300	3,295.00	113,018,500
いちご	179,400	396.00	71,042,400
日本駐車場開発	211,100	228.00	48,130,800
スター・マイカ・ホールディングス	19,100	655.00	12,510,500
S R E ホールディングス	7,700	3,895.00	29,991,500
A D ワークスグループ	9,500	206.00	1,957,000
ヒューリック	408,600	1,421.50	580,824,900
野村不動産ホールディングス	97,600	3,779.00	368,830,400
三重交通グループホールディングス	38,700	497.00	19,233,900
ディア・ライフ	30,500	847.00	25,833,500
地主	15,800	2,165.00	34,207,000
プレサンスコーポレーション	23,500	1,934.00	45,449,000
ハウスコム	1,200	1,050.00	1,260,000
J P M C	10,600	1,155.00	12,243,000
サンセイランディック	1,800	962.00	1,731,600
フージャースホールディングス	27,000	1,055.00	28,485,000

オープンハウスグループ	64,200	5,778.00	370,947,600
東急不動産ホールディングス	526,700	985.20	518,904,840
飯田グループホールディングス	167,900	2,234.00	375,088,600
イーランド	1,000	1,383.00	1,383,000
ムゲンエステート	3,300	1,631.00	5,382,300
And Doホールディングス	10,600	1,050.00	11,130,000
シーアールイー	8,200	1,242.00	10,184,400
ケイアイスター不動産	8,600	3,950.00	33,970,000
グッドコムアセット	15,000	852.00	12,780,000
ジェイ・エス・ビー	7,500	2,808.00	21,060,000
ロードスターキャピタル	10,200	2,317.00	23,633,400
イノベーションホールディングス	1,800	968.00	1,742,400
フェイスネットワーク	1,400	1,610.00	2,254,000
霞ヶ関キャピタル	7,200	15,550.00	111,960,000
パーク24	136,700	1,854.50	253,510,150
パラカ	5,800	1,792.00	10,393,600
三井不動産	2,427,900	1,354.00	3,287,376,600
三菱地所	1,098,300	2,335.00	2,564,530,500
平和不動産	28,600	4,065.00	116,259,000
東京建物	153,100	2,391.50	366,138,650
京阪神ビルディング	33,100	1,657.00	54,846,700
住友不動産	253,200	4,688.00	1,187,001,600
テーオーシー	32,200	619.00	19,931,800
レオパレス21	175,100	560.00	98,056,000
スターツコーポレーション	25,300	3,555.00	89,941,500
フジ住宅	22,900	708.00	16,213,200
空港施設	25,700	576.00	14,803,200
明和地所	13,100	1,001.00	13,113,100
ゴールドクレスト	14,500	3,310.00	47,995,000
エスリード	8,400	4,750.00	39,900,000
日神グループホールディングス	29,300	501.00	14,679,300
日本エスコン	32,700	997.00	32,601,900
MIRARTHホールディングス	91,000	500.00	45,500,000
AVANTIA	2,800	772.00	2,161,600
イオンモール	91,000	2,053.00	186,823,000
毎日コムネット	2,100	737.00	1,547,700
ファースト住建	2,100	1,111.00	2,333,100
カチタス	47,400	1,961.00	92,951,400
トーセイ	29,400	2,402.00	70,618,800
穴吹興産	1,200	1,990.00	2,388,000
サンフロンティア不動産	26,300	1,841.00	48,418,300
FJネクストホールディングス	18,900	1,161.00	21,942,900

インテリックス	900	757.00	681,300
ランドビジネス	1,400	196.00	274,400
サンネクスタグループ	1,800	1,015.00	1,827,000
グランディハウス	17,500	572.00	10,010,000
日本空港ビルデング	62,000	5,333.00	330,646,000
明豊ファシリティワークス	2,200	874.00	1,922,800
L I F U L L	45,900	150.00	6,885,000
M I X I	39,300	2,819.00	110,786,700
ジェイエシーリクルートメント	66,200	739.00	48,921,800
日本M&Aセンターホールディングス	291,300	614.60	179,032,980
メンバーズ	6,400	960.00	6,144,000
中広	900	460.00	414,000
U T グループ	23,900	2,666.00	63,717,400
アイティメディア	7,100	1,625.00	11,537,500
ケアネット	37,700	675.00	25,447,500
E・Jホールディングス	10,800	1,719.00	18,565,200
オープンアップグループ	55,000	1,970.00	108,350,000
コシダカホールディングス	54,900	1,239.00	68,021,100
アルトナー	1,700	1,816.00	3,087,200
パソナグループ	22,200	2,009.00	44,599,800
C D S	1,300	1,787.00	2,323,100
リンクアンドモチベーション	45,100	599.00	27,014,900
エス・エム・エス	64,100	2,155.00	138,135,500
サニーサイドアップグループ	1,600	555.00	888,000
パーソルホールディングス	1,860,000	259.60	482,856,000
リニカル	3,000	382.00	1,146,000
クックパッド	50,900	177.00	9,009,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,900	776.00	2,250,400
学情	9,400	1,817.00	17,079,800
スタジオアリス	9,200	2,016.00	18,547,200
エプコ	1,300	789.00	1,025,700
N J S	4,600	3,935.00	18,101,000
総合警備保障	305,300	1,033.50	315,527,550
カカクコム	118,600	2,436.00	288,909,600
アイロムグループ	7,400	2,781.00	20,579,400
セントケア・ホールディング	13,500	754.00	10,179,000
サイネックス	900	768.00	691,200
ルネサンス	14,400	1,104.00	15,897,600
ディップ	28,000	2,594.00	72,632,000
デジタルホールディングス	9,500	998.00	9,481,000
新日本科学	16,800	1,285.00	21,588,000
キャリアデザインセンター	800	1,795.00	1,436,000

エムスリー	361,100	1,760.50	635,716,550
ツカダ・グローバルホールディング	3,100	391.00	1,212,100
ウェルネット	3,700	713.00	2,638,100
ワールドホールディングス	7,300	1,954.00	14,264,200
ディー・エヌ・エー	65,000	1,795.50	116,707,500
博報堂D Yホールディングス	233,100	1,210.00	282,051,000
ぐるなび	34,500	330.00	11,385,000
タカミヤ	25,200	439.00	11,062,800
ファンコミュニケーションズ	26,000	424.00	11,024,000
ライク	6,900	1,410.00	9,729,000
A o b a - B B T	2,000	320.00	640,000
エスプール	58,300	362.00	21,104,600
W D Bホールディングス	9,400	1,745.00	16,403,000
ティア	3,000	442.00	1,326,000
アドウェイズ	22,800	333.00	7,592,400
バリューコマース	16,200	1,127.00	18,257,400
インフォマート	172,900	365.00	63,108,500
J Pホールディングス	47,000	701.00	32,947,000
エコナックホールディングス	4,800	112.00	537,600
C Lホールディングス	4,500	932.00	4,194,000
プレステージ・インターナショナル	85,700	693.00	59,390,100
プロトコーポレーション	19,500	1,426.00	27,807,000
アミューズ	11,300	1,397.00	15,786,100
ドリームインキュベータ	5,800	2,280.00	13,224,000
クイック	12,800	2,019.00	25,843,200
T A C	2,900	163.00	472,700
電通グループ	197,500	4,770.00	942,075,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	9,000	907.00	8,163,000
イオンファンタジー	6,700	2,225.00	14,907,500
シーティーエス	22,800	944.00	21,523,200
H . U . グループホールディングス	53,500	2,638.00	141,133,000
アルプス技研	16,000	2,846.00	45,536,000
日本空調サービス	19,800	1,029.00	20,374,200
オリエンタルランド	966,600	3,609.00	3,488,459,400
ダスキン	39,900	4,127.00	164,667,300
明光ネットワークジャパン	22,400	661.00	14,806,400
ファルコホールディングス	8,200	2,437.00	19,983,400
ラウンドワン	172,500	984.00	169,740,000
リゾートトラスト	79,400	2,802.00	222,478,800
ビー・エム・エル	22,500	2,713.00	61,042,500
リソー教育	94,100	277.00	26,065,700
早稲田アカデミー	10,200	1,611.00	16,432,200

ユー・エス・エス	409,900	1,252.00	513,194,800
東京個別指導学院	22,100	403.00	8,906,300
サイバーエージェント	403,800	1,033.50	417,327,300
楽天グループ	1,285,600	952.10	1,224,019,760
クリーク・アンド・リバー社	9,300	1,583.00	14,721,900
SBIグローバルアセットマネジメント	36,100	590.00	21,299,000
テー・オー・ダブリュー	36,400	325.00	11,830,000
山田コンサルティンググループ	8,000	2,158.00	17,264,000
セントラルスポーツ	6,900	2,421.00	16,704,900
フルキャストホールディングス	15,100	1,563.00	23,601,300
エン・ジャパン	29,800	2,432.00	72,473,600
リソルホールディングス	400	5,110.00	2,044,000
テクノプロ・ホールディングス	106,100	2,803.00	297,398,300
アトラグループ	1,500	134.00	201,000
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	869.00	8,429,300
Keeper 技研	11,300	4,190.00	47,347,000
ファーストロジック	1,500	692.00	1,038,000
三機サービス	800	884.00	707,200
Gunosy	14,700	735.00	10,804,500
デザインワン・ジャパン	2,500	112.00	280,000
イー・ガーディアン	8,800	1,872.00	16,473,600
リブセンス	3,000	165.00	495,000
ジャパンマテリアル	56,000	1,864.00	104,384,000
ベクトル	22,000	966.00	21,252,000
ウチヤマホールディングス	2,200	317.00	697,400
チャーム・ケア・コーポレーション	15,300	1,304.00	19,951,200
キャリアリンク	6,800	2,493.00	16,952,400
I B J	14,200	672.00	9,542,400
アサンテ	9,100	1,689.00	15,369,900
バリューHR	16,500	1,727.00	28,495,500
M&Aキャピタルパートナーズ	14,900	2,390.00	35,611,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,000.00	7,400,000
E R Iホールディングス	1,200	1,904.00	2,284,800
アビスト	700	3,060.00	2,142,000
シグマクシス・ホールディングス	24,000	1,718.00	41,232,000
ウィルグループ	15,500	985.00	15,267,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,000	141.00	846,000
メドピア	14,900	583.00	8,686,700
レアジョブ	1,200	410.00	492,000
リクルートホールディングス	1,315,400	9,677.00	12,729,125,800
エラン	24,400	940.00	22,936,000
土木管理総合試験所	2,400	310.00	744,000



日本郵政	1,909,400	1,411.00	2,694,163,400
ベルシステム24ホールディングス	19,700	1,318.00	25,964,600
鎌倉新書	16,000	529.00	8,464,000
S MN	1,400	262.00	366,800
グローバルキッズCOMPANY	1,000	692.00	692,000
エアトリ	13,500	1,060.00	14,310,000
アトラエ	13,500	834.00	11,259,000
ストライク	9,000	4,655.00	41,895,000
ソラスト	50,700	508.00	25,755,600
セラク	5,700	1,253.00	7,142,100
インソース	39,800	1,041.00	41,431,800
ベイカレント	134,300	5,036.00	676,334,800
Orchestra Holdings	4,200	885.00	3,717,000
アイモバイル	23,600	525.00	12,390,000
ディスラプターズ	2,300	170.00	391,000
MS - Japan	8,500	1,051.00	8,933,500
船場	1,000	1,248.00	1,248,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	59,200	3,115.00	184,408,000
フルテック	700	1,170.00	819,000
GameWith	2,400	210.00	504,000
MS&Consulting	800	496.00	396,800
エル・ティー・エス	2,500	1,781.00	4,452,500
ミダックホールディングス	11,200	1,843.00	20,641,600
キュービーネットホールディングス	10,600	1,045.00	11,077,000
オープングループ	25,700	212.00	5,448,400
スプリックス	1,400	795.00	1,113,000
マネジメントソリューションズ	9,100	1,995.00	18,154,500
プロレド・パートナーズ	4,800	501.00	2,404,800
テノ・ホールディングス	900	483.00	434,700
フロンティア・マネジメント	5,600	1,210.00	6,776,000
コプロ・ホールディングス	1,400	1,430.00	2,002,000
ギークス	900	401.00	360,900
アンビスホールディングス	39,200	1,954.00	76,596,800
カーブスホールディングス	50,100	808.00	40,480,800
フォーラムエンジニアリング	25,000	906.00	22,650,000
Fast Fitness Japan	6,400	1,320.00	8,448,000
Macbee Planet	5,200	2,648.00	13,769,600
ダイレクトマーケティングミックス	22,900	244.00	5,587,600
ポピンズ	3,500	1,405.00	4,917,500
LITALICO	14,400	1,267.00	18,244,800
コンフィデンス・インターワークス	400	1,718.00	687,200
アドバンテッジリスクマネジメント	2,300	582.00	1,338,600

リログループ	91,600	1,887.00	172,849,200
東祥	13,000	696.00	9,048,000
I D & Eホールディングス	11,100	4,335.00	48,118,500
ビーウィズ	3,800	1,680.00	6,384,000
サンウェルズ	7,100	1,680.00	11,928,000
T R Eホールディングス	35,100	1,859.00	65,250,900
人・夢・技術グループ	7,600	1,688.00	12,828,800
N I S S Oホールディングス	16,100	828.00	13,330,800
大栄環境	33,200	3,200.00	106,240,000
日本管財ホールディングス	19,200	2,705.00	51,936,000
M & A総研ホールディングス	19,800	2,795.00	55,341,000
エイチ・アイ・エス	58,500	1,701.00	99,508,500
ラックランド	8,300	1,973.00	16,375,900
共立メンテナンス	57,400	2,449.50	140,601,300
イチネンホールディングス	19,500	1,836.00	35,802,000
建設技術研究所	9,400	4,615.00	43,381,000
スペース	13,400	1,173.00	15,718,200
燦ホールディングス	17,000	1,161.00	19,737,000
スバル興業	7,100	3,135.00	22,258,500
東京テアトル	1,400	1,077.00	1,507,800
タナベコンサルティンググループ	8,000	1,219.00	9,752,000
ナガワ	5,700	6,980.00	39,786,000
東京都競馬	13,400	4,245.00	56,883,000
カナモト	28,400	2,814.00	79,917,600
ニシオホールディングス	15,100	3,805.00	57,455,500
トランス・コスモス	20,500	3,440.00	70,520,000
乃村工藝社	79,900	792.00	63,280,800
藤田観光	8,100	8,400.00	68,040,000
K N T - C Tホールディングス	10,900	1,292.00	14,082,800
トーカイ	16,200	2,183.00	35,364,600
セコム	372,000	5,280.00	1,964,160,000
セントラル警備保障	9,900	2,633.00	26,066,700
丹青社	35,600	813.00	28,942,800
メイテックグループホールディングス	62,200	3,198.00	198,915,600
応用地質	17,100	2,587.00	44,237,700
船井総研ホールディングス	36,600	2,499.00	91,463,400
進学会ホールディングス	1,800	227.00	408,600
オオバ	2,800	1,037.00	2,903,600
いであ	1,100	2,456.00	2,701,600
学究社	7,400	1,930.00	14,282,000
イオンディライト	19,600	4,290.00	84,084,000
ナック	15,800	580.00	9,164,000

ダイセキ	37,300	3,890.00	145,097,000	
ステップ	6,700	2,033.00	13,621,100	
合 計	329,565,800		669,849,525,470	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2024年10月21日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	645,889,080	
国債証券	567,250,114,970	
地方債証券	34,672,840,977	
特殊債券	36,711,372,694	
社債券	31,477,301,000	
未収入金	239,393,200	
未収利息	1,030,765,475	
前払費用	57,025,750	
流動資産合計	672,084,703,146	
資産合計	672,084,703,146	
負債の部		
流動負債		
未払金	465,666,500	
未払解約金	173,298,013	
流動負債合計	638,964,513	
負債合計	638,964,513	
純資産の部		
元本等		
元本	511,412,171,484	
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	160,033,567,149	
元本等合計	671,445,738,633	
純資産合計	671,445,738,633	
負債純資産合計	672,084,703,146	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年10月21日現在	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
	先物取引	

2024年10月21日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3.収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年10月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	511,412,171,484口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 98,758,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3129円 (1万口当たり純資産額) (13,129円)

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

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2024年10月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年10月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	502,149,062,095円
期中追加設定元本額	46,921,456,981円
期中一部解約元本額	37,658,347,592円
期末元本額	511,412,171,484円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,126,401,109円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,660,510円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,701,992,763円
世界経済インデックスファンド	9,249,186,872円
D C マイセレクション 2 5	29,492,595,372円
D C マイセレクション 5 0	37,538,853,065円
D C マイセレクション 7 5	12,632,071,030円
D C 日本債券インデックス・オープン	399,259,566円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,430,991,430円
D C 日本債券インデックス・オープン P	60,145,288,573円
D C マイセレクション S 2 5	18,675,779,473円
D C マイセレクション S 5 0	22,731,766,649円
D C マイセレクション S 7 5	6,307,943,664円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	233,681,452円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,190,571,573円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,334,412,958円
D C 世界経済インデックスファンド	6,846,782,223円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,772,597円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,985,935円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	8,589,478円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,260,056円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	45,995,508円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	75,344,063円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	26,575,120円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	24,233,626円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,585,371,244円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	736,448,283円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,211,424,675円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	65,714,823円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	41,060,879円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	881,778,706円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	958,040,817円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,322,338,188円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	92,128,509円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	6,151,363,178円
日本債券ファンド・シリーズ 1	17,520,537,473円
分散投資コア戦略ファンド A	19,221,920,466円
分散投資コア戦略ファンド S	26,765,256,706円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	351,468,517円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,256,415,442円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,237,403円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,349,854円
S M T インデックスバランス・オープン	65,579,341円
S M T 世界経済インデックス・オープン	68,060,187円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	171,442,024円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	256,786,254円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	23,331,590円
グローバル経済コア	445,193,360円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	58,488,324円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	42,339,668円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 3 0	215,918,588円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 4 0	131,236,590円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 5 0	39,799,538円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 6 0	32,419,334円

区分	2024年10月21日現在
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,367,301,425円
10資産分散投資ファンド	473,751,999円
グローバル10資産バランスファンド	691,056,298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	986,452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	164,442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	760,896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	229,526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	213,959円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	210,850円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	403,005円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	51,530,659円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	108,965,177,939円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	56,502,087円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,621,223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）	664,588,858円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,996,082,370
地方債証券	189,341,811
特殊債証券	154,171,705
社債証券	154,904,000
合計	4,494,499,886

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第454回利付国債（2年）	1,910,000,000	1,906,371,000	
	第455回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,485,053,200	
	第456回利付国債（2年）	1,100,000,000	1,097,052,000	
	第457回利付国債（2年）	2,720,000,000	2,711,676,800	
	第458回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,486,781,600	
	第459回利付国債（2年）	1,030,000,000	1,027,342,600	
	第460回利付国債（2年）	2,300,000,000	2,296,849,000	
	第461回利付国債（2年）	2,850,000,000	2,850,000,000	
	第462回利付国債（2年）	1,580,000,000	1,579,731,400	
	第463回利付国債（2年）	2,870,000,000	2,869,225,100	
	第464回利付国債（2年）	1,940,000,000	1,939,282,200	
	第465回利付国債（2年）	380,000,000	379,779,600	

第146回利付国債(5年)	5,160,000,000	5,147,151,600	
第147回利付国債(5年)	5,900,000,000	5,869,792,000	
第148回利付国債(5年)	4,960,000,000	4,927,264,000	
第149回利付国債(5年)	4,580,000,000	4,543,909,600	
第150回利付国債(5年)	4,340,000,000	4,301,374,000	
第151回利付国債(5年)	3,250,000,000	3,217,825,000	
第152回利付国債(5年)	690,000,000	684,735,300	
第153回利付国債(5年)	5,850,000,000	5,785,357,500	
第154回利付国債(5年)	5,000,000,000	4,951,800,000	
第155回利付国債(5年)	2,770,000,000	2,757,036,400	
第156回利付国債(5年)	3,380,000,000	3,353,636,000	
第157回利付国債(5年)	2,610,000,000	2,586,353,400	
第158回利付国債(5年)	3,360,000,000	3,318,268,800	
第159回利付国債(5年)	1,750,000,000	1,725,762,500	
第160回利付国債(5年)	1,730,000,000	1,712,267,500	
第161回利付国債(5年)	2,840,000,000	2,821,085,600	
第162回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,696,542,300	
第163回利付国債(5年)	4,240,000,000	4,222,912,800	
第164回利付国債(5年)	1,750,000,000	1,727,180,000	
第165回利付国債(5年)	2,510,000,000	2,487,485,300	
第166回利付国債(5年)	1,540,000,000	1,532,469,400	
第167回利付国債(5年)	1,160,000,000	1,153,248,800	
第168回利付国債(5年)	2,330,000,000	2,336,500,700	
第169回利付国債(5年)	1,780,000,000	1,777,312,200	
第170回利付国債(5年)	2,580,000,000	2,585,263,200	
第171回利付国債(5年)	3,070,000,000	3,048,356,500	
第172回利付国債(5年)	650,000,000	648,375,000	
第1回利付国債(40年)	740,000,000	801,242,400	
第2回利付国債(40年)	1,030,000,000	1,070,808,600	
第3回利付国債(40年)	730,000,000	753,958,600	
第4回利付国債(40年)	1,030,000,000	1,056,460,700	
第5回利付国債(40年)	1,050,000,000	1,028,149,500	
第6回利付国債(40年)	1,630,000,000	1,552,640,200	
第7回利付国債(40年)	1,460,000,000	1,319,051,600	
第8回利付国債(40年)	1,480,000,000	1,230,634,800	
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,352,429,200	
第10回利付国債(40年)	2,140,000,000	1,502,772,200	
第11回利付国債(40年)	1,915,000,000	1,281,537,150	
第12回利付国債(40年)	1,430,000,000	838,180,200	
第13回利付国債(40年)	2,360,000,000	1,350,462,800	
第14回利付国債(40年)	2,270,000,000	1,378,253,200	
第15回利付国債(40年)	2,950,000,000	1,970,806,500	

第16回利付国債(40年)	2,680,000,000	1,957,766,800	
第17回利付国債(40年)	1,070,000,000	1,014,327,900	
第341回利付国債(10年)	5,030,000,000	5,029,094,600	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,741,959,600	
第343回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,651,503,200	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,864,128,000	
第345回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,846,523,200	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,706,127,500	
第347回利付国債(10年)	3,840,000,000	3,807,168,000	
第348回利付国債(10年)	4,340,000,000	4,298,162,400	
第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,103,652,800	
第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	6,488,400,600	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	5,325,000,000	5,251,248,750	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,164,265,800	
第353回利付国債(10年)	4,415,000,000	4,339,459,350	
第354回利付国債(10年)	4,420,000,000	4,336,241,000	
第355回利付国債(10年)	4,170,000,000	4,083,806,100	
第356回利付国債(10年)	4,800,000,000	4,691,040,000	
第357回利付国債(10年)	4,670,000,000	4,557,639,800	
第358回利付国債(10年)	3,370,000,000	3,284,300,900	
第359回利付国債(10年)	4,065,000,000	3,955,895,400	
第360回利付国債(10年)	5,370,000,000	5,215,182,900	
第361回利付国債(10年)	5,580,000,000	5,409,363,600	
第362回利付国債(10年)	4,710,000,000	4,556,218,500	
第363回利付国債(10年)	5,260,000,000	5,076,899,400	
第364回利付国債(10年)	5,020,000,000	4,832,553,200	
第365回利付国債(10年)	4,767,000,000	4,576,606,020	
第366回利付国債(10年)	5,510,000,000	5,315,937,800	
第367回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,607,453,100	
第368回利付国債(10年)	6,120,000,000	5,870,732,400	
第369回利付国債(10年)	5,170,000,000	5,066,651,700	
第370回利付国債(10年)	5,880,000,000	5,747,817,600	
第371回利付国債(10年)	5,660,000,000	5,469,937,200	
第372回利付国債(10年)	5,410,000,000	5,396,529,100	
第373回利付国債(10年)	6,130,000,000	5,992,075,000	
第374回利付国債(10年)	5,320,000,000	5,278,397,600	
第375回利付国債(10年)	5,700,000,000	5,793,594,000	
第376回利付国債(10年)	30,000,000	29,850,300	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	121,837,100	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	175,284,800	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	131,288,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	125,059,000	



第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,043,000
第6回利付国債(30年)	580,000,000	649,350,600
第7回利付国債(30年)	880,000,000	983,056,800
第8回利付国債(30年)	850,000,000	919,785,000
第9回利付国債(30年)	240,000,000	252,288,000
第10回利付国債(30年)	160,000,000	164,233,600
第11回利付国債(30年)	260,000,000	279,515,600
第12回利付国債(30年)	190,000,000	210,723,300
第13回利付国債(30年)	400,000,000	440,220,000
第14回利付国債(30年)	750,000,000	852,382,500
第15回利付国債(30年)	340,000,000	389,558,400
第16回利付国債(30年)	400,000,000	458,448,000
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,284,810,000
第18回利付国債(30年)	505,000,000	569,301,650
第19回利付国債(30年)	630,000,000	709,921,800
第20回利付国債(30年)	660,000,000	757,402,800
第21回利付国債(30年)	960,000,000	1,082,044,800
第22回利付国債(30年)	300,000,000	344,490,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	493,743,200
第24回利付国債(30年)	780,000,000	895,954,800
第25回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,125,700,000
第26回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,830,505,600
第27回利付国債(30年)	1,370,000,000	1,571,746,200
第28回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,846,396,300
第29回利付国債(30年)	1,770,000,000	2,004,100,200
第30回利付国債(30年)	1,970,000,000	2,201,041,600
第31回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,773,270,100
第32回利付国債(30年)	1,950,000,000	2,168,302,500
第33回利付国債(30年)	2,410,000,000	2,569,734,800
第34回利付国債(30年)	2,085,000,000	2,277,174,450
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,629,519,200
第36回利付国債(30年)	2,310,000,000	2,440,792,200
第37回利付国債(30年)	2,705,000,000	2,808,195,750
第38回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,415,437,000
第39回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,857,564,000
第40回利付国債(30年)	1,290,000,000	1,307,518,200
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,303,397,600
第42回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,547,566,800
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,374,793,400
第44回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,587,556,600
第45回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,519,984,000
第46回利付国債(30年)	1,890,000,000	1,790,661,600
第47回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,750,676,200

第48回利付国債（30年）	1,750,000,000	1,617,822,500	
第49回利付国債（30年）	1,820,000,000	1,677,585,000	
第50回利付国債（30年）	1,860,000,000	1,512,942,600	
第51回利付国債（30年）	1,840,000,000	1,326,161,600	
第52回利付国債（30年）	1,830,000,000	1,376,141,700	
第53回利付国債（30年）	1,550,000,000	1,186,711,000	
第54回利付国債（30年）	1,880,000,000	1,499,582,000	
第55回利付国債（30年）	1,600,000,000	1,269,904,000	
第56回利付国債（30年）	1,780,000,000	1,406,805,200	
第57回利付国債（30年）	1,730,000,000	1,361,510,000	
第58回利付国債（30年）	2,090,000,000	1,637,891,200	
第59回利付国債（30年）	1,450,000,000	1,103,827,000	
第60回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,281,028,700	
第61回利付国債（30年）	1,530,000,000	1,154,277,900	
第62回利付国債（30年）	1,335,000,000	951,174,150	
第63回利付国債（30年）	1,460,000,000	1,006,086,000	
第64回利付国債（30年）	1,640,000,000	1,123,367,200	
第65回利付国債（30年）	1,235,000,000	841,553,700	
第66回利付国債（30年）	1,465,000,000	992,361,700	
第67回利付国債（30年）	1,695,000,000	1,208,568,900	
第68回利付国債（30年）	1,670,000,000	1,184,063,400	
第69回利付国債（30年）	1,720,000,000	1,248,066,400	
第70回利付国債（30年）	1,940,000,000	1,401,242,600	
第71回利付国債（30年）	1,470,000,000	1,056,841,800	
第72回利付国債（30年）	1,810,000,000	1,295,217,900	
第73回利付国債（30年）	1,840,000,000	1,310,576,800	
第74回利付国債（30年）	2,130,000,000	1,643,763,600	
第75回利付国債（30年）	1,760,000,000	1,462,454,400	
第76回利付国債（30年）	1,810,000,000	1,538,300,900	
第77回利付国債（30年）	1,890,000,000	1,682,572,500	
第78回利付国債（30年）	1,460,000,000	1,235,291,400	
第79回利付国債（30年）	950,000,000	761,596,000	
第80回利付国債（30年）	2,270,000,000	2,105,810,900	
第81回利付国債（30年）	1,910,000,000	1,686,931,100	
第82回利付国債（30年）	1,670,000,000	1,545,200,900	
第83回利付国債（30年）	1,610,000,000	1,627,516,800	
第84回利付国債（30年）	40,000,000	39,527,600	
第83回利付国債（20年）	290,000,000	295,988,500	
第84回利付国債（20年）	470,000,000	479,165,000	
第85回利付国債（20年）	290,000,000	297,047,000	
第86回利付国債（20年）	510,000,000	523,821,000	
第87回利付国債（20年）	1,790,000,000	1,836,003,000	

第 8 8 回利付国債(20年)	420,000,000	433,158,600
第 8 9 回利付国債(20年)	350,000,000	360,388,000
第 9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	651,331,800
第 9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	466,092,000
第 9 2 回利付国債(20年)	880,000,000	911,759,200
第 9 3 回利付国債(20年)	120,000,000	124,534,800
第 9 4 回利付国債(20年)	610,000,000	634,503,700
第 9 5 回利付国債(20年)	830,000,000	871,159,700
第 9 6 回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,660,484,700
第 9 7 回利付国債(20年)	900,000,000	945,954,000
第 9 8 回利付国債(20年)	440,000,000	461,199,200
第 9 9 回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,482,981,600
第 1 0 0 回利付国債(20年)	480,000,000	508,108,800
第 1 0 1 回利付国債(20年)	715,000,000	761,668,050
第 1 0 2 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,261,939,200
第 1 0 3 回利付国債(20年)	400,000,000	426,340,000
第 1 0 4 回利付国債(20年)	160,000,000	169,384,000
第 1 0 5 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,252,924,000
第 1 0 6 回利付国債(20年)	680,000,000	724,635,200
第 1 0 7 回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,171,511,000
第 1 0 8 回利付国債(20年)	840,000,000	887,754,000
第 1 0 9 回利付国債(20年)	920,000,000	974,712,400
第 1 1 0 回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,174,888,000
第 1 1 1 回利付国債(20年)	970,000,000	1,043,196,200
第 1 1 2 回利付国債(20年)	990,000,000	1,060,200,900
第 1 1 3 回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,169,237,600
第 1 1 4 回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,971,861,600
第 1 1 5 回利付国債(20年)	700,000,000	757,778,000
第 1 1 6 回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,802,892,800
第 1 1 7 回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,140,043,400
第 1 1 8 回利付国債(20年)	660,000,000	711,942,000
第 1 1 9 回利付国債(20年)	460,000,000	491,155,800
第 1 2 0 回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,130,422,900
第 1 2 1 回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,742,229,000
第 1 2 2 回利付国債(20年)	750,000,000	802,297,500
第 1 2 3 回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,962,180,000
第 1 2 4 回利付国債(20年)	760,000,000	823,954,000
第 1 2 5 回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,362,846,800
第 1 2 6 回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,184,165,100
第 1 2 7 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,101,824,400
第 1 2 8 回利付国債(20年)	1,620,000,000	1,753,180,200
第 1 2 9 回利付国債(20年)	740,000,000	796,099,400
第 1 3 0 回利付国債(20年)	2,055,000,000	2,213,522,700

第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,380,970,800	
第132回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,318,375,500	
第133回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,952,428,900	
第134回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,231,348,200	
第135回利付国債（20年）	220,000,000	236,075,400	
第136回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,321,381,200	
第137回利付国債（20年）	1,390,000,000	1,492,137,200	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,407,858,200	
第139回利付国債（20年）	480,000,000	511,776,000	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,675,654,400	
第141回利付国債（20年）	1,700,000,000	1,827,007,000	
第142回利付国債（20年）	1,315,000,000	1,423,921,450	
第143回利付国債（20年）	1,620,000,000	1,728,216,000	
第144回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,228,324,000	
第145回利付国債（20年）	2,275,000,000	2,445,761,500	
第146回利付国債（20年）	2,670,000,000	2,869,902,900	
第147回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,919,607,000	
第148回利付国債（20年）	2,360,000,000	2,490,366,400	
第149回利付国債（20年）	2,950,000,000	3,107,294,000	
第150回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,490,810,200	
第151回利付国債（20年）	2,205,000,000	2,251,900,350	
第152回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,526,748,000	
第153回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,412,087,000	
第154回利付国債（20年）	2,735,000,000	2,773,782,300	
第155回利付国債（20年）	2,140,000,000	2,120,825,600	
第156回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,531,458,600	
第157回利付国債（20年）	2,910,000,000	2,612,336,100	
第158回利付国債（20年）	2,790,000,000	2,585,074,500	
第159回利付国債（20年）	2,600,000,000	2,427,984,000	
第160回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,268,822,200	
第161回利付国債（20年）	2,520,000,000	2,333,293,200	
第162回利付国債（20年）	1,820,000,000	1,677,275,600	
第163回利付国債（20年）	2,620,000,000	2,404,400,200	
第164回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,136,436,500	
第165回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,125,392,300	
第166回利付国債（20年）	1,940,000,000	1,779,794,800	
第167回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,077,592,400	
第168回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,514,130,600	
第169回利付国債（20年）	2,170,000,000	1,849,274,000	
第170回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,007,508,500	
第171回利付国債（20年）	2,020,000,000	1,701,648,000	
第172回利付国債（20年）	1,750,000,000	1,489,495,000	

	第173回利付国債（20年）	2,200,000,000	1,861,244,000
	第174回利付国債（20年）	2,360,000,000	1,985,680,400
	第175回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,017,083,300
	第176回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,016,169,400
	第177回利付国債（20年）	2,230,000,000	1,846,417,700
	第178回利付国債（20年）	2,460,000,000	2,062,734,600
	第179回利付国債（20年）	2,825,000,000	2,357,377,750
	第180回利付国債（20年）	2,340,000,000	2,048,833,800
	第181回利付国債（20年）	2,560,000,000	2,271,027,200
	第182回利付国債（20年）	2,240,000,000	2,048,412,800
	第183回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,384,673,000
	第184回利付国債（20年）	2,530,000,000	2,297,821,900
	第185回利付国債（20年）	2,480,000,000	2,243,755,200
	第186回利付国債（20年）	2,500,000,000	2,412,900,000
	第187回利付国債（20年）	2,030,000,000	1,888,062,400
	第188回利付国債（20年）	1,980,000,000	1,931,371,200
	第189回利付国債（20年）	1,260,000,000	1,287,644,400
	国債証券合計	589,997,000,000	567,250,114,970
地方債証券	第2回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,113,000
	第5回東京都公募公債（東京グリーンボンド（30年））	100,000,000	70,487,000
	第6回東京都公募公債（東京ソーシャルボンド（5年））	100,000,000	99,277,000
	第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	111,285,000
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	107,815,000
	第13回東京都公募公債（30年）	100,000,000	103,219,000
	第15回東京都公募公債（30年）	100,000,000	99,310,000
	第16回東京都公募公債（20年）	200,000,000	211,404,000
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,070,000
	第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,866,000
	第19回東京都公募公債（30年）	100,000,000	71,519,000
	第26回東京都公募公債（20年）	200,000,000	213,702,000
	第27回東京都公募公債（20年）	200,000,000	212,998,000
	第33回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,074,000
	第38回東京都公募公債（20年）	200,000,000	164,136,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	99,953,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,274,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,108,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	295,479,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	194,064,000
	第830回東京都公募公債	300,000,000	288,003,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,695,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,411,000

平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,362,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	196,564,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	195,256,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	98,948,000	
第39回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	97,402,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	229,724,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	106,704,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	214,590,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,076,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	106,606,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	103,220,000	
第43回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	83,822,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	99,751,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,238,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,108,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	194,014,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	206,217,440	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	214,784,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	300,000,000	321,840,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	106,769,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,107,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	155,093,640	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	198,234,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	196,550,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	98,227,000	
第458回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	96,671,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	154,081,600	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	174,952,960	
第469回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	192,028,000	
平成21年度第3回京都府公募公債(20年)	100,000,000	107,410,000	
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	106,969,000	
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	89,844,000	
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	91,685,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	135,527,705	
第2回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	105,297,000	
第6回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,829,000	
第7回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,094,000	
第8回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,012,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	400,000,000	431,676,000	
第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	89,740,000	

令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	291,978,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	93,246,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	76,971,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,635,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,099,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,135,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,187,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,098,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	300,548,100	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	162,807,150	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	107,546,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,938,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,707,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,280,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	198,362,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	272,910,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	98,673,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	75,795,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	193,936,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	96,919,000	
令和2年度第13回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	83,415,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債（30年）	200,000,000	140,718,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	97,953,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	106,741,000	
平成21年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	214,256,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	125,340,202	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,130,000	
令和2年度第1回広島県公募公債（20年）	200,000,000	165,226,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	377,574,600	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	96,605,000	
第2回埼玉県公募公債（10年）	100,000,000	98,454,000	
第3回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	105,021,000	
第6回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	106,435,000	
第6回埼玉県公募公債（30年）	100,000,000	81,187,000	
第7回埼玉県公募公債（15年）	600,000,000	550,326,000	

第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	215,200,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	181,708,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	214,590,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	180,518,000	
第23回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	89,317,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	400,000,000	400,276,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,174,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,383,000	
第28回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	165,808,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,131,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,610,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	96,460,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	143,460,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,216,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	105,908,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,377,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,199,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,039,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	105,540,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	101,387,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,063,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	75,795,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	90,089,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	291,243,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	96,289,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	89,719,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン ボンド・10年)	100,000,000	98,210,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	97,962,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	212,870,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,204,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	106,635,000	
第20回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	91,436,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,178,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,100,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	290,553,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,811,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	126,919,000	



令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	98,816,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,797,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	289,044,000	
令和6年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	300,783,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	98,113,000	
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	100,162,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	213,354,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	97,918,000	
第30回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	100,540,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	99,018,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,109,000	
第153回共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,345,000	
第154回共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,850,000	
第156回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,978,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,408,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,570,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,414,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,708,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,035,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,250,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,373,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,230,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	587,703,270	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,051,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	295,974,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,156,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	191,436,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	192,196,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,116,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,283,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,754,000	
第255回共同発行市場公募地方債	300,000,000	301,488,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	96,677,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	97,819,510	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,088,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	99,026,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,004,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	193,296,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	215,452,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	70,083,000	
第19回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	100,174,000	
第19回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	100,787,000	

第22回大阪市公募公債（20年）	600,000,000	542,616,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	92,468,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	192,666,000	
第1回名古屋市長募公債（30年）	100,000,000	113,888,000	
第5回名古屋市長募公債（30年）	100,000,000	112,853,000	
第9回名古屋市長募公債（20年）	100,000,000	105,989,000	
第11回名古屋市長募公債（30年）	100,000,000	98,043,000	
第499回名古屋市長募公債（10年）	100,000,000	99,304,000	
第512回名古屋市長募公債（10年）	300,000,000	291,177,000	
第528回名古屋市長募公債（10年）	100,000,000	100,540,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,496,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	193,592,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	99,343,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	124,050,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	212,862,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,096,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	106,729,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	70,950,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	70,280,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	321,195,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,242,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,245,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,717,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	98,787,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	205,904,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	291,201,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	96,330,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	102,246,000	
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	101,516,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	99,745,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	195,018,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	106,671,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	176,980,000	
第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	105,223,000	
第27回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	89,700,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,241,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,562,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,091,000	

	平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,424,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	107,164,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	104,718,000	
	2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	98,596,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,208,300	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,155,500	
	令和元年度第2回広島市公募公債（20年）	200,000,000	164,892,000	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	533,951,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	193,802,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	287,364,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	96,173,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	97,412,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	97,889,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,342,000	
	地方債証券合計	35,277,030,000	34,672,840,977	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	91,564,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	60,065,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,149,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,145,000	
	第109回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	60,985,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	51,757,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	132,613,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,466,000	
	第21回道路債券	100,000,000	114,762,000	
	第28回道路債券	200,000,000	231,106,000	
	第33回道路債券	200,000,000	232,528,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,951,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,696,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,446,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,554,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,963,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,176,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,594,000	

第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,633,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,499,000	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,579,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,196,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,329,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,355,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,108,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,691,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,313,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,484,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	542,514,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,441,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	70,810,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,000,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,804,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,698,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,702,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,370,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	164,822,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,788,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,633,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	72,603,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	247,000,000	244,522,590	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,362,000	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	111,030,080	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	203,292,350	
	200,000,000	198,086,000	

第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,189,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,179,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,280,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	283,791,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,503,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,141,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,041,000	
第331回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,902,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	118,674,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,168,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	270,204,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	210,997,580	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,221,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,888,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	269,976,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	115,910,400	
第474回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	292,845,000	
第477回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	298,395,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	336,270,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	102,138,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	345,315,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	229,308,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	113,083,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	214,564,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	211,520,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	137,788,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,373,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	535,270,000	

第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,040,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,248,000	
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	500,000,000	526,695,000	
第43回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	99,967,000	
第45回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	100,458,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,828,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,004,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,647,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	199,868,370	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,718,000	
第86回地方公共団体金融機構債券(20年)	300,000,000	248,565,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,080,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,149,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	248,871,520	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	355,621,810	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,109,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,057,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	108,815,300	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	153,953,280	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,631,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,841,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,514,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,181,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,214,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	195,364,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,438,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,294,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,508,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,492,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,968,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,802,000	
F246回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,564,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,940,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	99,019,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	198,558,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,252,000	
第28回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,572,000	

第30回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	298,104,000	
第31回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,801,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	107,101,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	108,644,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,290,620	
第44回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	116,038,260	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,106,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,515,700	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,458,670	
第117回都市再生債券	200,000,000	200,328,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	104,546,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	58,193,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	119,998,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	81,918,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	298,902,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,853,000	
第23回政府保証中部国際空港債券	104,000,000	103,414,480	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	76,599,000	75,611,638	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,039,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	53,896,000	53,288,053	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	103,935,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	93,657,000	92,288,671	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	107,463,000	105,417,979	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	38,166,000	37,524,429	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	136,005,000	133,316,181	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	93,010,000	91,272,573	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,280,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,578,000	12,879,746	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,134,000	12,424,851	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,776,000	14,215,316	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,883,000	16,396,815	
第29回政府保証住宅金融支援機構債券	600,000,000	593,064,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,805,000	17,403,089	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,129,000	17,705,733	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,760,000	36,940,080	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,950,000	16,414,464	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,524,000	16,997,082	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,096,000	16,567,129	

第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,271,000	15,709,430	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,208,000	33,013,522	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,056,000	17,489,222	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,793,000	23,296,041	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,728,000	22,208,623	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,879,000	22,379,591	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,888,000	47,766,212	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,968,000	59,376,648	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,616,000	30,753,772	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,971,000	96,130,595	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,072,000	32,490,860	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,756,000	28,146,526	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,549,000	26,726,878	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,491,000	31,946,989	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	162,181,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,687,000	82,233,486	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,200,000	111,794,920	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,269,000	32,261,255	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,756,000	33,725,619	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,711,000	34,530,155	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,040,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,567,000	107,830,915	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,525,000	37,117,478	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,604,000	77,943,460	
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,116,000	44,205,107	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,979,000	46,731,546	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	307,254,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,252,000	46,266,795	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,719,000	145,915,646	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,024,000	97,908,492	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,979,000	47,835,340	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,611,000	51,254,688	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,790,000	55,226,738	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,246,000	60,467,692	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,403,000	59,469,477	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,091,000	60,302,580	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,494,000	60,925,546	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,867,000	61,106,660	



第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	129,698,000	122,228,692	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,921,000	62,781,936	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	268,172,000	251,690,148	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,536,000	62,247,089	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,432,000	62,140,492	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,376,000	63,003,297	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,484,000	128,151,586	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	134,386,000	125,602,531	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,244,000	129,321,732	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,993,000	64,383,577	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,332,000	127,777,812	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,363,000	64,623,426	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	140,096,000	130,048,314	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,970,000	129,901,957	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,209,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,152,000	66,384,104	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,597,000	66,046,317	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,740,000	65,515,851	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	146,502,000	134,871,206	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,542,000	67,561,564	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,464,000	66,700,213	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	148,652,000	136,435,778	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,009,000	68,271,691	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,922,000	206,121,260	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,140,000	139,280,904	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,397,000	71,932,383	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,350,000	72,559,227	

第158回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,928,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	162,490,000	148,723,847	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,226,000	75,235,145	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,568,000	151,353,987	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,792,000	152,997,779	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,124,000	76,036,847	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,060,000	153,466,327	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,318,000	152,496,974	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,880,000	77,689,815	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,806,000	78,160,685	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	256,104,000	233,231,351	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,971,000	78,338,494	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,583,000	80,053,489	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,196,000	80,533,353	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,669,000	81,952,323	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,496,000	82,790,959	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,116,000	167,063,209	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,591,000	86,624,020	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,326,000	176,338,414	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,151,000	89,169,915	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	87,875,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,092,000	89,098,089	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,009,000	89,820,651	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,890,000	184,671,822	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,410,000	93,194,579	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,456,000	93,531,607	
第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,960,000	98,952,083	

第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,170,000	
第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	58,751,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	69,281,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	280,242,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,676,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,495,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,634,000	
い第876号商工債	400,000,000	394,900,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,540,000	
い第888号商工債	200,000,000	199,722,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,317,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,118,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,612,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	395,140,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,645,000	
第411回信金中金債（5年）	200,000,000	197,886,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	99,907,000	
第20回アングス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	298,413,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	106,305,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,882,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	194,220,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	483,820,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,838,000	
第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,914,000	
第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,493,000	
第114回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,083,000	
第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,144,000	
第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,040,000	
第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,102,000	
第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	398,288,000	
第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,221,000	
第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,904,000	
第107回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,042,000	
第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,157,000	
第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,248,000	
第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,070,000	
第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,876,000	
第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,262,000	
第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,488,000	
第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,109,000	
第91回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,378,000	
第93回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	298,806,000	

	第9 2回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,077,000	
	第1 2 7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	185,912,000	
	特殊債券合計	37,732,321,000	36,711,372,694	
社債券	第4 1回フランス相互信用連合銀行(B F C M)円貨社債	200,000,000	199,670,000	
	第1 4回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,209,000	
	第3 2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,230,000	
	第3 3回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,102,000	
	第1 9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	398,652,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債(2023)	100,000,000	99,453,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債(2023)	400,000,000	398,432,000	
	第1 2回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	99,834,000	
	第3 9回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	96,495,000	
	第2 4回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,753,000	
	第3 2回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,168,000	
	第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,240,000	
	第2 4回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	297,312,000	
	第2 5回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	95,503,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,680,000	
	第1 9回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,604,000	
	第1 9回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,304,000	
	第1 2回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,156,000	
	第2 7回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	198,872,000	
	第7回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,336,000	
	第8回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,054,000	
	第9回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	100,000,000	99,514,000	
	第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	98,246,000	
	第1 1回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,415,000	
	第1 0回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,434,000	
	第2 5回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,649,000	
	第2 7回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,536,000	

第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,603,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,154,000	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,471,000	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,366,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,396,000	
第9回株式会社クレハ無担保社債	100,000,000	99,751,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	98,301,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,603,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	98,484,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	197,586,000	
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	79,016,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,501,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,541,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	195,050,000	
第2回株式会社A D E K A無担保社債	100,000,000	99,278,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	284,739,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,702,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,790,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	299,163,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,496,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	200,000,000	200,144,000	
第23回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,646,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	95,566,000	
第2回サイグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,434,000	
第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,792,000	
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	96,865,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,976,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,381,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,865,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	96,503,000	
第20回住友大阪セメント株式会社無担保社債	100,000,000	100,246,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,245,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,643,000	
第17回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	100,178,000	

第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,274,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	98,003,000	
第59回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	99,940,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,246,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,638,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,138,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,103,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	96,409,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,479,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,002,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,420,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,392,000	
第39回ソニーグループ株式会社無担保社債	500,000,000	496,555,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,573,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,869,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,003,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,237,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,749,000	
第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,622,000	
第31回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,359,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,652,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	191,642,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	100,402,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,475,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,237,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	199,496,000	
第9回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	91,311,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	83,102,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,995,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,812,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	194,742,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,833,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,343,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	192,104,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	98,107,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,260,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,690,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,724,000	
第106回株式会社クレディセゾン無担保社債	200,000,000	199,954,000	

第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	96,407,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	98,890,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,639,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,895,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,662,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,628,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,038,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	387,964,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,712,000	
第26回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	194,334,000	
第30回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	300,087,000	
第34回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,820,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,659,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,212,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,681,000	
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	300,048,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,190,000	
第44回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,023,000	
第47回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,459,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	98,979,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,107,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,818,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,751,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,168,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	96,516,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,502,000	
第36回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	198,582,000	
第42回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,224,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,724,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,829,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,360,000	

第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,567,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,380,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,707,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,240,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,884,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	197,670,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,074,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	197,082,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	189,416,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,616,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	83,436,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	95,319,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,554,000	
第17回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	86,881,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,256,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,888,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,198,000	
第89回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,726,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,722,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,424,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,413,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	70,535,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	84,550,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,477,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,433,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	212,970,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,325,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,995,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,282,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	69,281,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,806,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	69,710,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	82,137,000	



第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	60,409,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,721,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	66,087,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	78,565,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	81,899,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,058,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,082,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,693,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	69,063,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	57,773,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	47,500,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	61,356,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	72,622,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	141,294,000	
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	87,752,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	100,374,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,070,000	
第32回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,910,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,787,000	
第26回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	200,090,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	168,558,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,361,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,257,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,955,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	81,448,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	95,149,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,336,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,704,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,061,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,752,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,188,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,814,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,135,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,176,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,854,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	195,354,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,463,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	290,295,000	
第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,688,000	

第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,081,000	
第323回北陸電力株式会社社債	100,000,000	89,817,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	195,222,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	178,610,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,897,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,208,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	193,908,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	95,290,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,775,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,843,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	94,797,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,548,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,431,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,584,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,008,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	194,186,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,901,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	94,920,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,530,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	92,101,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,348,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	87,096,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,500,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	89,174,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,188,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,418,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,210,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,011,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,965,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	198,280,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,082,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,340,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,713,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	264,813,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,006,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	93,282,000	
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,862,000	
	100,000,000	101,548,000	

第75回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	95,447,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	198,788,000	
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	99,610,000	
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	97,918,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	69,479,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,502,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	190,978,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	81,629,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	197,252,000	
社債券合計	32,700,000,000	31,477,301,000	
合計		670,111,629,641	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

項目	2024年10月21日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	14,376,773,854
コール・ローン	417,658,316
株式	774,929,627,836
投資信託受益証券	119,172,531
投資証券	15,409,420,132
派生商品評価勘定	647,183,904
未収入金	1
未収配当金	491,414,751
未収利息	2,469
差入委託証拠金	8,333,297,955
流動資産合計	814,724,551,749
資産合計	814,724,551,749
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,605,233
前受金	645,195,967
未払解約金	400,915,994
流動負債合計	1,047,717,194
負債合計	1,047,717,194
純資産の部	
元本等	
元本	117,351,481,892

	2024年10月21日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	696,325,352,663
元本等合計	813,676,834,555
純資産合計	813,676,834,555
負債純資産合計	814,724,551,749

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年10月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 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>

	2024年10月21日現在
	(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10月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,351,481,892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 6.9337円 (1万口当たり純資産額) (69,337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10月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2024年10月21日現在
期首	2024年 4月23日
期首元本額	115,178,385,575円
期中追加設定元本額	7,943,611,935円
期中一部解約元本額	5,770,515,618円
期末元本額	117,351,481,892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）	1,391,340,190円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,163,567円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,636,476,635円
世界経済インデックスファンド	15,157,793,156円
外国株式インデックス・オープン	866,581,518円
D C マイセレクション 2 5	516,586,450円
D C マイセレクション 5 0	2,979,508,333円
D C マイセレクション 7 5	3,953,507,028円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,431,110,246円
D C マイセレクション S 2 5	326,242,590円
D C マイセレクション S 5 0	1,776,380,894円
D C マイセレクション S 7 5	1,944,992,786円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	7,902,692円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	116,527,844円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	96,751,229円
D C 世界経済インデックスファンド	8,617,190,199円
外国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	890,581,662円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,454,957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）	12,057,244円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,688,963円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	18,912,040円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	5,486,379円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	17,153,142円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	93,315,064円
バランス B（3 7. 5）V A 1（適格機関投資家専用）	102,536,950円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	799,930,175円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	54,811,118円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	11,215,006円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	87,027,594円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	27,325,009円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	627,958,922円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	661,060,387円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,145,140,221円
コア投資戦略ファンド（安定型）	116,440,151円
コア投資戦略ファンド（成長型）	289,209,523円
分散投資コア戦略ファンド A	1,285,712,778円
分散投資コア戦略ファンド S	6,018,408,147円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,562,224,025円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	975,381,130円
コア投資戦略ファンド（切替型）	89,182,776円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	422,521,644円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,043,457円
S M T インデックスバランス・オープン	101,455,756円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	70,026,638円
外国株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	5,789,692,109円
S M T 世界経済インデックス・オープン	276,728,313円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,299,963,411円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	210,999,185円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,679,255円
M y S M T グローバル株式インデックス（ノーロード）	3,009,260,753円
グローバル経済コア	691,557,937円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	15,191,400円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	6,223,424円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	96,251,542円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	33,222,439円

区分	2024年10月21日現在
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	169,805,329円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	179,796,574円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	81,627,269円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	106,266,715円
10資産分散投資ファンド	60,217,851円
グローバル10資産バランスファンド	19,983,957円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	3,918,039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	122,516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	24,376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	135,945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	39,986円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	32,107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	20,435円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	286,615円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	67,412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）	45,481,767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）	475,855,378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）	719,921,062円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,468,933,628円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	108,308,430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）	52,091,389円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,415,674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）	92,664,221円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	153,127,006円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	160,396,345円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	159,803,351円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	150,009,176円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	148,763,609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）	41,853,589円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	101,697,279円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	59,502,688,795
投資信託受益証券	8,244,836
投資証券	2,340,394,328
合計	61,834,838,287

(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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引			
	買建	22,141,761,450	-	22,786,957,417
合計		22,141,761,450	-	22,786,957,417

(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にて評価しております。

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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	367,895,400	-	367,512,696	382,704
	アメリカドル	367,895,400	-	367,512,696	382,704
合計		367,895,400	-	367,512,696	382,704

### (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	33,009	25.16	830,506.44	
	BAKER HUGHES CO	77,332	36.40	2,814,884.80	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	182.19	3,297,456.81	
	CHEVRON CORP	138,866	150.75	20,934,049.50	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	129.98	623,904.00	
	CONOCOPHILLIPS	93,272	105.67	9,856,052.24	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	23.78	1,297,103.88	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	40.66	2,043,408.96	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	183.99	2,440,995.33	
	EOG RESOURCES INC	45,763	126.62	5,794,511.06	
	EQT CORPORATION	43,539	36.49	1,588,738.11	
	EXPAND ENERGY CORP	16,182	86.66	1,402,332.12	
	EXXON MOBIL	355,800	120.01	42,699,558.00	
	HALLIBURTON CO	70,302	28.33	1,991,655.66	
	HESS CORP	21,602	139.42	3,011,750.84	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	44.27	594,501.83	
	KINDER MORGAN INC	160,038	24.95	3,992,948.10	
	MARATHON OIL CORP	39,344	26.72	1,051,271.68	
	MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	158.30	4,367,180.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	55,201	51.66	2,851,683.66	



ONEOK INC	47,287	97.23	4,597,715.01
OVINTIV INC	20,398	40.79	832,034.42
PHILLIPS 66	32,264	132.60	4,278,206.40
SCHLUMBERGER	110,287	41.92	4,623,231.04
TARGA RESOURCES CORP	17,298	162.75	2,815,249.50
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	1,058.53	1,692,589.47
VALERO ENERGY CORP	26,282	137.04	3,601,685.28
WILLIAMS COS	97,655	52.36	5,113,215.80
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	332.10	5,804,775.90
ALBEMARLE CORP	8,403	95.14	799,461.42
AMCOR PLC	110,292	11.24	1,239,682.08
AVERY DENNISON CORP	6,638	217.33	1,442,636.54
BALL CORP	25,896	67.25	1,741,506.00
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	135.97	1,166,894.54
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,872	83.99	1,081,119.28
CORTEVA INC	57,731	59.41	3,429,798.71
CRH PLC	55,795	93.48	5,215,716.60
CROWN HOLDINGS INC	9,940	97.75	971,635.00
DOW INC	56,967	53.11	3,025,517.37
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	85.09	2,903,185.71
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	108.84	961,274.88
ECOLAB INC	20,345	261.46	5,319,403.70
FREEMONT-MCMORAN INC	110,698	48.18	5,333,429.64
INT'L PAPER CO	25,191	46.78	1,178,434.98
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	104.50	2,017,581.50
LINDE PLC	38,142	486.45	18,554,175.90
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	91.49	1,806,470.05
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	581.00	2,914,877.00
MOSAIC CO/THE	27,732	26.26	728,242.32
NEWMONT CORPORATION	92,555	57.62	5,333,019.10
NUCOR CORP	18,727	158.24	2,963,360.48
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,847	220.12	1,727,281.64
PPG INDUSTRIES INC	17,495	130.93	2,290,620.35
RELIANCE INC	4,126	296.92	1,225,091.92
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	133.51	1,395,980.56
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,348	388.36	7,513,989.28
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	44.35	1,812,141.00
STEEL DYNAMICS INC	11,618	136.57	1,586,670.26
VULCAN MATERIALS CO	10,153	261.72	2,657,243.16
WESTLAKE CORP	2,222	139.34	309,613.48
3 M COMPANY	43,663	135.14	5,900,617.82
AECOM	10,456	107.89	1,128,097.84

AERCAP HOLDINGS NV	14,679	97.49	1,431,055.71
ALLEGION PLC	7,721	153.36	1,184,092.56
AMETEK INC	17,753	169.40	3,007,358.20
AXON ENTERPRISE INC	5,367	438.05	2,351,014.35
BOEING CO	46,725	155.00	7,242,375.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	194.97	1,856,504.34
CARLISLE COS INC	3,456	471.16	1,628,328.96
CARRIER GLOBAL CORP	66,700	81.55	5,439,385.00
CATERPILLAR	38,627	393.86	15,213,630.22
CNH INDUSTRIAL NV	54,445	11.16	607,606.20
CUMMINS INC	10,453	335.51	3,507,086.03
DEERE&CO	20,534	408.73	8,392,861.82
DOVER CORP	10,657	194.38	2,071,507.66
EATON CORP	32,052	348.18	11,159,865.36
EMCOR GROUP INC	3,640	453.74	1,651,613.60
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	110.44	4,860,464.40
FASTENAL CO	44,011	77.90	3,428,456.90
FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	204.48	3,324,844.80
FORTIVE CORP	25,894	77.47	2,006,008.18
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	90.01	928,003.10
GE AEROSPACE	87,134	192.61	16,782,879.74
GE VERNOVA INC	20,868	272.72	5,691,120.96
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	308.48	5,601,688.32
GRACO INC	13,378	85.92	1,149,437.76
GRAINGER (WW) INC	3,363	1,127.00	3,790,101.00
HEICO CORP	3,640	260.89	949,639.60
HEICO CORP-CLASS A	5,700	203.57	1,160,349.00
HONEYWELL INTL INC	51,027	222.02	11,329,014.54
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	105.54	3,340,129.92
HUBBELL INC	4,458	456.81	2,036,458.98
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	261.53	897,832.49
IDEX CORP	5,916	210.53	1,245,495.48
ILLINOIS TOOL WORKS	24,149	261.03	6,303,613.47
INGERSOLL-RAND INC	31,562	100.40	3,168,824.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	37.60	477,520.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	54,141	77.44	4,192,679.04
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	248.78	3,652,587.96
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	603.05	1,523,304.30
LOCKHEED MARTIN CORP	17,339	611.81	10,608,173.59
MASCO CORP	18,934	85.71	1,622,833.14
NORDSON CORP	4,121	257.17	1,059,797.57
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,345	530.79	6,021,812.55

OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	106.01	3,256,309.17
OWENS CORNING	6,460	189.60	1,224,816.00
PACCAR INC	40,380	110.09	4,445,434.20
PARKER HANNIFIN CORP	10,443	640.44	6,688,114.92
PENTAIR PLC	14,383	99.04	1,424,492.32
QUANTA SERVICES INC	11,573	314.27	3,637,046.71
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	272.82	2,309,694.12
RTX CORP	105,649	125.92	13,303,322.08
SMITH (A.O.) CORP	9,016	78.75	710,010.00
SNAP-ON INC	4,000	326.09	1,304,360.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	106.40	1,340,427.20
TEXTRON	13,876	90.05	1,249,533.80
TORO CO	8,812	83.89	739,238.68
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	402.54	7,245,720.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,495	1,397.16	6,280,234.20
UNITED RENTALS INC	5,364	839.27	4,501,844.28
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	112.25	3,255,811.25
WABTEC CORP	13,304	191.15	2,543,059.60
WATSCO INC	2,656	502.73	1,335,250.88
XYLEM INC	19,668	134.32	2,641,805.76
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	292.29	9,329,604.51
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	163.91	1,514,528.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	219.10	2,112,124.00
CINTAS CORP	29,848	214.02	6,388,068.96
COPART INC	69,100	53.88	3,723,108.00
DAYFORCE INC	10,668	65.00	693,420.00
EQUIFAX INC	10,261	281.99	2,893,499.39
JACOBS SOLUTIONS INC	11,026	143.90	1,586,641.40
LEIDOS HOLDINGS	9,314	169.52	1,578,909.28
PAYCHEX INC	26,671	141.53	3,774,746.63
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	165.89	702,544.15
REPUBLIC SERVICES INC	18,062	204.80	3,699,097.60
ROLLINS INC	25,466	50.14	1,276,865.24
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,884	76.68	1,524,705.12
TRANSUNION	15,741	107.86	1,697,824.26
VERALTO CORP	20,685	113.60	2,349,816.00
VERISK ANALYTICS INC	10,738	267.62	2,873,703.56
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	182.60	3,610,915.00
WASTE MANAGEMENT INC	32,252	212.75	6,861,613.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	110.12	921,415.87
CSX CORP	152,551	34.12	5,205,040.12
DELTA AIR LINES INC	15,193	55.80	847,769.40

EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	120.50	1,479,740.00
FEDEX CORP	18,843	274.40	5,170,519.20
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.73	710,057.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	176.87	1,016,648.76
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	51.95	707,714.85
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	252.37	4,538,117.34
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16,382	199.54	3,268,864.28
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	30.98	419,252.34
U-HAUL HOLDING CO	6,606	67.53	446,103.18
UBER TECHNOLOGIES INC	149,157	79.16	11,807,268.12
UNION PACIFIC CORP	48,392	244.10	11,812,487.20
UNITED PARCEL SERVICE B	58,139	135.93	7,902,834.27
APTIV PLC	21,896	71.76	1,571,256.96
FORD MOTOR COMPANY	320,913	11.10	3,562,134.30
GENERAL MOTORS CO	89,296	49.18	4,391,577.28
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	10.04	515,413.44
TESLA INC	227,655	220.70	50,243,458.50
DECKERS OUTDOOR CORP	12,618	161.85	2,042,223.30
DR HORTON INC	22,973	194.56	4,469,626.88
GARMIN LTD	13,022	167.58	2,182,226.76
LENNAR CORP-CL A	18,864	188.93	3,563,975.52
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	291.63	2,513,558.97
NIKE B	94,445	82.92	7,831,379.40
NVR INC	247	9,924.40	2,451,326.80
PULTE GROUP INC	16,747	149.04	2,495,972.88
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	136.45	4,752,144.15
BOOKING HOLDINGS INC	2,707	4,350.82	11,777,669.74
CARNIVAL CORPORATION	71,810	21.32	1,530,989.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	110,522	59.39	6,563,901.58
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	164.59	1,515,380.13
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	428.85	1,221,364.80
DOORDASH INC - A	24,442	151.98	3,714,695.16
DRAFTKINGS INC	32,654	38.46	1,255,872.84
EXPEDIA GROUP INC	9,628	159.61	1,536,725.08
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	232.33	3,030,047.86
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	238.81	4,689,034.35
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	153.93	582,932.91
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	51.55	1,575,625.75
MARRIOTT INTL A	19,516	265.60	5,183,449.60
MCDONALD'S CORP	57,161	316.56	18,094,886.16
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	41.19	636,879.78
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,480	199.94	4,094,771.20

STARBUCKS CORP	88,273	96.84	8,548,357.32
WYNN RESORTS LTD	6,702	99.44	666,446.88
YUM BRANDS INC	22,162	134.27	2,975,691.74
ALPHABET INC-CL A	465,895	163.42	76,136,560.90
ALPHABET INC-CL C	400,960	165.05	66,178,448.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	325.61	2,341,787.12
COMCAST CORP-CL A	309,993	41.93	12,998,006.49
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	144.35	2,848,458.55
FOX CORP - CLASS A	21,544	42.47	914,973.68
FOX CORP- CLASS B	10,345	38.97	403,144.65
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	32.03	913,207.33
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	80.28	1,234,626.12
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	114.94	1,334,798.22
MATCH GROUP INC	22,730	38.43	873,513.90
META PLATFORMS INC-CLASS A	173,814	576.47	100,198,556.58
NETFLIX INC	34,177	763.89	26,107,468.53
NEWS CORP-CLASS A	33,479	26.33	881,502.07
OMNICOM GROUP	14,048	104.48	1,467,735.04
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	61,829	10.45	646,113.05
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	33.18	1,518,549.06
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	39.93	1,402,062.09
ROKU INC	9,122	80.07	730,398.54
SEA LTD-ADR	28,338	98.90	2,802,628.20
SNAP INC - A	72,602	10.49	761,594.98
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	155.27	1,997,859.09
THE WALT DISNEY CO	146,237	97.28	14,225,935.36
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,780	118.76	4,367,992.80
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	7.82	1,387,369.66
AMAZON.COM	742,859	188.99	140,392,922.41
AUTOZONE INC	1,368	3,182.07	4,353,071.76
BATH & BODY WORKS INC	13,452	31.94	429,656.88
BEST BUY COMPANY INC	15,285	96.14	1,469,499.90
BURLINGTON STORES INC	5,108	257.78	1,316,740.24
CARMAX INC	10,695	74.70	798,916.50
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	218.66	1,082,367.00
EBAY	41,952	64.95	2,724,782.40
GENUINE PARTS CO	12,194	143.17	1,745,814.98
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	38.11	266,770.00
HOME DEPOT	78,650	415.00	32,639,750.00
LKQ CORP	19,286	39.31	758,132.66
LOWES COMPANIES	45,655	281.64	12,858,274.20
MERCADOLIBRE INC	3,573	2,079.79	7,431,089.67

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,210.96	5,542,563.92
POOL CORP	2,664	370.41	986,772.24
ROSS STORES INC	27,581	149.90	4,134,391.90
TJX COMPANIES INC	88,680	117.71	10,438,522.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,065	297.62	2,697,925.30
ULTA BEAUTY INC	3,920	368.92	1,446,166.40
WILLIAMS-SONOMA INC	11,384	144.03	1,639,637.52
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	19.00	475,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,163	889.56	31,279,598.28
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	80.60	1,312,732.20
DOLLAR TREE INC	16,318	68.20	1,112,887.60
KROGER CO	56,964	56.53	3,220,174.92
SYSCO CORP	40,090	75.54	3,028,398.60
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,356	156.84	5,858,915.04
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	10.79	556,407.93
WALMART INC	350,884	81.31	28,530,378.04
ALTRIA GROUP INC	139,180	49.61	6,904,719.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	56.40	2,290,855.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	48.97	689,595.54
BUNGE GLOBAL SA	11,604	89.55	1,039,138.20
CAMPBELL SOUP CO	15,869	48.50	769,646.50
CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	33.85	442,385.65
COCA-COLA CO	324,600	70.44	22,864,824.00
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	78.72	1,211,815.68
CONAGRA BRANDS INC	33,324	30.32	1,010,383.68
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	241.52	3,170,191.52
GENERAL MILLS INC	43,531	69.93	3,044,122.83
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	185.68	2,031,710.56
HORMEL FOODS CORP	23,338	32.19	751,250.22
JM SMUCKER CO	7,850	121.73	955,580.50
KELLANOVA	23,448	81.05	1,900,460.40
KEURIG DR PEPPER INC	90,354	36.94	3,337,676.76
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	36.00	2,482,704.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	78.22	928,940.72
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	80.18	1,450,616.56
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	56.00	821,464.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	71.58	7,546,750.98
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	54.05	3,153,709.40
PEPSICO INC	108,994	175.06	19,080,489.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	123,299	120.21	14,821,772.79
TYSON FOODS INC	23,306	60.01	1,398,593.06
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	104.34	2,018,561.64

CLOROX COMPANY	9,570	161.96	1,549,957.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	100.46	6,222,291.48
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	90.04	1,692,752.00
KENVUE INC	148,093	21.72	3,216,579.96
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	145.41	3,908,184.57
PROCTER & GAMBLE CO	187,206	171.28	32,064,643.68
ABBOTT LABORATORIES	137,979	119.39	16,473,312.81
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	219.70	1,154,084.10
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	36.86	1,532,491.36
BECTON DICKINSON & CO	23,549	243.75	5,740,068.75
BOSTON SCIENTIFIC CORP	116,607	88.07	10,269,578.49
CARDINAL HEALTH	19,151	112.41	2,152,763.91
CENCORA INC	14,462	237.43	3,433,712.66
CENTENE CORP	40,934	62.02	2,538,726.68
COOPER COS INC/THE	16,443	108.26	1,780,119.18
CVS HEALTH CORP	99,034	60.34	5,975,711.56
DAVITA INC	4,627	161.97	749,435.19
DEXCOM INC	33,285	72.38	2,409,168.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,765	70.27	3,496,986.55
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	430.77	7,853,798.64
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	91.34	3,014,037.32
HCA HEALTHCARE INC	15,457	415.54	6,423,001.78
HENRY SCHEIN INC	8,755	72.39	633,774.45
HOLOGIC INC	18,875	81.57	1,539,633.75
HUMANA INC	9,955	267.14	2,659,378.70
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	457.74	3,041,224.56
INSULET CORP	5,246	236.59	1,241,151.14
INTUITIVE SURGICAL INC	28,412	521.15	14,806,913.80
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	215.77	1,412,861.96
MCKESSON CORP	10,179	509.20	5,183,146.80
MEDTRONIC PLC	102,632	92.24	9,466,775.68
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	289.72	1,316,777.40
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	149.65	1,298,812.35
RESMED INC	10,920	240.00	2,620,800.00
SOLVENTUM CORP	10,915	73.68	804,217.20
STERIS PLC	8,172	225.65	1,844,011.80
STRYKER CORP	27,317	369.56	10,095,270.52
TELEFLEX INC	3,934	239.94	943,923.96
THE CIGNA GROUP	22,885	336.00	7,689,360.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,000	569.61	41,581,530.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	236.67	1,105,722.24
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	221.32	2,764,508.12

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	106.31	1,621,652.74
ABBVIE INC	140,059	188.86	26,451,542.74
AGILENT TECHNOLOGIES	24,157	138.83	3,353,716.31
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	295.93	2,853,652.99
AMGEN	42,902	321.66	13,799,857.32
AVANTOR INC	49,647	24.73	1,227,770.31
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	346.37	641,823.61
BIO-TECHNE CORP	12,980	71.24	924,695.20
BIOGEN INC	12,520	190.16	2,380,803.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	70.11	1,036,436.13
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	162,165	53.22	8,630,421.30
CATALENT INC	13,739	60.29	828,324.31
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	197.77	831,425.08
DANAHER CORP	52,873	274.38	14,507,293.74
ELI LILLY & CO	64,074	917.97	58,818,009.78
EXACT SCIENCES CORP	12,208	71.93	878,121.44
GILEAD SCIENCES INC	100,590	86.72	8,723,164.80
ILLUMINA INC	11,423	146.07	1,668,557.61
INCYTE CORP	15,212	66.39	1,009,924.68
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	236.69	3,274,842.84
JOHNSON & JOHNSON	190,885	165.12	31,518,931.20
MERCK & CO	200,889	108.70	21,836,634.30
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,373.98	2,235,465.46
MODERNA INC	25,884	54.10	1,400,324.40
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,925	118.01	1,053,239.25
PFIZER	449,444	29.22	13,132,753.68
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,604	990.68	8,523,810.72
REVVITY INC	8,524	119.67	1,020,067.08
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	27.98	841,722.34
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	17.95	1,653,930.95
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,276	601.71	18,217,371.96
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	368.43	1,332,979.74
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,565	483.00	9,932,895.00
VIATRIS INC	89,720	11.76	1,055,107.20
WATERS CORP	4,749	348.45	1,654,789.05
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	293.32	1,691,576.44
ZOETIS INC	35,994	193.28	6,956,920.32
BANK OF AMERICA CORP	558,243	42.32	23,624,843.76
CITIGROUP	152,078	62.85	9,558,102.30
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	42.47	1,678,499.34
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	44.67	2,430,941.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	2,115.01	1,620,097.66



HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	15.36	1,752,760.32
JPMORGAN CHASE & CO	227,765	225.37	51,331,398.05
KEY CORP	71,223	17.35	1,235,719.05
M & T BANK CORP	13,791	197.55	2,724,412.05
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	189.38	5,971,719.54
REGIONS FINL CORP	70,810	23.82	1,686,694.20
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	43.67	4,643,955.14
US BANCORP	124,604	49.16	6,125,532.64
WELLS FARGO & CO	273,850	64.36	17,624,986.00
ALLY FINANCIAL INC	21,529	35.01	753,730.29
AMERICAN EXPRESS	45,006	276.79	12,457,210.74
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	523.16	4,089,018.56
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	32,488	145.01	4,711,084.88
ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	169.89	2,504,348.49
BANK NEW YORK CO	56,329	76.67	4,318,744.43
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,044	464.80	48,824,451.20
BLACKROCK INC	11,959	1,007.02	12,042,952.18
BLACKSTONE INC	57,676	172.36	9,941,035.36
BLOCK INC	42,352	74.66	3,162,000.32
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	159.03	4,786,325.91
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	52.28	819,175.32
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	209.27	1,842,247.82
CME GROUP INC	27,997	228.32	6,392,275.04
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,368	220.21	3,163,977.28
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	31.71	610,385.79
CORPAY INC	4,988	353.51	1,763,307.88
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	148.68	2,822,987.16
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	45.98	1,286,658.34
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	471.53	1,484,376.44
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	90.95	4,135,496.50
FISERV INC	46,319	197.29	9,138,275.51
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	20.98	546,948.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	93.26	402,510.16
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	102.31	2,122,830.19
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,667	528.50	13,565,009.50
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,196	166.83	7,706,878.68
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	186.12	970,243.56
KKR & CO INC	47,919	139.81	6,699,555.39
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	258.62	1,419,823.80
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	288.83	926,277.81
MASTERCARD INC-CLASS A	65,849	516.34	34,000,472.66
MOODY'S CORP	13,270	488.46	6,481,864.20

MORGAN STANLEY	97,076	121.06	11,752,020.56
MSCI INC	6,530	608.02	3,970,370.60
NASDAQ INC	34,296	74.91	2,569,113.36
NORTHERN TRUST CORP	15,902	96.40	1,532,952.80
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	80.94	6,417,408.84
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	115.63	2,113,138.25
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	138.51	2,144,965.86
ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	26.83	1,252,102.44
S&P GLOBAL INC	25,389	524.80	13,324,147.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	122,251	71.36	8,723,831.36
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	73.35	700,492.50
STATE STREET CORP	22,335	91.43	2,042,089.05
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	56.42	1,647,238.32
TOAST INC-CLASS A	31,526	30.32	955,868.32
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	133.04	1,205,475.44
VISA INC-CLASS A SHARES	124,853	290.62	36,284,778.86
AFLAC	43,196	114.50	4,945,942.00
ALLSTATE CORP	20,722	195.37	4,048,457.14
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	136.32	861,406.08
AMERICAN INT'L GROUP	50,875	78.55	3,996,231.25
AON PLC	15,249	357.93	5,458,074.57
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	108.53	3,227,356.61
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,453	289.25	5,048,280.25
ASSURANT INC	4,726	197.50	933,385.00
BROWN & BROWN INC	20,155	106.39	2,144,290.45
CHUBB LTD	30,987	301.66	9,347,538.42
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,618	141.40	1,925,585.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	481.68	1,043,318.88
EVEREST GROUP LTD	3,288	384.23	1,263,348.24
FNF GROUP	20,461	62.16	1,271,855.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,814	122.00	3,027,308.00
LOEWS CORP	16,402	81.82	1,342,011.64
MARKEL GROUP INC	1,007	1,590.65	1,601,784.55
MARSH & MCLENNAN COS	39,706	224.66	8,920,349.96
METLIFE INC	48,925	85.32	4,174,281.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	90.46	1,676,766.56
PROGRESSIVE CORP	46,607	251.12	11,703,949.84
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,466	127.40	3,753,968.40
TRAVELERS COS INC/THE	18,639	265.45	4,947,722.55
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	290.03	2,243,962.11
WR BERKLEY CORP	21,540	61.26	1,319,540.40
WEYERHAEUSER CO	63,311	33.06	2,093,061.66

ACCENTURE PLC-CL A	49,681	376.86	18,722,781.66
ADOBE INC	35,487	494.90	17,562,516.30
AKAMA I TECHNOLOGIES, INC	11,484	106.67	1,224,998.28
ANSYS INC	6,794	327.40	2,224,355.60
APPLOVIN CORP-CLASS A	16,202	145.22	2,352,854.44
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	239.08	572,357.52
ATLASSIAN CORP-CL A	13,451	191.70	2,578,556.70
AUTODESK INC	17,030	292.99	4,989,619.70
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	49.94	739,761.22
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,140	258.52	5,465,112.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	206.23	1,455,571.34
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	90.80	2,094,483.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,334	78.00	3,224,052.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,728	310.15	5,808,489.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	299.98	929,938.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	128.12	2,662,333.60
DOCUSIGN INC	14,969	72.30	1,082,258.70
DYNATRACE INC	22,028	54.86	1,208,456.08
EPAM SYSTEMS INC	4,768	201.58	961,133.44
FAIR ISAAC CORP	2,026	1,973.46	3,998,229.96
FORTINET INC	53,692	81.07	4,352,810.44
GARTNER INC	5,859	531.09	3,111,656.31
GEN DIGITAL INC	43,555	27.20	1,184,696.00
GODADDY INC - CLASS A	11,388	164.70	1,875,603.60
HUBSPOT INC	3,646	537.14	1,958,412.44
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,859	232.20	16,917,859.80
INTUIT INC	22,172	613.29	13,597,865.88
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	298.28	1,400,126.32
MICROSOFT CORP	560,017	418.16	234,176,708.72
MICROSTRATEGY INC-CL A	12,190	215.86	2,631,333.40
MONDAY.COM LTD	2,838	287.31	815,385.78
MONGODB INC	5,325	275.54	1,467,250.50
OKTA INC	11,505	74.82	860,804.10
ORACLE CORP	131,290	174.69	22,935,050.10
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	160,620	42.97	6,901,841.40
PALO ALTO NETWORKS INC	25,444	374.83	9,537,174.52
PTC INC	9,741	184.40	1,796,240.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	557.62	4,715,234.72
SALESFORCE INC	76,856	292.94	22,514,196.64
SAMSARA INC-CL A	13,283	50.00	664,150.00
SERVICENOW INC	16,388	921.75	15,105,639.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	119.54	2,813,732.52

SYNOPSYS INC	11,896	507.03	6,031,628.88
TWILIO INC - A	12,842	70.85	909,855.70
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	588.43	1,964,767.77
VERISIGN INC	6,723	187.72	1,262,041.56
WIX.COM LTD	5,010	173.39	868,683.90
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	244.48	4,017,295.36
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	70.52	1,471,681.88
ZSCALER INC	7,204	190.01	1,368,832.04
AMPHENOL CORPORATION	96,707	67.46	6,523,854.22
APPLE INC	1,155,407	235.00	271,520,645.00
ARISTA NETWORKS INC	20,702	402.00	8,322,204.00
CDW CORP/DE	11,273	218.31	2,461,008.63
CISCO SYSTEMS	319,544	56.76	18,137,317.44
CORNING	66,604	46.66	3,107,742.64
DELL TECHNOLOGIES -C	23,308	126.46	2,947,529.68
F5 INC	4,851	217.48	1,054,995.48
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	20.69	2,015,868.08
HP INC	77,024	37.28	2,871,454.72
JABIL INC	9,340	126.30	1,179,642.00
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	39.21	992,836.41
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	159.95	2,213,388.10
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	475.20	6,253,156.80
NETAPP INC	15,191	126.53	1,922,117.23
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	57.07	1,362,546.25
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	112.12	1,631,121.76
SUPER MICRO COMPUTER INC	42,160	47.26	1,992,481.60
TE CONNECTIVITY PLC	25,340	148.97	3,774,899.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,107	450.06	1,848,396.42
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	61.77	1,094,440.86
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	67.03	1,728,703.70
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	375.45	1,562,622.90
AT&T INC	568,700	21.85	12,426,095.00
T-MOBILE US INC	41,896	223.21	9,351,606.16
VERIZON COMMUNICATIONS	333,856	43.99	14,686,325.44
AES CORP	54,375	17.47	949,931.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	62.17	1,291,768.26
AMEREN CORPORATION	20,898	88.84	1,856,578.32
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	100.69	4,100,096.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	141.96	2,053,877.28
ATMOS ENERGY CORP	11,302	143.26	1,619,124.52
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	30.11	1,429,201.26
CMS ENERGY CORP	23,697	71.29	1,689,359.13

CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	106.76	2,954,583.00
CONSTELLATION ENERGY	25,537	270.16	6,899,075.92
DOMINION ENERGY INC	70,231	59.92	4,208,241.52
DTE ENERGY COMPANY	15,851	128.90	2,043,193.90
DUKE ENERGY CORP	60,351	120.76	7,287,986.76
EDISON INTL	30,900	85.43	2,639,787.00
ENERGY CORP	16,181	135.28	2,188,965.68
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	40.55	827,179.45
EVERGY INC	18,475	61.12	1,129,192.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	66.13	1,815,268.50
EXELON CORP	81,573	40.95	3,340,414.35
FIRSTENERGY CORP	47,081	43.66	2,055,556.46
NEXTERA ENERGY INC	164,785	84.38	13,904,558.30
NISOURCE INC	32,351	35.14	1,136,814.14
NRG ENERGY INC	17,078	86.33	1,474,343.74
PG&E CORP	164,187	20.38	3,346,131.06
PPL CORPORATION	58,459	32.66	1,909,270.94
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	89.76	3,614,276.16
SEMPRA	49,744	85.96	4,275,994.24
SOUTHERN CO	86,109	93.24	8,028,803.16
VISTRA CORP	28,511	131.16	3,739,502.76
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	99.85	2,341,182.95
XCEL ENERGY INC	41,562	64.07	2,662,877.34
ADVANCED MICRO DEVICES	128,197	155.97	19,994,886.09
ANALOG DEVICES	39,357	228.33	8,986,383.81
APPLIED MATERIALS	66,508	186.36	12,394,430.88
BROADCOM INC	350,741	179.89	63,094,798.49
ENPHASE ENERGY INC	9,617	91.64	881,301.88
ENTEGRIS INC	12,389	103.23	1,278,916.47
FIRST SOLAR INC	7,921	200.55	1,588,556.55
INTEL CORP	344,792	22.77	7,850,913.84
KLA CORP	10,710	678.52	7,266,949.20
LAM RESEARCH CORP	102,370	72.84	7,456,630.80
MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	79.85	5,409,757.65
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	77.34	3,149,130.12
MICRON TECHNOLOGY	88,663	111.15	9,854,892.45
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	916.29	3,583,610.19
NVIDIA CORP	1,951,142	138.00	269,257,596.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,641	233.45	4,818,641.45
ON SEMICONDUCTOR CORP	36,454	68.49	2,496,734.46
QORVO INC	8,678	104.50	906,851.00
QUALCOMM	88,515	170.92	15,128,983.80

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,336	98.61	1,413,672.96
	TERADYNE INC	12,318	126.04	1,552,560.72
	TEXAS INSTRUMENTS	72,611	198.47	14,411,105.17
	CBRE GROUP INC-A	22,995	125.68	2,890,011.60
	COSTAR GROUP INC	33,027	79.25	2,617,389.75
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.02	396,774.00
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	63.71	752,351.39
	アメリカドル 小計	29,237,274		3,985,793,978.17 (595,597,194,157)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	55,750	22.87	1,275,002.50
	CAMECO CORP	31,793	80.13	2,547,573.09
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,204	49.06	8,104,908.24
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.38	2,602,030.34
	ENBRIDGE	175,303	57.97	10,162,314.91
	IMPERIAL OIL	16,202	106.31	1,722,434.62
	KEYERA CORP	18,607	44.02	819,080.14
	MEG ENERGY CORP	13,934	25.66	357,546.44
	PARKLAND CORP	7,149	35.43	253,289.07
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	59.45	2,731,192.45
	SUNCOR ENERGY	98,973	54.00	5,344,542.00
	TC ENERGY CORP	82,559	66.42	5,483,568.78
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	62.32	1,558,560.88
	AGNICO EAGLE MINES	40,306	119.01	4,796,817.06
	BARRICK GOLD CORP	133,727	28.88	3,862,035.76
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	83.30	776,522.60
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	18.30	1,194,386.10
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	182.46	2,853,856.86
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	19.68	1,020,348.96
	KINROSS GOLD CORP	108,451	14.64	1,587,722.64
	LUNDIN MINING CORP	38,990	14.47	564,185.30
	NUTRIEN LTD	37,152	65.84	2,446,087.68
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	33.69	755,195.04
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	69.66	2,464,988.76
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	133.11	466,550.55
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	91.81	3,396,143.71
	CAE INC	25,999	26.49	688,713.51
	STANTEC INC	9,001	115.65	1,040,965.65
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	133.62	696,561.06
	WSP GLOBAL INC	9,951	250.49	2,492,625.99
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	29.50	961,080.50
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	20,393	57.07	1,163,828.51
	RB GLOBAL INC	14,445	111.99	1,617,695.55

THOMSON REUTERS CORP	13,471	232.76	3,135,509.96
AIR CANADA	13,805	18.28	252,355.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	156.84	6,624,451.08
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	110.57	8,085,431.25
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	189.95	1,108,738.15
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	60.06	1,216,455.24
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	79.32	243,512.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	65.60	644,192.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	97.39	2,247,079.47
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	159.72	720,816.36
DOLLARAMA INC	22,000	144.74	3,184,280.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,541	73.73	4,684,877.93
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	40.75	282,397.50
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	177.23	2,288,570.99
METRO INC	18,840	84.76	1,596,878.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	223.36	1,167,279.36
SAPUTO INC	20,898	27.82	581,382.36
BANK MONTREAL	56,278	129.87	7,308,823.86
BANK NOVA SCOTIA	97,216	73.96	7,190,095.36
CANADIAN IMPERIAL BANK	77,158	86.48	6,672,623.84
NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	131.32	3,630,472.72
ROYAL BANK OF CANADA	112,236	174.08	19,538,042.88
TORONTO-DOMINION BANK	136,393	77.84	10,616,831.12
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	71.15	2,063,421.15
BROOKFIELD CORP	111,490	77.89	8,683,956.10
IGM FINANCIAL INC	7,685	42.49	326,535.65
ONEX CORP	6,603	99.11	654,423.33
TMX GROUP LTD	23,425	43.69	1,023,438.25
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,772	1,728.54	3,062,972.88
GREAT-WEST LIFE CO INC	23,788	47.63	1,133,022.44
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	118.44	826,355.88
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	270.87	3,590,381.85
MANULIFE FINANCIAL CORP	149,878	42.10	6,309,863.80
POWER CORP OF CANADA	43,577	44.39	1,934,383.03
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	78.90	3,441,144.60
CGI INC - CL A	16,084	160.58	2,582,768.72
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	4,431.06	6,881,436.18
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	147.04	1,026,927.36
OPEN TEXT CORP	20,463	46.96	960,942.48
SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	114.20	10,749,646.00
BCE INC	6,203	46.31	287,260.93
QUEBECOR INC -CL B	15,200	34.34	521,968.00

	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	53.97	1,504,737.57
	TELUS CORP	32,908	22.57	742,733.56
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	35.70	870,901.50
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	45.84	517,762.80
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.94	381,368.56
	EMERA INC	25,484	53.60	1,365,942.40
	FORTIS INC	45,064	62.09	2,798,023.76
	HYDRO ONE LTD	29,579	46.32	1,370,099.28
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	258.17	694,477.30
	カナダドル 小計	3,262,081		237,136,348.24 (25,660,524,243)
ユーロ	ENI	182,356	14.10	2,571,584.31
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	16.54	656,207.79
	NESTE OIL OYJ	32,766	15.29	500,992.14
	OMV AG	12,549	38.76	486,399.24
	REPSOL SA	89,536	11.72	1,049,361.92
	TENARIS SA	40,648	14.53	590,615.44
	TOTALENERGIES SE	172,328	59.66	10,281,088.48
	AIR LIQUIDE	46,418	173.68	8,061,878.24
	AKZO NOBEL	12,357	63.40	783,433.80
	ARCELORMITTAL	43,366	22.48	974,867.68
	ARKEMA	4,369	84.30	368,306.70
	BASF SE	70,406	46.99	3,308,377.94
	COVESTRO AG	14,454	58.44	844,691.76
	DSM-FIRMENICH AG	16,194	118.10	1,912,511.40
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	21.07	337,899.59
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	98.70	1,062,505.50
	OCI NV	7,248	25.15	182,287.20
	STORA ENSO OYJ R	42,169	10.84	457,111.96
	SYENSQO SA	5,356	74.03	396,504.68
	SYMRISE AG	10,018	118.45	1,186,632.10
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	28.66	1,213,005.84
	VOESTALPINE AG	7,152	20.28	145,042.56
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	17,256	43.88	757,193.28
	AIRBUS SE	48,168	139.56	6,722,326.08
	ALSTOM	24,388	20.51	500,197.88
	BOUYGUES ORD	16,606	30.18	501,169.08
	BRENTAG SE	9,500	64.28	610,660.00
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	37.80	1,484,708.40
	DASSAULT AVIATION SA	2,130	191.90	408,747.00
	EIFFAGE	5,924	89.86	532,330.64
	FERROVIAL SE	45,136	38.96	1,758,498.56



GEA GROUP AG	13,382	47.00	628,954.00
IMCD NV	4,641	152.00	705,432.00
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	83.30	1,032,753.40
KNORR-BREMSE AG	5,022	81.50	409,293.00
KONE OYJ-B	26,369	52.96	1,396,502.24
LEGRAND SA	19,340	106.35	2,056,809.00
LEONARDO SPA	31,340	21.99	689,166.60
METSO CORPORATION	51,970	9.44	490,700.74
MTU AERO ENGINES AG	3,962	311.00	1,232,182.00
PRYSMIAN SPA	21,155	67.92	1,436,847.60
RATIONAL AG	483	933.50	450,880.50
REXEL SA	17,411	25.93	451,467.23
RHEINMETALL AG	3,759	488.10	1,834,767.90
SAFRAN SA	26,619	215.10	5,725,746.90
SAINT-GOBAIN	36,177	84.78	3,067,086.06
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,466	246.05	10,694,809.30
SIEMENS	60,279	185.60	11,187,782.40
SIEMENS ENERGY AG	47,513	36.52	1,735,174.76
THALES SA	6,657	153.50	1,021,849.50
VINCI S.A.	39,327	107.30	4,219,787.10
WARTSILA OYJ	41,917	20.02	839,178.34
BUREAU VERITAS SA	25,073	30.34	760,714.82
RANDSTAD NV	10,680	43.59	465,541.20
TELEPERFORMANCE	4,734	99.12	469,234.08
WOLTERS KLUWER	19,155	159.00	3,045,645.00
ADP	2,382	113.10	269,404.20
AENA SME SA	5,508	204.00	1,123,632.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.76	306,790.73
DHL GROUP	82,579	38.00	3,138,002.00
GETLINK	21,115	16.08	339,529.20
INPOST SA	15,470	18.72	289,598.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	75.10	1,848,736.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	71.00	354,361.00
CONTINENTAL AG	8,168	60.44	493,673.92
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	67.32	690,299.28
FERRARI NV	10,026	443.30	4,444,525.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	58,663	57.30	3,361,389.90
MICHELIN	57,385	34.32	1,969,453.20
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	40.24	472,618.80
RENAULT SA	17,081	40.48	691,438.88
STELLANTIS NV	166,407	12.18	2,027,502.88
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	91.92	1,408,949.76

ADIDAS AG	12,783	227.90	2,913,245.70
HERMES INTERNATIONAL	2,556	2,089.00	5,339,484.00
KERING	5,534	238.05	1,317,368.70
LVMH	21,865	623.20	13,626,268.00
MONCLER SPA	18,908	55.20	1,043,721.60
PUMA SE	9,220	39.37	362,991.40
SEB SA	2,282	98.30	224,320.60
ACCOR	14,436	41.98	606,023.28
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	67.54	2,483,580.88
DELIVERY HERO SE	13,414	38.66	518,585.24
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	36.82	298,536.56
SODEXO	6,173	76.20	470,382.60
BOLLORE SE	31,761	5.91	187,707.51
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	98.60	475,942.20
PUBLICIS GROUPE	17,217	101.50	1,747,525.50
SCOUT24 SE	7,536	80.50	606,648.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	24.07	1,584,431.82
VIVENDI SE	61,243	10.56	646,726.08
D'IETEREN GROUP	2,217	195.50	433,423.50
INDITEX	87,257	53.70	4,685,700.90
PROSUS	112,590	39.34	4,429,290.60
ZALANDO SE	17,664	29.91	528,330.24
CARREFOUR	39,746	15.13	601,356.98
JERONIMO MARTINS	21,861	16.95	370,543.95
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.46	370,832.59
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	30.72	2,178,048.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73,503	60.72	4,463,102.16
DANONE (GROUPE)	51,810	64.80	3,357,288.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	78,177	7.78	608,217.06
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	67.25	639,682.00
HEINEKEN NV	23,160	78.32	1,813,891.20
JDE PEET'S BV	7,000	18.96	132,720.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	94.60	1,032,369.80
LOTUS BAKERIES	38	12,380.00	470,440.00
PERNOD-RICARD	15,339	127.65	1,958,023.35
BEIERSDORF AG	7,430	131.80	979,274.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	76.90	675,182.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,880	84.84	1,007,899.20
LOREAL	19,298	372.70	7,192,364.60
AMPLIFON SPA	11,650	27.76	323,404.00
BIOMERIEUX	3,044	105.90	322,359.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	64.80	222,264.00

DIASORIN ITALIA SPA	2,070	104.75	216,832.50
ESSILORLUXOTTICA	22,901	216.90	4,967,226.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	37.77	641,523.45
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	33.45	1,126,897.05
KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	29.50	1,966,057.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	52.44	1,130,973.48
ARGENX SE	4,935	509.40	2,513,889.00
BAYER	78,462	26.37	2,069,435.25
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	56.42	576,612.40
GRIFOLS SA	27,685	9.99	276,628.52
IPSEN	3,532	115.90	409,358.80
MERCK KGAA	10,703	164.70	1,762,784.10
ORION OYJ-CLASS B	10,139	47.63	482,920.57
QIAGEN N.V.	16,526	39.38	650,793.88
RECORDATI SPA	6,099	54.20	330,565.80
SANOFI	90,135	100.82	9,087,410.70
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	266.20	485,548.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	211.90	547,125.80
UCB (GROUPE)	9,389	173.40	1,628,052.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	45,808	15.60	714,604.80
AIB GROUP PLC	145,826	4.92	718,047.22
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	9.29	4,170,271.71
BANCO BPM SPA	118,197	6.40	756,697.19
BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.86	786,475.20
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.64	5,674,863.84
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	8.89	786,210.68
BNP PARIBAS	81,615	66.27	5,408,626.05
CAIXABANK	275,085	5.54	1,523,970.90
COMMERZBANK AG	81,889	16.59	1,358,538.51
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	14.31	1,247,724.03
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	50.20	1,273,875.20
FINECOBANK SPA	41,585	15.46	642,904.10
ING GROEP NV-CVA	256,546	15.98	4,099,605.08
INTESA SANPAOLO	1,145,097	4.00	4,580,388.00
KBC GROEP NV	18,057	67.98	1,227,514.86
MEDIOBANCA	33,860	16.12	545,992.50
NORDEA BANK ABP	276,242	11.08	3,060,761.36
SOCIETE GENERALE	53,019	23.95	1,270,070.14
UNICREDIT SPA	116,219	40.82	4,744,640.67
ADYEN NV	1,835	1,420.60	2,606,801.00
AMUNDI SA	4,626	70.70	327,058.20
DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	16.20	2,281,113.92

DEUTSCHE BOERSE	15,625	218.00	3,406,250.00
EDENRED	20,131	33.69	678,213.39
EURAZEO SA	3,357	74.70	250,767.90
EURONEXT NV	6,480	102.50	664,200.00
EXOR NV	7,825	98.70	772,327.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.55	600,733.25
NEXI SPA	48,458	5.98	289,778.84
SOFINA	1,238	239.00	295,882.00
AEGON LTD	101,846	5.90	601,706.16
AGEAS	11,086	49.34	546,983.24
ALLIANZ SE-REG	31,198	304.30	9,493,551.40
ASR NEDERLAND NV	11,959	45.06	538,872.54
AXA SA	145,111	36.08	5,235,604.88
GENERALI	84,111	26.98	2,269,314.78
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	257.70	1,148,053.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	505.20	5,261,152.80
NN GROUP NV	22,941	46.45	1,065,609.45
POSTE ITALIANE SPA	24,923	13.41	334,342.04
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	41.95	1,389,887.40
TALANX AG	5,053	76.45	386,301.85
BECHTLE AG	7,659	36.50	279,553.50
CAPGEMINI SA	12,235	184.55	2,257,969.25
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	33.31	1,650,410.57
NEMETSCHKE SE	5,455	101.50	553,682.50
SAP SE	82,823	212.85	17,628,875.55
NOKIA OYJ	396,129	4.27	1,693,253.41
CELLNEX TELECOM SA	42,906	36.12	1,549,764.72
DEUTSCHE TELEKOM	276,850	28.28	7,829,318.00
ELISA A	10,227	46.56	476,169.12
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.96	332,910.00
KPN (KON.)	290,883	3.80	1,105,355.40
ORANGE	153,281	10.17	1,559,634.17
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	215,695.65
TELEFONICA	297,657	4.43	1,320,108.79
ACCIONA SA	2,181	124.20	270,880.20
E.ON SE	192,389	13.02	2,505,866.72
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	13.95	303,440.40
ELIA GROUP SA/NV	987	97.50	96,232.50
ENDESA	25,972	19.66	510,739.38
ENEL	640,374	7.33	4,695,222.16
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.90	919,769.27
ENGIE	146,393	15.93	2,332,040.49

	FORTUM OYJ	32,550	14.56	474,090.75
	IBERDROLA SA	484,413	13.99	6,776,937.87
	REDEIA CORP SA	30,678	17.20	527,661.60
	RWE STAMM	52,507	31.49	1,653,445.43
	SNAM SPA	147,559	4.57	675,672.66
	TERNA SPA	95,819	8.21	787,248.90
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	59,881	30.57	1,830,562.17
	VERBUND AG	6,430	77.30	497,039.00
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	518.80	2,000,492.80
	ASML HOLDING NV	31,693	664.50	21,059,998.50
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	103.70	659,220.90
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,817	30.76	3,255,460.00
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	25.63	1,289,081.61
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	92.60	488,465.00
	VONOVIA SE	61,810	32.15	1,987,191.50
	ユーロ 小計	14,417,552		413,131,232.03 (67,075,986,832)
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	3.99	5,255,782.95
	SHELL PLC-NEW	500,920	25.36	12,705,835.80
	ANGLO AMERICAN PLC	101,769	23.79	2,421,593.35
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	18.29	546,066.24
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	37.42	408,776.08
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	18.72	329,546.88
	GLENCORE PLC	854,615	4.08	3,492,811.50
	MONDI PLC	37,918	12.83	486,487.94
	RIO TINTO PLC REG	88,047	49.95	4,398,387.88
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	59.02	1,966,369.34
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	13.24	3,179,422.51
	BUNZL PLC	29,337	35.76	1,049,091.12
	DCC PLC	6,622	52.45	347,323.90
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	4.41	446,528.25
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	686,376	5.67	3,894,497.42
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.33	432,353.08
	SPIRAX GROUP PLC	5,514	68.10	375,503.40
	EXPERIAN PLC	77,628	39.29	3,050,004.12
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	51.15	710,473.50
	RELX PLC	145,542	36.79	5,354,490.18
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	3.72	676,422.48
	BARRATT REDROW PLC	118,831	4.88	580,014.11
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,707	48.37	324,417.59
	PERSIMMON PLC	25,686	16.59	426,259.17
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.62	430,357.46

COMPASS GROUP PLC	140,293	25.17	3,531,174.81
ENTAIN PLC	49,630	7.27	361,008.62
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	86.18	1,192,127.94
PEARSON	55,305	10.38	574,342.42
WHITBREAD PLC	17,434	32.87	573,055.58
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.85	641,578.54
INFORMA PLC	110,598	8.38	927,253.63
WPP PLC	85,821	7.86	674,724.70
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.36	282,522.95
KINGFISHER PLC	153,717	3.13	481,749.07
NEXT PLC	8,464	102.45	867,136.80
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.79	414,744.66
TESCO PLC	525,585	3.61	1,901,566.53
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	23.48	604,375.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	26.40	4,170,672.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	28.30	508,268.00
DIAGEO	174,682	26.51	4,631,693.23
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	23.08	1,580,472.24
HALEON PLC	598,336	3.81	2,283,848.51
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	47.76	2,704,218.96
UNILEVER PLC	198,540	48.31	9,591,467.40
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.27	773,408.62
ASTRAZENECA	122,959	119.46	14,688,682.14
GSK PLC	335,128	14.76	4,946,489.28
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.98	357,841.80
BARCLAYS	1,129,529	2.42	2,736,284.00
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,485,052	6.80	10,107,263.91
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.62	3,002,346.37
NATWEST GROUP PLC	506,122	3.60	1,825,582.05
STANDARD CHARTERED PLC	161,358	8.38	1,352,825.47
3I GROUP PLC	74,757	34.03	2,543,980.71
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	10.86	359,237.94
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37,924	105.35	3,995,293.40
M&G PLC	131,539	2.08	273,995.73
SCHRODERS PLC	39,932	3.73	148,946.36
WISE PLC - A	49,048	7.09	347,750.32
ADMIRAL GROUP PLC	25,873	27.46	710,472.58
AVIVA PLC	193,334	4.88	943,469.92
LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.30	1,146,358.20
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.32	271,580.32
PRUDENTIAL	212,226	6.73	1,429,129.88
SAGE GROUP PLC	76,660	10.40	797,647.30

	HALMA PLC	31,069	24.94	774,860.86
	BT GROUP PLC	464,863	1.46	679,862.13
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.75	1,234,616.89
	CENTRICA PLC	453,631	1.27	576,338.18
	NATIONAL GRID PLC	371,439	10.28	3,818,392.92
	SEVERN TRENT PLC	17,468	27.14	474,081.52
	SSE PLC	81,692	19.05	1,556,232.60
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.87	549,804.60
	イギリスポンド 小計	21,001,741		154,209,594.04 (30,064,702,454)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	12.48	217,127.04
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	689.00	395,486.00
	GIVAUDAN-REG	742	4,342.00	3,221,764.00
	HOLCIM LTD	42,259	84.78	3,582,718.02
	SIG GROUP AG	26,203	18.61	487,637.83
	SIKA AG-BR	12,257	255.00	3,125,535.00
	ABB LTD	124,889	49.54	6,187,001.06
	GEBERIT AG-REG	2,530	532.40	1,346,972.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	252.00	516,096.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	260.00	803,920.00
	VAT GROUP AG	1,956	374.30	732,130.80
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	28.18	418,642.08
	SGS SA	12,959	96.74	1,253,653.66
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	224.90	850,346.90
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,028	127.45	5,483,918.60
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	171.85	426,703.55
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	34.00	133,892.00
	AVOLTA AG	7,820	34.66	271,041.20
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,581.00	442,680.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	107,200.00	857,600.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,870.00	891,340.00
	NESTLE SA - REGISTERED	208,575	85.98	17,933,278.50
	ALCON INC	38,399	82.38	3,163,309.62
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	323.30	1,256,667.10
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	130.60	1,115,324.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	69.30	128,205.00
	GALDERMA GROUP AG	3,774	78.92	297,844.08
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	552.00	3,055,872.00
	NOVARTIS	156,324	100.98	15,785,597.52
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	299.80	664,057.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,724	273.30	15,229,369.20
	SANDOZ GROUP AG	30,458	36.77	1,119,940.66

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	90.85	225,943.95	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	55.26	844,870.14	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,289.50	2,353,337.50	
	UBS GROUP AG	261,649	28.46	7,446,530.54	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	175.10	746,626.40	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	152.70	451,228.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	722.40	1,530,765.60	
	SWISS RE LTD	24,330	116.80	2,841,744.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	527.40	6,033,456.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	63.90	329,085.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	76.12	913,896.72	
	SWISSCOM	2,539	565.50	1,435,804.50	
	BKW AG	1,744	157.50	274,680.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	96.00	545,184.00	
	スイスフラン 小計	1,191,941		117,368,823.27 (20,266,074,714)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	332.00	7,387,664.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	429.40	2,311,460.20	
	SCA SV CELLULOSA B	59,490	140.50	8,358,345.00	
	ADDTECH AB-B SHARES	20,615	302.40	6,233,976.00	
	ALFA LAVAL AB	25,134	475.10	11,941,163.40	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	340.00	25,832,180.00	
	ATLAS COPCO A	207,097	183.55	38,012,654.35	
	ATLAS COPCO B	114,624	163.40	18,729,561.60	
	BEIJER REF AB	26,868	167.80	4,508,450.40	
	EPIROC AB-A	53,479	212.90	11,385,679.10	
	EPIROC AB-B	28,804	190.00	5,472,760.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	69.64	2,695,903.68	
	INDUTRADE AB	22,644	300.80	6,811,315.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	303.50	4,249,607.00	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	331.40	5,955,258.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	50.32	6,181,711.36	
	SAAB AB-B	25,552	219.60	5,611,219.20	
	SANDVIK AB	87,594	217.60	19,060,454.40	
	SKANSKA B	25,507	220.30	5,619,192.10	
	SKF AB-B	21,050	200.00	4,210,000.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	366.80	6,108,320.40	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	275.60	3,724,458.40	
	VOLVO B	124,872	274.30	34,252,389.60	
	SECURITAS B	28,375	131.10	3,719,962.50	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	23.54	1,173,210.06	
	EVOLUTION AB	13,186	957.80	12,629,550.80	



	HENNES & MAURITZ B	40,961	175.70	7,196,847.70	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	313.50	15,510,099.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	199.15	3,544,073.40	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	318.80	4,569,998.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	155.00	17,703,790.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	102.80	12,411,660.80	
	SWEDBANK AB-A	71,421	207.20	14,798,431.20	
	EQT AB	31,471	325.00	10,228,075.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	367.80	4,346,660.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	366.10	4,088,604.80	
	INVESTOR AB-B SHS	139,947	309.95	43,376,572.65	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	553.00	4,025,840.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	89.02	19,111,614.78	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	103.30	17,777,826.70	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	113.35	5,300,472.70	
	TELIA CO AB	253,410	32.14	8,144,597.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	83.32	4,724,244.00	
	SAGAX AB-B	17,402	271.00	4,715,942.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,653,728		463,751,797.28 (6,580,638,003)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	229.80	6,737,736.00	
	EQUINOR ASA	66,436	263.00	17,472,668.00	
	NORSK HYDRO	100,517	68.72	6,907,528.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	341.20	4,264,317.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,516	1,119.00	9,529,404.00	
	MOWI ASA	31,968	196.85	6,292,900.80	
	ORKLA	39,191	102.50	4,017,077.50	
	SALMAR ASA	5,423	578.00	3,134,494.00	
	DNB BANK ASA	71,795	221.90	15,931,310.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	198.30	3,683,224.20	
	TELENOR ASA	51,193	131.80	6,747,237.40	
	ノルウェークローネ 小計	435,431		84,717,898.24 (1,158,940,847)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	451.80	13,604,601.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	3,132.00	2,364,660.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	83,415	129.50	10,802,242.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	10,170.00	2,227,230.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	10,525.00	3,220,650.00	
	DSV A/S	16,193	1,496.50	24,232,824.50	
	PANDORA A/S	6,512	1,073.50	6,990,632.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	805.60	5,486,136.00	
	COLOPLAST-B	9,737	896.40	8,728,246.80	

	DEMANT A/S	8,512	269.00	2,289,728.00
	GENMAB A/S	4,878	1,563.50	7,626,753.00
	NOVO NORDISK A/S-B	255,486	807.20	206,228,299.20
	ZEALAND PHARMA A/S	5,068	804.00	4,074,672.00
	DANSKE BANK A/S	53,617	200.50	10,750,208.50
	TRYG A/S	29,772	162.30	4,831,995.60
	ORSTED A/S	12,910	442.40	5,711,384.00
	デンマーククローネ 小計	524,302		319,170,263.70 (6,948,336,640)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	28.64	590,814.56
	SANTOS	292,069	6.90	2,015,276.10
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	159,719	24.63	3,933,878.97
	BHP GROUP LTD	402,247	42.06	16,918,508.82
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	21.60	751,032.00
	FORTESCUE LTD	137,312	19.54	2,683,076.48
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,778	53.19	2,115,791.82
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	45.86	660,796.74
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	17.08	1,514,688.56
	ORICA LTD	38,288	17.96	687,652.48
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	2.67	559,324.95
	RIO TINTO LTD	28,272	117.62	3,325,352.64
	SOUTH32 LTD	346,773	3.70	1,283,060.10
	REECE LTD	16,814	26.57	446,747.98
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	43.04	543,595.20
	BRAMBLES LTD	108,007	19.08	2,060,773.56
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	26.32	1,167,976.32
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	7.37	626,450.00
	TRANSURBAN GROUP	261,181	13.45	3,512,884.45
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	58.30	2,694,043.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.13	933,726.69
	CAR GROUP LTD	29,334	37.08	1,087,704.72
	REA GROUP LTD	3,586	223.81	802,582.66
	SEEK LTD	28,001	24.96	698,904.96
	WESFARMERS LTD	90,005	70.23	6,321,051.15
	COLES GROUP LTD	108,486	17.88	1,939,729.68
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	4.79	526,425.79
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	32.70	3,010,721.70	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.54	738,098.40	
COCHLEAR LIMITED	4,783	283.50	1,355,980.50	
PRO MEDICUS LTD	3,708	192.81	714,939.48	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	42.36	512,852.52	
SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	27.07	1,132,311.03	

	CSL LIMITED	37,640	300.58	11,313,831.20
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	31.59	7,531,782.57
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,560	142.85	19,221,896.00
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	39.18	9,435,053.34
	WESTPAC BANKING	276,117	32.41	8,948,951.97
	ASX LTD	14,549	67.26	978,565.74
	MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	236.03	6,665,723.23
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	34.36	474,580.32
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	7.52	1,253,298.24
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.66	849,789.78
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	17.29	2,209,990.51
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	18.16	1,722,730.24
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	122.48	1,690,346.48
	XERO LTD	11,340	147.65	1,674,351.00
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.91	1,206,105.97
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	9.81	1,525,798.35
	オーストラリアドル 小計	5,251,261		144,569,548.95 (14,484,423,109)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.54	621,755.94
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	54,904	37.01	2,031,997.04
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	3.05	406,183.63
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.91	446,475.83
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	6.12	677,082.00
	ニュージーランドドル 小計	445,479		4,183,494.44 (379,777,625)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	237,496	42.00	9,974,832.00
	SWIRE PACIFIC A	44,500	64.75	2,881,375.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	116.50	12,465,500.00
	MTR CORP	125,000	29.05	3,631,250.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	21.55	2,586,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	35.00	6,090,000.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	18.78	3,718,440.00
	WH GROUP LTD	658,301	6.10	4,015,636.10
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.60	7,206,400.00
	HANG SENG BANK	59,400	97.75	5,806,350.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	317.00	30,527,100.00
	AIA GROUP LTD	864,200	63.40	54,790,280.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	55.20	2,070,000.00
	CLP HOLDINGS	136,500	67.00	9,145,500.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.20	5,608,873.40
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	51.35	5,751,200.00
CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	33.40	4,074,666.40	

	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.40	3,306,019.20	
	SINO LAND CO	315,400	8.63	2,721,902.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	87.35	9,171,750.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	22.30	1,873,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	25.15	3,093,450.00	
	香港ドル 小計	5,030,978		190,509,724.10 (3,663,501,994)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.47	729,816.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.81	708,994.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.50	704,158.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.84	247,416.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.28	585,808.00	
	DBS GROUP	155,760	39.70	6,183,672.00	
	OCBC BANK	257,100	15.40	3,959,340.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	32.60	3,064,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	11.74	774,840.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	3.26	2,028,186.18	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.52	464,232.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	3.00	780,300.00	
	シンガポールドル 小計	2,379,135		20,231,162.18 (2,306,959,423)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	15.79	938,352.33	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	820.40	1,760,578.40	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	37.79	3,715,134.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	37.20	4,185,446.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	21.59	2,148,205.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	150.70	1,884,202.10	
	NICE LTD	4,991	683.00	3,408,853.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	277.20	426,056.40	
	イスラエルシェケル 小計	390,926		18,466,828.53 (742,567,795)	
	合 計	86,221,829		774,929,627,836 (774,929,627,836)	

## (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	596,356.40	

		オーストラリアドル 小計	83,290	596,356.40 (59,748,947)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,090,150.00	
		香港ドル 小計	315,000	3,090,150.00 (59,423,584)	
		投資信託受益証券合計	398,290	119,172,531 (119,172,531)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,522,740.37	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	952,008.88	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,765	8,546,219.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	758,512.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,651,405.22	
		BXP INC	11,259	1,010,157.48	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	935,614.26	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,791,139.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	25,738	4,256,550.44	
		EQUINIX INC	7,333	6,564,501.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	985,877.30	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,957,682.55	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,543,282.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,564	3,008,361.92	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	24,610	1,266,922.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,239,879.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,008,856.21	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,536,123.04	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,933,477.76	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	1,179,224.14	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,421,455.05	
		PROLOGIS INC	73,867	9,048,707.50	
		PUBLIC STORAGE	12,826	4,432,922.12	
		REALTY INCOME CORP	69,450	4,494,109.50	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	907,923.27	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	2,210,649.51	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,979	4,596,204.68	
		SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,483,109.10	
		UDR INC	23,815	1,066,197.55	
		VENTAS INC	31,565	2,069,085.75	
		VICI PROPERTIES INC	83,762	2,780,060.78	
		WELLTOWER INC	47,424	6,271,349.76	
		WP CAREY INC	16,024	961,600.24	
		アメリカドル 小計	951,495	89,391,912.24 (13,357,833,446)	

カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	248,455.08	
カナダドル 小計		4,887	248,455.08	(26,885,324)
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	270,925.20	
	GECINA SA	3,139	329,595.00	
	KLEPIERRE	17,225	520,539.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	821,344.80	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	288,498.76	
ユーロ 小計		48,695	2,230,903.26	(362,209,453)
イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	363,908.38	
	SEGRO PLC	103,047	861,266.82	
イギリスポンド 小計		159,336	1,225,175.20	(238,860,156)
オーストラリアドル	DEXUS	94,090	706,615.90	
	GOODMAN GROUP	135,303	4,946,677.68	
	GPT GROUP	167,884	842,777.68	
	MIRVAC GROUP	266,683	581,368.94	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,376,431.63	
	STOCKLAND	207,412	1,105,505.96	
	VICINITY CENTERS	305,149	686,585.25	
オーストラリアドル 小計		1,557,804	10,245,963.04	(1,026,543,036)
香港ドル	LINK REIT	238,000	9,103,500.00	
香港ドル 小計		238,000	9,103,500.00	(175,060,305)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	798,427.78	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	541,829	1,148,677.48	
シンガポールドル 小計		825,967	1,947,105.26	(222,028,412)
投資証券合計		3,786,184	15,409,420,132	(15,409,420,132)
合計			15,528,592,663	(15,528,592,663)

## 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	573銘柄	97.8%				75.3%
	投資証券	33銘柄				2.2%	1.7%
カナダドル	株式	84銘柄	99.9%				3.2%
	新株予約権証券	1銘柄					
	投資証券	1銘柄				0.1%	0.0%
ユーロ	株式	214銘柄	99.5%				8.5%
	投資証券	5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式	75銘柄	99.2%				3.8%
	投資証券	2銘柄				0.8%	0.0%
スイスフラン	株式	46銘柄	100.0%				2.6%
スウェーデンクローナ	株式	44銘柄	100.0%				0.8%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%				0.1%
デンマーククローネ	株式	16銘柄	100.0%				0.9%
オーストラリアドル	株式	49銘柄	93.0%				1.8%
	投資信託受益証券	1銘柄			0.4%		0.0%
	投資証券	7銘柄				6.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%				0.0%
香港ドル	株式	22銘柄	94.0%				0.5%
	投資信託受益証券	1銘柄			1.5%		0.0%
	投資証券	1銘柄				4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	12銘柄	91.2%				0.3%
	投資証券	2銘柄				8.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%				0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年10月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	598,698,683
コール・ローン	2,183,740,154
国債証券	361,982,504,554

2024年10月21日現在	
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	2,212,808
未収利息	2,974,281,600
前払金	17,690,393
前払費用	348,387,616
差入委託証拠金	241,072,044
流動資産合計	368,348,587,852
資産合計	368,348,587,852
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,836,165
未払金	14,354,497
未払解約金	60,237,174
流動負債合計	96,427,836
負債合計	96,427,836
純資産の部	
元本等	
元本	101,775,665,001
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	266,476,495,015
元本等合計	368,252,160,016
純資産合計	368,252,160,016
負債純資産合計	368,348,587,852

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年10月21日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）



		2024年10月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		101,775,665,001口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6183円 (36,183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10月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針		当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク		当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	94,484,093,956円
期中追加設定元本額	10,375,867,760円
期中一部解約元本額	3,084,296,715円
期末元本額	101,775,665,001円
期末元本額の内訳	

区分	2024年10月21日現在
外国債券オープン（毎月決算型）	1,066,332,761円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	452,013,083円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	309,732,561円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,365,344,113円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,881,588円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,663,896,960円
世界経済インデックスファンド	25,547,733,811円
DCマイセレクション25	1,821,529,740円
DCマイセレクション50	1,713,052,817円
DCマイセレクション75	1,368,152,156円
DC外国債券インデックス・オープン	2,231,666,128円
DCマイセレクションS25	1,150,752,574円
DCマイセレクションS50	1,023,090,513円
DCマイセレクションS75	672,312,138円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,199,099円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,169,432円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,908,808円
DC世界経済インデックスファンド	16,161,858,687円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	813,929,393円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	912,064円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	896,753円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	7,653,657円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	19,445,053円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	33,607,582円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	48,897,211円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,958,843円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	569,667,162円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	340,340,948円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,422,854,853円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	50,381,058円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	24,023,553円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	314,360,946円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	115,113,164円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	158,804,764円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	615,410,505円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,465,039,918円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	603,986,386円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,507,899円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	828,183,904円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,576,886,339円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,176,919円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,043,992円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,326,400,007円
SMT インデックスバランス・オープン	162,801,823円
SMT 世界経済インデックス・オープン	470,008,290円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	707,533,001円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,060,749,722円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,518,643円
グローバル経済コア	1,259,772,479円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,310,528円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,760,226円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	66,349,555円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	109,283,690円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	56,462,197円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	80,656,611円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	968,558,359円
10資産分散投資ファンド	35,760,239円
グローバル10資産バランスファンド	34,417,911円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	132,474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	23,652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	124,345円

区分	2024年10月21日現在
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	36,548円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	31,102円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	21,345円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	37,241円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	3,152,475円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	14,243,308,731円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	236,559,112円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	452,698,381円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	141,884,677円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	9,871,558,859
合計	9,871,558,859

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2024年10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,683,050,463	-	1,665,360,070	17,690,393
	合計	1,683,050,463	-	1,665,360,070	17,690,393

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2024年10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,884,180,057	-	1,882,247,093	1,932,964
	アメリカドル	902,590,393	-	904,054,267	1,463,874
	カナダドル	73,731,320	-	73,396,344	334,976
	ユーロ	554,807,711	-	552,382,490	2,425,221
	イギリスポンド	112,717,826	-	112,697,944	19,882
	オフショア人民元	240,332,807	-	239,716,048	616,759
	合計	1,884,180,057	-	1,882,247,093	1,932,964

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,890,227.45	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,457,718.67	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,631,875.04	
		T 0.375% 07/31/27	16,100,000.00	14,630,875.00	
		T 0.375% 09/30/27	2,440,000.00	2,204,864.05	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,877,714.84	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,826,875.00	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,288,535.14	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,702,617.96	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,208,378.91	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,365,409.35	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,238,051.53	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,783,984.37	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,935,742.15	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,610,585.89	
		T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	10,183,429.72	
		T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,909,630.82	
		T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,264,160.15	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,670,374.97	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,686,523.48	
		T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,723,789.04	
		T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	9,041,328.12	
		T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,797,812.48	
		T 0.75% 08/31/26	9,630,000.00	9,080,036.67	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,594,843.76	
		T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,735,232.41	
		T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,335,729.53	
		T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,448,556.27	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,310,624.96	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,088,755.66	
		T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,281,890.61	
		T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,847,911.50	

T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,766,818.77	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,309,687.52	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,831,258.79	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,470,781.28	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	8,191,230.48	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,738,057.07	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,590,449.19	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,624,570.33	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,736,735.93	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,995,171.87	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,192,612.50	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,571,868.31	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,926,250.00	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,843,193.75	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,687,343.72	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,725,065.42	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,835,800.82	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,824,560.57	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,423,468.73	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,382,532.44	
T 1.625% 05/15/31	10,980,000.00	9,507,993.75	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,093,193.34	
T 1.625% 10/31/26	12,300,000.00	11,752,265.62	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,874,916.00	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,559,485.16	
T 1.75% 01/31/29	10,200,000.00	9,344,753.86	
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,842,332.79	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,711,250.00	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,151,076.53	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,588,478.48	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,949,558.60	
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,205,976.53	
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,790,745.72	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,004,092.59	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,960,986.32	
T 1% 07/31/28	13,000,000.00	11,691,621.11	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,495,234.38	
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,347,294.90	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,803,062.50	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,311,035.17	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,835,284.74	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,204,974.62	

T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,126,731.25
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,643,427.75
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,311,408.72
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,293,199.25
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,131,123.04
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,598,343.75
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,536,523.44
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,258,931.25
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,633,905.49
T 2.375% 05/15/51	7,450,000.00	5,027,149.44
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,788,320.29
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,066,228.12
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,780,173.82
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,874,796.87
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,049,833.98
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,604,444.12
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,354,360.53
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,325,375.00
T 2.625% 07/31/29	15,200,000.00	14,361,921.85
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,718,604.65
T 2.75% 02/15/28	8,550,000.00	8,248,078.12
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,302,466.81
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,426,244.16
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,815,593.75
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,640,617.15
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,033,465.83
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,759,797.64
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,279,875.00
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,161,167.97
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,724,011.69
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,360,648.48
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	4,045,720.69
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,599,662.51
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	8,105,484.34
T 2.875% 08/15/28	13,220,000.00	12,747,746.43
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,799,121.08
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	726,113.28
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,875,546.92
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,714,238.29
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,826,063.50
T 2% 11/15/26	6,320,000.00	6,080,531.27
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,396,914.07
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	891,023.43

T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,175,820.32	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,813,543.75	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,511,962.50	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	6,027,000.00	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,906,034.20	
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	10,112,745.67	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,562,596.67	
T 3.25% 06/30/29	6,500,000.00	6,319,853.54	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,980,445.31	
T 3.375% 05/15/44	7,110,000.00	6,097,380.42	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	2,003,919.91	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,410,593.75	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,922,656.24	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,782,843.79	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	711,798.82	
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,428,632.83	
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,356,875.37	
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,324,541.03	
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	2,006,390.62	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,203,011.70	
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,542,796.12	
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,972,695.32	
T 3.75% 11/15/43	6,130,000.00	5,573,031.99	
T 3.75% 12/31/30	6,160,000.00	6,091,903.10	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,481,718.75	
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,330,566.40	
T 3.875% 08/15/33	11,070,000.00	10,927,300.83	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,381,096.68	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,535,644.13	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,122,378.12	
T 3% 02/15/47	3,920,000.00	3,087,535.94	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	781,406.25	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	775,722.66	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,031,873.05	
T 3% 05/15/45	700,000.00	560,410.15	
T 3% 05/15/47	1,710,000.00	1,343,886.33	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,530,302.74	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,005,828.11	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,151,818.18	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,940,063.45	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,249,843.73	
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,835,058.58	

T 4.125% 03/31/29	3,350,000.00	3,381,602.52
T 4.125% 07/31/31	3,500,000.00	3,531,718.75
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	4,105,660.16
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,288,765.64
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,122,462.87
T 4.125% 11/15/32	8,000,000.00	8,063,281.28
T 4.25% 02/15/54	10,550,000.00	10,301,085.93
T 4.25% 02/28/31	9,000,000.00	9,147,304.71
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	901,019.52
T 4.25% 08/15/54	1,000,000.00	977,187.50
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,901,897.98
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	736,458.98
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,022,851.56
T 4.375% 05/15/34	6,310,000.00	6,459,369.56
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,920,892.57
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	655,712.88
T 4.375% 07/15/27	800,000.00	810,203.12
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,041,835.96
T 4.375% 08/15/43	1,500,000.00	1,490,390.62
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,393,203.12
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	971,793.75
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,602,304.71
T 4.375% 12/15/26	13,000,000.00	13,119,843.75
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,138,581.63
T 4.5% 04/15/27	9,150,000.00	9,280,458.96
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	568,626.95
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,084,960.90
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,746,019.52
T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,579,422.49
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,434,229.69
T 4.625% 04/30/31	7,070,000.00	7,337,196.29
T 4.625% 05/15/54	5,150,000.00	5,352,781.25
T 4.625% 09/15/26	4,000,000.00	4,048,593.76
T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,118,994.92
T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,643,462.50
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	790,107.42
T 4.75% 11/15/53	3,880,000.00	4,109,162.50
T 4.875% 05/31/26	3,400,000.00	3,444,226.55
T 4.875% 10/31/30	4,960,000.00	5,207,515.60
T 4.875% 11/30/25	9,700,000.00	9,771,802.69
T 4% 01/15/27	7,200,000.00	7,212,937.53
T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,492,509.79
T 4% 02/15/34	11,600,000.00	11,538,375.00



	T 4% 02/28/30	1,350,000.00	1,355,906.25
	T 4% 07/31/30	3,980,000.00	3,994,147.66
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,579,679.68
	T 4% 11/15/52	7,400,000.00	6,907,003.93
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	434,656.24
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,367,589.84
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,110,417.95
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,746,285.15
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,545,609.37
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,171,898.43
	アメリカドル 小計	1,240,040,000.00	1,130,363,625.65 (168,910,236,580)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	1,340,000.00	1,289,909.19
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	2,003,576.61
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,809,590.57
	CAN 1.25% 06/01/30	3,950,000.00	3,605,213.93
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	888,951.39
	CAN 1.5% 06/01/31	3,300,000.00	3,004,409.65
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,267,839.08
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	2,081,673.19
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	773,385.46
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,476,240.09
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	234,287.00
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,206,777.80
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,169,891.19
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,593,954.70
	CAN 2.75% 12/01/48	980,000.00	892,094.49
	CAN 2.75% 12/01/55	2,080,000.00	1,862,140.88
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	556,025.54
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	398,210.49
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,412,074.74
	CAN 2% 12/01/51	3,750,000.00	2,877,178.87
	CAN 3.25% 09/01/28	1,890,000.00	1,914,861.87
	CAN 3.25% 12/01/33	2,370,000.00	2,396,686.64
	CAN 3.25% 12/01/34	1,140,000.00	1,149,189.43
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,182,691.87
	CAN 3.5% 09/01/29	2,360,000.00	2,423,709.56
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	992,334.45
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,338,262.70
	CAN 3% 06/01/34	2,620,000.00	2,591,991.24
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,281,408.65
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	811,586.66

	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	304,991.82
	CAN 4.5% 11/01/25	1,940,000.00	1,964,034.84
	CAN 4% 03/01/29	2,180,000.00	2,278,464.64
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,279,682.15
	CAN 4% 08/01/26	1,490,000.00	1,514,546.72
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,676,661.41
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,940,014.05
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	581,019.72
	カナダドル 小計	66,910,000.00	64,025,563.28 (6,928,206,202)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,690,752.06
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	30,300,076.85
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	44,250,645.34
	MBONO 7.5% 05/26/33	30,430,000.00	26,413,848.60
	MBONO 7.5% 06/03/27	35,800,000.00	33,997,028.22
	MBONO 7.75% 05/29/31	38,870,000.00	35,251,427.66
	MBONO 7.75% 11/13/42	33,360,000.00	26,922,761.31
	MBONO 7.75% 11/23/34	18,410,000.00	16,038,884.05
	MBONO 7% 09/03/26	14,580,000.00	13,837,586.40
	MBONO 8.5% 03/01/29	25,020,000.00	23,906,610.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	32,230,000.00	30,821,307.27
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,129,283.98
	MBONO 8% 07/31/53	28,240,000.00	22,805,518.67
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,067,953.31
	メキシコペソ 小計	391,630,000.00	352,433,683.72 (2,648,856,323)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,249,899.62
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	1,031,902.47
	BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	439,830.43
	BGB 0.65% 06/22/71	530,000.00	228,055.29
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,456,296.85
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,519,966.72
	BGB 0.9% 06/22/29	1,790,000.00	1,679,147.09
	BGB 0% 10/22/27	900,000.00	842,726.70
	BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,228,078.63
	BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,178,836.25
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	674,535.75
	BGB 1.45% 06/22/37	630,000.00	530,918.95
	BGB 1.6% 06/22/47	950,000.00	698,173.05
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	794,317.70
	BGB 1.9% 06/22/38	1,020,000.00	893,810.70
	BGB 1% 06/22/26	1,560,000.00	1,529,214.57
	BGB 1% 06/22/31	1,770,000.00	1,611,843.42

BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	660,653.40
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	521,527.66
BGB 2.7% 10/22/29	610,000.00	619,832.02
BGB 2.75% 04/22/39	730,000.00	704,826.31
BGB 2.85% 10/22/34	1,270,000.00	1,280,031.09
BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	1,000,124.38
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	454,389.32
BGB 3.5% 06/22/55	690,000.00	698,968.62
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	999,601.20
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,490,067.12
BGB 3% 06/22/34	1,030,000.00	1,055,923.76
BGB 4.25% 03/28/41	1,680,000.00	1,916,932.08
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,175,119.06
BGB 4% 03/28/32	880,000.00	964,854.44
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,256,330.78
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,165,768.17
BKO 2.5% 03/19/26	1,110,000.00	1,114,267.95
BKO 2.7% 09/17/26	2,650,000.00	2,679,494.23
BKO 2.9% 06/18/26	730,000.00	738,760.00
BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,835,575.56
BTPS 0.25% 03/15/28	2,030,000.00	1,884,504.82
BTPS 0.45% 02/15/29	1,640,000.00	1,499,061.68
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,862,224.65
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,208,429.62
BTPS 0.6% 08/01/31	1,960,000.00	1,685,551.00
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,263,305.33
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,585,157.76
BTPS 0.95% 03/01/37	1,620,000.00	1,214,909.68
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	2,002,776.54
BTPS 0.95% 08/01/30	1,180,000.00	1,065,110.48
BTPS 0.95% 09/15/27	1,640,000.00	1,573,549.25
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,871,043.73
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,162,730.64
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	3,097,268.93
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,278,448.37
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,632,675.50
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,094,075.00
BTPS 1.45% 03/01/36	1,730,000.00	1,417,812.85
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	851,017.81
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,066,845.60
BTPS 1.65% 03/01/32	2,430,000.00	2,225,646.11
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,372,325.07
BTPS 1.7% 09/01/51	1,520,000.00	988,836.38

BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	736,197.12	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,280,000.00	1,268,503.68	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,433,242.80	
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	443,502.67	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	723,130.78	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,270,218.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,465,559.70	
BTPS 2.45% 09/01/33	1,510,000.00	1,435,993.39	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	1,065,894.06	
BTPS 2.5% 11/15/25	860,000.00	859,909.27	
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,425,733.10	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,771,572.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	926,727.34	
BTPS 2.8% 03/01/67	950,000.00	741,143.92	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,628,477.49	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,435,593.30	
BTPS 2.95% 02/15/27	860,000.00	869,811.30	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,380,000.00	1,286,888.64	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,229,219.93	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,202,186.21	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,325,180.21	
BTPS 3.2% 01/28/26	2,000,000.00	2,015,329.40	
BTPS 3.25% 03/01/38	2,080,000.00	2,010,742.24	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,080,573.04	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,330,000.00	2,343,181.97	
BTPS 3.35% 07/01/29	1,600,000.00	1,647,776.00	
BTPS 3.4% 04/01/28	1,550,000.00	1,596,066.00	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,709,005.48	
BTPS 3.45% 07/15/31	340,000.00	350,632.99	
BTPS 3.5% 01/15/26	1,840,000.00	1,860,825.12	
BTPS 3.5% 02/15/31	2,440,000.00	2,525,908.74	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,455,691.39	
BTPS 3.7% 06/15/30	1,730,000.00	1,810,249.85	
BTPS 3.8% 04/15/26	1,870,000.00	1,905,281.29	
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,839,079.96	
BTPS 3.85% 07/01/34	1,480,000.00	1,553,874.94	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,580,000.00	1,572,362.28	
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	882,385.80	
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	3,014,179.74	
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,169,297.00	
BTPS 4.1% 02/01/29	1,540,000.00	1,631,919.52	
BTPS 4.15% 10/01/39	1,010,000.00	1,064,673.32	

BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	2,074,905.60
BTPS 4.3% 10/01/54	700,000.00	728,846.30
BTPS 4.35% 11/01/33	2,090,000.00	2,285,935.41
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,164,512.82
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,689,235.08
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,135,024.73
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,640,474.57
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,843,587.56
BTPS 4.75% 09/01/44	1,850,000.00	2,088,938.97
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,254,235.30
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	937,360.16
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,338,560.87
BTPS 4% 11/15/30	2,310,000.00	2,456,619.62
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	3,087,866.52
BTPS 5.25% 11/01/29	3,350,000.00	3,762,043.30
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,720,401.83
BTPS 5% 08/01/34	2,830,000.00	3,249,636.64
BTPS 5% 09/01/40	2,640,000.00	3,042,001.24
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	3,020,442.75
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,354,349.07
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,535,087.40
DBR 0.25% 02/15/27	2,490,000.00	2,395,180.80
DBR 0.25% 02/15/29	1,970,000.00	1,836,525.11
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,965,018.00
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,935,602.00
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,299,643.20
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	336,702.10
DBR 0% 02/15/30	1,260,000.00	1,136,949.02
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,467,321.71
DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,677,237.50
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,885,249.15
DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,869,582.46
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,815,331.86
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,690,015.02
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,100,192.65
DBR 0% 08/15/30	1,980,000.00	1,769,912.10
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,488,067.97
DBR 0% 08/15/50	5,040,000.00	2,683,609.70
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,532,040.73
DBR 0% 11/15/27	2,820,000.00	2,658,514.11
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,842,847.46
DBR 1.25% 08/15/48	3,430,000.00	2,672,876.37
DBR 1.7% 08/15/32	2,600,000.00	2,535,779.09

DBR 1.8% 08/15/53	3,700,000.00	3,175,365.90
DBR 1% 05/15/38	2,360,000.00	1,982,979.37
DBR 2.1% 11/15/29	3,430,000.00	3,444,690.69
DBR 2.2% 02/15/34	2,900,000.00	2,913,218.20
DBR 2.3% 02/15/33	4,320,000.00	4,389,087.60
DBR 2.4% 11/15/30	2,000,000.00	2,040,480.00
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,932,593.05
DBR 2.5% 08/15/46	3,010,000.00	3,014,564.66
DBR 2.5% 08/15/54	1,540,000.00	1,539,079.84
DBR 2.6% 05/15/41	300,000.00	305,053.50
DBR 2.6% 08/15/33	2,890,000.00	3,001,662.66
DBR 2.6% 08/15/34	1,750,000.00	1,813,955.15
DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,253,159.93
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	3,022,825.51
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,213,329.90
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,571,701.56
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	3,059,396.24
DBR 4.75% 07/04/40	2,060,000.00	2,672,190.80
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,719,488.50
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,127,757.61
DBR 6.25% 01/04/30	1,570,000.00	1,894,405.96
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,004,763.62
FRTR 0.25% 11/25/26	3,700,000.00	3,549,210.20
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,376,615.62
FRTR 0.5% 05/25/29	4,260,000.00	3,902,292.06
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,805,963.78
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	480,864.65
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,220,968.87
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,935,516.91
FRTR 0.75% 05/25/28	5,660,000.00	5,349,731.53
FRTR 0.75% 05/25/52	3,250,000.00	1,725,425.00
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,571,566.00
FRTR 0.75% 11/25/28	4,550,000.00	4,260,242.35
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,898,531.68
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,794,154.98
FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	3,094,563.14
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,254,551.90
FRTR 0% 11/25/30	6,120,000.00	5,251,407.46
FRTR 0% 11/25/31	5,340,000.00	4,443,787.80
FRTR 1.25% 05/25/34	5,510,000.00	4,780,951.22
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,699,307.25
FRTR 1.25% 05/25/38	2,920,000.00	2,315,370.20

FRTR 1.5% 05/25/31	5,280,000.00	4,941,620.64
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,066,788.27
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,079,196.72
FRTR 1.75% 06/25/39	3,570,000.00	2,998,251.11
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,811,071.82
FRTR 1% 11/25/25	4,200,000.00	4,137,115.50
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,566,308.59
FRTR 2.5% 05/25/43	1,910,000.00	1,696,113.42
FRTR 2.5% 09/24/26	3,690,000.00	3,705,009.07
FRTR 2.5% 09/24/27	2,490,000.00	2,502,632.76
FRTR 2.75% 02/25/29	4,840,000.00	4,898,525.28
FRTR 2.75% 02/25/30	2,170,000.00	2,192,668.89
FRTR 2.75% 10/25/27	5,460,000.00	5,528,523.00
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,225,232.29
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,748,334.35
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,829,069.10
FRTR 3.25% 05/25/55	920,000.00	874,678.48
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,813,855.80
FRTR 3.5% 11/25/33	4,100,000.00	4,323,614.00
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,282,007.84
FRTR 3% 05/25/54	2,450,000.00	2,228,477.11
FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	722,282.33
FRTR 3% 11/25/34	990,000.00	998,957.52
FRTR 4.5% 04/25/41	3,490,000.00	4,058,212.13
FRTR 4.75% 04/25/35	3,460,000.00	4,034,094.26
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,773,392.21
FRTR 4% 04/25/60	1,970,000.00	2,169,772.77
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,352,989.92
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,674,432.96
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,315,633.04
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,966,550.35
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	639,116.35
IRISH 0.2% 10/18/30	910,000.00	806,200.99
IRISH 0.35% 10/18/32	450,000.00	384,809.85
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	552,650.67
IRISH 0.55% 04/22/41	410,000.00	290,597.75
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	738,859.27
IRISH 0% 10/18/31	1,120,000.00	954,318.40
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	933,835.05
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	393,701.55
IRISH 1.35% 03/18/31	370,000.00	349,498.48
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	607,839.20
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	663,208.35

IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	981,752.40
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	937,168.90
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	201,449.04
IRISH 2% 02/18/45	1,010,000.00	878,543.45
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	380,207.37
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	869,321.25
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,078,095.89
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,702,262.18
NETHER 0.5% 07/15/32	1,300,000.00	1,134,731.84
NETHER 0.75% 07/15/27	1,060,000.00	1,022,908.48
NETHER 0.75% 07/15/28	960,000.00	913,166.40
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,157,394.00
NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,652,421.61
NETHER 0% 01/15/29	1,770,000.00	1,617,692.38
NETHER 0% 01/15/38	1,390,000.00	983,428.47
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	858,808.32
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,190,700.00
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,178,677.69
NETHER 2.5% 01/15/30	1,210,000.00	1,227,306.86
NETHER 2.5% 01/15/33	1,210,000.00	1,223,880.51
NETHER 2.5% 07/15/33	1,170,000.00	1,179,908.96
NETHER 2.5% 07/15/34	1,220,000.00	1,225,048.36
NETHER 2.75% 01/15/47	1,900,000.00	1,922,362.42
NETHER 2% 01/15/54	1,300,000.00	1,120,226.25
NETHER 3.25% 01/15/44	840,000.00	908,652.17
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,945,739.25
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,903,986.80
NETHER 5.5% 01/15/28	1,600,000.00	1,767,680.00
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,977,172.41
OBL 0% 04/16/27	2,920,000.00	2,782,051.89
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,576,820.00
OBL 0% 10/10/25	3,000,000.00	2,933,223.74
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,486,402.21
OBL 2.1% 04/12/29	2,780,000.00	2,791,796.92
OBL 2.2% 04/13/28	870,000.00	877,057.87
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,339,302.10
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	534,528.00
RAGB 0.5% 02/20/29	1,800,000.00	1,669,648.49
RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,430,884.25
RAGB 0.7% 04/20/71	420,000.00	196,606.62
RAGB 0.75% 02/20/28	1,010,000.00	962,959.25
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	464,763.39



RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,440,021.50
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	106,008.76
RAGB 0.9% 02/20/32	1,120,000.00	999,748.40
RAGB 0% 02/20/30	1,790,000.00	1,579,231.96
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,432,429.97
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	804,804.00
RAGB 0% 10/20/40	650,000.00	409,110.00
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,175,725.95
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	820,863.72
RAGB 1.5% 11/02/86	440,000.00	272,777.56
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	529,988.58
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	509,140.45
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	911,723.64
RAGB 2.9% 02/20/33	1,510,000.00	1,544,907.42
RAGB 2.9% 02/20/34	1,060,000.00	1,082,082.98
RAGB 2.9% 05/23/29	350,000.00	359,178.40
RAGB 3.15% 06/20/44	830,000.00	849,671.00
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	446,494.40
RAGB 3.2% 07/15/39	330,000.00	340,618.14
RAGB 3.45% 10/20/30	330,000.00	348,639.45
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	491,204.70
RAGB 4.15% 03/15/37	1,550,000.00	1,761,981.87
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,211,556.06
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,306,909.00
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	326,304.00
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	219,823.61
RFGB 0.125% 09/15/31	710,000.00	605,887.73
RFGB 0.25% 09/15/40	350,000.00	231,987.21
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	555,653.81
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	319,632.79
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	515,289.60
RFGB 0.5% 09/15/28	780,000.00	729,553.50
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	485,480.99
RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	458,902.08
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	441,343.24
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	626,112.96
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	559,633.59
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	343,255.15
RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	423,836.32
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	527,993.85
RFGB 2.5% 04/15/30	460,000.00	463,121.10
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	450,207.36
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	394,268.16

RFGB 2.75% 07/04/28	680,000.00	693,160.37
RFGB 2.875% 04/15/29	340,000.00	348,097.10
RFGB 2.95% 04/15/55	350,000.00	344,427.11
RFGB 3% 09/15/33	520,000.00	536,120.00
RFGB 3% 09/15/34	430,000.00	442,342.07
SPGB 0.1% 04/30/31	2,460,000.00	2,105,312.28
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,892,197.16
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,232,816.00
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,803,150.85
SPGB 0.7% 04/30/32	2,500,000.00	2,177,962.50
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,343,295.48
SPGB 0.8% 07/30/29	2,210,000.00	2,051,268.96
SPGB 0.85% 07/30/37	1,760,000.00	1,343,911.36
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,580,160.10
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,763,306.90
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,828,714.87
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,564,339.23
SPGB 1.25% 10/31/30	3,370,000.00	3,137,705.90
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	2,031,456.60
SPGB 1.4% 04/30/28	2,230,000.00	2,162,179.01
SPGB 1.4% 07/30/28	2,400,000.00	2,321,065.20
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,584,847.22
SPGB 1.45% 10/31/27	2,100,000.00	2,048,849.24
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	346,039.32
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,471,800.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,976,381.37
SPGB 1.9% 10/31/52	1,890,000.00	1,342,426.82
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,287,499.50
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,965,311.02
SPGB 1% 07/30/42	1,350,000.00	932,721.75
SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,161,075.00
SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,564,621.18
SPGB 2.35% 07/30/33	1,890,000.00	1,834,982.10
SPGB 2.5% 05/31/27	2,330,000.00	2,340,765.99
SPGB 2.55% 10/31/32	2,500,000.00	2,479,518.74
SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,497,131.50
SPGB 2.8% 05/31/26	2,220,000.00	2,235,284.70
SPGB 2.9% 10/31/46	1,780,000.00	1,635,674.04
SPGB 3.15% 04/30/33	2,170,000.00	2,240,843.99
SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,226,244.37
SPGB 3.45% 07/30/43	1,290,000.00	1,295,341.24
SPGB 3.45% 07/30/66	1,530,000.00	1,465,380.45

	SPGB 3.45% 10/31/34	2,090,000.00	2,194,940.99
	SPGB 3.5% 05/31/29	1,980,000.00	2,073,545.10
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,409,491.50
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,660,000.00	1,787,270.54
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	2,012,954.40
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,780,000.00	2,096,877.73
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,880,000.00	2,251,441.00
	SPGB 4% 10/31/54	770,000.00	822,081.26
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,105,955.31
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,640,000.00	2,052,542.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,739,998.25
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,452,663.29
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,044,402.45
	ユーロ 小計	703,940,000.00	672,324,449.82 (109,158,597,672)
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,207,377.36
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,348,416.71
	UKT 0.25% 07/31/31	2,490,000.00	1,962,671.78
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,789,607.80
	UKT 0.375% 10/22/30	2,180,000.00	1,786,541.82
	UKT 0.5% 01/31/29	2,880,000.00	2,514,562.56
	UKT 0.5% 10/22/61	2,420,000.00	746,086.00
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,577,479.50
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	596,590.90
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	774,258.03
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,622,590.00
	UKT 0.875% 10/22/29	1,460,000.00	1,271,909.95
	UKT 1.125% 01/31/39	2,130,000.00	1,419,538.50
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	393,960.00
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,169,925.00
	UKT 1.25% 07/31/51	2,810,000.00	1,384,768.00
	UKT 1.25% 10/22/41	2,190,000.00	1,372,692.00
	UKT 1.5% 07/22/26	2,800,000.00	2,691,637.20
	UKT 1.5% 07/22/47	1,450,000.00	829,298.50
	UKT 1.5% 07/31/53	1,680,000.00	862,680.00
	UKT 1.625% 10/22/28	1,460,000.00	1,347,419.40
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	704,920.40
	UKT 1.625% 10/22/71	1,790,000.00	829,844.00
	UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	639,990.72
UKT 1.75% 07/22/57	1,900,000.00	1,012,387.26	
UKT 1.75% 09/07/37	2,400,000.00	1,820,751.60	
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	3,023,743.60	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	899,660.88	

UKT 3.25% 01/22/44	2,310,000.00	1,936,704.00	
UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,753,619.84	
UKT 3.5% 01/22/45	2,000,000.00	1,728,100.00	
UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,199,890.44	
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,330,892.62	
UKT 3.75% 01/29/38	2,430,000.00	2,311,902.00	
UKT 3.75% 03/07/27	1,970,000.00	1,958,731.60	
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	1,001,276.48	
UKT 3.75% 10/22/53	3,060,000.00	2,651,125.24	
UKT 4.125% 01/29/27	3,780,000.00	3,790,514.44	
UKT 4.125% 07/22/29	1,210,000.00	1,220,678.25	
UKT 4.25% 03/07/36	1,730,000.00	1,746,991.54	
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,350,338.88	
UKT 4.25% 07/31/34	1,650,000.00	1,674,558.10	
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,258,331.24	
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,825,501.50	
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,425,930.00	
UKT 4.25% 12/07/46	1,930,000.00	1,846,624.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,440,000.00	1,370,880.00	
UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,609,900.00	
UKT 4.375% 01/31/40	500,000.00	500,450.00	
UKT 4.375% 07/31/54	1,390,000.00	1,340,377.00	
UKT 4.5% 06/07/28	3,370,000.00	3,434,805.10	
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,439,998.30	
UKT 4.5% 12/07/42	2,290,000.00	2,299,389.00	
UKT 4.625% 01/31/34	2,230,000.00	2,329,235.00	
UKT 4.75% 10/22/43	1,830,000.00	1,886,364.00	
UKT 4.75% 12/07/30	1,910,000.00	2,005,335.93	
UKT 4.75% 12/07/38	1,800,000.00	1,890,518.40	
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,133,275.62	
UKT 4% 10/22/31	1,140,000.00	1,143,216.27	
UKT 4% 10/22/63	1,440,000.00	1,300,835.52	
UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,179,022.91	
イギリスポンド 小計	118,790,000.00	100,476,622.69 (19,588,922,359)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,280,000.00	4,712,928.00
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,550,903.80
	SGB 0.75% 11/12/29	6,770,000.00	6,427,404.15
	SGB 1.75% 11/11/33	4,610,000.00	4,523,908.25
	SGB 1% 11/12/26	7,940,000.00	7,823,956.90
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,419,038.00
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,607,879.75

スウェーデンクローナ 小計		40,650,000.00	40,066,018.85 (568,536,807)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,135,201.90
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,636,727.42
	NGB 1.5% 02/19/26	5,320,000.00	5,161,743.91
	NGB 1.75% 02/17/27	4,770,000.00	4,580,177.85
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,791,268.97
	NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,394,313.05
	NGB 2% 04/26/28	4,150,000.00	3,950,530.25
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,838,296.59
	NGB 3.625% 04/13/34	3,760,000.00	3,780,830.40
	NGB 3% 08/15/33	5,180,000.00	4,971,472.88
ノルウェークローネ 小計		42,850,000.00	40,240,563.22 (550,490,904)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,940,000.00	3,425,416.81
	DGB 0.5% 11/15/27	4,990,000.00	4,802,909.93
	DGB 0.5% 11/15/29	5,490,000.00	5,139,576.86
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,726,532.55
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,541,283.46
	DGB 2.25% 11/15/26	2,040,000.00	2,058,419.76
	DGB 2.25% 11/15/33	4,120,000.00	4,194,345.40
	DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	12,077,871.32
デンマーククローネ 小計		45,150,000.00	43,966,356.09 (957,147,572)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	4,500,000.00	4,102,203.37
	POLGB 0% 10/25/25	1,480,000.00	1,421,353.52
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,093,229.42
	POLGB 1.75% 04/25/32	4,610,000.00	3,588,071.32
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,704,962.85
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,530,000.00	4,241,391.43
	POLGB 2.75% 04/25/28	4,250,000.00	3,934,611.75
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,337,568.50
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,045,160.54
	POLGB 4.75% 07/25/29	1,650,000.00	1,608,535.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	6,600,000.00	6,713,239.49
	POLGB 5% 10/25/34	1,160,000.00	1,110,848.18
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,495,814.17
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,970,000.00	4,279,461.50
ポーランドズロチ 小計		54,010,000.00	50,676,451.54 (1,910,334,990)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	1,960,000.00	1,881,913.60
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,241,843.90
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,247,494.90

	ACGB 1.5% 06/21/31	3,250,000.00	2,762,337.50	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,003,377.00	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,664,620.00	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,249,576.00	
	ACGB 1% 12/21/30	1,500,000.00	1,253,205.00	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,040,000.00	1,931,737.20	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,167,705.80	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,042,853.00	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,950,000.00	1,688,095.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,481,759.10	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,740,000.00	1,667,581.20	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,683,755.40	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,110,000.00	2,054,338.20	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	813,372.60	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,578,696.60	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,440,000.00	1,350,417.60	
	ACGB 3.75% 05/21/34	2,340,000.00	2,243,194.20	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,018,872.00	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,665,862.40	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,778,088.90	
	ACGB 4.25% 06/21/34	960,000.00	957,129.60	
	ACGB 4.25% 12/21/35	940,000.00	932,282.60	
	ACGB 4.5% 04/21/33	2,720,000.00	2,771,952.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,160,000.00	2,205,813.60	
	ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	711,280.80	
	オーストラリアドル 小計	52,200,000.00	47,049,156.20 (4,713,854,959)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	1,340,000.00	1,180,642.99	
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	693,394.49	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	846,777.78	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	298,744.13	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	516,198.61	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	404,449.90	
	NZGB 2% 05/15/32	900,000.00	767,560.16	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,239,000.00	
	NZGB 3% 04/20/29	940,000.00	903,028.42	
	NZGB 4.25% 05/15/34	750,000.00	739,602.14	
	NZGB 4.25% 05/15/36	610,000.00	590,224.14	
	NZGB 4.5% 04/15/27	930,000.00	945,686.40	
	NZGB 4.5% 05/15/30	570,000.00	581,741.53	
	NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	439,107.32	
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	379,696.83	

ニュージーランドドル 小計		11,600,000.00	10,525,854.84 (955,537,102)
シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	774,396.48
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	845,496.45
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	520,520.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	605,170.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	348,597.81
	SIGB 2.125% 06/01/26	1,030,000.00	1,022,422.98
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	715,920.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	560,000.00	528,074.40
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	718,200.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	454,480.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	808,876.70
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	620,550.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	900,000.00	905,697.00
	SIGB 2.875% 08/01/28	140,000.00	140,770.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	422,109.49
	SIGB 2.875% 09/01/30	840,000.00	846,300.00
	SIGB 3.25% 06/01/54	210,000.00	229,530.00
	SIGB 3.375% 05/01/34	160,000.00	167,852.80
	SIGB 3.375% 09/01/33	880,000.00	918,016.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	753,759.04
SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	151,800.00	
SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	521,115.00	
シンガポールドル 小計		13,280,000.00	13,019,654.15 (1,484,631,162)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,545,140.48
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,513,028.00
	MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	710,921.22
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,292,758.69
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,951,652.40
	MGS 3.757% 05/22/40	2,950,000.00	2,867,570.00
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,776,769.18
	MGS 3.844% 04/15/33	1,830,000.00	1,832,748.66
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,192,410.80
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,143,030.82
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,996,243.35
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,497,901.86
	MGS 3.906% 07/15/26	1,210,000.00	1,221,652.05
	MGS 4.054% 04/18/39	460,000.00	466,001.71
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	3,027,880.36
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,558,572.85
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,809,121.82

	MGS 4.392% 04/15/26	1,750,000.00	1,777,277.60
	MGS 4.457% 03/31/53	1,740,000.00	1,814,524.54
	MGS 4.498% 04/15/30	2,930,000.00	3,054,625.20
	MGS 4.504% 04/30/29	720,000.00	749,113.77
	MGS 4.642% 11/07/33	2,010,000.00	2,137,499.71
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,131,582.55
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,064,623.88
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	3,008,459.28
	MGS 4.893% 06/08/38	2,130,000.00	2,338,688.88
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,872,497.08
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,146,922.92
	マレーシアリングット 小計	51,090,000.00	52,499,219.66 (1,821,428,926)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	3,260,000.00	3,087,646.40
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,970,000.00	2,313,489.51
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,880,000.00	1,924,339.09
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,904,875.83
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,465,789.85
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,520,000.00	949,075.53
	ILGOV 2% 03/31/27	2,530,000.00	2,377,496.40
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,690,000.00	2,586,586.16
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,041,842.12
	ILGOV 3.75% 09/30/27	970,000.00	945,015.22
	ILGOV 4% 03/30/35	1,490,000.00	1,371,684.75
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,190,000.00	2,255,304.04
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,382,667.07
	イスラエルシェケル 小計	30,640,000.00	26,605,811.97 (1,069,843,644)
オフショア 人民元	CGB 1.62% 08/15/27	21,000,000.00	21,008,540.70
	CGB 1.67% 06/15/26	34,680,000.00	34,825,881.42
	CGB 1.85% 05/15/27	42,700,000.00	42,975,496.13
	CGB 1.91% 07/15/29	23,000,000.00	23,123,489.30
	CGB 1.99% 03/15/26	25,520,000.00	25,717,818.28
	CGB 2.04% 02/25/27	41,310,000.00	41,728,383.54
	CGB 2.05% 04/15/29	36,880,000.00	37,331,300.56
	CGB 2.11% 08/25/34	16,500,000.00	16,483,783.96
	CGB 2.12% 06/25/31	32,000,000.00	32,241,680.00
	CGB 2.18% 08/15/26	35,600,000.00	35,996,972.04
	CGB 2.27% 05/25/34	38,000,000.00	38,556,396.00
	CGB 2.28% 03/25/31	50,700,000.00	51,609,649.26
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,475,664.22
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,673,654.45



CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,581,956.30	
CGB 2.35% 02/25/34	25,200,000.00	25,703,332.20	
CGB 2.37% 01/15/29	34,560,000.00	35,421,504.76	
CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,632,581.49	
CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,463,583.00	
CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,623,525.72	
CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	18,093,846.24	
CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,634,673.39	
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,415,590.00	
CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	27,218,335.50	
CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,337,349.67	
CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	60,256,022.25	
CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	31,542,468.65	
CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	28,086,392.42	
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	33,283,094.90	
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,653,580.15	
CGB 2.62% 04/15/28	34,000,000.00	35,024,161.60	
CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,808,891.12	
CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,752,404.99	
CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	39,350,276.23	
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,782,914.04	
CGB 2.67% 11/25/33	23,400,000.00	24,462,331.92	
CGB 2.68% 05/21/30	30,700,000.00	31,794,227.82	
CGB 2.69% 08/12/26	39,900,000.00	40,724,661.18	
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	20,307,558.08	
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	15,209,917.10	
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,571,688.54	
CGB 2.76% 05/15/32	13,150,000.00	13,803,164.44	
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,729,893.36	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	24,065,098.25	
CGB 2.8% 03/25/30	39,490,000.00	41,387,648.51	
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,847,707.24	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	32,013,623.07	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	12,017,730.80	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,613,523.90	
CGB 2.91% 10/14/28	24,320,000.00	25,412,062.84	
CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,168,761.04	
CGB 3.02% 05/27/31	27,560,000.00	29,403,077.74	
CGB 3.02% 10/22/25	49,870,000.00	50,692,545.80	
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,209,742.24	
CGB 3.12% 10/25/52	12,970,000.00	15,142,402.36	
CGB 3.19% 04/15/53	18,360,000.00	21,727,479.20	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,416,077.83	

	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,854,679.23	
	CGB 3.29% 05/23/29	35,000,000.00	37,500,211.00	
	CGB 3.32% 04/15/52	18,600,000.00	22,460,974.98	
	CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	25,250,988.03	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	10,393,648.30	
	CGB 3.72% 04/12/51	15,140,000.00	19,349,390.85	
	CGB 3.81% 09/14/50	24,020,000.00	30,923,607.41	
	CGB 3.86% 07/22/49	19,660,000.00	25,405,355.82	
	CGB 3% 10/15/53	13,770,000.00	15,851,236.35	
	CGB 4.08% 10/22/48	19,370,000.00	25,704,340.59	
	オフショア人民元 小計	1,853,070,000.00	1,939,830,550.30 (40,715,879,352)	
	合計		361,982,504,554 (361,982,504,554)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 212銘柄	100.0%	46.7%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 370銘柄	100.0%	30.2%
イギリスポンド	国債証券 61銘柄	100.0%	5.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券 22銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 67銘柄	100.0%	11.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 貸借対照表

	2024年10月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,112,700,825
コール・ローン	76,515,817
株式	218,368,914,087
投資信託受益証券	459,731,976
投資証券	218,147,335
派生商品評価勘定	402,276,020
未収配当金	291,492,523
未収利息	452
差入委託証拠金	2,307,915,984
流動資産合計	229,237,695,019
資産合計	229,237,695,019
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,864,855
前受金	372,552,151
未払株式払込金	3,888,142
未払解約金	36,561,286
流動負債合計	442,866,434
負債合計	442,866,434
純資産の部	
元本等	
元本	47,658,760,259
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	181,136,068,326
元本等合計	228,794,828,585
純資産合計	228,794,828,585
負債純資産合計	229,237,695,019

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年10月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

2024年10月21日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>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10月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,658,760,259口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.8007円 (48,007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10月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。
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10月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	2024年10月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	44,643,487,967円
期中追加設定元本額	4,429,852,297円
期中一部解約元本額	1,414,580,005円
期末元本額	47,658,760,259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	7,127,358,111円
世界経済インデックスファンド	13,446,213,265円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,384,161,024円
DC 世界経済インデックスファンド	7,839,568,904円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	88,571,848円
コア投資戦略ファンド（安定型）	54,839,070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	272,513,881円
分散投資コア戦略ファンドS	1,274,051,690円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,378,888,585円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	814,422,796円
コア投資戦略ファンド（切替型）	42,007,611円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	368,688,322円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,596,367円
SMT インデックスバランス・オープン	87,576,626円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	32,975,659円
外国株式SMT Bセクション（SMA専用）	2,734,513,954円
SMT 世界経済インデックス・オープン	304,731,715円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,433,956,586円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	232,833,857円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,888,771円
グローバル経済コア	638,607,125円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	578,000,517円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	43,894,747円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	15,640,654円
DC ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	123,486,238円
DC ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	130,762,897円
DC ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	59,334,785円
DC ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	77,240,396円
10資産分散投資ファンド	17,943,287円
グローバル10資産バランスファンド	28,662,995円
DC 世界経済インデックスファンド（株式特化型）	3,607,817円
DC 全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	11,922円

区分	2024年10月21日現在
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,622,761,714円
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	118,529,879円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,204,590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）	14,936,888円
F O F s用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	22,121,922円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	38,121,664,812
投資信託受益証券	15,799,000
投資証券	28,258,198
合計	38,109,205,614

(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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,298,752,455	-	9,671,304,606	372,552,151
合計		9,298,752,455	-	9,671,304,606	372,552,151

## (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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	33,011,000	-	32,870,266	140,734
	アメリカドル 売建	33,011,000	-	32,870,266	140,734
	アメリカドル 売建	62,743,800	-	62,744,052	252
	アメリカドル 買建	62,743,800	-	62,744,052	252
合計		95,754,800	-	95,614,318	140,986

## (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	2.20	307,098.20	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	13.70	505,941.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,001	112.90	1,806,512.90	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	38.18	1,558,736.68	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	10.38	822,801.84	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	43.83	2,912,591.16	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	29.99	368,367.17	
	IQIYI INC-ADR	59,454	2.42	143,878.68	
	KANZHUN LTD	38,815	15.15	588,047.25	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	11.88	1,883,538.36	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	124,381	124.62	15,500,360.22	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	14.30	781,866.80	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	42.87	633,961.56	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	488,730	1.53	747,756.90	
	CREDICORP LTD	10,882	190.60	2,074,109.20	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	500,000	14.45	7,225,000.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	33.37	692,527.61	
	STONECO LTD-A	30,000	11.02	330,600.00	
	XP INC - CLASS A	50,000	18.15	907,500.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	168,912	1.64	277,691.32		
KE HOLDINGS INC	114,048	21.10	2,406,412.80		
アメリカドル 小計		2,283,291		42,475,299.65 (6,347,084,026)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	11.95	31,837,918.95	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	564,092	110.28	62,208,065.76	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	293.62	10,276,700.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	19.71	3,519,259.92	
	ALFA S.A.B. -A	361,623	14.74	5,330,323.02	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	121.67	12,410,340.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	554.96	18,632,782.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	173.84	9,230,904.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	344.40	20,657,112.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	177.36	7,570,611.60	

	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	54,300	140.29	7,617,747.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	941,080	59.81	56,285,994.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	180.26	14,758,787.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	194.75	60,984,015.00	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	357.04	9,268,758.40	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	65.52	18,319,392.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	30.49	5,543,082.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	46.81	6,679,787.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	451,600	146.28	66,060,048.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	371,700	46.60	17,321,220.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	17.05	60,038,847.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	18.22	4,028,442.00	
	メキシコペソ 小計	10,681,063		508,580,137.95 (3,822,437,458)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	11.81	1,914,401.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	40.37	25,598,617.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	36.83	31,004,967.20	
	PRIO SA	178,800	42.18	7,541,784.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	20.80	3,159,520.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	11.67	1,159,998.00	
	GERDAU SA-PREF	312,408	18.40	5,748,307.20	
	SUZANO SA	162,779	55.77	9,078,184.83	
	VALE SA	621,587	60.55	37,637,092.85	
	EMBRAER SA	156,200	47.98	7,494,476.00	
	WEG SA	314,144	55.22	17,347,031.68	
	CCR SA	248,600	12.20	3,032,920.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	192,040	42.25	8,113,690.00	
	RUMO SA	244,300	19.19	4,688,117.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	22.61	3,911,530.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	6.98	925,548.00	
	RAIA DROGASIL SA	259,280	25.16	6,523,484.80	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	7.09	2,124,873.00	
	AMBEV SA	756,200	12.88	9,739,856.00	
	BRF SA	119,300	24.35	2,904,955.00	
	JBS SA	176,000	34.71	6,108,960.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	200,308	14.89	2,982,586.12	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	3.76	3,929,779.04	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	29.94	2,865,258.00	
	HYPERA SA	54,500	25.67	1,399,015.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	13.34	4,349,146.82	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	15.32	12,687,748.24	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	26.69	8,353,970.00	



	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	35.28	29,687,449.68	
	ITAUSA SA	824,701	10.61	8,750,077.61	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	10.65	11,244,365.85	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	33.82	3,682,998.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	14.43	2,049,060.00	
	TOTVS SA	124,500	28.54	3,553,230.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	54.81	4,900,014.00	
	TIM SA	222,800	17.64	3,930,192.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	42.11	1,558,070.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	266,600	37.77	10,069,482.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	11.04	3,040,140.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	85,500	91.09	7,788,195.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	9.90	2,025,540.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	32.60	886,720.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	41.39	1,914,287.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	32.48	5,362,448.00	
	ブラジルリアル 小計	13,616,361		332,768,086.42 (8,731,268,881)	
チリペソ	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,567.00	213,057,155.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	30,645	37,212.00	1,140,361,740.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	12.56	532,124,897.92	
	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,228.00	563,154,444.00	
	FALABELLA SA	214,533	3,580.00	768,028,140.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,970.00	603,671,040.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	117.40	890,268,032.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	28,500.00	199,186,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	48.78	563,417,243.82	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	91.49	319,420,409.35	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	52.30	133,954,839.40	
	チリペソ 小計	68,337,584		5,926,644,441.69 (928,248,832)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	37,680.00	1,910,300,640.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	35,480.00	2,184,326,200.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,020.00	910,208,220.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		5,004,835,060.00 (175,139,198)	
ユーロ	METLEN ENERGY & METALS SA	20,295	33.90	688,000.50	
	OPAP SA	44,643	15.95	712,055.85	
	JUMBO SA	19,341	25.92	501,318.72	
	ALPHA SERVICES AND HLD	511,806	1.52	782,807.27	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	2.05	880,126.33	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	7.47	1,000,464.57	

	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.86	437,199.15
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	16.12	422,456.84
	PUBLIC POWER CORP	55,892	12.15	679,087.80
	ユーロ 小計	1,352,835		6,103,517.03 (990,967,024)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	145.00	20,675,550.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	48.06	12,441,196.08
	SASA POLYESTER SANAYI	2,951,032	3.95	11,656,576.40
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	59.35	11,818,484.20
	KOC HOLDING AS	89,884	176.50	15,864,526.00
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	39.64	11,842,370.72
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	236.60	8,303,950.20
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	268.00	23,212,820.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	967.50	15,837,975.00
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	196.60	6,213,149.80
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	461.00	37,446,108.00
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	42,776	178.90	7,652,626.40
	COCA-COLA ICECEK AS	223,014	49.32	10,999,050.48
	AKBANK T.A.S.	586,183	50.15	29,397,077.45
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	82.70	17,480,464.40
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	11.76	22,070,380.08
YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	25.10	9,315,287.70	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	85.10	12,177,044.10	
	トルコリラ 小計	7,645,463		284,404,637.01 (1,244,042,763)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	815.50	10,848,596.50
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	114.00	6,920,940.00
	CEZ AS	25,283	864.00	21,844,512.00
	チェココルナ 小計	99,296		39,614,048.50 (254,817,366)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	2,644.00	253,871,592.00
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	10,960.00	315,001,360.00
	OTP BANK NYRT	40,021	18,930.00	757,597,530.00
	ハンガリーフォリント 小計	164,780		1,326,470,482.00 (537,924,901)
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	53.40	5,499,078.60
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	157.70	3,183,332.20
	BUDIMEX	2,656	591.50	1,571,024.00
	LPP SA	230	15,910.00	3,659,300.00
	CD PROJEKT SA	15,492	160.45	2,485,691.40
	ALLEGRO.EU SA	83,795	35.00	2,932,825.00
	DINO POLSKA SA	9,471	333.90	3,162,366.90

	ALIOR BANK SA	19,054	94.50	1,800,603.00
	BANK PEKAO SA	33,684	149.30	5,029,021.20
	M BANK SA	1,423	614.20	874,006.60
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	57.72	9,230,582.40
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	463.80	3,405,683.40
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	116,529	41.44	4,828,961.76
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	6.84	683,031.20
	ポーランドズロチ 小計	672,562		48,345,507.66 (1,822,466,098)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	722,000	0.00	0.07
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	151,214	0.00	0.01
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
	ロシアルーブル 小計	5,317,350		0.48 ( - )
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	9.75	3,207,750.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	7.60	1,839,200.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,869,400	4.71	22,934,874.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	35.00	20,142,500.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	272,000	8.37	2,276,640.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	6.10	23,180,000.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	557,700	10.66	5,945,082.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	6.22	6,966,400.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	21.70	5,153,750.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	13.38	7,432,590.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	3.11	2,264,080.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	7.07	5,726,700.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	14.60	3,416,400.00
	MMG LIMITED	1,176,000	2.62	3,081,120.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	17.56	4,302,200.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	14.10	4,526,100.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,185,000	17.20	20,382,000.00

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.90	1,072,500.00
BOC AVIATION LTD	68,800	63.60	4,375,680.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	4.52	2,467,920.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.99	2,816,940.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	12.46	5,507,320.00
CITIC LTD	1,038,000	9.50	9,861,000.00
CRRG CORP LTD-H	936,000	5.23	4,895,280.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.70	1,353,600.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	178,000	22.95	4,085,100.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	22.40	3,729,600.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	408,800	12.10	4,946,480.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	62,300	33.35	2,077,705.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	13.54	5,220,306.38
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	11.70	6,061,185.00
JD LOGISTICS INC	326,200	14.86	4,847,332.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	8.23	2,650,060.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	32,500	108.50	3,526,250.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.50	1,705,000.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	72,831	198.90	14,486,085.90
BYD CO LTD-H	187,000	287.00	53,669,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	56.60	8,150,400.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	12.60	11,944,800.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	13.70	6,764,375.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	2.71	971,112.24
LI AUTO INC-CLASS A	234,842	98.60	23,155,421.20
NIO INC-CLASS A	231,271	42.55	9,840,581.05
XPENG INC - CLASS A SHARES	287,162	42.45	12,190,026.90
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	12.54	2,934,360.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	29.65	2,570,655.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	87.15	20,933,430.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.91	2,150,580.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	31.30	14,416,780.00
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	99,000	26.45	2,618,550.00
LI NING CO LTD	380,000	16.22	6,163,600.00
MIDEA GROUP CO LTD	67,000	76.30	5,112,100.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	62.60	9,940,880.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	15.48	3,622,320.00
MEITUAN-CLASS B	904,050	185.40	167,610,870.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	55.70	13,618,650.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	17.86	2,979,048.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	11.20	884,800.00
TRIP.COM GROUP LTD	96,607	485.20	46,873,716.40

BAIDU INC-CLASS A	404,500	93.30	37,739,850.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	163.70	6,809,920.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	27.65	1,426,740.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.96	2,485,280.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	26.95	4,613,840.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	47.80	21,624,720.00
NETEASE INC	338,630	130.60	44,225,078.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,168,800	430.80	503,519,040.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	100.50	274,896,444.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	7.15	1,801,800.00
JD.COM INC - CL A	444,911	158.80	70,651,866.80
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	31.35	1,345,040.40
POP MART INTERNATIONAL GROUP	132,800	63.95	8,492,560.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	2.77	1,135,700.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	11.88	1,092,960.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.05	3,175,200.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	27.40	5,300,530.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	117.97	1,793,144.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	5.51	3,107,640.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	16.22	9,358,940.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	396,000	31.10	12,315,600.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	30.85	10,754,310.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	595,000	11.32	6,735,400.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	12.08	5,025,280.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	53.75	6,235,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	5.06	4,938,560.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	51.80	4,693,080.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	24.00	2,100,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	4.92	1,964,064.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	12.50	1,605,000.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	20.10	3,843,120.00
AKESO INC	132,000	69.20	9,134,400.00
BEIGENE LTD	138,905	131.80	18,307,679.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.57	9,120,211.20
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.79	1,962,810.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	12.10	2,686,200.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	22.05	5,997,600.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	46.45	9,429,350.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.78	7,450,380.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	63,688	51.20	3,260,825.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	16.50	10,362,000.00

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	4.00	20,540,000.00
BANK OF CHINA LTD-H	14,349,200	3.84	55,100,928.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	6.28	8,612,863.00
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	5.13	8,029,476.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	6.15	102,099,963.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.72	1,020,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	40.35	29,270,818.05
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	3.24	5,948,316.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	12,091,515	4.79	57,918,356.85
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.79	8,861,500.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	6.76	3,265,080.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	14.58	5,120,496.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	21.25	6,072,718.75
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.62	1,348,800.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	6.91	2,468,252.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	12.92	3,436,720.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	16.66	21,991,200.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	506,600	29.00	14,691,400.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	14.62	2,690,430.88
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	309,600	27.15	8,405,640.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	4.04	7,587,120.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	12.22	14,630,859.36
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	49.95	58,841,100.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	9.15	4,510,950.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	33.40	7,398,100.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	35.55	5,705,775.00
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	11.58	18,389,040.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	50.35	6,016,825.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,704,200	24.55	66,388,110.00
ZTE CORP-H	282,908	20.85	5,898,631.80
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	1.08	7,648,560.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	26.40	1,570,800.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.45	1,494,500.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	3.00	4,284,000.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	6.83	3,185,512.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	6.56	2,965,120.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.66	2,437,560.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	32.60	6,415,680.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	407,400	20.50	8,351,700.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	55.70	6,516,900.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	5.16	2,301,360.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.44	3,125,760.00

	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	7.80	4,274,400.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.14	3,589,860.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	23.70	2,133,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	3.19	2,858,198.53	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	14.74	1,348,031.96	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	884,540	14.80	13,091,192.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	26.20	14,177,108.20	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	32.35	3,849,650.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	6.91	2,180,105.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	12.42	4,266,270.00	
	香港ドル 小計	141,081,110		2,464,420,686.45 (47,390,809,800)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	17.90	1,582,360.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	5.63	2,344,332.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.80	3,636,480.00	
	GAMUDA BHD	414,102	8.20	3,395,636.40	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.42	813,957.32	
	SUNWAY BHD	454,600	4.47	2,032,062.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	10.42	1,117,868.02	
	MISC BHD	217,540	7.66	1,666,356.40	
	GENTING BHD	271,600	4.05	1,099,980.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.32	857,704.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	2.21	670,624.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.78	1,021,885.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	21.38	2,492,095.56	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	104.00	1,892,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	14.30	2,337,764.00	
	QL RESOURCES BHD	187,200	4.79	896,688.00	
	SD GUTHRIE BHD	247,046	4.72	1,166,057.12	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	7.19	3,389,366.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	662,600	5.17	3,425,642.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	8.15	10,050,596.30	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	21.16	2,566,538.72	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	10.66	9,396,843.30	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.57	11,626,537.00	
	RHB BANK BHD	219,347	6.42	1,408,207.74	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.40	1,298,613.60	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	3.60	1,792,800.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.73	999,267.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.53	1,773,234.56	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.66	2,620,744.00	

	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	14.68	6,485,257.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	2.31	1,877,337.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	3.52	1,757,888.00	
	INARI AMERTRON BHD	820,200	2.83	2,321,166.00	
	マレーシアリングット 小計	15,174,309		91,814,688.74	(3,185,455,537)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	308,100	129.00	39,744,900.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	33.75	56,855,250.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	47.75	14,019,638.75	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	25.50	12,396,417.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	26.50	5,371,550.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	212.00	27,644,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	63.75	41,749,875.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.20	6,699,400.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	29.00	24,619,202.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	34.00	6,194,800.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	10.50	8,821,417.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	16.60	13,153,840.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	67.50	64,557,000.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	234,477	34.00	7,972,218.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	25.75	14,327,300.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	29.00	54,754,900.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	278.00	22,990,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	151.50	20,179,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	21.50	9,430,975.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	110.00	16,632,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.83	15,970,776.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	48.50	4,922,750.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	636,300	130.50	83,037,150.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	282.00	57,471,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	111.50	13,586,275.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	11.90	23,985,854.20	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	68.25	47,372,325.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	68.25	25,825,800.00	
	タイパーツ 小計	24,561,007		740,288,413.45	(3,338,700,744)
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	719.00	39,120,790.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	26.10	15,297,810.30	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	962.00	34,906,170.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	185,130	409.00	75,718,170.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	276.80	16,887,568.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	98.50	9,412,660.00	



	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	143.10	33,600,166.20	
	BDO UNIBANK INC	394,773	164.00	64,742,772.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	80.30	43,769,683.10	
	PLDT INC	20,460	1,500.00	30,690,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	499.40	26,558,092.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	36.20	46,368,580.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	32.10	49,862,535.00	
	フィリピンベソ 小計	5,101,060		486,934,996.60 (1,265,203,201)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	3,780.00	8,173,494,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	26,725.00	5,369,052,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	9,800.00	10,815,280,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,895,911	1,020.00	2,953,829,220.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK	1,270,900	8,900.00	11,311,010,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	8,225.00	6,201,650,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,520.00	4,090,708,440.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	4,920.00	16,124,316,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	68.00	9,155,513,472.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	3,360.00	10,546,032,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,553,300	5,100.00	7,921,830,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	12,800.00	7,672,320,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	7,425.00	10,423,215,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	2,330.00	2,696,742,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,715.00	7,183,277,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	10,195,000	10,750.00	109,596,250,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	7,175.00	43,780,357,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	5,650.00	14,602,990,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	4,970.00	59,791,594,940.00	
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	3,100.00	27,585,350,000.00		
	インドネシアルピア 小計	199,779,606		375,994,812,672.00 (3,647,149,682)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	81,100.00	420,098,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	58,800.00	375,555,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	112,100.00	1,125,932,400.00	
	ENCHEM CO LTD	1,966	180,000.00	353,880,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	21,000.00	383,796,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	27,250.00	304,900,250.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	824,000.00	992,096,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	49,750.00	268,102,750.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	138,800.00	263,442,400.00	
	LG CHEM LTD	9,272	328,500.00	3,045,852,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	222,000.00	194,694,000.00	

LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	89,700.00	207,745,200.00	
POSCO HOLDINGS INC	13,371	345,000.00	4,612,995,000.00	
SKC CO LTD	5,899	145,900.00	860,664,100.00	
DOOSAN BOBCAT INC	12,098	43,000.00	520,214,000.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	20,450.00	1,676,961,350.00	
ECOPRO BM CO LTD	8,232	163,100.00	1,342,639,200.00	
ECOPRO CO LTD	15,665	80,100.00	1,254,766,500.00	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	116,500.00	322,588,500.00	
GS HOLDINGS CORP	6,593	41,650.00	274,598,450.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,245	387,500.00	2,032,437,500.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	30,850.00	458,091,650.00	
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	3,567	310,500.00	1,107,553,500.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	4,937	191,600.00	945,929,200.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	9,215	195,000.00	1,796,925,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	30,150.00	294,505,200.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	53,600.00	719,097,600.00	
L&F CO LTD	4,327	98,700.00	427,074,900.00	
LG CORP	16,658	77,400.00	1,289,329,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	8,760	388,500.00	3,403,260,000.00	
LS ELECTRIC CO LTD	3,284	150,800.00	495,227,200.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	230,500.00	1,096,719,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	51,300.00	443,591,100.00	
SAMSUNG C&T CORP	15,406	136,700.00	2,106,000,200.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	20,650.00	625,695,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	10,050.00	956,448,450.00	
SK INC	6,394	148,100.00	946,951,400.00	
SK SQUARE CO LTD	19,731	88,400.00	1,744,220,400.00	
HMM CO LTD	35,545	17,180.00	610,663,100.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5,586	120,600.00	673,671,600.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	23,150.00	620,929,300.00	
HANKOOK TIRE & TECHONLOGY CO	18,150	37,400.00	678,810,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	244,500.00	2,481,186,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	234,500.00	5,498,556,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	170,200.00	1,028,348,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	167,000.00	575,983,000.00	
KIA CORP	45,204	95,100.00	4,298,900,400.00	
COWAY CO LTD	9,036	66,400.00	599,990,400.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	97,300.00	1,678,814,200.00	
HANJIN KAL CORP	7,812	91,700.00	716,360,400.00	
HYBE CO LTD	4,975	188,800.00	939,280,000.00	
KAKAO CORP	52,020	38,500.00	2,002,770,000.00	
KRAFTON INC	6,265	340,500.00	2,133,232,500.00	

NAVER CORP	24,969	176,800.00	4,414,519,200.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	193,100.00	523,107,900.00
NETMARBLE CORP	2,465	56,000.00	138,040,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	281,500.00	517,678,500.00
KT&G CORP	19,456	106,800.00	2,077,900,800.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	99,900.00	313,885,800.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	125,100.00	470,626,200.00
LG H&H CO LTD	1,321	349,000.00	461,029,000.00
HLB INC	23,903	69,700.00	1,666,039,100.00
ALTEOGEN INC	6,824	386,500.00	2,637,476,000.00
CELLTRION INC	27,796	188,400.00	5,236,766,400.00
CELLTRION PHARM INC	2,169	64,600.00	140,117,400.00
HANMI PHARM CO LTD	1,202	350,500.00	421,301,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	1,060,000.00	3,563,720,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	8,337	123,200.00	1,027,118,400.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	57,100.00	119,910,000.00
YUHAN CORPORATION	13,854	155,300.00	2,151,526,200.00
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	65,600.00	3,361,934,400.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	14,500.00	410,785,000.00
KAKAObANK CORP	35,459	22,650.00	803,146,350.00
KB FINANCIAL GROUP INC	71,042	94,400.00	6,706,364,800.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	56,500.00	4,550,679,500.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	16,410.00	1,867,687,740.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	12,058	77,500.00	934,495,000.00
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	106,000.00	1,799,350,000.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	9,050.00	280,685,750.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	13,860.00	167,803,020.00
DB INSURANCE CO LTD	10,074	109,500.00	1,103,103,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	352,500.00	2,165,760,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	101,000.00	1,225,231,000.00
POSCO DX CO LTD	9,010	27,350.00	246,423,500.00
SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	146,900.00	1,070,019,600.00
COSMOAM&T CO LTD	3,978	107,900.00	429,226,200.00
LG DISPLAY CO LTD	51,846	10,570.00	548,012,220.00
LG INNOTEK CO LTD	2,696	193,700.00	522,215,200.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	11,233	123,000.00	1,381,659,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	857,794	59,200.00	50,781,404,800.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	50,100.00	7,108,037,700.00
SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	330,000.00	3,386,790,000.00
KT CORP	10,500	42,900.00	450,450,000.00
LG UPLUS CORP	22,125	9,920.00	219,480,000.00
SK TELECOM	9,563	56,200.00	537,440,600.00

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	21,050.00	931,252,000.00
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	104,200.00	754,199,600.00
	SK HYNIX INC	97,741	187,300.00	18,306,889,300.00
	韓国ウォン 小計	2,684,354		202,159,360,680.00 (22,075,802,186)
新台幣ドル	ASIA CEMENT CORP	454,176	47.60	21,618,777.60
	CHINA STEEL	2,373,261	22.95	54,466,339.95
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	40.10	21,736,646.10
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	48.20	28,815,116.80
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	43.25	33,335,024.00
	TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	32.75	41,540,722.25
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	910.00	28,716,870.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	37.10	13,431,238.80
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	22,000	618.00	13,596,000.00
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	16,000	2,010.00	32,160,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	31.80	15,970,373.40
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	21.70	10,090,500.00
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	37.30	14,397,800.00
	EVERGREEN MARINE	183,215	196.50	36,001,747.50
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.35	13,853,200.00
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	85.30	6,366,365.50
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	65.90	14,300,300.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	47.85	22,157,468.85
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	558.00	22,284,846.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	140.00	11,046,140.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	514.00	15,934,000.00
	POU CHEN	273,780	36.85	10,088,793.00
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	666.00	36,003,960.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	297.00	26,297,568.00
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	89.70	69,642,631.50
	PHARMAESSENTIA CORP	44,000	624.00	27,456,000.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	627,846	17.90	11,238,443.40
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	36.90	114,029,745.30
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,524,109	28.80	72,694,339.20
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,240,618	27.60	61,841,056.80
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,052,544	26.00	53,366,144.00
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,128,069	39.80	84,697,146.20
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,381,230	24.00	57,149,520.00
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,080,677	17.55	36,515,881.35
	TAIWAN BUSINESS BANK	1,732,572	15.90	27,547,894.80
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,139,268	25.90	55,407,041.20
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	39.65	27,357,905.25

CHAILEASE HOLDING CO LTD	297,253	156.50	46,520,094.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,958,218	33.50	65,600,303.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,731,057	69.80	120,827,778.60
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,578,623	93.20	147,127,663.60
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,576,226	17.75	45,728,011.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,157,158	11.60	36,623,032.80
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	569.00	48,934,000.00
ACER INC	617,803	41.85	25,855,055.55
ADVANTECH CO LTD	76,261	324.50	24,746,694.50
ASIA VITAL COMPONENTS	55,000	681.00	37,455,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	596.00	75,746,832.00
AUO CORP	1,268,072	17.15	21,747,434.80
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	244.50	29,022,150.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	35.50	28,604,480.00
DELTA ELECTRONICS INC	347,903	402.00	139,857,006.00
E INK HOLDINGS INC	144,000	319.00	45,936,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	267.50	20,062,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,259,248	207.50	468,793,960.00
INNOLUX CORP	1,162,106	16.30	18,942,327.80
INVENTEC CO LTD	455,511	45.50	20,725,750.50
LARGAN PRECISION CO LTD	20,040	2,325.00	46,593,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	104.50	36,935,734.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	179.00	17,900,000.00
PEGATRON CORP	340,474	104.00	35,409,296.00
QUANTA COMPUTER INC	463,270	307.00	142,223,890.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	73.20	14,793,720.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	144.50	30,489,500.00
WISTRON CORP	427,000	109.00	46,543,000.00
WIWYNN CORP	16,000	1,935.00	30,960,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	78.00	20,333,976.00
YAGEO CORPORATION	77,172	624.00	48,155,328.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	112.00	15,447,264.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	734,315	124.00	91,055,060.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	89.20	19,267,200.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	114.50	28,075,400.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	17,000	1,880.00	31,960,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	594,315	163.50	97,170,502.50
EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	3,045.00	36,540,000.00
GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,200.00	15,600,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	430.00	18,060,000.00
MEDIATEK INC	277,804	1,305.00	362,534,220.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	43.85	11,357,150.00

	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	523.00	50,231,535.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	465.00	39,963,960.00
	SILERGY CORP	53,000	508.00	26,924,000.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,408,389	1,085.00	4,783,102,065.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	50.50	99,788,000.00
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	205,205	98.20	20,151,131.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	385,263	20.10	7,743,786.30
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	48.30	13,479,419.10
	新台湾ドル 小計	63,680,644		8,950,797,758.80 (41,715,192,954)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	342.65	102,762,105.60
	COAL INDIA LTD	295,479	492.15	145,419,989.85
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	431.40	81,201,990.60
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	165.25	98,660,199.00
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	283.15	152,832,477.70
	OIL INDIA LTD	92,949	533.85	49,620,823.65
	PETRONET LNG LTD	83,779	349.15	29,251,437.85
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	552,888	2,717.55	1,502,500,784.40
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	573.15	42,145,438.95
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,570.30	41,504,599.30
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	2,990.60	200,977,291.80
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,760.10	129,291,364.30
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	753.40	186,006,926.00
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	742.80	40,386,778.80
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	964.30	67,283,068.20
	JSW STEEL LTD	99,332	992.40	98,577,076.80
	NMDC LTD	146,261	231.45	33,852,108.45
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	4,561.75	58,376,714.75
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	3,184.70	92,865,852.00
	SHREE CEMENT LTD	1,387	24,340.00	33,759,580.00
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	4,277	11,396.90	48,744,541.30
	SRF LTD	33,773	2,325.50	78,539,111.50
	SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	5,054.15	50,602,149.80
	TATA STEEL LTD	1,356,728	155.30	210,699,858.40
	ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	11,060.90	219,580,986.80
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	555.80	38,712,025.80
	VEDANTA LTD	184,749	480.85	88,836,556.65
	ABB LTD INDIA	11,720	8,780.45	102,906,874.00
	ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,004.35	101,096,377.50
	ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	223.30	54,032,570.90
	ASTRAL LTD	19,918	1,872.30	37,292,471.40
	BHARAT ELECTRONICS LTD	646,541	287.15	185,654,248.15

BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	253.70	38,512,421.10
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	117,125	818.80	95,901,950.00
CUMMINS INDIA LTD	20,968	3,708.90	77,768,215.20
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,851.05	66,019,549.30
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	4,525.10	164,333,531.60
LARSEN & TOUBRO LTD	118,675	3,576.25	424,411,468.75
POLYCAB INDIA LTD	7,354	7,117.55	52,342,462.70
RAIL VIKAS NIGAM LTD	120,000	477.20	57,264,000.00
SIEMENS INDIA LTD	16,262	7,804.80	126,921,657.60
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	72.26	108,390,000.00
THERMAX LTD	7,627	5,198.80	39,651,247.60
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	52,993	880.85	46,678,884.05
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,405.35	146,974,313.70
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	872.20	23,074,051.00
GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	85.73	33,820,313.54
INTERGLOBE AVIATION LTD	33,892	4,650.95	157,629,997.40
BAJAJ AUTO LTD	13,012	10,063.10	130,941,057.20
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,995.30	26,451,494.30
BHARAT FORGE LTD	51,953	1,474.70	76,615,089.10
BOSCH LTD	1,235	36,810.80	45,461,338.00
EICHER MOTORS LTD	26,253	4,764.20	125,074,542.60
HERO MOTOCORP LTD	21,431	5,214.70	111,756,235.70
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	165,233	2,963.75	489,709,303.75
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,102.65	294,699,527.50
MRF LTD	432	129,583.85	55,980,223.20
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	205.05	106,879,236.75
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	637.50	37,796,737.50
TATA MOTORS LTD	329,881	910.05	300,208,204.05
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	4,486.40	94,896,332.80
TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,714.95	112,002,547.30
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	6,048	15,384.70	93,046,665.60
PAGE INDUSTRIES LTD	886	45,523.00	40,333,378.00
TITAN CO LTD	56,531	3,379.80	191,063,473.80
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	686.70	112,960,089.90
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	625.25	27,467,232.50
ZOMATO LTD	1,214,742	257.40	312,674,590.80
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	8,088.30	116,115,634.80
TRENT LTD	37,950	7,770.30	294,882,885.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,986.40	113,979,148.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,886.30	130,416,862.80
ITC LTD	515,447	486.65	250,842,282.55
MARICO LTD	81,711	669.15	54,676,915.65

NESTLE INDIA LIMITED	57,460	2,349.55	135,005,143.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,094.65	102,064,071.35
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,517.40	88,889,292.00
VARUN BEVERAGES LTD	200,895	588.35	118,196,573.25
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	3,395.95	88,294,700.00
DABUR INDIA LTD	144,837	571.30	82,745,378.10
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,335.80	84,684,376.80
HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,715.65	391,216,539.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,995.40	101,867,014.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	161,282	937.75	151,242,195.50
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,472.35	52,143,275.25
CIPLA LTD	88,546	1,551.50	137,379,119.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	6,024.85	132,137,010.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	6,749.35	123,654,841.35
LUPIN LTD	48,134	2,176.35	104,756,430.90
MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,648.35	48,451,563.25
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,909.80	319,853,304.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	3,447.80	42,132,116.00
ZYDUS LIFESCIENCES LTD	70,000	1,021.65	71,515,500.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	683.75	62,978,161.25
AXIS BANK LTD	421,633	1,195.25	503,956,843.25
BANK OF BARODA	248,313	248.00	61,581,624.00
CANARA BANK	305,000	104.65	31,918,250.00
HDFC BANK LTD	762,664	1,681.15	1,282,152,583.60
ICICI BANK LTD	931,368	1,263.20	1,176,504,057.60
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	71.59	38,016,294.52
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,346.55	65,125,890.75
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,869.80	348,427,881.00
PUNJAB NATIONAL BANK	573,845	103.25	59,249,496.25
STATE BANK OF INDIA	314,786	819.95	258,108,780.70
UNION BANK OF INDIA	238,889	112.35	26,839,179.15
YES BANK LTD	2,352,478	21.09	49,613,761.02
BAJAJ FINANCE LTD	49,376	6,897.25	340,558,616.00
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,819.75	139,321,879.75
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	6,545	10,245.80	67,058,761.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,461.55	122,767,276.90
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	4,709.70	66,750,578.10
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	578,315	330.55	191,162,023.25
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,968.70	24,457,160.10
POWER FINANCE CORPORATION	265,755	472.55	125,582,525.25
REC LTD	246,323	545.85	134,455,409.55
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	738.85	44,844,500.75



	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	3,344.90	182,949,305.50
	SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	5,074.40	56,650,601.60
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	207,570	742.20	154,058,454.00
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	2,014.90	67,763,101.90
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	744.90	33,755,888.40
	PB FINTECH LTD	48,956	1,685.20	82,500,651.20
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,705.35	124,040,337.60
	HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,857.20	303,325,332.80
	INFOSYS LTD	598,702	1,878.85	1,124,871,252.70
	LTIMINDTREE LTD	15,699	5,992.25	94,072,332.75
	MPHASIS LTD	19,317	3,095.90	59,803,500.30
	ORACLE FINANCIAL SERVICES	4,194	11,585.00	48,587,490.00
	PERSISTENT SYSTEMS LTD	23,160	5,506.60	127,532,856.00
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	161,114	4,121.85	664,087,740.90
	TATA ELXSI LTD	7,679	7,329.60	56,283,998.40
	TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,688.00	160,017,336.00
	WIPRO LTD	247,008	548.70	135,533,289.60
	BHARTI AIRTEL LTD	457,159	1,706.80	780,278,981.20
	INDUS TOWERS LTD	220,428	384.70	84,798,651.60
	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,873.10	37,132,334.40
	VODAFONE IDEA LTD	4,326,724	9.02	39,027,050.48
	ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,735.35	105,339,215.70
	ADANI POWER LTD	167,705	611.45	102,543,222.25
	GAIL INDIA LTD	504,548	221.45	111,732,154.60
	JSW ENERGY LTD	63,163	677.05	42,764,509.15
	NHPC LTD	546,313	84.17	45,983,165.21
	NTPC LTD	766,679	424.75	325,646,905.25
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	331.95	265,885,311.00
	TATA POWER CO LTD	285,870	453.50	129,642,045.00
	TORRENT POWER LTD	28,990	1,972.70	57,188,573.00
	DLF LTD	126,742	875.95	111,019,654.90
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	3,131.70	93,205,655.40
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,161.90	48,732,409.80
	PHOENIX MILLS LTD	34,560	1,609.30	55,617,408.00
	PRESTIGE ESTATES PROJECTS	28,897	1,766.15	51,036,436.55
	インドルピー 小計	32,539,140		23,371,666,604.32 (41,835,283,221)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	15.24	913,089.36
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.33	2,033,930.90
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.62	2,128,261.60
	INDUSTRIES QATAR	282,919	13.21	3,737,359.99
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.26	2,263,725.66

	DUKHAN BANK	319,751	3.74	1,195,868.74	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.39	2,741,156.19	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.85	2,327,683.05	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	21.60	7,242,501.60	
	QATAR NATIONAL BANK	839,424	17.51	14,698,314.24	
	OOREDOO QSC	72,800	11.45	833,560.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	15.86	1,530,680.32	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.83	587,196.70	
	カタールリアル 小計	5,880,152		42,233,328.35 (1,734,100,462)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	168.00	5,748,456.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	673.63	6,730,237.33	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	75,443	527.93	39,828,622.99	
	GOLD FIELDS LTD	162,200	309.17	50,147,374.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	202.30	20,201,880.30	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	111.90	16,879,779.30	
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	350.95	6,204,445.05	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	125.33	6,024,487.77	
	SASOL LTD	88,115	115.30	10,159,659.50	
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	18.62	14,886,038.30	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	283.98	14,285,045.94	
	NASPERS LTD-N SHS	32,598	4,189.27	136,561,823.46	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	23.44	11,147,548.32	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	65.71	11,585,724.36	
	BID CORP LTD	58,066	446.70	25,938,082.20	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	372.84	13,206,738.48	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	285.73	24,351,053.52	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	182.00	10,225,124.00	
	ABSA GROUP LTD	140,135	172.02	24,106,022.70	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	17,205	3,260.00	56,088,300.00	
	NEDBANK GROUP LTD	88,111	298.34	26,287,035.74	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	238.99	58,062,381.51	
	FIRSTRAND LTD	903,903	82.74	74,788,934.22	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	480.13	8,251,994.31	
	REMGRO LTD	74,679	159.84	11,936,691.36	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	177.15	17,498,699.85	
OLD MUTUAL LTD	974,656	12.91	12,582,808.96		
OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	59.04	14,043,490.56		
SANLAM LTD	307,490	91.07	28,003,114.30		
MTN GROUP LTD	350,498	91.50	32,070,567.00		
VODACOM GROUP	166,454	109.55	18,235,035.70		
NEPI ROCKCASTLE N.V.	69,897	142.38	9,951,934.86		

	南アフリカランド 小計	6,145,383		816,019,131.89 (6,919,842,238)
アラブ首長国連邦 ディルハム	ADNOC DRILLING CO PJSC	650,000	4.68	3,042,000.00
	MULTIPLY GROUP	519,646	2.23	1,158,810.58
	AMERICANA RESTAURANTS INTL-FOREIGN CO	431,446	2.47	1,065,671.62
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.57	1,585,158.54
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.33	3,927,011.90
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	250,781	12.46	3,124,731.26
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	6.19	3,250,641.36
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	20.00	7,153,980.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	839,207	13.52	11,346,078.64
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	17.66	11,340,157.08
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	7.29	5,291,307.99
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	8.40	9,312,811.20
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	6,966,012		61,598,360.17 (2,510,133,176)
クウェートディ ナール	BOUBAYAN BANK K.S.C	171,769	0.53	92,411.72
	GULF BANK	162,936	0.30	49,206.67
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,971,962	0.71	1,402,064.98
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.85	1,203,636.78
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.45	134,167.16
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.82	124,175.88
	クウェートディナール 小計	4,158,308		3,005,663.19 (1,468,236,411)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	7.05	1,034,235.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	41.98	3,736,220.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	13.00	832,000.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.75	693,625.00
	PETROCHINA CO LTD-A	400,000	8.54	3,416,000.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	25.16	2,420,392.00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.76	1,845,265.92
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	8.57	682,172.00
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	15.72	155,628.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	40,365	15.85	639,785.25
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	31.10	870,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	8.55	1,404,765.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	25.14	740,121.60
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.56	2,423,920.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	10.33	952,426.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	19.30	401,440.00
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	38.05	548,681.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	30.96	346,752.00	

GEM CO LTD-A	289,800	6.97	2,019,906.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	16.45	408,387.70
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.63	542,773.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.33	933,675.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	52.21	1,169,504.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.63	751,430.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.10	246,000.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	8.17	182,191.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	58.50	593,190.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	18.80	287,640.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	15.74	1,246,608.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	17.21	819,196.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	9.14	442,833.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	18.15	1,006,871.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	77,252	28.30	2,186,231.60
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	23.19	416,028.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	4.12	1,180,792.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	14.17	230,120.80
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	39.42	425,736.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	33.35	380,190.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	11.90	116,620.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.48	1,153,968.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	78.22	3,152,266.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	33.69	496,994.88
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	49.09	809,248.65
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	32.18	131,938.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	27.10	1,013,540.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	28.95	214,519.50
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	19.58	2,533,652.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	23.90	832,867.20
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	17.63	4,744,233.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	41.60	474,240.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	40.88	633,640.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	31.53	264,852.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	39.15	2,161,667.25
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.34	1,411,254.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.17	1,879,917.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	6.28	3,531,872.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	249.89	13,688,974.20
CRRG CORP LTD-A	185,800	8.17	1,517,986.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	14.79	638,928.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	45.52	1,796,810.96

GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	74.76	179,424.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	9.82	197,490.02
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	21.65	125,570.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	55.40	634,662.40
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.07	619,377.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	33.50	1,611,350.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.30	1,091,970.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	26.36	2,213,712.80
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	8,316	86.75	721,413.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	49.12	615,670.08
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.51	899,232.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	191,900	18.00	3,454,200.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.52	2,199,884.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	58.50	1,660,990.50
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	8.40	210,504.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	14,000	94.50	1,323,000.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	22.41	912,087.00
TBEA CO LTD-A	29,274	13.01	380,854.74
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	13.46	581,472.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	7.84	1,563,296.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	20.90	660,440.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	48.42	399,949.20
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	22.45	163,885.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.93	555,093.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	29.95	329,450.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	6.98	1,576,782.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	817,100	5.69	4,649,299.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.62	144,800.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	14.23	2,611,205.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.75	1,083,375.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	42.52	2,257,812.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	34.80	185,101.20
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	6.21	275,724.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	17.18	956,926.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	47.70	721,224.00
BYD CO LTD -A	17,000	300.30	5,105,100.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	148.52	1,336,680.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.26	574,847.52
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	58.60	1,084,100.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	16.27	558,061.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	118.63	996,492.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.36	479,348.00

NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	66,265	45.10	2,988,551.50
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	13.11	558,486.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	18.94	743,470.76
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	51.25	143,500.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	47.30	2,057,550.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	75.01	3,810,508.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	56.44	434,588.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	31.13	3,147,243.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	53.96	431,680.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	16.48	403,760.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.15	436,840.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.99	974,406.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	24.36	397,068.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	4.12	253,380.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	68.02	1,409,374.40
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	17,035	22.58	384,650.30
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	36.26	387,982.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	188.20	301,120.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	41.19	90,618.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	62.30	1,140,090.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	91.64	274,920.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	60.30	476,370.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	43.09	2,329,316.13
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	42.81	727,770.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	24.83	1,951,141.40
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	26.40	905,572.80
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	45.49	786,977.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	84.97	773,227.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,541.00	20,033,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	135.24	2,488,416.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	93,558	42.19	3,947,212.02
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	9.35	250,580.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	191.03	1,791,861.40
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	18.28	697,564.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	143.00	5,934,500.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	33.54	338,754.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	12.97	385,209.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	15.00	1,376,235.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	28.35	453,600.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	32.99	320,662.80
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	27,985	5.26	147,201.10
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	12.21	180,708.00

SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	269.20	4,011,080.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	75.98	1,426,904.40
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	99,816	21.89	2,184,972.24
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	37.24	1,057,616.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	72.30	758,210.10
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	60.60	549,460.20
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	102.69	225,918.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	13,260	45.57	604,258.20
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	32.52	482,922.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	58.05	1,288,303.65
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	64.00	512,000.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	16.25	306,312.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	220.33	641,600.96
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	50.48	6,012,268.96
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.23	463,443.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	36.78	257,460.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	16.80	158,592.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	32.60	366,163.20
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	50.22	826,822.08
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	56.59	562,504.60
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	230.54	899,106.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.37	165,697.40
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.96	5,119,216.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.86	339,880.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	15.86	2,496,364.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	7.48	3,829,012.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	14.59	1,644,293.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	8.99	2,065,362.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.64	1,569,400.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	26.19	1,526,877.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	8.05	366,275.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	8.31	1,037,919.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.51	2,931,903.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	39.05	7,263,300.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.91	1,069,776.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.96	1,187,492.80
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	7.37	879,978.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	678,600	6.32	4,288,752.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	19.60	4,027,800.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	12.04	1,437,576.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.64	798,060.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	10.15	4,438,595.00

BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	11.60	921,040.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	8.25	472,972.50
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.79	135,121.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.45	394,615.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	20.26	580,651.60
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	27.91	3,937,542.80
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	26.86	647,326.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	22.95	2,694,949.65
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	17.72	63,792.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	16.23	983,538.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	11.63	2,617,913.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	20.27	1,465,521.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	8.29	1,260,494.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	210.83	1,138,482.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	17.30	544,950.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.47	739,326.90
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	10.59	429,699.84
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.35	1,108,520.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	7.89	2,426,964.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.71	536,940.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	13.61	594,757.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.78	2,134,344.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	38.00	3,807,600.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	57.18	5,992,464.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	8.53	229,457.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	284.50	1,372,143.50
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	42.94	1,385,502.04
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	28.10	465,392.20
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	45.83	494,964.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	28.53	326,297.61
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	11.05	145,528.50
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	34.94	1,324,226.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	4.16	2,556,736.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	36.25	1,015,000.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	10.65	370,620.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	26.08	4,305,808.00
GOERTEK INC -A	26,900	22.50	605,250.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	8.44	422,000.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	43.40	855,500.80
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	22.52	378,336.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	125,050	44.45	5,558,472.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	105.58	182,442.24



NINESTAR CORP-A	18,543	28.89	535,707.27
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	19.51	474,093.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	112.96	537,689.60
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	95.59	861,170.31
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	24.51	698,535.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.14	464,508.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	24.52	449,696.80
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	32.71	137,382.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.41	397,991.10
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	39.26	618,345.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	16.42	497,526.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	168.00	2,046,240.00
ZTE CORP-A	76,400	30.88	2,359,232.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	5.17	2,185,876.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	10.47	1,819,686.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.51	1,088,263.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	28.43	9,378,488.40
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	19.24	1,069,744.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	5.11	1,613,227.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	15.84	2,802,096.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	17.57	1,621,711.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	185.65	1,317,558.05
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	72.36	733,585.68
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	429.71	4,908,147.62
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	52.23	1,098,501.36
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	87.74	550,305.28
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	15.97	473,270.95
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	26.50	198,750.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	132.99	5,469,213.75
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	72.25	541,875.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	13.71	468,909.42
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	40.03	1,192,894.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	8.55	196,530.30
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	16.45	1,650,593.00
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	68.95	1,451,742.25
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	401.16	1,243,596.00
SG MICRO CORP-A	4,095	95.49	391,031.55
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	98.98	405,422.08
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	9.20	339,250.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	10.52	344,530.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	22.92	514,920.72
TONGWEI CO LTD-A	66,600	20.43	1,360,638.00

	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	21.52	546,995.36	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	70.83	485,822.97	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	110.20	803,358.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	34.71	590,833.62	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	10.75	588,025.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	414,800	9.37	3,886,676.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.34	1,746,152.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	10.47	856,446.00	
	オフショア人民元 小計	25,409,864		392,496,468.74 (8,238,265,380)	
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	80,157	19.98	1,601,536.86	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	765,496	27.05	20,706,666.80	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	36.50	429,787.50	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	116.20	4,347,390.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	27.50	1,299,127.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	51.40	10,837,381.60	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	121.80	1,138,708.20	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	72.70	11,912,403.90	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	18.08	1,542,639.84	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	7.98	825,379.38	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	40.65	2,076,361.35	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	280.60	1,728,215.40	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	292.00	1,228,444.00	
	JARIR MARKETING CO	125,000	13.10	1,637,500.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	129.00	829,599.00	
	ALMARAI CO	56,483	56.80	3,208,234.40	
	SAVOLA	77,064	27.10	2,088,434.40	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	158.00	1,079,614.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	290.00	4,755,710.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	97.90	1,558,959.60	
	AL RAJHI BANK	354,607	82.70	29,325,998.90	
	ALINMA BANK	250,177	28.30	7,080,009.10	
	ARAB NATIONAL BANK	195,935	18.48	3,620,878.80	
	BANK AL-JAZIRA	122,367	16.16	1,977,450.72	
	BANK ALBILAD	112,127	35.20	3,946,870.40	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	30.70	2,911,434.50	
	RIYAD BANK	293,961	24.30	7,143,252.30	
	SAUDI AWWAL BANK	191,132	34.25	6,546,271.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	13.10	1,156,730.00		
THE SAUDI NATIONAL BANK	533,249	34.50	18,397,090.50		
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	246.00	2,695,422.00		
AL RAJHI CO FOR CO-OPERATIVE	7,596	178.20	1,353,607.20		

BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	208.60	2,966,917.80	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	147.00	2,448,285.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	271.20	1,197,890.40	
ELM CO	4,094	1,030.00	4,216,820.00	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	50.80	2,481,275.20	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	10.70	968,435.60	
SAUDI TELECOM CO	339,167	42.20	14,312,847.40	
ACWA POWER CO	24,653	444.20	10,950,862.60	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	54.20	871,590.20	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	16.14	2,616,439.26	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	14.96	1,510,825.36	
サウジアラビアリアル 小計	4,957,450		205,529,298.57 (8,190,342,548)	
合計	648,451,758		218,368,914,087 (218,368,914,087)	

## (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	16,857,884.00	
		メキシコペソ 小計	97,360	16,857,884.00 (126,702,170)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,635,939.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,628,770.00	
		KLABIN SA-UNIT	213,800	4,427,798.00	
ブラジルリアル 小計	451,500	12,692,507.00 (333,029,806)			
投資信託受益証券合計			548,860	459,731,976 (459,731,976)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	14,280,799.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	216,346	14,743,979.90	
	メキシコペソ 小計	830,046	29,024,778.90 (218,147,335)		
投資証券合計			830,046	218,147,335 (218,147,335)	
合計				677,879,311 (677,879,311)	

(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 24銘柄	100.0%			2.9%
メキシコペソ	株式 22銘柄	91.7%			1.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		3.0%		0.1%
	投資証券 2銘柄			5.2%	0.1%
ブラジルレアル	株式 44銘柄	96.3%			4.0%
	投資信託受 益証券 3銘柄		3.7%		0.2%
チリペソ	株式 11銘柄	100.0%			0.4%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 9銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%			0.6%
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%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%			0.8%
ロシアルーブル	株式 14銘柄				
香港ドル	株式 154銘柄	100.0%			21.6%
マレーシアリンギット	株式 33銘柄	100.0%			1.5%
タイバーツ	株式 28銘柄	100.0%			1.5%
フィリピンペソ	株式 13銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式 20銘柄	100.0%			1.7%
韓国ウォン	株式 98銘柄	100.0%			10.1%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%			19.0%
インドルピー	株式 151銘柄	100.0%			19.1%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.0%			0.8%
南アフリカランド	株式 32銘柄	100.0%			3.2%
アラブ首長国連邦 ディルハム	株式 12銘柄	100.0%			1.1%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%			0.7%
オフショア人民元	株式 278銘柄	100.0%			3.8%
サウジアラビアリアル	株式 43銘柄	100.0%			3.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年10月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	660,153,063
コール・ローン	1,334,355,148
国債証券	151,922,028,930
派生商品評価勘定	2,932,675
未収入金	178,787
未収利息	2,335,862,121
前払費用	293,500,482
流動資産合計	156,549,011,206
資産合計	156,549,011,206
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,780,567
未払金	494,069
未払解約金	45,568,625
流動負債合計	51,843,261
負債合計	51,843,261
純資産の部	
元本等	
元本	67,413,337,194
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,083,830,751
元本等合計	156,497,167,945
純資産合計	156,497,167,945
負債純資産合計	156,549,011,206

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年10月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年10月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	67,413,337,194口

		2024年10月21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)	2,3215円 (23,215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10月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	61,835,203,451円
期中追加設定元本額	6,704,719,503円
期中一部解約元本額	1,126,585,760円
期末元本額	67,413,337,194円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,730,816,435円
世界経済インデックスファンド	26,096,717,384円

区分	2024年10月21日現在
D C 新興国債券インデックス・オープン	6,034,462,493円
D C 世界経済インデックスファンド	16,112,871,293円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	4,647,437円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	849,687,013円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,722,703,043円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,019,556円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,789,960円
S M T インデックスバランス・オープン	169,111,625円
S M T 世界経済インデックス・オープン	553,760,643円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	835,224,288円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,252,052,620円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	15,149,133円
グローバル経済コア	1,248,240,471円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	133,142,298円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	123,945,563円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	53,312,898円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	66,311,122円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	345,150,832円
10資産分散投資ファンド	57,664,871円
グローバル10資産バランスファンド	53,672,804円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	276,687,739円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	168,566,927円
S M T A M 海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	224,458,738円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	228,020,224円
S M T A M 海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	227,181,017円
S M T A M 海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	219,894,769円
S M T A M 海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	218,072,064円
S M T A M 海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	144,554,817円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,018,840,860
合計	3,018,840,860

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2024年10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,122,900,239	-	1,120,052,347	2,847,892
	メキシコペソ	177,401,543	-	174,290,585	3,110,958
	チェココルナ	95,227,691	-	94,966,163	261,528
	ハンガリーフォリント	48,618,296	-	48,153,494	464,802
	ポーランドズロチ	129,333,516	-	128,353,626	979,890
	マレーシアリンギット	174,101,417	-	173,787,882	313,535

	タイバーツ	169,148,609	-	171,252,276	2,103,667
	南アフリカランド	147,921,699	-	148,623,117	701,418
	オフショア人民元	181,147,468	-	180,625,204	522,264
	合計	1,122,900,239	-	1,120,052,347	2,847,892

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	38,800,000.00	39,438,734.52			
		MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000.00	191,311,369.20			
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	165,573,919.50			
		MBONO 7.5% 05/26/33	176,000,000.00	152,771,520.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	131,999,634.74			
		MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000.00	191,175,738.42			
		MBONO 7.75% 11/13/42	193,000,000.00	155,758,181.52			
		MBONO 7.75% 11/23/34	132,100,000.00	115,086,180.50			
		MBONO 7% 09/03/26	225,600,000.00	214,112,448.00			
		MBONO 8.5% 03/01/29	181,000,000.00	172,945,500.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000.00	147,842,820.50			
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	87,746,552.30			
		MBONO 8% 05/24/35	20,000,000.00	17,617,800.00			
		MBONO 8% 07/31/53	129,500,000.00	104,579,131.37			
		MBONO 8% 11/07/47	175,700,000.00	143,330,869.82			
			メキシコペソ 小計		2,259,700,000.00	2,031,290,400.39 (15,266,975,520)	
		ブラジルレアル		BLTN 0% 01/01/26	86,500,000.00	74,990,514.14	
BLTN 0% 01/01/28	54,400,000.00			36,907,079.42			
BLTN 0% 01/01/30	20,200,000.00			10,736,271.31			
BLTN 0% 07/01/25	68,000,000.00			62,882,842.23			
BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00			63,621,845.04			
BLTN 0% 07/01/27	64,500,000.00			46,598,349.43			
BNTNF 10% 01/01/27	61,300,000.00			58,163,742.85			
BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000.00			46,958,793.12			
BNTNF 10% 01/01/31	39,350,000.00			34,800,387.88			



	BNTNF 10% 01/01/33	28,900,000.00	25,066,570.68	
	BNTNF 10% 01/01/35	14,000,000.00	11,924,791.57	
ブラジルレアル 小計		566,550,000.00	472,651,187.67 (12,401,563,657)	
チリペソ	BTPCL 0% 04/01/29	1,700,000,000.00	1,401,599,000.00	
	BTPCL 4.5% 03/01/26	3,160,000,000.00	3,139,098,546.56	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,290,000,000.00	2,211,021,664.76	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,360,000,000.00	2,293,979,247.80	
	BTPCL 5% 10/01/28	840,000,000.00	835,229,072.16	
	BTPCL 6.2% 10/01/40	1,400,000,000.00	1,547,105,182.00	
	BTPCL 6% 01/01/43	2,000,000,000.00	2,193,678,082.00	
	BTPCL 6% 04/01/33	2,550,000,000.00	2,645,284,342.95	
	BTPCL 7% 05/01/34	620,000,000.00	699,917,391.16	
チリペソ 小計		16,920,000,000.00	16,966,912,529.39 (2,657,408,741)	
コロンビアペソ	COLTES 13.25% 02/09/33	12,000,000,000.00	13,888,475,640.00	
	COLTES 5.75% 11/03/27	25,000,000,000.00	22,824,701,500.00	
	COLTES 6.25% 07/09/36	12,000,000,000.00	8,500,176,360.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	31,000,000,000.00	30,819,372,920.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	47,600,000,000.00	38,379,187,896.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000.00	36,278,301,652.60	
	COLTES 7.75% 09/18/30	7,000,000,000.00	6,385,903,860.00	
	COLTES 7% 03/26/31	10,700,000,000.00	9,253,900,671.00	
	COLTES 7% 06/30/32	10,000,000,000.00	8,363,895,100.00	
	COLTES 9.25% 05/28/42	3,000,000,000.00	2,558,348,730.00	
コロンビアペソ 小計		212,410,000,000.00	177,252,264,329.60 (6,202,765,737)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	6,450,000.00	5,554,641.37	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	9,250,000.00	8,563,964.68	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	10,400,000.00	10,757,335.05	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	11,300,000.00	11,368,254.14	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	1,750,000.00	1,840,378.83	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	11,212,780.75	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	10,900,000.00	11,589,064.10	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,800,000.00	10,487,500.18	
	PERUGB 7.6% 08/12/39	9,100,000.00	9,761,068.13	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,450,000.00	2,605,262.13	
ペルーソル 小計		82,450,000.00	83,740,249.36 (3,331,857,041)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,475,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,612,994.32	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	40,000,000.00	40,480,000.00	

ウルグアイペソ 小計		82,000,000.00	80,567,994.32 (289,504,973)	
ドミニカペソ	DOMREP 10.75% 06/01/36	62,000,000.00	67,363,000.00	
	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	44,325,815.60	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	39,016,647.36	
ドミニカペソ 小計		134,000,000.00	150,705,462.96 (374,096,170)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	41,100,000.00	34,418,392.31	
	CZGB 0.25% 02/10/27	95,200,000.00	88,270,630.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	108,900,000.00	94,200,654.04	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	84,215,075.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	39,700,000.00	27,921,918.33	
	CZGB 1.75% 06/23/32	102,500,000.00	88,878,217.40	
	CZGB 1.95% 07/30/37	29,000,000.00	22,898,636.93	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	65,868,346.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	74,996,915.05	
	CZGB 2.5% 08/25/28	98,700,000.00	94,940,023.50	
	CZGB 2.75% 07/23/29	100,500,000.00	96,739,805.56	
	CZGB 2% 10/13/33	102,500,000.00	88,017,992.30	
	CZGB 3.5% 05/30/35	57,000,000.00	54,635,412.00	
	CZGB 3% 03/03/33	28,000,000.00	26,270,114.36	
	CZGB 4.2% 12/04/36	45,000,000.00	45,806,728.50	
	CZGB 4.5% 11/11/32	25,000,000.00	26,148,750.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	51,063,720.75	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	74,195,548.20	
	CZGB 5.75% 03/29/29	18,000,000.00	19,601,994.60	
	CZGB 5% 09/30/30	60,000,000.00	64,284,198.00	
CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	31,047,399.90		
CZGB 6% 02/26/26	68,000,000.00	70,259,340.80		
チェココルナ 小計		1,405,100,000.00	1,324,679,813.53 (8,521,002,900)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	574,806,702.36	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	477,210,748.12	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	798,421,163.35	
	HGB 2.25% 04/20/33	872,000,000.00	638,641,978.48	
	HGB 2.25% 06/22/34	291,000,000.00	204,376,575.00	
	HGB 2.75% 12/22/26	685,500,000.00	643,528,288.26	
	HGB 2% 05/23/29	733,000,000.00	616,620,395.21	
	HGB 3.25% 10/22/31	1,042,000,000.00	865,136,671.84	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	235,053,542.50	
	HGB 3% 08/21/30	835,000,000.00	706,737,637.30	
	HGB 3% 10/27/27	772,000,000.00	709,015,855.04	
	HGB 3% 10/27/38	580,000,000.00	390,624,200.00	

	HGB 4.5% 03/23/28	603,000,000.00	574,833,658.95	
	HGB 4.75% 11/24/32	873,000,000.00	782,775,301.59	
	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	901,197,180.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	784,220,223.80	
	HGB 7% 10/24/35	340,000,000.00	351,118,170.00	
	HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	245,279,751.00	
	ハンガリーフォリント 小計	11,854,000,000.00	10,499,598,042.80 (4,257,912,493)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	21,500,000.00	19,599,416.12	
	POLGB 0% 10/25/25	15,200,000.00	14,597,684.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	27,300,000.00	21,652,605.97	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	17,667,943.45	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	20,452,185.45	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	22,190,061.15	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	19,441,611.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000.00	34,605,235.77	
	POLGB 3.25% 07/25/25	20,050,000.00	19,974,476.66	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	20,451,605.44	
	POLGB 4.75% 07/25/29	17,200,000.00	16,767,764.00	
	POLGB 5% 10/25/34	6,600,000.00	6,320,343.15	
	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000.00	33,486,064.20	
	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000.00	30,721,575.00	
	ポーランドズロチ 小計	317,450,000.00	297,928,572.16 (11,230,924,006)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,736,461.22	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	11,100,000.00	10,602,680.70	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,652,279.74	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	9,400,000.00	9,236,871.74	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,399,920.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,502,300.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,510,117.21	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,319,688.50	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	10,200,000.00	8,767,162.03	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,620,758.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,274,598.16	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,300,000.00	7,264,412.50	
	ROMGB 5% 02/12/29	11,200,000.00	10,676,400.00	
	ROMGB 6.3% 04/25/29	5,500,000.00	5,454,681.21	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	9,600,000.00	9,539,684.72	
	ROMGB 7.1% 07/31/34	3,500,000.00	3,588,868.85	
ROMGB 7.2% 05/31/27	5,800,000.00	5,927,390.62		
ROMGB 7.2% 10/28/26	5,300,000.00	5,405,324.25		

	ROMGB 7.2% 10/30/33	5,300,000.00	5,449,963.50	
	ROMGB 7.35% 04/28/31	8,200,000.00	8,451,454.64	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	6,600,000.00	7,239,039.06	
	ROMGB 8.25% 09/29/32	10,200,000.00	11,096,070.00	
	ROMGB 8.75% 10/30/28	7,500,000.00	8,090,868.75	
	ROMGB 8% 04/29/30	9,100,000.00	9,599,806.58	
	ルーマニアレイ 小計	183,400,000.00	178,406,801.98 (5,824,821,518)	
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	41,200,000.00	38,581,689.73	
	MGS 3.502% 05/31/27	24,950,000.00	25,000,032.23	
	MGS 3.582% 07/15/32	21,500,000.00	21,217,032.05	
	MGS 3.733% 06/15/28	41,000,000.00	41,302,985.90	
	MGS 3.757% 05/22/40	20,450,000.00	19,878,578.52	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,231,360.08	
	MGS 3.885% 08/15/29	24,800,000.00	25,172,124.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	7,500,000.00	7,599,911.25	
	MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,681,009.33	
	MGS 3.906% 07/15/26	24,600,000.00	24,836,893.08	
	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000.00	34,110,719.01	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,750,000.00	13,561,353.43	
	MGS 4.254% 05/31/35	13,650,000.00	14,111,150.23	
	MGS 4.457% 03/31/53	9,200,000.00	9,594,037.84	
	MGS 4.504% 04/30/29	14,900,000.00	15,502,493.42	
	MGS 4.642% 11/07/33	14,000,000.00	14,888,057.80	
	MGS 4.696% 10/15/42	26,800,000.00	28,998,178.88	
	MGS 4.762% 04/07/37	18,500,000.00	20,020,322.60	
	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000.00	47,981,551.20	
	MGS 4.921% 07/06/48	11,400,000.00	12,706,230.24	
	マレーシアリンギット 小計	434,450,000.00	443,975,710.82 (15,403,470,901)	
タイパーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	149,200,000.00	148,093,089.67	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	70,800,000.00	64,904,903.84	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	59,995,007.73	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	108,100,000.00	105,056,056.42	
	THAIGB 1% 06/17/27	203,000,000.00	197,148,037.80	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	203,198,036.37	
	THAIGB 2.25% 03/17/27	83,000,000.00	83,289,587.00	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,567,503.00	
	THAIGB 2.4% 03/17/29	118,000,000.00	119,108,256.00	
	THAIGB 2.4% 11/17/27	11,000,000.00	11,093,214.00	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	164,000,000.00	166,979,371.60	
	THAIGB 2.8% 06/17/34	118,000,000.00	122,080,192.20	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	98,100,000.00	95,786,941.30	

	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	103,927,474.90	
	THAIGB 2% 06/17/42	93,600,000.00	83,867,196.81	
	THAIGB 2% 12/17/31	123,000,000.00	120,613,930.38	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	160,366,585.64	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	157,000,000.00	168,660,327.20	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	155,000,000.00	168,989,726.50	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	171,041,947.32	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	151,000,000.00	164,027,072.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	166,500,000.00	180,699,902.55	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	197,937,756.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	107,458,862.52	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	188,500,000.00	211,068,690.30	
	タイパーツ 小計	3,260,300,000.00	3,357,959,669.05 (15,144,398,107)	
インドネシア アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,666,122,000.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	7,813,800,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	61,327,980,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000.00	107,761,760,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,887,360,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	37,800,000,000.00	36,541,638,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	115,000,000,000.00	114,140,950,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	26,100,000,000.00	25,395,039,000.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	100,500,000,000.00	100,535,175,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	75,422,990,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	53,102,820,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	82,000,000,000.00	81,802,380,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,968,600,000.00	
	INDOGB 6.875% 04/15/29	60,000,000,000.00	61,118,100,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	39,000,000,000.00	40,081,470,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	62,800,000,000.00	64,261,984,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	28,500,000,000.00	29,291,017,500.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	51,000,000,000.00	53,834,580,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	36,599,825,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	49,700,000,000.00	52,424,057,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,412,920,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	77,000,000,000.00	78,841,840,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,223,004,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	73,000,000,000.00	74,908,220,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	58,088,850,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,615,603,000.00	
INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,693,770,000.00		
INDOGB 8.375% 03/15/34	71,000,000,000.00	79,184,880,000.00		
INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,548,796,000.00		

	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,574,477,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	43,198,875,000.00	
	INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,139,184,000.00	
	INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,521,497,000.00	
インドネシアルピア 小計		1,560,800,000,000.00	1,604,929,563,500.00 (15,567,816,765)	
インドル ピー	IGB 5.77% 08/03/30	185,000,000.00	177,011,670.40	
	IGB 5.85% 12/01/30	220,000,000.00	210,716,864.60	
	IGB 6.1% 07/12/31	150,000,000.00	145,070,535.00	
	IGB 6.54% 01/17/32	230,000,000.00	227,642,500.00	
	IGB 6.99% 12/15/51	190,000,000.00	192,843,065.00	
	IGB 7.04% 06/03/29	260,000,000.00	263,389,178.00	
	IGB 7.1% 04/08/34	200,000,000.00	204,164,660.00	
	IGB 7.1% 04/18/29	165,000,000.00	167,457,361.50	
	IGB 7.16% 09/20/50	220,000,000.00	227,809,692.00	
	IGB 7.17% 04/17/30	150,000,000.00	152,891,580.00	
	IGB 7.18% 07/24/37	110,000,000.00	113,398,406.00	
	IGB 7.18% 08/14/33	200,000,000.00	204,674,260.00	
	IGB 7.26% 08/22/32	170,000,000.00	175,192,769.00	
	IGB 7.36% 09/12/52	200,000,000.00	210,797,580.00	
	IGB 7.37% 01/23/54	200,000,000.00	212,641,780.00	
	IGB 7.37% 10/23/28	140,000,000.00	143,242,120.00	
	IGB 7.38% 06/20/27	160,000,000.00	163,171,568.00	
	IGB 7.41% 12/19/36	230,000,000.00	240,042,329.00	
	IGB 7.54% 05/23/36	130,000,000.00	136,959,199.00	
インドルピー 小計		3,510,000,000.00	3,569,117,117.50 (6,388,719,640)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	195,700,000.00	204,130,364.60	
	SAGB 11.625% 03/31/53	35,000,000.00	35,950,652.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	51,206,353.29	
	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	74,251,719.82	
	SAGB 7% 02/28/31	122,700,000.00	107,371,702.50	
	SAGB 8.25% 03/31/32	173,500,000.00	158,278,498.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	121,742,694.70	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	89,207,888.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000.00	149,734,548.23	
	SAGB 8.875% 02/28/35	225,000,000.00	201,104,669.25	
	SAGB 8% 01/31/30	210,100,000.00	199,123,073.38	
	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000.00	156,888,848.20	
南アフリカランド 小計		1,781,000,000.00	1,548,991,012.47 (13,135,443,785)	
オフショア 人民元	CGB 2.04% 02/25/27	26,000,000.00	26,263,325.40	

CGB 2.11% 08/25/34	3,600,000.00	3,596,461.95	
CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,437,913.06	
CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,252,601.40	
CGB 2.25% 08/29/39	7,000,000.00	6,970,185.95	
CGB 2.27% 05/25/34	11,000,000.00	11,161,062.00	
CGB 2.28% 03/25/31	13,000,000.00	13,233,243.40	
CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,170,513.00	
CGB 2.35% 02/25/34	8,400,000.00	8,567,777.40	
CGB 2.39% 11/15/26	2,000,000.00	2,033,384.00	
CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,237,861.00	
CGB 2.44% 10/15/27	16,600,000.00	16,969,369.92	
CGB 2.46% 02/15/26	21,600,000.00	21,846,721.68	
CGB 2.47% 07/25/54	3,800,000.00	3,933,325.28	
CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,512,209.30	
CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,135,535.00	
CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,129,450.60	
CGB 2.52% 08/25/33	15,700,000.00	16,207,290.55	
CGB 2.54% 12/25/30	17,800,000.00	18,408,391.54	
CGB 2.57% 05/20/54	5,500,000.00	5,835,438.40	
CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	17,550,212.29	
CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	18,336,178.72	
CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,712,881.90	
CGB 2.62% 09/25/29	25,000,000.00	25,969,920.00	
CGB 2.64% 01/15/28	16,200,000.00	16,679,080.98	
CGB 2.67% 05/25/33	16,700,000.00	17,432,166.41	
CGB 2.67% 11/25/33	7,300,000.00	7,631,411.24	
CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	28,273,042.98	
CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,206,682.00	
CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,457,033.00	
CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	8,076,990.46	
CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,362,550.22	
CGB 2.76% 05/15/32	13,000,000.00	13,645,713.90	
CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,566,294.40	
CGB 2.8% 03/24/29	19,000,000.00	19,810,956.10	
CGB 2.8% 03/25/30	16,500,000.00	17,292,889.35	
CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,433,109.06	
CGB 2.85% 06/04/27	9,400,000.00	9,697,971.54	
CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	18,292,475.20	
CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,463,783.20	
CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,449,039.00	
CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,250,505.02	
CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	9,068,438.35	
CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,420,404.74	

	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,924,998.60	
	CGB 3.12% 10/25/52	5,600,000.00	6,537,968.64	
	CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,498,648.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,841,023.88	
	CGB 3.19% 04/15/53	6,200,000.00	7,337,166.18	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,041,516.96	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,613,929.80	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,950,237.97	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,818,060.20	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,211,933.99	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	15,214,371.32	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,830,317.20	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	10,953,785.04	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	10,863,264.35	
	CGB 3.81% 09/14/50	14,800,000.00	19,053,679.84	
	CGB 3% 10/15/53	13,000,000.00	14,964,856.40	
	オフショア人民元 小計	721,400,000.00	758,637,549.26 (15,923,346,976)	
	合計		151,922,028,930 (151,922,028,930)	

## 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.0%
ブラジルリアル	国債証券 11銘柄	100.0%	8.2%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	1.7%
コロンビアペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	4.1%
ペルーソル	国債証券 10銘柄	100.0%	2.2%
ウルグアイペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 22銘柄	100.0%	5.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	2.8%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	7.4%
ルーマニアレイ	国債証券 24銘柄	100.0%	3.8%
マレーシアリンギット	国債証券 20銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 25銘柄	100.0%	10.0%
インドネシアルピア	国債証券 33銘柄	100.0%	10.2%
インドルピー	国債証券 19銘柄	100.0%	4.2%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	8.6%



オフショア人民元	国債証券 60銘柄	100.0%	10.5%
----------	-----------	--------	-------

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年10月21日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,748,990,736
投資証券	92,987,783,350
未収配当金	1,344,635,120
未収利息	10,341
前払金	123,101,280
差入委託証拠金	179,934,818
流動資産合計	96,384,455,645
資産合計	96,384,455,645
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	123,505,860
未払金	3,704,800
未払解約金	62,001,085
流動負債合計	189,211,745
負債合計	189,211,745
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	47,285,381,232
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	48,909,862,668
元本等合計	96,195,243,900
純資産合計	96,195,243,900
負債純資産合計	96,384,455,645

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年10月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

	2024年10月21日現在
	投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
	(2)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10月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,285,381,232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) 2.0344円 (20,344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10月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年10月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	60,105,680,753円
期中追加設定元本額	5,810,008,265円
期中一部解約元本額	18,630,307,786円
期末元本額	47,285,381,232円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,835,540,181円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,918,484円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,137,763,376円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	20,218,842,104円
コア投資戦略ファンド（安定型）	602,448,365円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,042,334,487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）	459,626,988円
SMT インデックスバランス・オープン	21,839,127円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	137,260,651円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,227,597円
グローバル経済コア	563,720,562円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,093,070円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	299,327,569円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,105,958円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	1,133,062,419円
10資産分散投資ファンド	33,151,065円
グローバル10資産バランスファンド	58,239,554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）	212,649,650円
FOfs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,727,206円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	751,658,647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）	63,522,104円
J-REIT バッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	486,711,899円
J-REIT バッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	44,709,121円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	5,901,828,232
合計	5,901,828,232

(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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	3,219,977,280	-	3,096,876,000	123,101,280
	合計	3,219,977,280	-	3,096,876,000	123,101,280

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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	2,096	246,280,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,034	246,664,200	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,726	522,695,600	
	東海道リート投資法人	1,618	175,229,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	3,271	1,992,039,000	
	森ヒルズリート投資法人	11,138	1,424,550,200	
	産業ファンド投資法人	17,343	2,010,053,700	
	アドバンス・レジデンス投資法人	9,309	2,913,717,000	
	アクティピア・プロパティーズ投資法人	4,604	1,510,112,000	
	G L P 投資法人	31,816	4,237,891,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,796	1,460,382,000	
	日本プロロジスリート投資法人	16,501	3,999,842,400	
	星野リゾート・リート投資法人	2,003	940,408,500	
	O n e リート投資法人	1,652	394,497,600	
	イオンリート投資法人	11,619	1,502,336,700	
	ヒューリックリート投資法人	8,370	1,116,558,000	
	日本リート投資法人	3,077	981,563,000	
	積水ハウス・リート投資法人	28,463	2,131,878,700	
	トーセイ・リート投資法人	2,059	270,346,700	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,335	264,322,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	2,581	245,195,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	30,320	4,393,368,000	
	いちごホテルリート投資法人	1,568	207,603,200	
	ラサールロジポート投資法人	12,127	1,762,053,100	
	スターアジア不動産投資法人	17,455	888,459,500	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,720	194,188,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,950	1,631,350,000	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,529	109,935,100	
	投資法人みらい	13,043	547,153,850	
	三菱地所物流リート投資法人	3,271	1,174,289,000	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,078	572,143,400	
	ザイマックス・リート投資法人	1,622	181,664,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	6,186	523,335,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,150	492,190,000		

日本ビルファンド投資法人	55,249	7,154,745,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,730	5,458,530,000	
日本都市ファンド投資法人	49,115	4,661,013,500	
オリックス不動産投資法人	18,873	2,908,329,300	
日本プライムリアルティ投資法人	6,478	2,189,564,000	
N T T都市開発リート投資法人	9,627	1,074,373,200	
東急リアル・エステート投資法人	6,351	982,499,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,994	698,001,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,188	2,902,756,000	
森トラストリート投資法人	18,258	1,144,776,600	
インヴィンシブル投資法人	52,187	3,204,281,800	
フロンティア不動産投資法人	3,514	1,438,983,000	
平和不動産リート投資法人	6,945	863,263,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,364	1,732,917,200	
福岡リート投資法人	5,344	770,604,800	
K D X不動産投資法人	26,500	3,953,800,000	
いちごオフィスリート投資法人	6,911	562,555,400	
大和証券オフィス投資法人	3,924	1,185,048,000	
阪急阪神リート投資法人	4,516	548,694,000	
スターツプロシード投資法人	1,642	299,665,000	
大和ハウスリート投資法人	14,205	3,255,786,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,798	2,463,698,400	
大和証券リビング投資法人	13,990	1,302,469,000	
ジャパンエクセレント投資法人	8,134	967,132,600	
合計	664,267	92,987,783,350	

(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10月21日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	440,819,394
コール・ローン	164,542,909
投資証券	138,222,834,958
派生商品評価勘定	19,825
未収配当金	82,852,942
未収利息	972
流動資産合計	138,911,071,000

	2024年10月21日現在
項目	金額（円）
資産合計	138,911,071,000
負債の部	
流動負債	
未払解約金	175,715,565
流動負債合計	175,715,565
負債合計	175,715,565
純資産の部	
元本等	
元本	41,782,888,125
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	96,952,467,310
元本等合計	138,735,355,435
純資産合計	138,735,355,435
負債純資産合計	138,911,071,000

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年10月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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10月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	41,782,888,125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 3.3204円 (1万口当たり純資産額) (33,204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10月21日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2024年10月21日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年10月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 元本の移動

区分	2024年10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	40,027,161,619円
期中追加設定元本額	5,413,318,153円
期中一部解約元本額	3,657,591,647円
期末元本額	41,782,888,125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	45,815,858円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	70,730,034円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,511,606,658円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,621,932円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,818,002,097円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,163,370,941円
コア投資戦略ファンド（安定型）	381,863,011円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,091,049,272円
分散投資コア戦略ファンドA	1,289,822,691円
分散投資コア戦略ファンドS	3,459,827,749円
コア投資戦略ファンド（切替型）	292,626,236円

区分	2024年10月21日現在
SMT インデックスバランス・オープン	103,056,405円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	142,943,632円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,594,137円
グローバル経済コア	381,510,478円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,536,370円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	303,695,306円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	99,132,517円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	345,366,005円
10資産分散投資ファンド	17,596,135円
グローバル10資産バランスファンド	42,338,708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）	1,314,777,505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）	182,847,177円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	99,429,780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）	46,807,730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）	48,610,030円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	80,202,667円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	84,204,527円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	83,893,688円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	78,584,761円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	77,918,065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）	38,118,162円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	53,387,861円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	27,903,743,184
合計	27,903,743,184

(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10月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	17,929,200	-	17,929,236	36
	アメリカドル	17,929,200	-	17,929,236	36
	売建	10,851,660	-	10,831,871	19,789
	シンガポールドル	10,851,660	-	10,831,871	19,789
合計		28,780,860	-	28,761,107	19,825

## (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	61,245	1,515,201.30	
		AGREE REALTY CORP	59,950	4,531,021.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,493	803,750.64	
		ALEXANDER'S INC	1,336	313,692.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	92,639	11,282,503.81	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	105,279.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	814,034.12	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	89,479	2,255,765.59	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	187,472	7,146,432.64	
		AMERICOLD REALTY TRUST	156,107	4,178,984.39	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	80,107	707,344.81	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	134,633	2,019,495.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	35,039	394,539.14	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	84,432	19,177,884.48	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	91,266.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	107,083	699,251.99	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	179,847	5,098,662.45	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	109,120	2,041,635.20	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	87,100.00	
		BXP INC	86,581	7,768,047.32	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	63,515	7,668,801.10	
		CARETRUST REIT INC	92,393	2,853,095.84	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,284	198,270.48	
		CENTERSPACE	8,999	641,358.73	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	216,765.76	
		CITY OFFICE REIT INC	15,298	87,198.60	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	265,895.00	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	63,749	2,062,917.64	
		COUSINS PROPERTIES INC	91,208	2,902,238.56	
		CTO REALTY GROWTH INC	12,400	241,428.00	
		CUBESMART	134,181	6,706,366.38	
		CURLINE PROPERTIES CORP	55,764	1,295,397.72	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	123,244	1,109,196.00	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	508,800	292,560.00			
DIGITAL REALTY TRUST INC	182,872	30,243,371.36			
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	432,160.00			
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	100,867	1,937,655.07			
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02			

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,918	838,073.46	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	29,020	5,305,726.60	
ELME COMMUNITIES	50,407	859,439.35	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	75,879	865,779.39	
EPR PROPERTIES	45,488	2,222,998.56	
EQUINIX INC	56,395	50,484,804.00	
EQUITY COMMONWEALTH	59,311	1,176,137.13	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	111,097	7,773,457.09	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	202,898	15,345,175.74	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	104,848	3,580,559.20	
ESSEX PROPERTY TRUST	38,207	11,328,375.50	
EXTRA SPACE STORAGE INC	125,962	21,574,771.36	
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	309,120.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	44,889	5,132,608.26	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	79,030	4,366,407.50	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	55,891	1,661,639.43	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	80,912.48	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	163,409	8,412,295.32	
GETTY REALTY CORP	27,420	872,504.40	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	21,056	347,634.56	
GLADSTONE LAND CORP	16,220	218,970.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	362,415.69	
GLOBAL NET LEASE INC	108,650	913,746.50	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	216,948	3,952,792.56	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	418,962	9,485,299.68	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	63,725	2,317,678.25	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	418,449	7,435,838.73	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	86,787	432,199.26	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	134,676	2,686,786.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	142,282.14	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,011	2,265,524.98	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	43,782	1,313,022.18	
INVITATION HOMES INC	338,962	11,568,773.06	
IRON MOUNTAIN INC	174,366	21,928,268.16	
JBG SMITH PROPERTIES	47,755	892,540.95	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	92,529.00	
KILROY REALTY CORPORATION	63,383	2,760,963.48	
KIMCO REALTY CORP	401,330	9,880,744.60	
KITE REALTY GROUP TRUST	131,391	3,473,978.04	
LAMAR ADVERTISING CO-A	52,367	7,129,767.05	
LINEAGE INC	35,589	2,759,926.95	

LTC PROPERTIES INC	25,175	909,069.25
LXP INDUSTRIAL TRUST	171,218	1,677,936.40
MACERICH CO/THE	129,674	2,449,541.86
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	97,714.18
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	360,602	1,799,403.98
MID-AMERICA APARTMENT COMM	69,550	10,751,734.50
MODIV INDUSTRIAL INC	2,421	41,399.10
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	39,809	1,789,414.55
NATL HEALTH INVESTORS INC	26,103	1,998,445.68
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	264,940.96
NETSTREIT CORP	41,151	682,283.58
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,812	98,686.44
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	619,086.08
NNN REIT INC	109,572	5,367,932.28
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	46,793.52
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	153,715	6,396,081.15
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	239,654.13
ORION OFFICE REIT INC	34,844	147,390.12
OUTFRONT MEDIA INC	77,211	1,477,818.54
PARAMOUNT GROUP INC	100,128	536,686.08
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	119,531	1,672,238.69
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	265,810.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	900,300.50
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	73,421	2,740,805.93
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	774,711.81
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	468,544.96
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	195,348.80
PRIME US REIT	324,500	57,761.00
PROLOGIS INC	549,890	67,361,525.00
PUBLIC STORAGE	93,585	32,344,847.70
REALTY INCOME CORP	517,420	33,482,248.20
REGENCY CENTERS CORP	97,337	7,063,746.09
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,747	1,207,911.52
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	130,561	6,009,722.83
RLJ LODGING TRUST	86,118	783,673.80
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,798	3,910,931.50
SABRA HEALTH CARE REIT INC	140,484	2,624,241.12
SAFEHOLD INC	27,407	674,212.20
SAUL CENTERS INC	6,846	278,289.90
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	312,261.83
SIMON PROPERTY GROUP	182,098	32,216,778.16

	SITE CENTERS CORP	27,882	467,859.96	
	SL GREEN REALTY CORP	38,851	3,060,293.27	
	STAG INDUSTRIAL INC	108,775	4,192,188.50	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	442,367.52	
	SUN COMMUNITIES INC	69,762	9,500,886.78	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	114,627	1,178,365.56	
	TANGER INC	65,707	2,280,032.90	
	TERRENO REALTY CORP	57,912	3,732,428.40	
	UDR INC	178,761	8,003,129.97	
	UMH PROPERTIES INC	38,966	738,795.36	
	UNITI GROUP INC	142,514	800,928.68	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	329,155.54	
	URBAN EDGE PROPERTIES	70,777	1,575,496.02	
	VENTAS INC	245,683	16,104,520.65	
	VERIS RESIDENTIAL INC	47,792	844,006.72	
	VICI PROPERTIES INC	622,457	20,659,347.83	
	VORNADO REALTY TRUST	99,051	4,296,832.38	
	WELLTOWER INC	343,754	45,458,028.96	
	WHITESTONE REIT	25,954	376,073.46	
	WP CAREY INC	130,336	7,821,463.36	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,969	827,781.51	
	アメリカドル 小計	15,650,097	730,166,941.98 (109,108,846,140)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	775,810.61	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	250,222.50	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,841	1,201,230.54	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	49,417	2,512,360.28	
	CHOICE PROPERTIES REIT	98,063	1,436,622.95	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	411,677.73	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	437,579.40	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	82,960	1,138,211.20	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	60,959.96	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,799	1,052,519.79	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,753	1,443,418.41	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	852,166.69	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	521,387.14	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	710,784.43	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	173,826.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,956	244,609.28	

	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	139,010.20	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	312,021.60	
	PRIMARIS REIT	30,375	480,836.25	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,268	1,767,506.40	
	SLATE GROCERY REIT	16,578	234,578.70	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	43,580	1,137,002.20	
	カナダドル 小計	880,802	17,294,342.26 (1,871,420,775)	
ユーロ	AEDIFICA	28,671	1,806,273.00	
	ALTAREA	2,775	275,835.00	
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	302,108.40	
	CARMILA	32,392	605,082.56	
	COFINIMMO	22,512	1,428,386.40	
	COVIVIO(FP)	32,109	1,753,151.40	
	CROMWELL REIT EUR	170,400	274,344.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	624,505.00	
	GECINA SA	31,111	3,266,655.00	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	243,090.00	
	ICADE	17,487	434,726.82	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	84,137.10	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	205,464	1,242,029.88	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	363,595	311,600.91	
	KLEPIERRE	131,702	3,980,034.44	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	22,979	189,346.96	
	MERCIALYS	53,414	637,763.16	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	236,880	2,593,836.00	
	MONTEA NV	12,266	877,019.00	
	NSI NV	11,864	240,839.20	
	RETAIL ESTATES	6,645	431,260.50	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	743,193.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	59,784	4,696,631.04	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	106,191	2,372,306.94	
	WERELDHAVE NV	22,533	337,093.68	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	18,383	606,639.00	
	ユーロ 小計	1,726,319	30,357,888.89 (4,928,906,840)	
イギリスポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	142,413.43	
	AEW UK REIT PLC	68,000	63,784.00	
	ASSURA PLC	1,814,839	746,261.79	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	360,615.20	
	BIG YELLOW GROUP PLC	118,103	1,466,839.26	

	BRITISH LAND CO PLC	591,977	2,559,708.54
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	74,350.18
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	190,232.11
	DERWENT LONDON PLC	67,447	1,540,489.48
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	303,597.86
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	233,105	790,225.95
	HAMMERSON PLC	254,457	798,994.98
	HELICAL PLC	65,400	135,378.00
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	213,944.71
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	444,935	2,876,504.77
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	69,005.82
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,221,233	2,501,085.18
	NEWRIVER REIT PL	196,000	158,172.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	251,256.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	812,946	805,223.01
	PRS REIT PLC/THE	340,013	355,653.59
	REGIONAL REIT LTD	91,200	115,459.20
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	131,866	1,165,036.11
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	345,000	174,570.00
	SEGR0 PLC	804,437	6,723,484.44
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,172,248	1,711,482.08
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	668,864	486,264.12
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347,000	310,218.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	128,070.18
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,484,144	2,325,653.64
	UNITE GROUP PLC	248,532	2,317,560.90
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	261,651	318,167.61
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	210,520.26
	WORKSPACE GROUP PLC	75,057	455,595.99
	イギリスbond 小計	15,202,111	32,997,485.18 (6,433,189,710)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	224,474	283,959.61
	ABACUS STORAGE KING	347,779	448,634.91
	ARENA REIT	230,160	952,862.40
	BWP TRUST	309,156	1,109,870.04
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	961,772.02
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	1,010,658.99
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	253,891.60
	CHARTER HALL GROUP	283,470	4,546,858.80
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	406,059	1,656,720.72

	CHARTER HALL RETAIL REIT	307,930	1,083,913.60	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	586,273.86	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	294,553.60	
	DEXUS	644,157	4,837,619.07	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	309,620.00	
	GOODMAN GROUP	1,038,280	37,959,516.80	
	GPT GROUP	1,145,526	5,750,540.52	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	377,563.20	
	HEALTHCO REIT	300,321	355,880.38	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	985,745	1,242,038.70	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	382,066.32	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	207,805	1,028,634.75	
	MIRVAC GROUP	2,361,833	5,148,795.94	
	NATIONAL STORAGE REIT	831,282	2,094,830.64	
	REGION RE GROUP	676,974	1,550,270.46	
	RURAL FUNDS GROUP	222,079	430,833.26	
	SCENTRE GROUP	3,094,291	11,170,390.51	
	STOCKLAND	1,424,840	7,594,397.20	
	VICINITY CENTERS	2,315,843	5,210,646.75	
	WAYPOINT REIT LTD	398,821	1,040,922.81	
	オーストラリアドル 小計	20,003,620	99,674,537.46 (9,986,391,908)	
ニュージ ランドドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	630,524	1,349,321.36	
	ニュージ ランドドル 小計	630,524	1,349,321.36 (122,491,393)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	2,182,290.00	
	FORTUNE REIT	875,000	3,753,750.00	
	LINK REIT	1,529,600	58,507,200.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,110,780.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,398,126.20	
	香港ドル 小計	5,439,260	66,952,146.20 (1,287,489,771)	
シンガポ ールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	490,071.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,104,718	5,914,257.58	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,530,877	1,461,987.53	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	514,576.80	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	3,231,596	6,850,983.52	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	389,942.00	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-LOGOS REIT	3,505,364	1,016,555.56	

	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	345,600.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	715,662	1,646,022.60	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,773,996	2,004,615.48	
	KEPPEL DC REIT	815,803	1,835,556.75	
	KEPPEL REIT	1,450,200	1,363,188.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	917,650	550,590.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,245,863	3,077,281.61	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,030,385	2,883,146.70	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,400,673	2,016,969.12	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250,000	393,750.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	233,000	929,670.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	295,800	211,497.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	863,000	457,390.00	
	SUNTEC REIT	1,328,400	1,700,352.00	
	シンガポールドル 小計	26,834,008	36,100,707.85 (4,116,563,716)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	86,720	436,201,600.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	31,000	161,200,000.00	
	JR REIT XXVII	134,877	447,117,255.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	27,961	135,471,045.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	262,377,600.00	
	LOTTE REIT CO LTD-RIGHTS	13,722	1,413,366.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	46,380	277,352,400.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS	16,537	1,157,590.00	
	SK REITS CO LTD	75,914	375,394,730.00	
	韓国ウォン 小計	505,591	2,097,685,586.00 (229,067,265)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	651,600.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,615,635.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	155,000	1,176,295.00	
	イスラエルシェケル 小計	618,500	3,443,530.00 (138,467,440)	
	合計	87,490,832	138,222,834,958 (138,222,834,958)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 141銘柄	100.0%	78.9%



カナダドル	投資証券	22銘柄	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券	26銘柄	100.0%	3.6%
イギリスポンド	投資証券	36銘柄	100.0%	4.7%
オーストラリアドル	投資証券	29銘柄	100.0%	7.2%
ニュージーランドドル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券	5銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券	22銘柄	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券	9銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年10月21日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	8,422,466
コール・ローン	464,272
投資証券	549,663,992
派生商品評価勘定	576
未収配当金	1,809,761
未収利息	2
流動資産合計	560,361,069
資産合計	560,361,069
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	1,326,548
流動負債合計	1,326,548
負債合計	1,326,548
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	601,420,692
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	42,386,171
元本等合計	559,034,521
純資産合計	559,034,521
負債純資産合計	560,361,069

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年10月21日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2024年10月21日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2024年10月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	601,420,692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 42,386,171円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9295円 (1万口当たり純資産額) (9,295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10月21日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</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10月21日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

	2024年10月21日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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10月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 4月23日
期首元本額	619,682,840円
期中追加設定元本額	32,064,653円
期中一部解約元本額	50,326,801円
期末元本額	601,420,692円
期末元本額の内訳	
SMT インデックスバランス・オープン	209,265,841円
SMT 新興国REITインデックス・オープン	392,154,851円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2024年10月21日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		71,041,290
合計		71,041,290

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

(2024年10月21日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,357,120	-	1,356,544	576
	南アフリカランド	1,357,120	-	1,356,544	576
合計		1,357,120	-	1,356,544	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はありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	268,600	6,250,322.00		
		MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	73,341	2,382,849.09		
		PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	15,700	602,723.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	90,213	6,148,015.95		
	メキシコペソ 小計			447,854	15,383,910.04 (115,623,929)	
	トルコリラ	AKFEN GAYRIMENKUL YATIRIM OR	179,000	329,360.00		
		AKIS GAYRIMENKUL YATIRIMI AS	117,000	685,620.00		
		AVRUPAKENT GAYRIMENKUL YATIR	8,870	388,683.40		
		EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	183,602	1,791,955.52		
		IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	45,871	714,211.47		
		KIZILBUK GAYRIMENKUL YATIRIM	9,000	269,820.00		
		OZAK GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	34,000	313,480.00		
		PASIFIK GAYRIMENKUL YATIRIM	205,780	255,167.20		
		REYSAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	52,000	572,000.00		
		ROENESANS GAYRIMENKUL YATIRI	3,900	401,700.00		
		SERVET GAYRIMENKUL YATIRIM O	1,370	385,655.00		
		SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	76,700	569,114.00		
		TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	13,720	628,376.00		
		YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	19,198	1,066,448.90		
	ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	86,420	864,200.00			
トルコリラ 小計			1,036,431	9,235,791.49 (40,399,199)		
香港ドル	SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	50,000	154,500.00			
香港ドル 小計			50,000	154,500.00 (2,971,035)		
マレーシア リンギット	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	133,500	240,300.00			
	CAPITALAND MALAYSIA TRUST	155,000	107,725.00			
	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	133,800	290,346.00			
	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	107,700	159,396.00			
	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	192,800	345,112.00			

	YTL HOSPITALITY REIT	75,000	88,500.00	
マレーシアリングット 小計		797,800	1,231,379.00 (42,721,955)	
タイパーツ	BA AIRPORT LEASEHOLD REIT	78,300	775,170.00	
	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	222,800	2,807,280.00	
	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	158,700	1,729,830.00	
	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	60,200	734,440.00	
	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	142,600	1,967,880.00	
	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	160,800	1,704,480.00	
タイパーツ 小計		823,400	9,719,080.00 (43,833,050)	
フィリピン ペソ	AREIT INC	90,320	3,522,480.00	
	CITICORE ENERGY REIT CORP	250,000	765,000.00	
	MREIT INC	108,000	1,501,200.00	
	RL COMMERCIAL REIT INC	412,700	2,480,327.00	
フィリピンペソ 小計		861,020	8,269,007.00 (21,485,360)	
インドル ピー	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	27,651	8,071,879.92	
	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	83,399	32,598,167.13	
	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	20,922	7,745,324.40	
	NEXUS SELECT TRUST	82,910	11,952,305.60	
インドルピー 小計		214,882	60,367,677.05 (108,058,141)	
南アフリカ ランド	ATTACQ LTD	67,086	872,118.00	
	BURSTONE GROUP LIMITED	58,843	563,127.51	
	EQUITES PROPERTY FUND LTD	77,297	1,140,130.75	
	FAIRVEST LTD-B	129,040	606,488.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	329,583	4,373,566.41	
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	35,975	1,519,584.00	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	674,187	3,337,225.65	
	RESILIENT REIT LTD	27,942	1,569,502.14	
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	250,024	702,567.44	
	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	41,727	622,984.11	
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	97,185	1,812,500.25	
南アフリカランド 小計		1,788,889	17,119,794.26 (145,175,855)	
サウジアラ ビアリアル	AL MAATHER REIT FUND	5,245	46,890.30	
	AL RAJHI REIT	21,814	185,419.00	
	ALAHLI REIT FUND 1	4,800	35,040.00	
	ALINMA RETAIL REIT FUND	7,174	35,152.60	
	ALKHABEER REIT	8,225	50,008.00	
	BONYAN REIT	6,340	57,884.20	
	DERAYAH REIT	10,061	62,277.59	

	MULKIA GULF REAL ESTATE REIT	7,100	39,263.00	
	MUSHARAKA REIT FUND	6,364	32,456.40	
	RIYAD REIT FUND	11,566	76,335.60	
	SEDCO CAPITAL REIT FUND	14,489	116,926.23	
	サウジアラビアリアル 小計	103,178	737,652.92 (29,395,468)	
	合計	6,123,454	549,663,992 (549,663,992)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	投資証券 4銘柄	100.0%	21.0%
トルコリラ	投資証券 15銘柄	100.0%	7.3%
香港ドル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	投資証券 6銘柄	100.0%	7.8%
タイバーツ	投資証券 6銘柄	100.0%	8.0%
フィリピンペソ	投資証券 4銘柄	100.0%	3.9%
インドルピー	投資証券 4銘柄	100.0%	19.7%
南アフリカランド	投資証券 11銘柄	100.0%	26.4%
サウジアラビアリアル	投資証券 11銘柄	100.0%	5.3%

(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。

## 2【ファンドの現況】

## 【SMT インデックスバランス・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2024年11月29日現在)

資産総額	2,868,235,819円
負債総額	8,659,387円
純資産総額( - )	2,859,576,432円
発行済口数	1,651,757,665口
1口当たり純資産額( / )	1.7312円
(1万口当たり純資産額)	(17,312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11月29日現在)

資産総額	712,490,342,364円
負債総額	13,732,517,142円
純資産総額( - )	698,757,825,222円
発行済口数	248,249,603,332口
1口当たり純資産額( / )	2.8147円
(1万口当たり純資産額)	(28,147円)

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2024年11月29日現在)

資産総額	759,141,455,051円
負債総額	50,769,462,520円
純資産総額( - )	708,371,992,531円
発行済口数	543,152,783,629口
1口当たり純資産額( / )	1.3042円
(1万口当たり純資産額)	(13,042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11月29日現在)

資産総額	836,982,299,578円
負債総額	1,782,960,097円
純資産総額( - )	835,199,339,481円
発行済口数	117,940,956,832口

1口当たり純資産額（ / ）	7.0815円
（1万口当たり純資産額）	（70,815円）

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年11月29日現在）

資産総額	372,541,353,804円
負債総額	159,261,017円
純資産総額（ - ）	372,382,092,787円
発行済口数	103,400,040,239口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6014円
（1万口当たり純資産額）	（36,014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11月29日現在）

資産総額	219,295,364,977円
負債総額	383,660,053円
純資産総額（ - ）	218,911,704,924円
発行済口数	48,346,920,660口
1口当たり純資産額（ / ）	4.5279円
（1万口当たり純資産額）	（45,279円）

## 新興国債券インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年11月29日現在）

資産総額	153,460,895,957円
負債総額	46,489,972円
純資産総額（ - ）	153,414,405,985円
発行済口数	67,204,574,047口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2828円
（1万口当たり純資産額）	（22,828円）

## J - R E I Tインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年11月29日現在）

資産総額	95,901,876,740円
負債総額	497,627,878円
純資産総額（ - ）	95,404,248,862円
発行済口数	47,475,543,274口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0095円



（1万口当たり純資産額）	（20,095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11月29日現在）

資産総額	141,397,835,848円
負債総額	246,531,750円
純資産総額（ - ）	141,151,304,098円
発行済口数	42,247,495,774口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3411円
（1万口当たり純資産額）	（33,411円）

## 新興国REITインデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

（2024年11月29日現在）

資産総額	541,205,549円
負債総額	1,136,308円
純資産総額（ - ）	540,069,241円
発行済口数	593,675,262口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9097円
（1万口当たり純資産額）	（9,097円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

## 受益権の譲渡

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

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

載又は記録が行われるよう通知するものとします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【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11月29日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。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2025年 1月21日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年11月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	532	15,942,848
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	58	202,419
単体型公社債投資信託	52	172,709
合計	642	16,317,975

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第38期事業年度（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。  
また、第39期事業年度の中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (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

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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

当事業年度

(自 2022年4月1日  
至 2023年3月31日)(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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。  
これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリ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		



	58	百万円	63	百万円
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				
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳  
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報  
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報  
単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益  
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産  
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等  
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2024年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭

1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭
--------------	---------------	---------------

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。  
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268

## 固定資産

有形固定資産	1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047

## 投資その他の資産

投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850

## 固定資産合計

固定資産合計		21,491
--------	--	--------

## 資産合計

80,759

## 負債の部

## 流動負債

未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	2	2,306
流動負債合計		12,364

## 固定負債

退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154

その他	53
固定負債合計	1,244
負債合計	13,608

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	45,816
利益剰余金合計	48,416
株主資本合計	67,655
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	453
繰延ヘッジ損益	958
評価・換算差額等合計	504
純資産合計	67,150
負債・純資産合計	80,759

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第39期中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169
営業費用		18,985
一般管理費	1	7,504
営業利益		4,678
営業外収益	2	193
営業外費用	3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		129
法人税等調整額		22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

## 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	157	157	157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	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	360	1,071	710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	958	504	67,150

## 注記事項

（重要な会計方針）

第39期中間会計期間  
（自 2024年4月1日  
至 2024年9月30日）

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

## (2) デリバティブ

時価法によっております。

- (3) 金銭の信託  
時価法によっております。
2. 固定資産の減価償却の方法
- (1) 有形固定資産  
定額法によっております。
- (2) 無形固定資産  
定額法によっております。  
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。
3. 引当金の計上基準
- (1) 賞与引当金  
従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。
- (2) 退職給付引当金  
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。
- 過去勤務費用：発生事業年度に損益処理  
数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理
- なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。
4. 収益及び費用の計上基準  
当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
- (1) 投資信託委託業務  
当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (2) 投資一任業務  
当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (3) 投資助言業務  
当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (4) 成功報酬  
当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準  
外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. ヘッジ会計の方法
- (1) ヘッジ会計の方法  
繰延ヘッジ処理によっております。
- (2) ヘッジ手段とヘッジ対象  
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
- (3) ヘッジ方針  
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
- (4) ヘッジ有効性評価の方法  
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。
7. グループ通算制度の適用  
グループ通算制度を適用しております。

## (中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末 (2024年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,128百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 83百万円
	無形固定資産 1,211百万円

2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益	149百万円
3	営業外費用の主要項目 金銭の信託運用損 投資有価証券償還損 為替差損 デリバティブ費用	263百万円 239百万円 146百万円 138百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）  
第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項  
該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

（リース取引関係）  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）  
第39期中間会計期間末（2024年9月30日）  
金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（1）時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	2,561	15,657	-	18,219
投資有価証券(*2) その他有価証券	-	3,269	-	3,269
資産計	2,561	18,927	-	21,488
デリバティブ取引(*3) 株式関連取引 通貨関連取引 デリバティブ取引計	(281) - (281)	(230) (286) (517)	- - -	(511) (286) (798)

(\*1)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(\*2)投資有価証券のうち、非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,991百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は上記に含めておりません。

(\*3)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

## 投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

## デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

## (注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	876
関係会社株式	6,077

## (注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

## (有価証券関係)

第39期中間会計期間末（2024年9月30日）

## 1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	6,077

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,249	2,306	57
小計	2,249	2,306	57
合計	5,260	4,613	647

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引



## (1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,053	-	83	83
	英ポンド	173	-	5	5
	カナダドル	130	-	2	2
	スイスフラン	74	-	1	1
	香港ドル	120	-	1	1
	ユーロ	461	-	9	9
	買建				
	米ドル	42	-	0	0
	ユーロ	11	-	0	0
合計		6,068	-	104	104

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## (2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,399	-	281	281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	-	230	230
合計		15,923	-	511	511

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,833	-	30
	英ポンド		4,463	-	137
	スイスフラン		49	-	0
	香港ドル		95	-	1
	ユーロ		31	-	0
	シンガポールドル		433	-	11
	合計			6,906	-

(資産除去債務関係)  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

- 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。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報  
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。
- 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)  
当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

- 製品及びサービスごとの情報  
単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
- 地域ごとの情報  
(1)営業収益  
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略してお

ります。

(2)有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,620百万円

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）  
該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）  
該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）  
該当事項はありません。

( 1株当たり情報 )

第39期中間会計期間 ( 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日 )	
1株当たり純資産額	22,383,579円15銭
1株当たり中間純利益	928,397円37銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第39期中間会計期間 ( 自 2024年4月1日 至 2024年9月30日 )	
中間純利益	2,785百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,785百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の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

2025年1月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（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。
マネックス証券株式会社	13,195	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	54,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
立花証券株式会社	6,695	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	38,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社荘内銀行	8,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	135,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
G M O クリック証券株式会社	4,346	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（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みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

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12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 百瀬和政

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT インデックスバランス・オープンの2024年4月23日から2024年10月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT インデックスバランス・オープンの2024年10月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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



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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

田 中 洋 一

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間

財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。