

【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2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】	10資産分散投資ファンド
【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】

10資産分散投資ファンド

（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】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2025年 2月22日から2025年 8月26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

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。

（ 1 0 ）【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。

（ 1 1 ）【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

（ 1 2 ）【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 >

当ファンドは「分配金再投資コース」（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）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号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。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

< 受付不可日 >

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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

- (1) インデックス型... 目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

- (4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

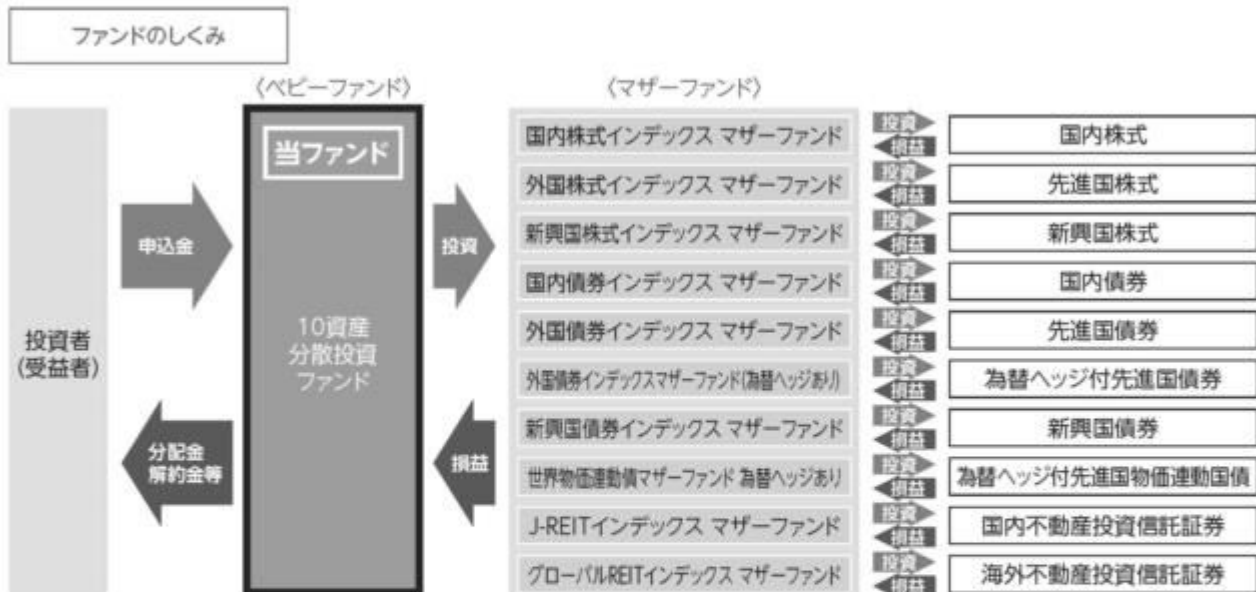
ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

1.

国内、先進国、新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券*並びに国内及び海外の不動産投資信託証券(REIT)に投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

*先進国債券には、為替ヘッジ付債券及び為替ヘッジ付物価連動国債を含みます。



? 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。

? 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ベビーファンドとし、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。

●各資産毎に、以下のマザーファンドを投資対象ファンドとします。

資産	マザーファンド	インデックス
国内株式	国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX(東証株価指数)(配当 込み) ¹
先進国株式	外国株式インデックス マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース) ²
新興国株式	新興国株式インデックス マザーファンド	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) ³
国内債券	国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI総合 ⁴
先進国債券	外国債券インデックス マザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) ⁵
為替ヘッジ付先進国債券	外国債券インデックス マザーファンド(為替ヘッジあ り)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベ ース) ⁶
新興国債券	新興国債券インデックス マザーファンド	JPモルガン・ガバメント・ボン ド・インデックス・エマージ ング・マーケット・グローバル ディバーシファイド(円換算ベ ース) ⁷

為替ヘッジ付 先進国物価連動国債	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	ブルームバーグ世界インフレ連動 国債インデックス（除く日本、円 ヘッジベース） ⁸
国内不動産投資信託証券	J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数（配当込み） ⁹
海外不動産投資信託証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数 （除く日本、配当込み、円ベ ース） ¹⁰

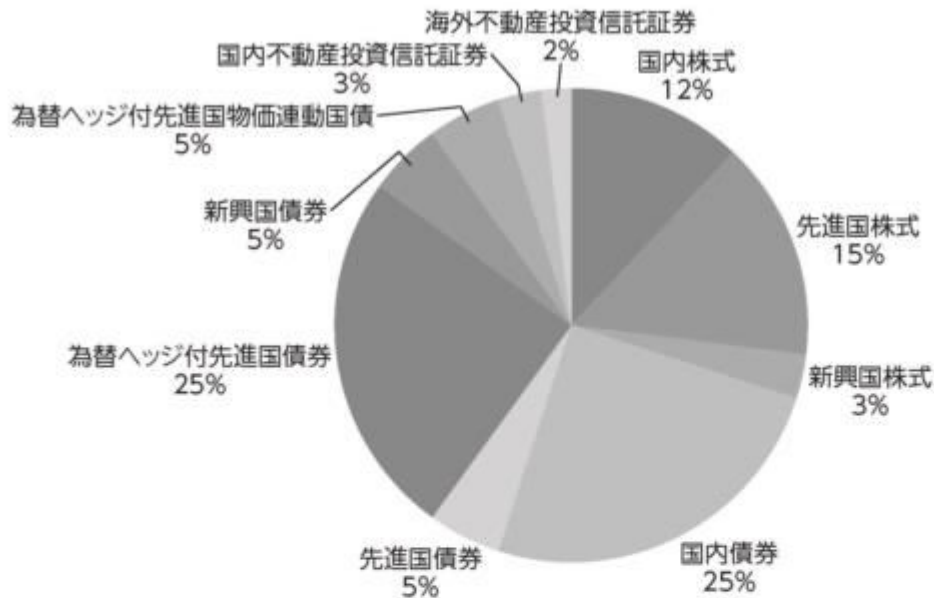
* 1:各マザーファンドは、上記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

* 2: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を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標準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 「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。「円ヘッジ・円ベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。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。
- ※7 「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・ディパーシファイド」とは、新興国の現地通貨建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。
- ※8 「ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行うインデックスであり、世界の物価連動国債市場のパフォーマンスを表します。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して算出した指数です。Bloomberg®及びブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
- ※9 「東証REIT指数」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準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。
- ※10 「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®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任を負いません。

- 投資対象ファンドにおいて組入れ継続困難な事象等が発生した場合には、委託会社の判断により投資対象ファンドの見直しを行う場合があります。この際、投資対象ファンドとして定められていたマザーファンドが投資対象ファンドから除外されることや、新たなマザーファンドが投資対象ファンドとして定められることがあります。また、この際に先進国資産を投資対象とするマザーファンドには国内資産が含まれる場合があります。
- 為替ヘッジ付先進国債券部分及び為替ヘッジ付先進国物価連動国債部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

2. 基本配分比率は以下の通りです。



- 基本配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、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。

分配方針

- 原則として毎年5月24日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
 - 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。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

- 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- 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。

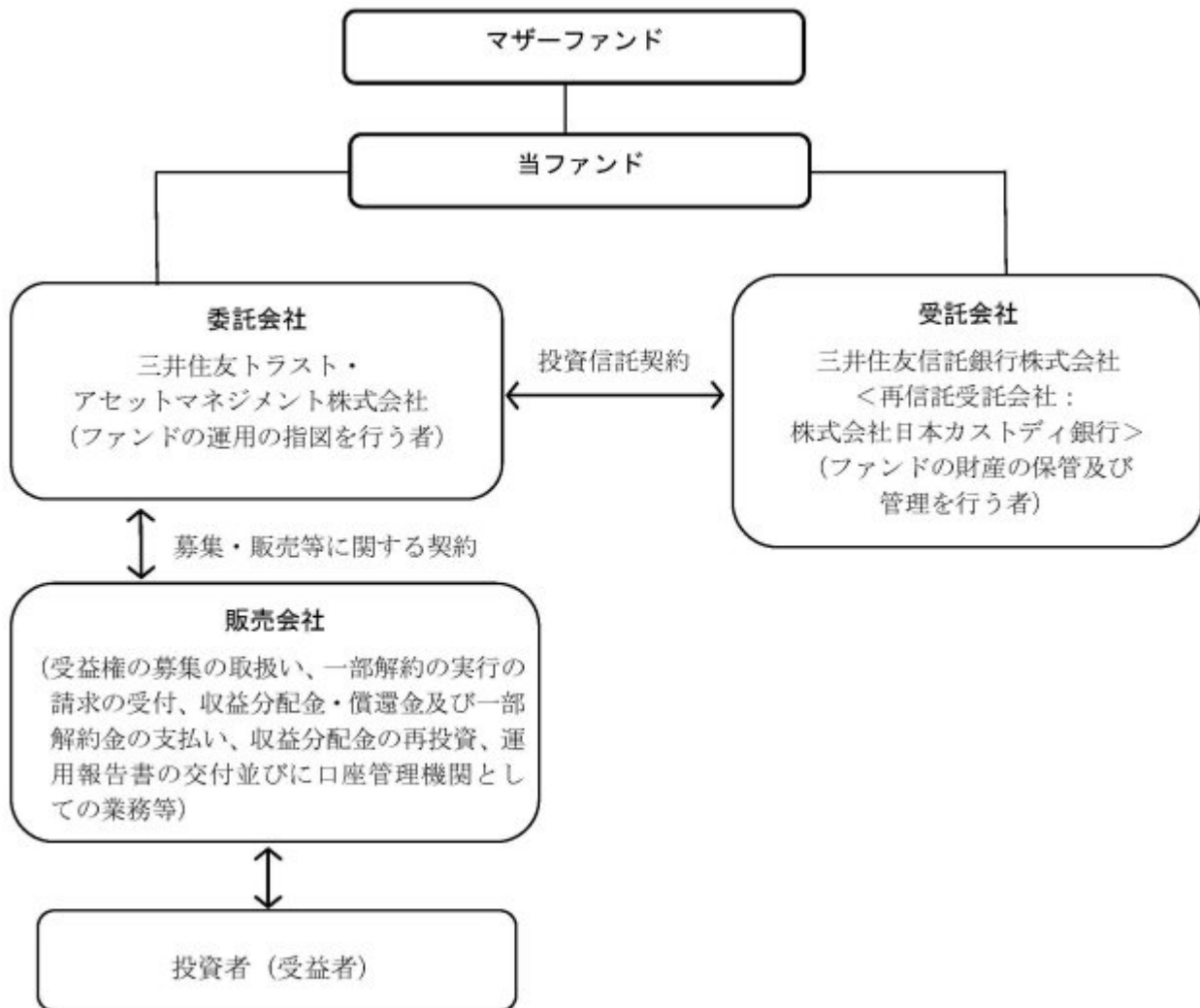
(2) 【ファンドの沿革】

2022年 6月30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12月30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、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

投資対象

別に定めるマザーファンド（ ）（以下「投資対象ファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．投資対象ファンドへの投資を通じて、主として国内株式、先進国株式、新興国株式（DR（預託証券）を含みます。）、国内債券、先進国債券、為替ヘッジ付先進国債券、新興国債券、為替ヘッジ付先進国物価連動国債、国内不動産投資信託証券、海外不動産投資信託証券に投資します。

ロ．各資産の基本配分比率は以下の通りとします。また、基本配分比率には一定の変動許容幅を設けます。

資産	基本配分比率
国内株式	12%
先進国株式	15%
新興国株式	3%
国内債券	25%
先進国債券	5%
為替ヘッジ付先進国債券	25%
新興国債券	5%
為替ヘッジ付先進国物価連動国債	5%
国内不動産投資信託証券	3%
海外不動産投資信託証券	2%

ハ．投資対象ファンドにおいて組入れ継続困難な事象等が発生した場合には、委託会社の判断により投資対象ファンドの見直しを行う場合があります。この際、投資対象ファンドとして定められていたマザーファンドが投資対象ファンドから除外されることや、新たなマザーファンドが投資対象ファンドとして定められることがあります。また、この際に先進国資産を投資対象とするマザーファンドには国内資産が含まれる場合があります。

ニ．為替ヘッジ付先進国債券部分及び為替ヘッジ付先進国物価連動国債部分を除き、実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

上記の別に定めるマザーファンドは以下の通りです。

後記（2）の別に定める親投資信託も同様です。

資産	マザーファンド
国内株式	国内株式インデックス マザーファンド
先進国株式	外国株式インデックス マザーファンド
新興国株式	新興国株式インデックス マザーファンド
国内債券	国内債券インデックス マザーファンド

先進国債券	外国債券インデックス マザーファンド
為替ヘッジ付 先進国債券	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）
新興国債券	新興国債券インデックス マザーファンド
為替ヘッジ付 先進国物価連動国債	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり
国内不動産投資信託証券	J-REITインデックス マザーファンド
海外不動産投資信託証券	グローバルREITインデックス マザーファンド

（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せん。）
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別に定める親投資信託（以下総称して「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券に投資するほか、次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 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、新投資口予約権証券、投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券（「新投資口予約権証券」、「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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2

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

(2)投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、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、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、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・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポ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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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、並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

超えることとなる投資の指図をしません。

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

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

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

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

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、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、円ヘッジ・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、円ヘッジ・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。

公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。

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

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

(3)運用制限

株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1)投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

3. 運用制限

株式への投資は行いません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として日本を除く世界のインフレ連動国債（物価連動国債）に投資し、ブルームバーグ世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ヘッジベース）に連動する投資成果を目指します。

インフレ連動国債（物価連動国債）への投資割合は、原則として高位を維持します。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

運用の効率化を図るため、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。

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

(3)運用制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

「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、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投資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（以下当マザーファンドにおいて「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。

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

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並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券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。

投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうち不動産投信指数を対象とする先物取引並びに外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「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。

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。

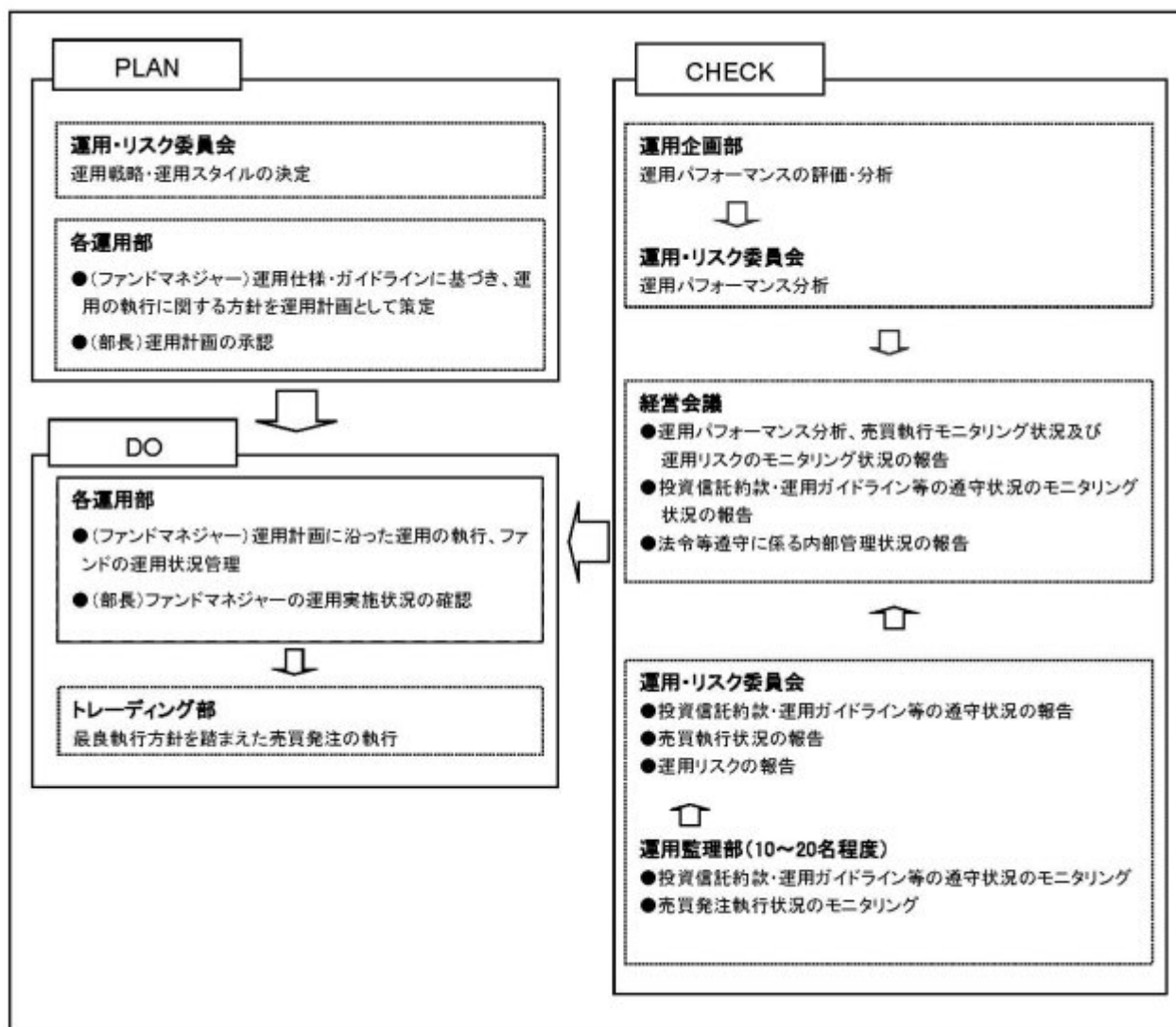
一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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。

(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】

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・ 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。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

ロ．投資信託証券への投資割合

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

ハ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ．投資する株式等の範囲

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

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

ホ．信用取引の指図範囲

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

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

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品

取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。）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効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、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効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、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効率的な運用に資するため、並びに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（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当たっては、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当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに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、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当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

（ニ）委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次のa.及びb.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

b.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

（ロ）上記（イ）a.及びb.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

（ハ）委託会社は、有価証券の貸付に当たって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うも

のとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

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

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、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にする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。

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て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を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てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

リート of 価格変動リスク

リート of 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 of 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。

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

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。

物価変動リスク

物価の下落はインフレ連動国債（物価連動国債）の元本や利金を減少させるため、インフレ連動国債（物価連動国債）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。

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性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

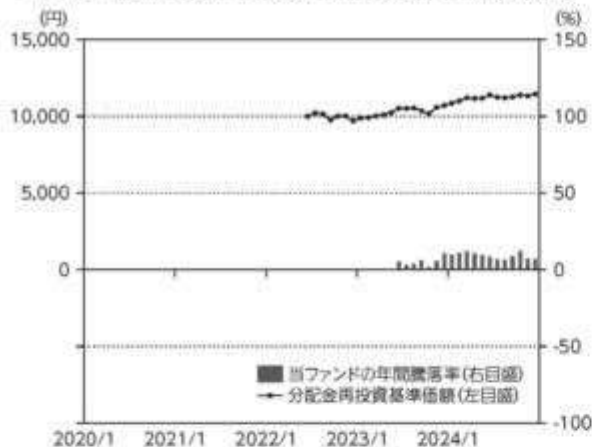
(2) リスクの管理体制

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】

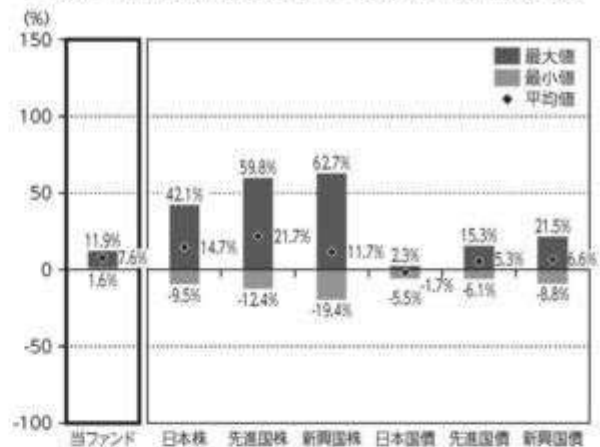
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*当ファンドについては2023年6月～2024年12月の1年7ヶ月間、他の代表的な資産クラスについては2020年1月～2024年12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。

*当ファンドの年間騰落率は、設定後のデータのみで算出しています。従って、当該ファンドの年間騰落率と他の代表的な資産クラスの指数の年間騰落率を同じ図に表示すると、誤認につながる懸念があるため、別の図に表示しています。

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範囲するとともに、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株価指数です。同指数の指数値及び指数値に係る権利又は権限は、株式会社JPX(以下「JPX」という)の知的財産であり、指数の算出・指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は権限に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動向を表す株価指数で、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向を表す株価指数で、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、野村フィナンシャル・リサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指標で、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ナンシャル・リサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィナンシャル・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会社の事業活動・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により開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、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 J.P. Morganグローバル・エマージング・マーケット・グローバル・デベロップメント・インデックス	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有する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 0.176%（税抜 0.16%）（ ）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 0.088% （税抜 0.08%）	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 0.055% （税抜 0.05%）	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 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「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。

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 2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、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（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。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関及び国民年金基金連合会である場合は、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。なお、確定拠出年金制度の加入者等については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記は、2024年12月30日現在のものでありますので、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⁾
0.21%	0.17%	0.04%

※対象期間は2023年5月25日～2024年5月24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12月30日現在の状況について記載してあります。

【10 資産分散投資ファンド】

（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	2,604,264,290	99.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,194,205	0.88
合計(純資産総額)		2,627,458,495	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	国内債券インデックス マザーファンド	490,099,644	1.3037	638,942,906	1.3028	638,501,816	24.30
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（為替ヘッジあり）	764,776,328	0.8164	624,363,395	0.8147	623,063,274	23.71
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	57,932,621	6.6306	384,128,037	7.3645	426,644,787	16.24
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	113,760,161	2.8462	323,784,171	2.9280	333,089,751	12.68
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	57,942,021	2.3574	136,592,521	2.3680	137,206,705	5.22
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	35,937,788	3.6413	130,860,268	3.7140	133,472,944	5.08
日本	親投資信託受益証券	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	119,303,385	0.8847	105,547,705	0.8572	102,266,861	3.89
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	18,023,778	4.7035	84,774,840	4.7725	86,018,480	3.27
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	33,342,169	2.0703	69,028,293	2.0101	67,021,093	2.55
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	17,673,805	2.9365	51,899,129	3.2239	56,978,579	2.17

(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、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	99.12
合計	99.12

(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 (2023年 5月24日)	1,640,336,672	1,640,336,672	10,203	10,203
第2期計算期間末 (2024年 5月24日)	2,545,332,525	2,545,332,525	11,221	11,221
2023年12月末日	1,797,573,835		10,710	
2024年 1月末日	1,811,755,419		10,857	
2月末日	2,470,219,816		11,007	
3月末日	2,540,428,854		11,206	
4月末日	2,526,035,747		11,162	
5月末日	2,546,782,665		11,173	
6月末日	2,604,691,110		11,391	
7月末日	2,548,827,670		11,243	

8月末日	2,551,618,558		11,202
9月末日	2,579,057,679		11,264
10月末日	2,599,009,590		11,386
11月末日	2,604,672,661		11,333
12月末日	2,627,458,495		11,452

【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	2022年 6月30日～2023年 5月24日	0
第2期計算期間	2023年 5月25日～2024年 5月24日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	2.0
第2期計算期間	2023年 5月25日～2024年 5月24日	10.0
第3期中間計算期間	2024年 5月25日～2024年11月24日	1.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	1,628,450,903	20,709,270	1,607,741,633
第2期計算期間	2023年 5月25日～2024年 5月24日	790,951,104	130,323,608	2,268,369,129
第3期中間計算期間	2024年 5月25日～2024年11月24日	98,374,883	80,153,747	2,286,590,265

(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	723,678,262,550	99.08
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		6,742,046,170	0.92
合計（純資産総額）		730,420,308,720	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	6,381,085,000	0.87

(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	9,659,200	3,318.65	32,055,533,124	3,146.00	30,387,843,200	4.16
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,363,100	2,526.94	16,079,190,807	3,369.00	21,437,283,900	2.93
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,481,800	1,633.10	18,750,927,580	1,846.00	21,195,402,800	2.90
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,725,700	3,254.54	15,379,990,909	3,937.00	18,605,080,900	2.55
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,457,400	7,985.40	11,637,927,429	11,145.00	16,242,723,000	2.22
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,733,300	3,343.32	12,481,639,978	3,764.00	14,052,141,200	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	181,800	69,474.72	12,630,505,748	64,630.00	11,749,734,000	1.61
日本	株式	任天堂	その他製品	1,147,200	8,270.23	9,487,615,471	9,264.00	10,627,660,800	1.46
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,292,300	7,275.04	9,401,544,509	7,832.00	10,121,293,600	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,747,200	5,359.90	9,364,822,061	5,728.00	10,007,961,600	1.37
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,415,500	3,141.64	7,588,631,435	3,873.00	9,355,231,500	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	2,824,600	3,954.33	11,169,401,952	3,311.00	9,352,250,600	1.28
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	384,600	34,477.18	13,259,924,167	24,185.00	9,301,551,000	1.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,553,100	3,312.28	11,768,881,307	2,604.00	9,252,272,400	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	1,632,100	5,879.00	9,595,132,098	5,296.00	8,643,601,600	1.18
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	54,206,900	151.95	8,236,784,307	158.00	8,564,690,200	1.17
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	899,000	8,918.18	8,017,444,452	9,185.00	8,257,315,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	1,719,900	5,396.98	9,282,271,404	4,352.00	7,485,004,800	1.02
日本	株式	三菱重工業	機械	3,209,300	1,367.58	4,388,991,076	2,223.00	7,134,273,900	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	355,000	18,682.95	6,632,447,518	19,815.00	7,034,325,000	0.96
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,621,500	4,110.18	6,664,660,204	4,181.00	6,779,491,500	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,340,400	4,312.78	5,780,861,453	5,042.00	6,758,296,800	0.93
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,305,200	1,708.06	7,353,541,337	1,535.00	6,608,482,000	0.90
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	108,100	40,832.94	4,414,041,846	53,820.00	5,817,942,000	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	29,161,100	187.76	5,475,335,313	198.90	5,800,142,790	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	2,123,700	2,047.12	4,347,479,669	2,487.00	5,281,641,900	0.72
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	572,600	6,009.08	3,440,799,498	9,198.00	5,266,774,800	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,866,600	2,666.49	4,977,271,851	2,687.00	5,015,554,200	0.69
日本	株式	富士通	電気機器	1,688,700	2,286.05	3,860,467,723	2,799.50	4,727,515,650	0.65
日本	株式	キャノン	電気機器	906,300	4,502.93	4,081,013,337	5,161.00	4,677,414,300	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.24
		建設業	2.13
		食料品	3.03
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.10
		医薬品	4.29
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.65
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.49
		機械	5.50
		電気機器	17.43
		輸送用機器	7.81
		精密機器	2.38
		その他製品	2.63
		電気・ガス業	1.24
		陸運業	2.22
		海運業	0.68
		空運業	0.34
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	7.43
		卸売業	6.75
		小売業	4.56
		銀行業	8.47
		証券、商品先物取引業	0.88
		保険業	3.25
		その他金融業	1.19
		不動産業	1.77
サービス業	5.10		
	小計	99.08	
合計		99.08	

(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	229円		6,310,874,750	6,381,085,000	0.87

(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。

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	630,016,447,513	72.81
	イギリス	29,543,432,447	3.41
	カナダ	27,140,831,529	3.14
	スイス	21,831,202,011	2.52
	フランス	20,592,141,816	2.38
	ドイツ	18,919,177,438	2.19
	アイルランド	15,396,976,935	1.78
	オーストラリア	13,909,370,153	1.61
	オランダ	13,467,306,772	1.56
	スウェーデン	6,460,406,290	0.75
	デンマーク	6,016,837,076	0.70
	スペイン	5,413,833,380	0.63
	イタリア	4,535,196,358	0.52
	香港	3,031,032,550	0.35
	シンガポール	2,598,553,290	0.30
	フィンランド	2,013,610,615	0.23
	イスラエル	1,942,967,008	0.22
	ベルギー	1,531,949,123	0.18
	ルクセンブルク	1,265,851,565	0.15
	ケイマン	1,238,732,584	0.14
	ノルウェー	1,174,355,479	0.14
	ジャージー	1,171,282,533	0.14
	バミューダ	912,429,406	0.11
	リベリア	703,109,105	0.08
	キュラソー	660,235,664	0.08
	ニュージーランド	625,707,588	0.07
	オーストリア	398,111,866	0.05
パナマ	344,579,097	0.04	
ポルトガル	297,371,155	0.03	
マン島	66,869,745	0.01	
	小計	833,219,908,091	96.30
新株予約権証券	カナダ	-	-

投資信託受益証券	香港	61,308,135	0.01
	オーストラリア	59,151,308	0.01
	小計	120,459,443	0.01
投資証券	アメリカ	12,946,747,791	1.50
	オーストラリア	918,331,285	0.11
	フランス	290,690,683	0.03
	シンガポール	207,548,924	0.02
	イギリス	202,143,911	0.02
	香港	159,579,476	0.02
	ベルギー	40,550,952	0.00
	カナダ	22,718,487	0.00
	小計	14,788,311,509	1.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,126,877,180	1.98
合計(純資産総額)		865,255,556,223	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	13,108,574,325	1.51
	買建	カナダ	392,511,175	0.05
	買建	ドイツ	2,136,059,882	0.25
	買建	イギリス	1,006,265,022	0.12
	買建	オーストラリア	528,654,425	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		135,900,400	0.02

(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	30,497.77	37,122,624,291	40,429.22	49,211,424,432	5.69

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,963,841	18,062.57	35,472,023,780	21,672.24	42,560,837,009	4.92
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	565,406	68,001.58	38,448,502,473	68,101.23	38,504,847,103	4.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	756,235	28,812.20	21,788,796,522	35,392.77	26,765,255,202	3.09
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	174,791	76,226.94	13,323,783,419	94,877.94	16,583,811,024	1.92
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	230,394	28,193.09	6,495,519,593	68,279.97	15,731,297,436	1.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	469,065	27,830.18	13,054,167,697	30,490.77	14,302,156,220	1.65
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	354,961	22,504.60	7,988,257,999	38,240.01	13,573,713,964	1.57
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	402,416	28,102.25	11,308,798,577	30,693.24	12,351,453,765	1.43
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	227,781	31,692.94	7,219,050,660	38,148.27	8,689,451,226	1.00
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	128,532.46	8,334,687,445	123,881.83	8,033,117,305	0.93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	106,308	64,397.62	6,845,982,376	72,210.75	7,676,580,602	0.89
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	133,734	43,272.29	5,786,977,091	50,405.63	6,740,947,699	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	355,687	18,190.69	6,470,195,510	16,843.00	5,990,838,417	0.69
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,878	80,083.37	5,916,399,472	80,670.21	5,959,754,380	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	66,022	70,677.98	4,666,302,098	84,183.39	5,557,956,171	0.64
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,586	129,115.76	4,594,713,790	148,641.74	5,289,565,173	0.61
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	355,106	10,366.22	3,681,108,304	14,498.77	5,148,603,345	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,519	25,852.93	4,847,917,305	26,816.25	5,028,557,396	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	79,596	52,252.62	4,159,099,827	62,142.59	4,946,301,976	0.57
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,199	102,983.08	3,521,918,661	143,556.25	4,909,480,502	0.57
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	22,946.26	4,432,805,350	22,944.00	4,432,369,547	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	76,537	42,639.00	3,263,461,204	53,536.02	4,097,486,439	0.47
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	24,806.29	3,516,937,158	28,157.62	3,992,074,988	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	558,868	6,229.12	3,481,260,530	7,013.70	3,919,733,162	0.45

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	20,220.08	5,227,214,779	14,059.74	3,634,670,072	0.42
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,142	146,834.74	4,719,562,344	112,953.70	3,630,558,083	0.42
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	133,133	19,892.78	2,648,385,628	26,726.09	3,558,124,913	0.41
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	84,225	29,409.04	2,476,976,784	39,498.33	3,326,747,686	0.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	329,211	9,831.97	3,236,795,642	9,878.34	3,252,058,519	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	3.73
		素材	3.10
		資本財	6.74
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	1.42
		自動車・自動車部品	2.35
		耐久消費財・アパレル	1.15
		消費者サービス	1.96
		メディア・娯楽	6.93
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.15
		生活必需品流通・小売り	1.82
		食品・飲料・タバコ	2.70
		家庭用品・パーソナル用品	1.43
		ヘルスケア機器・サービス	3.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.60
		銀行	5.55
		金融サービス	7.14
		保険	2.95
		エクイティ不動産投資信託(REIT)	0.03
		ソフトウェア・サービス	10.09
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.22		
電気通信サービス	1.09		
公益事業	2.48		
半導体・半導体製造装置	9.24		
不動産管理・開発	0.27		
		小計	96.30
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.01

投資証券		1.71
合計		98.02

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	275	アメリカドル	84,501,062.5	13,366,378,066	82,871,250	13,108,574,325	1.51
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	12	カナダドル	3,633,542	398,853,905	3,575,760	392,511,175	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	33	スイスフラン	3,866,021	677,906,782	3,818,100	669,503,835	0.08
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	181	ユーロ	8,998,534.2	1,484,038,260	8,892,530	1,466,556,047	0.17
	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	5,413,707	533,250,140	5,367,050	528,654,425	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	62	イギリスポンド	5,105,397.5	1,016,076,210	5,056,100	1,006,265,022	0.12

(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	860,000.00	135,865,000	135,900,400	0.02

(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	43,790,933,028	18.90
	台湾	43,713,882,769	18.87
	ケイマン	36,645,929,885	15.82
	中国	24,248,690,804	10.47
	韓国	20,220,716,014	8.73
	サウジアラビア	9,188,898,149	3.97
	ブラジル	7,828,385,644	3.38
	南アフリカ	6,145,029,979	2.65

	メキシコ	3,685,592,602	1.59
	マレーシア	3,403,961,121	1.47
	インドネシア	3,296,292,813	1.42
	タイ	3,213,781,287	1.39
	アラブ首長国連邦	3,038,577,165	1.31
	香港	1,964,475,628	0.85
	カタール	1,842,167,939	0.80
	ポーランド	1,776,991,906	0.77
	クウェート	1,670,910,677	0.72
	トルコ	1,526,010,801	0.66
	フィリピン	1,189,138,826	0.51
	ギリシャ	1,063,181,461	0.46
	チリ	943,976,878	0.41
	バミューダ	839,645,657	0.36
	アメリカ	753,486,349	0.33
	ハンガリー	576,080,265	0.25
	ルクセンブルク	357,222,241	0.15
	イギリス	327,593,699	0.14
	チェコ	310,810,024	0.13
	コロンビア	225,747,058	0.10
	エジプト	117,507,113	0.05
	シンガポール	84,759,605	0.04
	ペルー	71,617,862	0.03
	ロシア	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	224,061,995,249	96.73
投資信託受益証券	ブラジル	302,207,318	0.13
	メキシコ	120,809,376	0.05
	小計	423,016,694	0.18
投資証券	メキシコ	198,802,180	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,958,114,330	3.00
合計(純資産総額)		231,641,928,453	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	7,522,447,625	3.25

(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		645,173,492	0.28
	売建		6,771,035	0.00

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	4,533,389	5,245.03	23,777,794,296	5,252.92	23,813,566,013	10.28
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,194,800	8,564.76	10,233,183,807	8,506.61	10,163,700,018	4.39
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	6,135.71	5,398,165,277	5,778.11	5,083,555,307	2.19
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	1,894.58	5,674,818,869	1,678.29	5,026,970,883	2.17
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	1,042,664	3,274.63	3,414,349,037	3,344.00	3,486,669,459	1.51
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	904,050	3,908.88	3,533,826,580	3,152.78	2,850,276,183	1.23
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,105,776	2,388.23	2,640,858,474	2,270.96	2,511,180,805	1.08
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	961,368	2,345.14	2,254,551,263	2,431.29	2,337,373,057	1.01
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	17,701,620	125.90	2,228,797,105	131.85	2,334,110,831	1.01
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	613,702	3,408.61	2,091,876,230	3,564.78	2,187,714,457	0.94
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	1,050.11	2,403,984,924	898.78	2,057,532,149	0.89
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	18,565.25	2,370,430,505	15,414.64	1,968,156,778	0.85
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	576.87	1,629,198,983	695.97	1,965,578,243	0.85
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	277,804	6,168.57	1,713,655,087	6,891.45	1,914,474,043	0.83
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	100,741	21,498.84	2,165,814,667	18,776.19	1,891,533,164	0.82
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	472,159	2,921.18	1,379,261,755	2,974.04	1,404,223,057	0.61
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	354,607	3,961.17	1,404,660,028	3,885.15	1,377,704,932	0.59
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,791,515	98.93	1,265,509,092	105.16	1,345,165,951	0.58
ケイマン	株式	TRIP.COM GROUP LTD	消費者サービス	114,607	10,660.62	1,221,781,761	11,392.42	1,305,651,079	0.56

インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	167,114	7,719.76	1,290,080,222	7,752.38	1,295,532,401	0.56
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	1,075,496	1,184.79	1,274,242,226	1,176.10	1,264,896,761	0.55
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	3,165.01	1,408,149,544	2,769.64	1,232,244,192	0.53
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	34,584.95	1,127,400,464	35,972.93	1,172,645,800	0.51
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,238,000	1,011.48	1,252,218,176	944.61	1,169,430,894	0.50
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	14,349,200	76.83	1,102,486,344	80.29	1,152,200,582	0.50
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	187,000	5,681.94	1,062,523,528	5,575.96	1,042,706,016	0.45
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	338,630	2,433.37	824,012,760	2,891.92	979,291,547	0.42
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	10,195,000	98.73	1,006,603,325	96.04	979,127,800	0.42
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	165,233	5,541.40	915,622,972	5,673.18	937,397,542	0.40
ブラジル	株式	VALE SA	素材	621,587	1,544.35	959,951,137	1,394.32	866,695,122	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	4.36
		素材	5.50
		資本財	4.59
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	3.53
		耐久消費財・アパレル	1.20
		消費者サービス	2.97
		メディア・娯楽	6.42
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.03
		生活必需品流通・小売り	1.09
		食品・飲料・タバコ	2.89
		家庭用品・パーソナル用品	0.60
		ヘルスケア機器・サービス	0.83
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.47
		銀行	17.31
		金融サービス	2.64
		保険	3.02
		ソフトウェア・サービス	2.65
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.60		
電気通信サービス	2.71		

		公益事業	2.58
		半導体・半導体製造装置	13.42
		不動産管理・開発	1.52
		小計	96.73
投資信託受益証券			0.18
投資証券			0.09
合計			97.00

(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	875	アメリカドル	48,533,910	7,677,093,884	47,556,250	7,522,447,625	3.25

(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	4,082,854.32	645,066,559	645,173,492	0.28
	ブラジルリアル	売建	265,824.95	6,786,959	6,771,035	0.00

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

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

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	604,790,117,550	84.92
地方債証券	日本	36,283,627,790	5.09
特殊債券	日本	36,964,437,333	5.19
	国際機関	297,705,000	0.04
	小計	37,262,142,333	5.23
社債券	日本	31,390,401,000	4.41
	フランス	1,587,378,000	0.22
	オーストラリア	99,446,000	0.01
	韓国	99,260,000	0.01
	小計	33,176,485,000	4.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		661,879,333	0.09
合計(純資産総額)		712,174,252,006	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376回利付国債(10年)	7,240,000,000	98.77	7,151,379,900	98.33	7,119,236,800	0.900	2034/9/20	1.00
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	98.36	6,462,777,600	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	95.54	6,363,430,200	0.400	2033/6/20	0.89
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	98.90	6,270,767,200	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	96.85	5,975,706,700	0.500	2032/12/20	0.84
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	96.61	5,893,393,000	0.500	2033/3/20	0.83
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	99.21	5,853,685,000	0.100	2026/9/20	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	99.43	5,797,293,700	0.005	2026/3/20	0.81
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	95.61	5,794,390,200	0.100	2031/6/20	0.81
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	6,060,000,000	94.76	5,742,997,900	94.85	5,748,152,400	0.200	2032/9/20	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	98.97	5,691,235,000	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	96.57	5,663,830,500	0.100	2030/6/20	0.80
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,790,000,000	96.34	5,578,242,000	96.36	5,579,533,500	0.100	2030/9/20	0.78
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	98.55	5,578,269,600	0.800	2033/9/20	0.78
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	95.89	5,571,383,300	0.100	2031/3/20	0.78
日本	国債証券	第174回利付国債(5年)	5,550,000,000	99.85	5,541,750,800	99.84	5,541,120,000	0.700	2029/9/20	0.78
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	98.60	5,374,190,500	0.005	2027/6/20	0.75
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	5,350,000,000	101.82	5,447,370,000	100.38	5,370,651,000	1.100	2034/6/20	0.75
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	96.15	5,365,616,400	0.100	2030/12/20	0.75
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	5,617,000,000	94.87	5,329,276,900	95.07	5,340,362,750	0.100	2031/12/20	0.75
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	98.69	5,329,530,000	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	95.46	5,259,846,000	0.200	2032/3/20	0.74
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	5,420,000,000	96.27	5,218,140,400	96.59	5,235,340,600	0.600	2033/12/20	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	98.17	5,227,872,000	0.100	2028/6/20	0.73
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	98.02	5,214,930,000	0.800	2034/3/20	0.73
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,390,000,000	95.03	5,122,117,000	95.14	5,128,261,600	0.200	2032/6/20	0.72

日本	国債証券	第151回利付国債（5年）	5,090,000,000	98.76	5,027,358,000	98.77	5,027,494,800	0.005	2027/3/20	0.71
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	99.09	4,835,689,600	0.100	2026/12/20	0.68
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	95.36	4,834,904,100	0.100	2031/9/20	0.68
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	99.56	4,739,056,000	99.55	4,738,675,200	0.100	2026/3/20	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	84.92
地方債証券	5.09
特殊債券	5.23
社債券	4.66
合計	99.91

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックス 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	177,768,510,647	46.08
	中国	43,539,774,434	11.29
	フランス	27,579,298,425	7.15
	イタリア	26,108,439,790	6.77
	ドイツ	21,937,378,672	5.69
	イギリス	19,325,116,229	5.01
	スペイン	16,532,878,891	4.29
	カナダ	7,227,524,709	1.87
	ベルギー	5,900,080,180	1.53
	オランダ	4,990,164,315	1.29
	オーストラリア	4,591,897,457	1.19
	オーストリア	4,160,662,576	1.08
	メキシコ	2,825,411,465	0.73
	ポルトガル	2,215,796,604	0.57
	ポーランド	2,011,338,991	0.52
	マレーシア	1,925,007,209	0.50
	フィンランド	1,871,051,650	0.48
アイルランド	1,782,060,153	0.46	

	シンガポール	1,461,482,099	0.38
	イスラエル	1,253,539,309	0.32
	ニュージーランド	1,036,756,308	0.27
	デンマーク	845,724,539	0.22
	スウェーデン	626,547,404	0.16
	ノルウェー	577,059,858	0.15
	小計	378,093,501,914	98.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		7,710,855,494	2.00
合計（純資産総額）		385,804,357,408	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,565,635,965	0.41
	買建	ドイツ	1,358,934,203	0.35

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建		3,662,218,215	0.95

(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	14,699.00	2,278,345,005	15,119.47	2,343,518,561	1.500	2026/8/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	14,063.59	2,264,239,494	14,290.26	2,300,732,736	0.375	2027/7/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	14,150,000	15,660.74	2,215,995,667	15,788.95	2,234,137,711	4.375	2028/8/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	14,886.22	2,262,705,583	14,629.79	2,223,729,036	2.625	2029/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/15/26	13,000,000	16,072.28	2,089,396,940	15,832.52	2,058,227,658	4.375	2026/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/34	13,770,000	15,377.44	2,117,474,793	14,907.22	2,052,725,473	3.875	2034/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.375% 07/15/27	12,800,000	15,920.85	2,037,869,409	15,826.03	2,025,732,164	4.375	2027/7/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	13,220,000	14,780.35	1,953,962,570	15,004.54	1,983,601,114	2.875	2028/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,459.56	1,970,839,036	14,487.06	1,974,586,777	3.375	2033/5/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	14,986.10	1,843,290,348	15,071.89	1,853,843,336	1.625	2026/10/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1% 07/31/28	13,000,000	13,733.86	1,785,402,933	14,038.16	1,824,961,590	1.000	2028/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,790.44	1,729,003,354	15,119.47	1,767,466,578	2.375	2027/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	15,604.81	1,810,158,687	15,095.99	1,751,135,400	4.000	2034/2/15	0.45

アメリカ	国債証券	T 1.125%	08/31/28	12,030,000	13,695.23	1,647,536,978	14,065.97	1,692,136,324	1.125	2028/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.875%	08/15/33	11,070,000	15,083.08	1,669,697,628	15,003.62	1,660,900,742	3.875	2033/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625%	05/15/26	10,770,000	14,841.11	1,598,388,081	15,256.33	1,643,107,544	1.625	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 3.5%	02/15/33	11,200,000	14,627.32	1,638,260,369	14,664.39	1,642,412,594	3.500	2033/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.375%	11/15/31	12,580,000	12,664.28	1,593,167,211	12,881.47	1,620,489,533	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.625%	07/31/26	10,800,000	14,437.01	1,559,197,556	14,930.09	1,612,449,851	0.625	2026/7/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.5%	07/15/26	10,000,000	15,683.60	1,568,360,885	15,860.01	1,586,001,656	4.500	2026/7/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.125%	11/15/28	10,410,000	14,871.39	1,548,111,861	15,093.21	1,571,203,612	3.125	2028/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.875%	02/15/32	11,720,000	13,082.90	1,533,316,710	13,259.93	1,554,064,126	1.875	2032/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.875%	11/30/25	9,700,000	15,993.37	1,551,357,218	15,904.06	1,542,694,498	4.875	2025/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625%	08/15/30	11,950,000	12,474.59	1,490,713,957	12,804.54	1,530,143,422	0.625	2030/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 4.25%	02/15/54	10,550,000	14,999.86	1,582,485,417	14,383.25	1,517,433,723	4.250	2054/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.625%	10/15/26	9,520,000	15,734.27	1,497,903,055	15,895.85	1,513,285,328	4.625	2026/10/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.625%	05/15/31	10,980,000	13,174.40	1,446,549,562	13,296.69	1,459,977,366	1.625	2031/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.5%	11/15/33	9,270,000	15,759.91	1,460,944,417	15,694.42	1,454,872,907	4.500	2033/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.75%	01/31/29	10,200,000	14,254.18	1,453,926,634	14,240.52	1,452,533,576	1.750	2029/1/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.5%	04/15/27	9,150,000	15,910.54	1,455,814,589	15,872.06	1,452,293,988	4.500	2027/4/15	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.00
合計	98.00

(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	40	アメリカドル	4,287,721.5	678,231,786	4,241,562.4	670,930,340	0.17
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	25	アメリカドル	2,761,632.58	436,835,042	2,710,937.5	428,816,094	0.11
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	26	アメリカドル	3,071,947.8	485,920,703	2,945,312.5	465,889,531	0.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	14	ユーロ	1,503,004.4	247,875,486	1,497,300	246,934,716	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	20	ユーロ	2,380,942	392,664,954	2,353,000	388,056,760	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	33	ユーロ	4,497,319.3	741,697,899	4,389,660	723,942,727	0.19

(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	11,370,000.00	1,732,892,976	1,794,868,200	0.47
	カナダドル	買建	1,190,000.00	127,705,645	130,442,088	0.03
	ユーロ	買建	6,630,000.00	1,063,847,630	1,091,948,403	0.28
	イギリスポンド	買建	1,000,000.00	193,981,678	198,586,500	0.05
	オフショア人民元	買建	20,640,000.00	433,469,980	446,373,024	0.12

(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（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	39,079,190,261	48.83
	中国	9,574,137,868	11.96
	フランス	6,064,215,745	7.58
	イタリア	5,739,757,166	7.17
	ドイツ	4,814,264,650	6.02
	イギリス	4,247,712,562	5.31
	スペイン	3,636,082,959	4.54
	カナダ	1,588,113,097	1.98
	ベルギー	1,296,620,539	1.62
	オランダ	1,095,893,824	1.37
	オーストラリア	1,007,277,981	1.26
	オーストリア	914,780,795	1.14
	メキシコ	621,770,298	0.78
	ポルトガル	486,824,880	0.61
	ポーランド	440,533,394	0.55
	マレーシア	422,563,509	0.53
	フィンランド	411,753,129	0.51
	アイルランド	392,363,691	0.49
	シンガポール	320,980,593	0.40
	イスラエル	274,663,026	0.34
ニュージーランド	226,316,759	0.28	
デンマーク	185,849,416	0.23	
スウェーデン	137,469,925	0.17	
ノルウェー	126,347,740	0.16	
	小計	83,105,483,807	103.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,078,384,671	3.85
合計(純資産総額)		80,027,099,136	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	68,617,988	0.09
	買建	ドイツ	58,978,690	0.07

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		85,322,531,736	106.62

(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 2.25% 02/15/27	4,620,000	15,207.52	702,587,611	15,155.31	700,175,429	2.250	2027/2/15	0.87
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	4,230,000	15,205.67	643,199,856	15,070.66	637,488,974	2.875	2028/5/15	0.80
アメリカ	国債証券	T 6.125% 11/15/27	3,500,000	16,720.12	585,204,210	16,579.55	580,284,255	6.125	2027/11/15	0.73
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/15/54	4,000,000	15,429.34	617,173,872	14,383.25	575,330,322	4.250	2054/2/15	0.72
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	3,500,000	15,950.22	558,258,003	15,895.85	556,354,900	4.625	2026/10/15	0.70
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	3,350,000	16,184.71	542,188,053	15,694.42	525,763,132	4.500	2033/11/15	0.66
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	3,330,000	15,094.14	502,634,898	14,664.39	488,324,458	3.500	2033/2/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	3,150,000	15,468.89	487,270,092	15,003.62	472,614,032	3.875	2033/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	3,200,000	14,847.91	475,133,177	14,629.79	468,153,481	2.625	2029/7/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/15/26	2,890,000	15,872.37	458,711,619	15,831.59	457,533,056	4.375	2026/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 4.125% 10/31/27	2,800,000	15,836.22	443,414,376	15,719.75	440,153,149	4.125	2027/10/31	0.55
中国	国債証券	CGB 2.18% 08/15/26	19,880,000	2,195.11	436,389,463	2,204.39	438,233,612	2.180	2026/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.875% 10/31/30	2,620,000	16,443.92	430,830,787	16,120.45	422,355,983	4.875	2030/10/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/15/31	3,190,000	13,299.16	424,243,486	13,009.37	414,999,164	1.125	2031/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.625% 05/15/26	2,640,000	15,695.65	414,365,359	15,673.10	413,769,960	3.625	2026/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/30/30	2,510,000	16,033.33	402,436,705	15,713.26	394,403,016	4.375	2030/11/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	2,730,000	14,536.18	396,837,873	14,160.50	386,581,877	2.875	2032/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.25% 02/28/29	2,450,000	15,913.46	389,879,872	15,702.76	384,717,701	4.250	2029/2/28	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.625% 05/31/31	2,400,000	16,262.26	390,294,321	15,901.10	381,626,552	4.625	2031/5/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.625% 11/15/26	2,400,000	15,958.26	382,998,268	15,899.87	381,596,891	4.625	2026/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/34	2,470,000	15,416.37	380,784,368	14,907.22	368,208,564	3.875	2034/8/15	0.46
中国	国債証券	CGB 2.74% 08/04/26	16,500,000	2,215.52	365,560,858	2,222.84	366,769,030	2.740	2026/8/4	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.625% 06/30/26	2,250,000	15,923.65	358,282,335	15,889.36	357,510,744	4.625	2026/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/29	2,280,000	15,835.91	361,058,948	15,621.81	356,177,491	4.125	2029/3/31	0.45

アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	2,350,000	15,267.76	358,792,556	15,093.21	354,690,537	3.125	2028/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.125% 02/15/27	2,200,000	15,817.38	347,982,406	15,750.64	346,514,298	4.125	2027/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	2,450,000	14,209.93	348,143,518	14,065.97	344,616,291	1.125	2028/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/28/29	2,400,000	14,470.68	347,296,547	14,285.01	342,840,321	1.875	2029/2/28	0.43
中国	国債証券	CGB 2.52% 08/25/33	14,850,000	2,267.04	336,656,437	2,302.71	341,953,280	2.520	2033/8/25	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	2,290,000	14,957.27	342,521,675	14,931.94	341,941,539	1.125	2026/10/31	0.43

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	103.85
合計	103.85

(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	2	アメリカドル	215,265.62	34,050,716	212,078.12	33,546,517	0.04
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	1	アメリカドル	111,171.88	17,585,167	108,437.5	17,152,643	0.02
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	1	アメリカドル	119,343.75	18,877,794	113,281.25	17,918,828	0.02
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	1	ユーロ	107,215	17,681,898	106,950	17,638,194	0.02
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	1	ユーロ	118,830	19,597,443	117,650	19,402,838	0.02
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	1	ユーロ	136,020	22,432,418	133,020	21,937,658	0.03

(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	売建	254,885,000.00	38,477,439,600	40,271,830,000	50.32
	カナダドル	売建	14,832,000.00	1,581,527,260	1,626,816,772	2.03
	メキシコペソ	売建	84,710,000.00	627,574,035	656,561,796	0.82
	ユーロ	売建	155,134,000.00	24,740,723,779	25,565,338,556	31.95
	イギリスポンド	売建	22,442,000.00	4,318,803,560	4,460,933,236	5.57
	スウェーデンクローナ	売建	9,885,000.00	137,024,880	142,159,149	0.18
	ノルウェークローネ	売建	9,373,000.00	127,228,164	130,523,711	0.16
	デンマーククローネ	売建	8,654,000.00	185,136,752	191,214,456	0.24

ポーランドズロチ	売建	11,814,000.00	440,881,939	455,240,676	0.57
オーストラリアドル	売建	10,349,000.00	1,004,624,000	1,018,204,992	1.27
ニュージーランドドル	売建	2,573,000.00	227,252,248	229,195,377	0.29
シンガポールドル	売建	2,823,000.00	318,129,233	328,645,473	0.41
マレーシアリングット	売建	12,052,000.00	411,178,084	426,231,032	0.53
イスラエルシェケル	売建	6,562,000.00	277,534,540	281,399,558	0.35
オフショア人民元	売建	440,724,000.00	9,167,808,430	9,538,236,952	11.92

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

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

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	中国	16,032,355,987	10.01
	マレーシア	15,849,925,075	9.90
	インドネシア	15,424,035,730	9.63
	メキシコ	15,239,886,676	9.51
	タイ	14,722,556,484	9.19
	南アフリカ	12,912,504,508	8.06
	ポーランド	11,558,794,851	7.22
	ブラジル	11,133,442,116	6.95
	インド	9,436,635,205	5.89
	チェコ	8,364,536,169	5.22
	コロンビア	5,930,892,962	3.70
	ルーマニア	5,574,516,125	3.48
	ハンガリー	3,812,590,675	2.38
	ペルー	3,250,181,518	2.03
	チリ	2,719,946,207	1.70
	トルコ	2,166,292,013	1.35
	ドミニカ共和国	391,743,472	0.24
	ウルグアイ	288,935,214	0.18
	小計	154,809,770,987	96.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,358,290,517	3.35
合計(純資産総額)		160,168,061,504	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		1,965,250,306	1.23

(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	2,216.90	1,828,944,859	2,204.11	1,818,392,646	0.000	2026/1/1	1.14
マレーシア	国債証券	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000	3,857.17	1,685,585,333	3,872.58	1,692,320,827	4.893	2038/6/8	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	184,700,000	882.06	1,629,175,533	882.27	1,629,566,635	10.500	2026/12/21	1.02
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	68,000,000	2,368.71	1,610,727,303	2,385.81	1,622,354,737	0.000	2025/7/1	1.01
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,085.62	1,626,791,075	2,045.14	1,595,210,465	0.000	2026/7/1	1.00
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	193,600,000	806.69	1,561,767,007	811.92	1,571,881,654	8.000	2030/1/31	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 7% 09/03/26	210,600,000	740.57	1,559,649,612	744.50	1,567,924,537	7.000	2026/9/3	0.98
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	210,000,000	709.52	1,490,000,163	712.15	1,495,533,110	5.500	2027/3/4	0.93
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	191,000,000	767.13	1,465,220,406	771.95	1,474,441,240	8.875	2035/2/28	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	210,800,000	705.64	1,487,509,925	694.82	1,464,692,401	7.750	2031/5/29	0.91
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	41,200,000	3,300.84	1,359,946,809	3,315.14	1,365,838,858	2.632	2031/4/15	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	173,500,000	780.07	1,353,436,940	785.48	1,362,814,151	8.250	2032/3/31	0.85
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	187,300,000	718.24	1,345,263,743	722.37	1,353,007,509	9.000	2040/1/31	0.84
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	38,000,000	3,559.08	1,352,452,618	3,555.18	1,350,971,969	3.733	2028/6/15	0.84
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000	3,439.12	1,337,819,599	3,419.84	1,330,318,902	2.750	2029/10/25	0.83
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	737.25	1,292,416,050	741.74	1,300,286,780	5.750	2026/3/5	0.81
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	188,700,000	681.93	1,286,820,354	682.69	1,288,236,997	8.750	2048/2/28	0.80
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	45,600,000,000	2.83	1,294,496,079	2.66	1,215,235,053	7.250	2034/10/18	0.76
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000	3,558.11	1,206,199,605	3,559.29	1,206,601,142	3.955	2025/9/15	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 03/01/29	160,000,000	742.81	1,188,502,371	736.53	1,178,463,562	8.500	2029/3/1	0.74
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	159,000,000	739.30	1,175,495,882	738.73	1,174,589,077	7.500	2027/6/3	0.73
ポーランド	国債証券	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000	4,155.95	1,184,445,786	4,117.83	1,173,582,337	7.500	2028/7/25	0.73
ポーランド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	30,100,000	3,958.69	1,191,567,686	3,896.60	1,172,877,909	6.000	2033/10/25	0.73
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000	2.39	1,293,574,912	2.13	1,155,230,258	7.250	2050/10/26	0.72
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	159,200,000	718.48	1,143,829,715	720.24	1,146,622,909	8.500	2037/1/31	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000	742.91	1,148,551,231	737.09	1,139,545,988	8.500	2029/5/31	0.71
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	64,500,000	1,848.98	1,192,595,651	1,766.47	1,139,377,498	0.000	2027/7/1	0.71

ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,331.74	1,198,515,943	2,150.15	1,105,181,423	10.000	2029/1/1	0.69
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	183,000,000	627.31	1,147,982,129	597.73	1,093,858,491	7.750	2042/11/13	0.68
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	46,300,000	2,413.45	1,117,428,763	2,316.10	1,072,358,807	10.000	2027/1/1	0.67

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.65
合計	96.65

(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	38,640,000.00	292,808,718	298,691,064	0.19
	トルコリラ	買建	9,700,000.00	41,552,720	42,657,690	0.03
	チェココルナ	買建	25,100,000.00	161,279,232	163,887,940	0.10
	ハンガリーフォリント	買建	185,580,000.00	72,962,470	74,279,692	0.05
	ポーランドズロチ	買建	5,870,000.00	221,668,336	225,881,122	0.14
	マレーシアリングット	買建	8,740,000.00	302,531,873	308,869,852	0.19
	タイバーツ	買建	61,060,000.00	277,467,320	284,222,088	0.18
	南アフリカランド	買建	30,180,000.00	256,287,591	254,689,020	0.16
	オフショア人民元	買建	14,430,000.00	305,148,971	312,071,838	0.19

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

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

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	1,368,089,295	56.35
	イギリス	539,361,787	22.21
	フランス	229,913,609	9.47
	イタリア	162,687,905	6.70
	ドイツ	68,853,001	2.84
	スペイン	68,136,610	2.81
	カナダ	41,031,955	1.69
	オーストラリア	22,820,046	0.94
	スウェーデン	15,448,589	0.64
	ニュージーランド	9,218,777	0.38

	デンマーク	4,419,280	0.18
	小計	2,529,980,854	104.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		102,017,498	4.20
合計（純資産総額）		2,427,963,356	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		2,602,941,367	107.21

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

(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	TII 0.125% 01/15/30	260,000	14,483.92	45,376,932	14,321.31	45,675,939	0.125	2030/1/15	1.88
アメリカ	国債証券	TII 1.75% 01/15/34	290,000	15,763.72	46,171,777	15,129.32	45,047,367	1.750	2034/1/15	1.86
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/26	220,000	15,129.91	42,764,548	15,430.40	44,696,508	0.125	2026/7/15	1.84
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 04/15/26	240,000	15,191.60	43,215,124	15,421.86	44,542,670	0.125	2026/4/15	1.83
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 01/15/32	280,000	13,961.40	43,656,286	13,679.43	43,608,834	0.125	2032/1/15	1.80
アメリカ	国債証券	TII 0.375% 01/15/27	210,000	15,150.63	40,834,556	15,316.03	42,022,801	0.375	2027/1/15	1.73
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/31	250,000	14,134.13	40,780,988	13,891.66	40,894,977	0.125	2031/7/15	1.68
アメリカ	国債証券	TII 1.375% 07/15/33	260,000	15,345.62	40,659,941	14,763.79	39,889,445	1.375	2033/7/15	1.64
アメリカ	国債証券	TII 0.625% 07/15/32	260,000	14,507.19	40,241,706	14,107.10	39,841,608	0.625	2032/7/15	1.64
アメリカ	国債証券	TII 1.125% 01/15/33	250,000	14,980.43	38,900,865	14,517.14	38,453,006	1.125	2033/1/15	1.58
アメリカ	国債証券	TII 1.875% 07/15/34	250,000	15,929.53	39,960,523	15,287.81	38,441,581	1.875	2034/7/15	1.58
アメリカ	国債証券	TII 0.875% 01/15/29	200,000	15,248.39	37,623,136	15,069.12	37,670,092	0.875	2029/1/15	1.55
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 10/15/26	210,000	15,214.08	36,629,766	15,355.91	37,244,808	0.125	2026/10/15	1.53
アメリカ	国債証券	TII 2.125% 04/15/29	230,000	15,898.30	37,020,058	15,802.25	37,085,178	2.125	2029/4/15	1.53
アメリカ	国債証券	TII 1.625% 10/15/27	220,000	15,738.91	36,077,118	15,693.73	36,784,575	1.625	2027/10/15	1.52
アメリカ	国債証券	TII 0.75% 07/15/28	190,000	15,211.88	35,602,643	15,162.71	36,222,049	0.750	2028/7/15	1.49
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 01/15/31	210,000	14,242.55	35,818,879	14,005.76	35,658,943	0.125	2031/1/15	1.47
アメリカ	国債証券	TII 1.25% 04/15/28	220,000	15,485.82	35,270,693	15,384.37	35,612,370	1.250	2028/4/15	1.47

アメリカ	国債証券	TII 0.375% 07/15/27	180,000	15,117.06	34,405,679	15,233.79	35,378,347	0.375	2027/7/15	1.46
アメリカ	国債証券	TII 0.5% 01/15/28	180,000	15,092.04	34,145,556	15,093.76	34,762,181	0.500	2028/1/15	1.43
アメリカ	国債証券	TII 2.375% 10/15/28	210,000	16,305.19	34,585,249	16,028.53	34,683,194	2.375	2028/10/15	1.43
フランス	国債証券	FRTRI 1.85% 07/25/27	150,000	17,126.39	34,292,373	17,072.43	34,536,852	1.850	2027/7/25	1.42
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 07/15/30	190,000	14,296.30	32,566,622	14,213.60	33,242,843	0.125	2030/7/15	1.37
アメリカ	国債証券	TII 3.875% 04/15/29	100,000	17,451.99	32,630,547	16,930.10	32,502,744	3.875	2029/4/15	1.34
アメリカ	国債証券	TII 3.625% 04/15/28	100,000	16,929.64	32,259,242	16,573.41	32,339,873	3.625	2028/4/15	1.33
アメリカ	国債証券	TII 2.375% 01/15/27	120,000	15,995.16	29,257,741	15,949.46	29,953,088	2.375	2027/1/15	1.23
アメリカ	国債証券	TII 0.125% 04/15/27	170,000	14,966.99	27,884,828	15,133.63	28,757,841	0.125	2027/4/15	1.18
イギリス	国債証券	UKTI 1.25% 11/22/27	70,000	20,702.06	28,410,820	20,337.69	28,636,206	1.250	2027/11/22	1.18
アメリカ	国債証券	TII 2.125% 02/15/41	130,000	16,185.52	29,784,415	15,279.78	28,627,203	2.125	2041/2/15	1.18
アメリカ	国債証券	TII 2% 01/15/26	110,000	15,743.65	26,819,401	15,812.08	27,657,591	2.000	2026/1/15	1.14

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	104.20
合計	104.20

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	8,859,000.00	1,323,358,670	1,399,722,000	57.65
	カナダドル	売建	383,000.00	40,920,055	42,008,549	1.73
	ユーロ	売建	3,282,000.00	518,856,204	540,857,845	22.28
	イギリスポンド	売建	2,853,000.00	541,467,281	567,108,212	23.36
	スウェーデンクローナ	売建	1,098,000.00	15,061,810	15,790,667	0.65
	デンマーククローネ	売建	208,000.00	4,410,562	4,595,864	0.19
	オーストラリアドル	売建	238,000.00	23,135,575	23,416,058	0.96
	ニュージーランドドル	売建	106,000.00	9,346,825	9,442,172	0.39

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

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

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	92,346,398,600	95.85
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,999,423,868	4.15
合計（純資産総額）		96,345,822,468	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	3,958,759,000	4.11

(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	56,220	129,792.48	7,296,933,402	122,400	6,881,328,000	7.14
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	49,505	112,739.04	5,581,146,365	107,900	5,341,589,500	5.54
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	49,979	92,221.45	4,609,136,181	90,200	4,508,105,800	4.68
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	30,853	141,063.92	4,352,245,388	137,700	4,248,458,100	4.41
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	26,965	146,685.61	3,955,377,613	149,500	4,031,267,500	4.18
日本	投資証券	GLP投資法人	32,375	129,109.38	4,179,916,447	123,400	3,995,075,000	4.15
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	16,791	245,410.77	4,120,692,299	222,900	3,742,713,900	3.88
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	53,104	63,343.22	3,363,778,450	66,200	3,515,484,800	3.65
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,374	232,053.4	3,335,535,571	231,800	3,331,893,200	3.46
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	19,205	160,408.79	3,080,650,987	164,100	3,151,540,500	3.27
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	21,405	138,855.17	2,972,194,913	140,800	3,013,824,000	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	9,473	303,236.4	2,872,558,443	292,400	2,769,905,200	2.87
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,409	68,529.02	2,426,544,078	70,600	2,499,875,400	2.59
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	28,963	73,493.88	2,128,603,402	77,300	2,238,839,900	2.32
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	21,010	99,409.63	2,088,596,449	101,500	2,132,515,000	2.21
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	6,592	336,735.69	2,219,761,717	315,500	2,079,776,000	2.16
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,647	114,473.13	2,020,107,359	114,900	2,027,640,300	2.10
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,328	590,688.9	1,965,812,665	587,000	1,953,536,000	2.03
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,340	144,129.42	1,778,557,084	142,100	1,753,514,000	1.82
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,476	274,028.18	1,774,606,545	263,200	1,704,483,200	1.77
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4,685	324,401.18	1,519,819,543	328,500	1,539,022,500	1.60
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,823	126,572.76	1,496,469,770	126,700	1,497,974,100	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,334	127,413.78	1,444,107,887	123,900	1,404,282,600	1.46
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	17,880	80,940.3	1,447,212,702	77,700	1,389,276,000	1.44

日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,880	290,038.64	1,415,388,596	277,900	1,356,152,000	1.41
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,235	91,453.04	1,301,834,079	89,100	1,268,338,500	1.32
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	9,797	109,185.63	1,069,691,682	119,600	1,171,721,200	1.22
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,517	131,791.99	1,122,472,423	137,300	1,169,384,100	1.21
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	3,328	354,250.18	1,178,944,603	346,500	1,153,152,000	1.20
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	18,578	61,377.37	1,140,268,899	61,600	1,144,404,800	1.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	95.85
合計	95.85

(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	2,422	円	3,901,316,640	3,958,759,000	4.11

(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	108,412,408,478	79.41
	オーストラリア	9,930,712,673	7.27
	イギリス	5,494,935,886	4.03
	シンガポール	4,115,487,479	3.01
	フランス	2,337,572,884	1.71
	カナダ	1,682,673,661	1.23
	ベルギー	1,141,338,668	0.84
	香港	1,114,137,989	0.82
	スペイン	569,924,632	0.42
	韓国	213,112,095	0.16
	ガーンジー	211,566,517	0.15
	イスラエル	194,567,677	0.14
	オランダ	183,213,421	0.13
	ニュージーランド	117,226,675	0.09

	アイルランド	55,166,960	0.04
	ドイツ	38,320,811	0.03
	イタリア	13,820,164	0.01
	小計	135,826,186,670	99.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		692,403,321	0.51
合計(純資産総額)		136,518,589,991	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		244,693,534	0.18

(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	555,164	18,312.69	10,166,548,893	16,646.86	9,241,739,162	6.77
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	57,841	145,710.91	8,428,064,994	149,109.95	8,624,669,127	6.32
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	354,698	21,817.02	7,738,456,885	19,772.50	7,013,266,205	5.14
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	187,042	28,784.54	5,383,919,266	28,178.18	5,270,504,116	3.86
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	183,989	28,313.86	5,209,438,915	27,208.54	5,006,072,397	3.67
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	94,185	53,675.21	5,055,400,539	47,153.45	4,441,148,442	3.25
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	523,699	9,093.76	4,762,397,313	8,329.75	4,362,286,354	3.20
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,142,750	3,526.62	4,030,053,488	3,633.66	4,152,370,679	3.04
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	84,994	36,971.41	3,142,348,140	34,986.25	2,973,621,536	2.18
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	126,687	26,515.71	3,359,196,183	23,424.87	2,967,627,291	2.17
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	175,379	18,924.65	3,318,987,104	16,564.60	2,905,084,667	2.13
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	629,277	4,965.27	3,124,530,336	4,577.72	2,880,659,698	2.11
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	250,839	10,297.54	2,583,024,955	9,315.22	2,336,620,520	1.71
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	204,225	11,629.39	2,375,012,908	11,322.52	2,312,342,546	1.69
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	342,941	5,327.99	1,827,187,657	5,077.57	1,741,309,677	1.28
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	38,581	48,191.11	1,859,261,554	44,991.13	1,735,803,072	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,360	25,164.83	1,770,597,857	24,320.17	1,711,167,513	1.25
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	401,402	3,943.42	1,582,899,646	3,696.66	1,483,849,367	1.09
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	93,715	18,009.68	1,687,777,930	15,557.00	1,457,924,536	1.07
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	71,563	19,819.59	1,418,349,388	19,560.53	1,399,810,838	1.03
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	418,004	3,600.17	1,504,888,303	3,176.25	1,327,687,044	0.97
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	163,498	7,871.03	1,286,898,775	7,568.91	1,237,502,138	0.91
アメリカ	投資証券	UDR INC	178,809	7,034.26	1,257,789,819	6,866.59	1,227,808,771	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	114,181	11,290.02	1,289,106,471	10,534.78	1,202,872,629	0.88

アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	417,757	2,847.24	1,189,454,441	2,843.28	1,187,802,420	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	63,524	19,253.66	1,223,070,108	18,227.08	1,157,857,119	0.85
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	97,398	11,740.11	1,143,464,169	11,697.41	1,139,304,437	0.83
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	816,685	1,547.81	1,264,079,532	1,379.20	1,126,378,975	0.83
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	130,425	8,968.80	1,169,756,522	8,622.39	1,124,575,450	0.82
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	190,398	5,847.24	1,113,303,912	5,868.47	1,117,346,474	0.82

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.49
合計	99.49

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,480,000.00	233,825,200	233,869,600	0.17
	オーストラリアドル	買建	110,000.00	10,821,690	10,823,934	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。

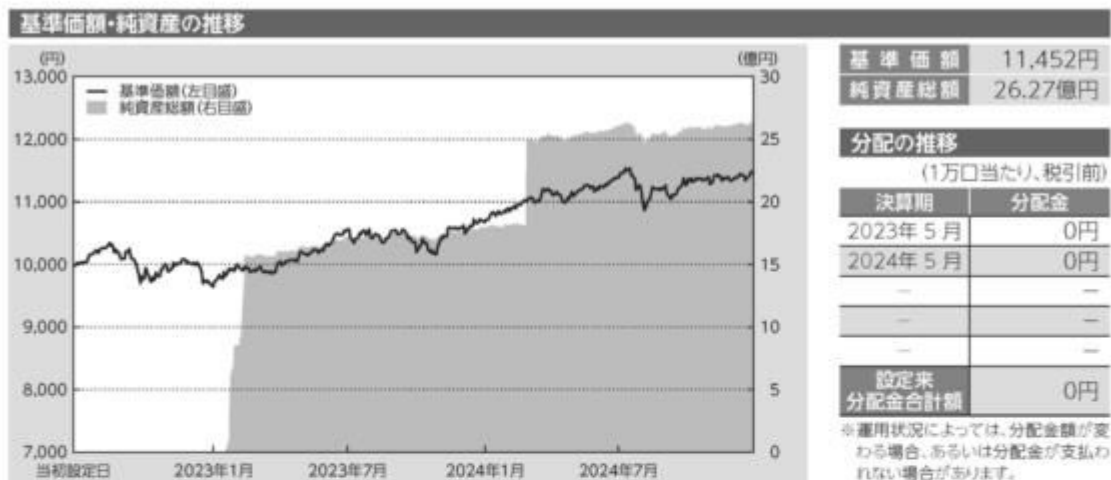
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2022年6月30日
作成基準日：2024年12月30日

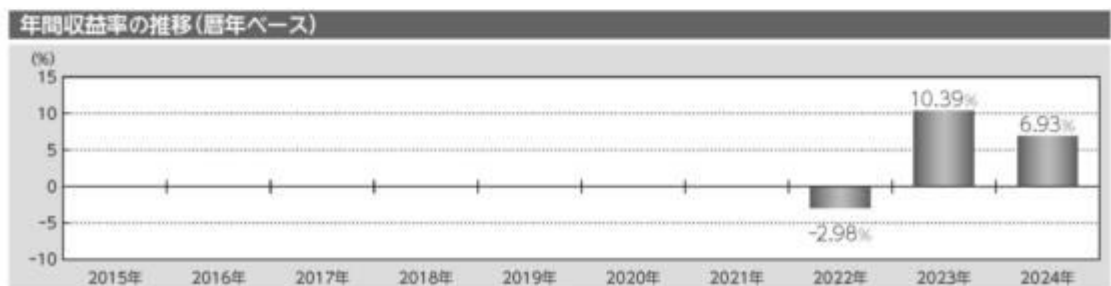


※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
国内債券インデックスマザーファンド	24.3%	第376回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.900%	2034/09/20	0.2%
外国債券インデックスマザーファンド(海外)	23.7%	T 2.25% 02/15/27	アメリカ	国債	-	2.250%	2027/02/15	0.2%
外国株式インデックスマザーファンド	16.2%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア/IT機器	-	-	0.9%
国内株式インデックスマザーファンド	12.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.5%
新興国債券インデックスマザーファンド	5.2%	BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	国債	-	0.000%	2026/01/01	0.1%
外国債券インデックスマザーファンド	5.1%	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	国債	-	1.500%	2026/08/15	0.0%
世界債券動向マザーファンド(海外)	3.9%	TII 0.125% 01/15/30	アメリカ	国債	-	0.125%	2030/01/15	0.1%
新興国株式インデックスマザーファンド	3.3%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.3%
J-REITインデックスマザーファンド	2.6%	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	-	-	-	0.2%
グローバルREITインデックスマザーファンド	2.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	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。



※2022年は当初設定日から年末までの収益率です。
※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。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

<申込手続>

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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 >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「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 >

1円以上1円単位とします。

< 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 >

ありません。

< 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

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 >

1口以上1口単位とします。

< 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（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。

< 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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより、振り込まれることとなります。

< 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

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

- ・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）
原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。
- ・外国上場株式、外国上場投資信託受益証券（海外REITを含みます。）、外国上場投資証券（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）
原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

・公社債等

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。

（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

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。（2022年6月30日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年5月25日から翌年5月24日までとします。

ただし、第1計算期間は2022年6月30日から2023年5月24日までとします。

なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期

間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 反対受益者の受益権買取請求の不適用 >

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

< 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、原則として毎計算期間終了日（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎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します。）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。

(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

て取得申込者とします。)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2期計算期間(2023年5月25日から2024年5月24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】

【10 資産分散投資ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期 (2024年 5月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,085,368	26,276,778
親投資信託受益証券	1,623,873,177	2,519,820,556
未収入金	2,814,060	4,092,460
未収利息	-	48
流動資産合計	1,642,772,605	2,550,189,842
資産合計	1,642,772,605	2,550,189,842
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,574,662	2,935,360
未払受託者報酬	156,598	349,464
未払委託者報酬	678,591	1,514,305
未払利息	27	-
その他未払費用	26,055	58,188
流動負債合計	2,435,933	4,857,317
負債合計	2,435,933	4,857,317
純資産の部		
元本等		
元本	1,607,741,633	2,268,369,129
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	32,595,039	276,963,396
（分配準備積立金）	45,271,760	216,478,131
元本等合計	1,640,336,672	2,545,332,525
純資産合計	1,640,336,672	2,545,332,525
負債純資産合計	1,642,772,605	2,550,189,842

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自 至	2022年 6月30日 2023年 5月24日	自 至	2023年 5月25日 2024年 5月24日
営業収益				
受取利息		17		3,229
有価証券売買等損益		46,319,631		183,949,524
営業収益合計		46,319,648		183,952,753
営業費用				
支払利息		1,460		5,962
受託者報酬		156,631		633,110
委託者報酬		678,948		2,743,400
その他費用		26,055		105,399
営業費用合計		863,094		3,487,871
営業利益又は営業損失 ()		45,456,554		180,464,882
経常利益又は経常損失 ()		45,456,554		180,464,882
当期純利益又は当期純損失 ()		45,456,554		180,464,882
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 ()		184,794		6,001,645
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		32,595,039
剰余金増加額又は欠損金減少額		165,895		73,316,013
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		165,895		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		73,316,013
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,842,616		3,410,893
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,410,893
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,842,616		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		32,595,039		276,963,396

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期 (2024年 5月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,607,741,633口	2,268,369,129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) 1.0203円 (10,203円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1221円 (11,221円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日			第2期 自 2023年 5月25日 至 2024年 5月24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	11,760,271円	費用控除後の配当等収益額	A	41,120,283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	33,511,489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	133,342,954円
収益調整金額	C	1,299,954円	収益調整金額	C	60,485,265円
分配準備積立金額	D	- 円	分配準備積立金額	D	42,014,894円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	46,571,714円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	276,963,396円
当ファンドの期末残存口数	F	1,607,741,633口	当ファンドの期末残存口数	F	2,268,369,129口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	289円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,220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2期 自 2023年 5月25日 至 2024年 5月24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2期 (2024年 5月24日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日	第2期 自 2023年 5月25日 至 2024年 5月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	1,607,741,633円
期中追加設定元本額	1,627,950,903円	790,951,104円
期中一部解約元本額	20,709,270円	130,323,608円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期 (2024年 5月24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	46,356,085	170,337,176
合計	46,356,085	170,337,176

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	33,159,984	68,664,378	
	グローバルREITインデックス マザーファンド	17,591,029	51,546,992	
	新興国株式インデックス マザーファンド	17,935,218	84,410,309	
	国内株式インデックス マザーファンド	113,723,354	323,793,133	
	外国株式インデックス マザーファンド	61,825,769	409,904,848	
	国内債券インデックス マザーファンド	462,411,118	602,937,856	
	外国債券インデックス マザーファンド	35,744,317	130,223,695	
	新興国債券インデックス マザーファンド	57,646,480	136,011,104	
	世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり	118,001,238	104,395,695	
	外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	744,832,819	607,932,546	
合計		1,662,871,326	2,519,820,556	

(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 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,238,703,827
株式	652,955,918,130
派生商品評価勘定	83,408,850
未収入金	20,176,000
未収配当金	6,381,485,345
未収利息	9,752
差入委託証拠金	433,057,481
流動資産合計	665,112,759,385
資産合計	665,112,759,385
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,225,200
前受金	60,388,800
未払金	213,900
未払解約金	1,323,012,680
流動負債合計	1,406,840,580
負債合計	1,406,840,580
純資産の部	
元本等	
元本	233,105,572,904
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	430,600,345,901
元本等合計	663,705,918,805
純資産合計	663,705,918,805
負債純資産合計	665,112,759,385

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。

2024年 5月24日現在	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2024年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	233,105,572,904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) 2.8472円 (28,472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 5月24日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2024年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	255,830,605,457円
期中追加設定元本額	24,611,101,970円
期中一部解約元本額	47,336,134,523円
期末元本額	233,105,572,904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）	268,612,952円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,258,378,877円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,749,846円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,483,269,604円
世界経済インデックスファンド	5,993,105,218円
日本株式インデックス・オープン	2,823,807,944円
DCマイセクション25	4,666,945,849円
DCマイセクション50	15,531,596,121円
DCマイセクション75	17,839,366,596円
DC日本株式インデックス・オープン	6,004,147,224円
DCマイセクションS25	2,851,144,597円
DCマイセクションS50	9,080,134,975円
DCマイセクションS75	8,509,029,082円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,545,307,856円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	57,037,683円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	553,840,858円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	450,162,148円
DC世界経済インデックスファンド	3,957,693,881円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	695,206,783円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,269,905円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,300,182円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,243,691円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	135,849,914円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	12,459,639円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	60,324,905円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,949,675円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,514,138円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	408,569,072円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	288,030,221円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,956,879,985円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,771,657円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,552,242円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	288,907,051円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	162,430,682円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	216,305,563円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,960,135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）	360,895,009円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,364,163,444円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,895,735,458円
コア投資戦略ファンド（安定型）	539,366,846円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593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）	656,310,207円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	415,092,606円
コア投資戦略ファンド（切替型）	573,424,327円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,038,803円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,509,866円
SMT インデックスバランス・オープン	49,886,896円
国内株式SMTBセクション（SMA専用）	15,602,036,566円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	194,507,065円

区分	2024年 5月24日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,539,184円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	241,070,266円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	39,389,912円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,013,629円
グローバル経済コア	271,400,278円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,032,501円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,171,825,359円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,437,400円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	485,317,449円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	123,670,049円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	63,754,015円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	62,440,897円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	27,132,687円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	34,024,311円
10資産分散投資ファンド	113,723,354円
グローバル10資産バランスファンド	32,972,273円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	32,694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	35,914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	38,209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	38,209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	32,814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	20,588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	18,210円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	14,076円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	41,300,971,907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）	243,870,644円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	290,896,491円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,271,837円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	156,681,751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）	49,016,101,716円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,809,867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）	201,941,213円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		135,953,942,188
合計		135,953,942,188

(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 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,167,271,200	-	10,227,660,000	60,388,800
合計		10,167,271,200	-	10,227,660,000	60,388,800

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,800	3,710.00	36,358,000	
ニッスイ	236,400	916.70	216,707,880	
マルハニチロ	35,100	3,260.00	114,426,000	
雪国まいたけ	20,100	989.00	19,878,900	
カネコ種苗	6,700	1,436.00	9,621,200	
サカタのタネ	26,900	3,460.00	93,074,000	
ホクト	18,900	1,839.00	34,757,100	
ホクリヨウ	1,300	997.00	1,296,100	
住石ホールディングス	30,100	1,460.00	43,946,000	
日鉄鉱業	9,500	5,240.00	49,780,000	
三井松島ホールディングス	14,000	4,560.00	63,840,000	
I N P E X	794,000	2,371.00	1,882,574,000	
石油資源開発	27,400	6,530.00	178,922,000	
K & O エナジーグループ	10,700	3,620.00	38,734,000	
ショーボンドホールディングス	32,200	6,111.00	196,774,200	
ミライト・ワン	71,400	1,872.50	133,696,500	
タマホーム	14,900	4,545.00	67,720,500	
サンヨーホームズ	900	732.00	658,800	
日本アクア	3,300	889.00	2,933,700	
ファーストコーポレーション	2,300	810.00	1,863,000	
ベステラ	1,900	951.00	1,806,900	
キャンディル	1,400	598.00	837,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,600	986.00	1,577,600	
第一カッター興業	6,800	1,492.00	10,145,600	
安藤・間	137,000	1,138.00	155,906,000	
東急建設	74,100	766.00	56,760,600	
コムシスホールディングス	75,500	3,167.00	239,108,500	
ビーアールホールディングス	34,700	357.00	12,387,900	
高松コンストラクショングループ	17,600	2,789.00	49,086,400	
東建コーポレーション	5,900	10,600.00	62,540,000	
ソネック	800	932.00	745,600	
ヤマウラ	12,000	1,292.00	15,504,000	
オリエンタル白石	87,500	359.00	31,412,500	
大成建設	151,500	5,837.00	884,305,500	
大林組	591,400	1,807.00	1,068,659,800	

清水建設	468,900	883.30	414,179,370	
飛島建設	17,000	1,481.00	25,177,000	
長谷工コーポレーション	151,700	1,790.00	271,543,000	
松井建設	15,400	785.00	12,089,000	
銭高組	800	4,405.00	3,524,000	
鹿島建設	366,700	2,626.00	962,954,200	
不動テトラ	11,400	2,505.00	28,557,000	
大末建設	2,200	1,756.00	3,863,200	
鉄建建設	11,900	2,600.00	30,940,000	
西松建設	31,500	4,410.00	138,915,000	
三井住友建設	123,100	389.00	47,885,900	
大豊建設	5,700	3,360.00	19,152,000	
佐田建設	3,500	749.00	2,621,500	
ナカノフドー建設	3,900	516.00	2,012,400	
奥村組	26,800	4,855.00	130,114,000	
東鉄工業	20,500	3,080.00	63,140,000	
イチケン	1,400	2,517.00	3,523,800	
富士ピー・エス	2,400	442.00	1,060,800	
浅沼組	12,200	3,635.00	44,347,000	
戸田建設	223,800	1,075.00	240,585,000	
熊谷組	27,300	3,545.00	96,778,500	
北野建設	1,000	3,665.00	3,665,000	
植木組	1,600	1,650.00	2,640,000	
矢作建設工業	22,500	1,551.00	34,897,500	
ピーエス三菱	21,000	1,027.00	21,567,000	
日本ハウスホールディングス	35,300	312.00	11,013,600	
新日本建設	23,200	1,549.00	35,936,800	
東亜道路工業	32,900	1,211.00	39,841,900	
日本道路	19,400	1,737.00	33,697,800	
東亜建設工業	51,100	958.00	48,953,800	
日本国土開発	47,000	498.00	23,406,000	
若築建設	5,700	3,350.00	19,095,000	
東洋建設	41,700	1,396.00	58,213,200	
五洋建設	234,500	633.30	148,508,850	
世紀東急工業	21,200	1,670.00	35,404,000	
福田組	6,200	5,470.00	33,914,000	
住友林業	142,900	5,588.00	798,525,200	
日本基礎技術	3,300	590.00	1,947,000	
巴コーポレーション	6,900	771.00	5,319,900	
大和ハウス工業	457,300	4,154.00	1,899,624,200	
ライト工業	32,900	2,016.00	66,326,400	
積水ハウス	501,600	3,540.00	1,775,664,000	

日特建設	15,800	1,090.00	17,222,000
北陸電気工事	11,300	1,072.00	12,113,600
ユアテック	36,400	1,629.00	59,295,600
日本リーテック	12,900	1,171.00	15,105,900
四電工	6,900	3,525.00	24,322,500
中電工	25,700	3,160.00	81,212,000
関電工	103,600	1,719.00	178,088,400
きんでん	115,000	3,096.00	356,040,000
東京エネシス	15,400	1,354.00	20,851,600
トーエネック	5,500	5,090.00	27,995,000
住友電設	15,700	3,500.00	54,950,000
日本電設工業	31,000	1,940.00	60,140,000
エクシオグループ	161,600	1,613.50	260,741,600
新日本空調	10,700	4,180.00	44,726,000
九電工	35,700	6,060.00	216,342,000
三機工業	35,700	2,154.00	76,897,800
日揮ホールディングス	163,600	1,275.50	208,671,800
中外炉工業	5,400	3,135.00	16,929,000
ヤマト	4,600	1,136.00	5,225,600
太平電業	10,300	4,755.00	48,976,500
高砂熱学工業	44,300	5,730.00	253,839,000
三晃金属工業	700	4,450.00	3,115,000
朝日工業社	15,400	1,389.00	21,390,600
明星工業	32,000	1,320.00	42,240,000
大気社	19,100	4,945.00	94,449,500
ダイダン	21,700	3,175.00	68,897,500
日比谷総合設備	12,000	3,045.00	36,540,000
フィル・カンパニー	2,600	580.00	1,508,000
テスホールディングス	35,600	394.00	14,026,400
インフロニア・ホールディングス	190,600	1,373.50	261,789,100
東洋エンジニアリング	24,300	986.00	23,959,800
レイズネクスト	23,900	1,833.00	43,808,700
ニッポン	49,700	2,288.00	113,713,600
日清製粉グループ本社	153,500	1,747.50	268,241,250
日東富士製粉	3,000	6,220.00	18,660,000
昭和産業	16,100	3,155.00	50,795,500
鳥越製粉	4,900	679.00	3,327,100
中部飼料	23,000	1,522.00	35,006,000
フィード・ワン	24,300	926.00	22,501,800
東洋精糖	1,000	1,709.00	1,709,000
日本甜菜製糖	9,700	1,982.00	19,225,400
D M三井製糖ホールディングス	16,500	3,245.00	53,542,500

塩水港精糖	7,200	285.00	2,052,000
ウェルネオシュガー	8,300	2,369.00	19,662,700
森永製菓	70,700	2,473.50	174,876,450
中村屋	4,100	3,285.00	13,468,500
江崎グリコ	47,500	4,040.00	191,900,000
名糖産業	6,500	1,806.00	11,739,000
井村屋グループ	9,900	2,523.00	24,977,700
不二家	11,400	2,484.00	28,317,600
山崎製パン	111,100	3,490.00	387,739,000
第一屋製パン	1,000	620.00	620,000
モロゾフ	5,400	4,275.00	23,085,000
亀田製菓	9,500	4,000.00	38,000,000
寿スピリッツ	78,500	1,769.00	138,866,500
カルビー	76,000	3,105.00	235,980,000
森永乳業	58,000	3,238.00	187,804,000
六甲バター	12,200	1,457.00	17,775,400
ヤクルト本社	237,300	2,911.00	690,780,300
明治ホールディングス	203,500	3,501.00	712,453,500
雪印メグミルク	40,200	2,562.00	102,992,400
プリマハム	22,300	2,409.00	53,720,700
日本ハム	71,400	4,891.00	349,217,400
林兼産業	1,800	516.00	928,800
丸大食品	16,700	1,672.00	27,922,400
S Foods	18,300	2,929.00	53,600,700
柿安本店	6,500	2,626.00	17,069,000
伊藤ハム米久ホールディングス	25,400	4,175.00	106,045,000
サッポロホールディングス	54,700	5,200.00	284,440,000
アサヒグループホールディングス	383,600	5,840.00	2,240,224,000
キリンホールディングス	691,600	2,202.50	1,523,249,000
宝ホールディングス	111,900	1,068.00	119,509,200
オエノンホールディングス	49,600	360.00	17,856,000
養命酒製造	5,500	2,271.00	12,490,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	130,100	1,837.00	238,993,700
ライフドリンク カンパニー	3,300	5,550.00	18,315,000
サントリー食品インターナショナル	116,900	5,679.00	663,875,100
ダイドーグループホールディングス	18,800	2,670.00	50,196,000
伊藤園	56,300	3,740.00	210,562,000
キーコーヒー	18,600	2,038.00	37,906,800
ユニカフェ	1,800	914.00	1,645,200
ジャパンフーズ	900	1,989.00	1,790,100
日清オイリオグループ	23,400	4,915.00	115,011,000
不二製油グループ本社	38,700	2,388.00	92,415,600

かどや製油	700	3,615.00	2,530,500
J - オイルミルズ	19,000	1,922.00	36,518,000
キッコーマン	550,100	1,824.50	1,003,657,450
味の素	394,500	5,930.00	2,339,385,000
ブルドックソース	8,800	1,973.00	17,362,400
キューピー	89,200	3,078.00	274,557,600
ハウス食品グループ本社	57,200	2,926.00	167,367,200
カゴメ	71,400	3,696.00	263,894,400
アリアケジャパン	16,600	5,220.00	86,652,000
ピエトロ	800	1,791.00	1,432,800
エバラ食品工業	4,000	2,822.00	11,288,000
やまみ	800	3,005.00	2,404,000
ニチレイ	76,100	3,611.00	274,797,100
東洋水産	83,900	11,140.00	934,646,000
イトアンドホールディングス	7,900	2,039.00	16,108,100
大冷	800	1,907.00	1,525,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,600	1,496.00	11,369,600
日清食品ホールディングス	175,100	4,022.00	704,252,200
永谷園ホールディングス	8,100	2,199.00	17,811,900
一正蒲鉾	2,400	770.00	1,848,000
フジッコ	17,100	1,852.00	31,669,200
ロック・フィールド	20,300	1,481.00	30,064,300
日本たばこ産業	1,008,900	4,456.00	4,495,658,400
ケンコーマヨネーズ	11,400	1,891.00	21,557,400
わらべや日洋ホールディングス	11,100	2,321.00	25,763,100
なとり	10,400	2,105.00	21,892,000
イフジ産業	1,100	1,316.00	1,447,600
ファーマフーズ	23,700	861.00	20,405,700
ユーグレナ	103,300	532.00	54,955,600
紀文食品	14,400	1,188.00	17,107,200
ピクルスホールディングス	9,700	1,157.00	11,222,900
ミヨシ油脂	2,100	1,345.00	2,824,500
理研ビタミン	14,300	2,536.00	36,264,800
片倉工業	15,800	1,928.00	30,462,400
ゲンゼ	12,100	5,170.00	62,557,000
東洋紡	73,300	1,050.00	76,965,000
ユニチカ	57,200	236.00	13,499,200
富士紡ホールディングス	7,500	4,605.00	34,537,500
倉敷紡績	12,100	4,375.00	52,937,500
シキボウ	10,100	1,086.00	10,968,600
日本毛織	43,600	1,314.00	57,290,400
トーア紡コーポレーション	2,200	436.00	959,200

帝国繊維	19,200	2,311.00	44,371,200
帝人	162,500	1,532.00	248,950,000
東レ	1,132,200	775.10	877,568,220
住江織物	1,200	2,563.00	3,075,600
日本フェルト	4,000	462.00	1,848,000
イチカワ	900	1,684.00	1,515,600
日東製網	600	1,454.00	872,400
アツギ	4,000	636.00	2,544,000
ダイニック	1,800	807.00	1,452,600
セーレン	32,800	2,440.00	80,032,000
ソトー	1,900	712.00	1,352,800
東海染工	600	845.00	507,000
小松マテーレ	24,600	713.00	17,539,800
ワコールホールディングス	34,600	3,790.00	131,134,000
ホギメディカル	22,300	3,930.00	87,639,000
T S Iホールディングス	55,000	883.00	48,565,000
マツオカコーポレーション	1,800	1,546.00	2,782,800
ワールド	23,900	2,067.00	49,401,300
三陽商会	7,200	2,588.00	18,633,600
ナイガイ	2,100	261.00	548,100
オンワードホールディングス	99,700	607.00	60,517,900
ルックホールディングス	5,000	2,741.00	13,705,000
ゴールドウイン	29,900	8,219.00	245,748,100
デサント	29,100	3,285.00	95,593,500
キング	2,200	666.00	1,465,200
ヤマトインターナショナル	4,600	343.00	1,577,800
特種東海製紙	9,200	3,450.00	31,740,000
王子ホールディングス	703,600	622.10	437,709,560
日本製紙	95,300	967.00	92,155,100
三菱製紙	7,600	735.00	5,586,000
北越コーポレーション	83,000	1,108.00	91,964,000
中越パルプ工業	2,300	1,582.00	3,638,600
大王製紙	74,600	898.00	66,990,800
阿波製紙	1,500	483.00	724,500
レンゴー	153,800	1,095.50	168,487,900
トモク	9,800	2,811.00	27,547,800
ザ・バック	12,500	3,855.00	48,187,500
北の達人コーポレーション	71,200	166.00	11,819,200
クラレ	246,100	1,912.50	470,666,250
旭化成	1,142,600	1,044.50	1,193,445,700
共和レザー	3,200	731.00	2,339,200
巴川コーポレーション	1,600	973.00	1,556,800

レゾナック・ホールディングス	163,200	3,441.00	561,571,200
住友化学	1,253,400	320.40	401,589,360
住友精化	7,900	5,080.00	40,132,000
日産化学	78,900	4,468.00	352,525,200
ラサ工業	6,500	3,040.00	19,760,000
クレハ	36,900	2,853.00	105,275,700
多木化学	6,600	3,895.00	25,707,000
テイカ	14,400	1,650.00	23,760,000
石原産業	28,000	1,645.00	46,060,000
片倉コープアグリ	1,300	1,160.00	1,508,000
日本曹達	19,900	5,160.00	102,684,000
東ソー	225,500	1,957.50	441,416,250
トクヤマ	54,500	3,076.00	167,642,000
セントラル硝子	18,000	3,590.00	64,620,000
東亜合成	81,200	1,539.50	125,007,400
大阪ソーダ	11,800	8,540.00	100,772,000
関東電化工業	32,700	861.00	28,154,700
デンカ	61,400	2,223.50	136,522,900
信越化学工業	1,514,600	5,914.00	8,957,344,400
日本カーバイド工業	8,000	1,846.00	14,768,000
堺化学工業	12,900	2,682.00	34,597,800
第一稀元素化学工業	18,500	866.00	16,021,000
エア・ウォーター	159,400	2,237.00	356,577,800
日本酸素ホールディングス	163,900	4,510.00	739,189,000
日本化学工業	6,200	2,386.00	14,793,200
東邦アセチレン	5,900	361.00	2,129,900
日本パーカラライジング	75,300	1,172.00	88,251,600
高压ガス工業	24,500	900.00	22,050,000
チタン工業	700	1,014.00	709,800
四国化成ホールディングス	21,500	1,953.00	41,989,500
戸田工業	3,800	1,781.00	6,767,800
ステラ ケミファ	9,200	4,215.00	38,778,000
保土谷化学工業	5,300	4,880.00	25,864,000
日本触媒	98,400	1,596.50	157,095,600
大日精化工業	11,700	3,155.00	36,913,500
カネカ	42,700	4,039.00	172,465,300
三菱瓦斯化学	123,300	2,977.00	367,064,100
三井化学	139,300	4,623.00	643,983,900
東京応化工業	80,600	4,204.00	338,842,400
大阪有機化学工業	14,100	3,480.00	49,068,000
三菱ケミカルグループ	1,234,700	812.80	1,003,564,160
KHネオケム	25,800	2,191.00	56,527,800

ダイセル	217,100	1,565.50	339,870,050
住友ベークライト	47,300	4,263.00	201,639,900
積水化学工業	339,400	2,225.00	755,165,000
日本ゼオン	115,800	1,437.00	166,404,600
アイカ工業	42,600	3,421.00	145,734,600
U B E	80,400	2,917.50	234,567,000
積水樹脂	25,200	2,305.00	58,086,000
タキロンシーアイ	43,100	741.00	31,937,100
旭有機材	11,200	4,590.00	51,408,000
ニチバン	9,200	1,780.00	16,376,000
リケンテクノス	31,700	1,026.00	32,524,200
大倉工業	7,800	2,994.00	23,353,200
積水化成成品工業	23,700	446.00	10,570,200
群栄化学工業	4,000	3,105.00	12,420,000
タイガースポリマー	2,600	826.00	2,147,600
ミライアル	1,900	1,546.00	2,937,400
ダイキアクシス	2,300	740.00	1,702,000
ダイキョーニシカワ	37,300	696.00	25,960,800
竹本容器	2,100	853.00	1,791,300
森六ホールディングス	8,800	2,679.00	23,575,200
恵和	12,200	1,494.00	18,226,800
日本化薬	129,000	1,259.00	162,411,000
カーリットホールディングス	18,200	1,196.00	21,767,200
日本精化	11,200	2,588.00	28,985,600
扶桑化学工業	17,900	3,950.00	70,705,000
トリケミカル研究所	20,500	4,440.00	91,020,000
A D E K A	58,900	3,251.00	191,483,900
日油	152,900	2,004.50	306,488,050
新日本理化	7,700	187.00	1,439,900
ハリマ化成グループ	11,800	879.00	10,372,200
花王	381,900	6,889.00	2,630,909,100
第一工業製薬	6,700	3,750.00	25,125,000
石原ケミカル	7,600	1,845.00	14,022,000
日華化学	2,200	1,121.00	2,466,200
ニイタカ	1,100	1,918.00	2,109,800
三洋化成工業	10,400	4,065.00	42,276,000
有機合成薬品工業	4,500	307.00	1,381,500
大日本塗料	18,700	1,183.00	22,122,100
日本ペイントホールディングス	896,800	1,070.00	959,576,000
関西ペイント	146,000	2,214.50	323,317,000
神東塗料	4,700	126.00	592,200
中国塗料	34,700	2,049.00	71,100,300

日本特殊塗料	4,000	1,279.00	5,116,000
藤倉化成	19,500	511.00	9,964,500
太陽ホールディングス	29,400	3,130.00	92,022,000
D I C	66,000	3,292.00	217,272,000
サカタインクス	37,600	1,757.00	66,063,200
a r t i e n c e	36,800	3,430.00	126,224,000
富士フィルムホールディングス	941,200	3,468.00	3,264,081,600
資生堂	353,100	5,018.00	1,771,855,800
ライオン	215,200	1,257.00	270,506,400
高砂香料工業	12,700	3,690.00	46,863,000
マンダム	36,500	1,212.00	44,238,000
ミルボン	23,000	3,417.00	78,591,000
ファンケル	74,000	1,969.00	145,706,000
コーセー	34,400	9,881.00	339,906,400
コタ	17,100	1,438.00	24,589,800
シーボン	800	1,392.00	1,113,600
ポーラ・オルビスホールディングス	86,700	1,342.50	116,394,750
ノエビアホールディングス	15,100	5,340.00	80,634,000
アジュバンホールディングス	1,400	849.00	1,188,600
新日本製薬	9,600	1,703.00	16,348,800
I - n e	4,500	1,485.00	6,682,500
アクシージア	11,100	979.00	10,866,900
エステー	13,100	1,527.00	20,003,700
アグロ カネショウ	6,800	1,122.00	7,629,600
コニシ	48,800	1,282.00	62,561,600
長谷川香料	32,300	3,065.00	98,999,500
小林製薬	49,200	5,736.00	282,211,200
荒川化学工業	14,300	1,096.00	15,672,800
メック	13,900	4,495.00	62,480,500
日本高純度化学	3,800	3,300.00	12,540,000
タカラバイオ	45,600	1,021.00	46,557,600
J C U	18,700	3,745.00	70,031,500
新田ゼラチン	3,800	799.00	3,036,200
O A T アグリオ	6,300	1,531.00	9,645,300
デクセリアルズ	42,200	6,466.00	272,865,200
アース製薬	15,400	4,695.00	72,303,000
北興化学工業	17,000	1,528.00	25,976,000
大成ラミック	4,900	2,786.00	13,651,400
クミアイ化学工業	67,200	789.00	53,020,800
日本農薬	31,000	735.00	22,785,000
アキレス	10,700	1,600.00	17,120,000
有沢製作所	29,600	1,512.00	44,755,200

日東電工	108,600	12,105.00	1,314,603,000
レック	21,700	1,206.00	26,170,200
三光合成	21,300	684.00	14,569,200
きもと	9,300	210.00	1,953,000
藤森工業	13,400	4,150.00	55,610,000
前澤化成工業	10,900	1,778.00	19,380,200
未来工業	6,100	3,930.00	23,973,000
ウェーブロックホールディングス	2,100	643.00	1,350,300
J S P	11,900	2,122.00	25,251,800
エフピコ	32,000	2,556.00	81,792,000
天馬	12,300	2,349.00	28,892,700
信越ポリマー	36,500	1,538.00	56,137,000
東リ	12,400	398.00	4,935,200
ニフコ	50,600	3,553.00	179,781,800
バルカー	14,100	3,780.00	53,298,000
ユニ・チャーム	352,300	5,002.00	1,762,204,600
ショーエイコーポレーション	1,800	585.00	1,053,000
協和キリン	204,300	2,568.00	524,642,400
武田薬品工業	1,496,700	4,134.00	6,187,357,800
アステラス製薬	1,483,400	1,565.50	2,322,262,700
住友ファーマ	125,400	300.00	37,620,000
塩野義製薬	213,200	6,921.00	1,475,557,200
わかもと製薬	5,900	244.00	1,439,600
日本新薬	44,300	3,518.00	155,847,400
中外製薬	529,400	4,748.00	2,513,591,200
科研製薬	29,000	3,462.00	100,398,000
エーザイ	205,700	6,764.00	1,391,354,800
ロート製薬	163,800	2,753.00	450,941,400
小野薬品工業	345,900	2,246.00	776,891,400
久光製薬	37,600	3,735.00	140,436,000
持田製薬	19,300	2,955.00	57,031,500
参天製薬	298,400	1,550.50	462,669,200
扶桑薬品工業	6,000	2,280.00	13,680,000
日本ケミファ	600	1,575.00	945,000
ツムラ	53,200	3,867.00	205,724,400
キッセイ薬品工業	28,000	3,205.00	89,740,000
生化学工業	28,700	777.00	22,299,900
栄研化学	30,300	2,038.00	61,751,400
鳥居薬品	9,100	3,740.00	34,034,000
J C R ファーマ	57,200	563.00	32,203,600
東和薬品	26,000	2,814.00	73,164,000
富士製薬工業	12,500	1,477.00	18,462,500

ゼリア新薬工業	23,400	1,953.00	45,700,200
ネクセラファーマ	74,000	1,414.00	104,636,000
第一三共	1,473,300	5,444.00	8,020,645,200
杏林製薬	36,700	1,702.00	62,463,400
大幸薬品	35,100	376.00	13,197,600
ダイト	12,900	2,254.00	29,076,600
大塚ホールディングス	351,700	6,184.00	2,174,912,800
ペプチドリーム	82,000	1,936.50	158,793,000
セルソース	6,200	1,330.00	8,246,000
あすか製薬ホールディングス	17,300	2,278.00	39,409,400
サワイグループホールディングス	38,700	5,830.00	225,621,000
日本コークス工業	171,600	130.00	22,308,000
ニチレキ	22,000	2,409.00	52,998,000
ユシロ化学工業	8,800	1,731.00	15,232,800
ビーピー・カストロール	2,200	976.00	2,147,200
富士石油	49,300	470.00	23,171,000
MORESCO	2,000	1,301.00	2,602,000
出光興産	878,100	1,016.50	892,588,650
ENEOSホールディングス	2,677,300	772.60	2,068,481,980
コスモエネルギーホールディングス	50,100	7,314.00	366,431,400
横浜ゴム	85,500	4,007.00	342,598,500
TOYO TIRE	97,200	2,721.50	264,529,800
ブリヂストン	495,000	6,853.00	3,392,235,000
住友ゴム工業	165,900	1,761.00	292,149,900
藤倉コンポジット	14,600	1,330.00	19,418,000
オカモト	8,000	4,625.00	37,000,000
フコク	8,900	1,940.00	17,266,000
ニッタ	17,200	3,980.00	68,456,000
住友理工	26,200	1,230.00	32,226,000
三ツ星ベルト	19,600	4,410.00	86,436,000
バンドー化学	25,100	1,806.00	45,330,600
日東紡績	21,400	6,850.00	146,590,000
A G C	150,800	5,480.00	826,384,000
日本板硝子	80,700	458.00	36,960,600
石塚硝子	1,000	2,860.00	2,860,000
日本山村硝子	2,200	1,724.00	3,792,800
日本電気硝子	69,100	3,610.00	249,451,000
オハラ	8,100	1,364.00	11,048,400
住友大阪セメント	28,200	3,818.00	107,667,600
太平洋セメント	100,000	3,893.00	389,300,000
日本ヒューム	14,900	1,075.00	16,017,500
日本コンクリート工業	33,000	360.00	11,880,000

三谷セキサン	7,100	5,150.00	36,565,000
アジアパイルホールディングス	24,100	1,011.00	24,365,100
東海カーボン	156,100	982.90	153,430,690
日本カーボン	9,000	5,390.00	48,510,000
東洋炭素	11,900	7,110.00	84,609,000
ノリタケカンパニーリミテド	18,700	4,035.00	75,454,500
TOTO	111,600	3,982.00	444,391,200
日本碍子	196,700	2,072.00	407,562,400
日本特殊陶業	141,600	4,621.00	654,333,600
MARUWA	6,200	35,550.00	220,410,000
品川リフラクトリーズ	20,900	1,925.00	40,232,500
黒崎播磨	13,800	3,105.00	42,849,000
ヨータイ	10,500	1,750.00	18,375,000
東京窯業	6,200	436.00	2,703,200
ニッカトー	2,700	571.00	1,541,700
フジインコーポレーテッド	45,500	3,070.00	139,685,000
クニミネ工業	1,700	1,121.00	1,905,700
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,402.00	1,682,400
ニチアス	42,800	4,480.00	191,744,000
ニチハ	21,200	3,480.00	73,776,000
日本製鉄	779,200	3,336.00	2,599,411,200
神戸製鋼所	349,900	1,960.00	685,804,000
中山製鋼所	39,800	973.00	38,725,400
合同製鐵	9,700	5,420.00	52,574,000
JFEホールディングス	483,900	2,284.50	1,105,469,550
東京製鐵	48,900	1,612.00	78,826,800
共英製鋼	19,800	2,116.00	41,896,800
大和工業	32,800	8,160.00	267,648,000
東京鐵鋼	7,700	5,030.00	38,731,000
大阪製鐵	8,000	2,562.00	20,496,000
淀川製鋼所	19,800	5,620.00	111,276,000
中部鋼鈹	11,400	2,683.00	30,586,200
丸一鋼管	53,000	3,751.00	198,803,000
モリ工業	3,800	5,370.00	20,406,000
大同特殊鋼	109,600	1,583.00	173,496,800
日本高周波鋼業	2,300	449.00	1,032,700
日本冶金工業	12,700	4,915.00	62,420,500
山陽特殊製鋼	17,200	2,212.00	38,046,400
愛知製鋼	10,000	3,700.00	37,000,000
日本金属	1,500	782.00	1,173,000
大太平洋金属	14,800	1,268.00	18,766,400
新日本電工	86,600	281.00	24,334,600

栗本鐵工所	8,100	4,730.00	38,313,000
虹技	800	1,160.00	928,000
三菱製鋼	12,900	1,523.00	19,646,700
日亜鋼業	5,900	310.00	1,829,000
日本精線	13,800	1,249.00	17,236,200
エンビプロ・ホールディングス	15,000	501.00	7,515,000
シンニッタン	7,300	231.00	1,686,300
新家工業	1,300	5,080.00	6,604,000
大紀アルミニウム工業所	22,000	1,277.00	28,094,000
日本軽金属ホールディングス	50,800	1,863.00	94,640,400
三井金属鉱業	50,600	5,055.00	255,783,000
三菱マテリアル	124,400	3,010.00	374,444,000
住友金属鉱山	201,700	5,196.00	1,048,033,200
D O W A ホールディングス	43,000	5,818.00	250,174,000
古河機械金属	23,000	1,954.00	44,942,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,200	2,315.00	69,913,000
東邦チタニウム	36,000	1,117.00	40,212,000
U A C J	24,400	4,185.00	102,114,000
C K サンエツ	4,200	3,705.00	15,561,000
古河電気工業	57,900	3,761.00	217,761,900
住友電気工業	650,800	2,372.50	1,544,023,000
フジクラ	205,200	3,205.00	657,666,000
S W C C	19,400	4,575.00	88,755,000
タツタ電線	31,900	716.00	22,840,400
カナレ電気	1,000	1,553.00	1,553,000
平河ヒューテック	11,100	1,353.00	15,018,300
リョービ	18,500	2,521.00	46,638,500
アーレスティ	6,300	684.00	4,309,200
A R E ホールディングス	65,400	2,019.00	132,042,600
稲葉製作所	9,700	1,861.00	18,051,700
宮地エンジニアリンググループ	8,700	4,610.00	40,107,000
トーカロ	50,200	1,924.00	96,584,800
アルファC o	2,100	1,378.00	2,893,800
S U M C O	309,100	2,362.50	730,248,750
川田テクノロジーズ	12,300	2,718.00	33,431,400
R S T e c h n o l o g i e s	11,600	3,155.00	36,598,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,702.00	1,702,000
信和	3,700	736.00	2,723,200
東洋製罐グループホールディングス	99,800	2,547.00	254,190,600
ホッカフホールディングス	8,500	1,641.00	13,948,500
コロナ	9,700	916.00	8,885,200
横河ブリッジホールディングス	27,200	2,743.00	74,609,600

駒井ハルテック	1,000	1,765.00	1,765,000
高田機工	400	3,610.00	1,444,000
三和ホールディングス	174,800	2,949.00	515,485,200
文化シャッター	45,500	1,735.00	78,942,500
三協立山	21,900	850.00	18,615,000
アルインコ	13,300	1,079.00	14,350,700
東洋シャッター	1,300	894.00	1,162,200
LIXIL	271,700	1,750.50	475,610,850
日本フィルコン	3,800	553.00	2,101,400
ノーリツ	27,600	1,758.00	48,520,800
長府製作所	17,300	2,197.00	38,008,100
リンナイ	83,200	3,776.00	314,163,200
ダイニチ工業	2,900	675.00	1,957,500
日東精工	25,200	586.00	14,767,200
三洋工業	700	3,035.00	2,124,500
岡部	31,100	773.00	24,040,300
ジーテクト	22,200	1,895.00	42,069,000
東プレ	30,700	2,251.00	69,105,700
高周波熱錬	25,800	1,076.00	27,760,800
東京製綱	11,300	1,303.00	14,723,900
サンコール	17,100	440.00	7,524,000
モリテック スチール	5,100	237.00	1,208,700
パイオラックス	21,600	2,198.00	47,476,800
エイチワン	17,900	842.00	15,071,800
日本発條	153,900	1,827.50	281,252,250
中央発條	12,900	1,052.00	13,570,800
アドバネクス	700	1,099.00	769,300
立川ブラインド工業	7,900	1,357.00	10,720,300
三益半導体工業	15,700	3,710.00	58,247,000
日本ドライケミカル	1,400	2,605.00	3,647,000
日本製鋼所	46,900	4,625.00	216,912,500
三浦工業	71,100	2,850.50	202,670,550
タクマ	57,600	1,644.00	94,694,400
ツガミ	37,900	1,465.00	55,523,500
オークマ	14,900	6,923.00	103,152,700
芝浦機械	17,000	3,575.00	60,775,000
アマダ	258,100	1,780.50	459,547,050
アイダエンジニアリング	39,500	913.00	36,063,500
F U J I	80,200	2,536.00	203,387,200
牧野フライス製作所	18,800	6,640.00	124,832,000
オーエスジー	75,100	1,989.00	149,373,900
ダイジェット工業	600	846.00	507,600

旭ダイヤモンド工業	39,300	880.00	34,584,000
D M G 森精機	105,700	4,378.00	462,754,600
ソディック	41,500	715.00	29,672,500
ディスコ	82,000	61,500.00	5,043,000,000
日東工器	8,300	2,273.00	18,865,900
日進工具	15,800	963.00	15,215,400
パンチ工業	5,600	460.00	2,576,000
富士ダイス	11,100	778.00	8,635,800
豊和工業	3,100	822.00	2,548,200
リケンN P R	18,500	2,731.00	50,523,500
東洋機械金属	4,700	720.00	3,384,000
エンシュウ	1,400	696.00	974,400
島精機製作所	27,100	1,449.00	39,267,900
オプトラン	28,000	2,114.00	59,192,000
N C ホールディングス	1,300	1,449.00	1,883,700
イワキポンプ	11,400	2,207.00	25,159,800
フリュー	16,100	1,013.00	16,309,300
ヤマシンフィルタ	40,600	365.00	14,819,000
日阪製作所	18,600	1,029.00	19,139,400
やまびこ	27,800	2,083.00	57,907,400
野村マイクロ・サイエンス	23,100	4,900.00	113,190,000
平田機工	8,100	7,050.00	57,105,000
P E G A S U S	18,900	524.00	9,903,600
マルマエ	7,400	2,050.00	15,170,000
タツモ	10,300	3,600.00	37,080,000
ナプテスコ	106,900	2,684.50	286,973,050
三井海洋開発	21,600	2,725.00	58,860,000
レオン自動機	19,700	1,594.00	31,401,800
S M C	51,000	81,900.00	4,176,900,000
ホソカワミクロン	11,900	4,285.00	50,991,500
ユニオンツール	7,500	5,370.00	40,275,000
瑞光	12,300	1,096.00	13,480,800
オイレス工業	23,100	2,169.00	50,103,900
日精エー・エス・ビー機械	6,800	5,140.00	34,952,000
サトーホールディングス	24,200	2,100.00	50,820,000
技研製作所	16,000	1,840.00	29,440,000
日本エアーテック	8,000	1,165.00	9,320,000
カワタ	1,800	902.00	1,623,600
日精樹脂工業	12,700	1,033.00	13,119,100
オカダアイヨン	1,900	2,445.00	4,645,500
ワイエイシイホールディングス	7,200	2,301.00	16,567,200
小松製作所	798,300	4,595.00	3,668,188,500

住友重機械工業	100,800	4,205.00	423,864,000
日立建機	67,800	4,346.00	294,658,800
日工	25,300	720.00	18,216,000
巴工業	6,700	4,215.00	28,240,500
井関農機	16,000	1,011.00	16,176,000
TOWA	19,000	13,530.00	257,070,000
丸山製作所	1,000	2,356.00	2,356,000
北川鉄工所	6,700	1,371.00	9,185,700
ローツェ	8,900	30,500.00	271,450,000
タカキタ	1,900	473.00	898,700
クボタ	890,400	2,267.50	2,018,982,000
荏原実業	9,000	3,445.00	31,005,000
三菱化工機	6,000	4,170.00	25,020,000
月島ホールディングス	23,100	1,386.00	32,016,600
帝国電機製作所	11,700	2,283.00	26,711,100
新東工業	34,500	1,109.00	38,260,500
澁谷工業	16,000	3,725.00	59,600,000
アイチ コーポレーション	23,700	1,147.00	27,183,900
小森コーポレーション	42,000	1,243.00	52,206,000
鶴見製作所	13,000	3,960.00	51,480,000
日本ギア工業	2,200	530.00	1,166,000
酒井重工業	3,000	5,700.00	17,100,000
荏原製作所	69,900	12,235.00	855,226,500
石井鐵工所	700	2,791.00	1,953,700
西島製作所	14,700	3,260.00	47,922,000
北越工業	17,100	2,078.00	35,533,800
ダイキン工業	203,300	23,940.00	4,867,002,000
オルガノ	20,500	8,380.00	171,790,000
トーヨーカネツ	5,800	3,905.00	22,649,000
栗田工業	95,300	6,805.00	648,516,500
椿本チエイン	24,000	5,870.00	140,880,000
大同工業	2,500	802.00	2,005,000
木村化工機	13,100	696.00	9,117,600
アネスト岩田	26,300	1,324.00	34,821,200
ダイフク	287,400	2,868.50	824,406,900
サムコ	4,600	4,490.00	20,654,000
加藤製作所	2,900	1,329.00	3,854,100
油研工業	1,000	2,380.00	2,380,000
タダノ	98,000	1,108.00	108,584,000
フジテック	39,800	4,233.00	168,473,400
C K D	47,100	3,150.00	148,365,000
平和	50,400	1,999.00	100,749,600

理想科学工業	13,600	3,145.00	42,772,000
SANKYO	164,000	1,490.50	244,442,000
日本金銭機械	20,600	1,157.00	23,834,200
マースグループホールディングス	8,600	3,415.00	29,369,000
フクシマガリレイ	11,100	6,090.00	67,599,000
オーイズミ	2,200	353.00	776,600
ダイコク電機	8,400	3,405.00	28,602,000
竹内製作所	30,900	6,100.00	188,490,000
アマノ	48,300	3,734.00	180,352,200
JUKI	26,400	506.00	13,358,400
ジャノメ	17,300	673.00	11,642,900
マックス	24,000	3,605.00	86,520,000
グローリー	40,900	2,749.00	112,434,100
新晃工業	17,200	4,260.00	73,272,000
大和冷機工業	26,100	1,427.00	37,244,700
セガサミーホールディングス	152,100	2,207.50	335,760,750
TPR	21,600	2,323.00	50,176,800
ツバキ・ナカシマ	34,100	775.00	26,427,500
ホシザキ	100,500	5,526.00	555,363,000
大豊工業	14,800	833.00	12,328,400
日本精工	315,300	761.80	240,195,540
NTN	369,400	302.10	111,595,740
ジェイテクト	151,600	1,154.00	174,946,400
不二越	12,600	3,470.00	43,722,000
日本トムソン	46,400	610.00	28,304,000
THK	98,300	3,083.00	303,058,900
ユーシン精機	13,500	734.00	9,909,000
前澤給装工業	12,200	1,355.00	16,531,000
イーグル工業	18,800	1,827.00	34,347,600
前澤工業	3,600	1,331.00	4,791,600
日本ピラー工業	15,800	5,180.00	81,844,000
キッツ	57,000	1,094.00	62,358,000
マキタ	194,200	4,839.00	939,733,800
三井E&S	84,500	1,416.00	119,652,000
日立造船	150,300	1,088.00	163,526,400
三菱重工業	2,978,200	1,320.50	3,932,713,100
IHI	126,800	3,874.00	491,223,200
スター精密	31,300	2,063.00	64,571,900
日清紡ホールディングス	128,000	1,100.00	140,800,000
イビデン	88,900	5,681.00	505,040,900
コニカミノルタ	380,700	455.70	173,484,990
ブラザー工業	227,600	2,894.50	658,788,200

ミネベアミツミ	296,300	3,301.00	978,086,300
日立製作所	818,500	15,580.00	12,752,230,000
三菱電機	1,895,500	2,831.50	5,367,108,250
富士電機	103,600	8,814.00	913,130,400
東洋電機製造	2,000	1,108.00	2,216,000
安川電機	185,000	6,255.00	1,157,175,000
シンフォニアテクノロジー	18,800	3,665.00	68,902,000
明電舎	31,600	3,845.00	121,502,000
オリジン	1,300	1,279.00	1,662,700
山洋電気	7,400	7,420.00	54,908,000
デンヨー	13,000	2,600.00	33,800,000
PHCホールディングス	32,000	1,056.00	33,792,000
KOKUSAI ELECTRIC	88,100	3,795.00	334,339,500
ソシオネクスト	124,000	4,294.00	532,456,000
東芝テック	21,800	3,065.00	66,817,000
芝浦メカトロニクス	9,700	6,920.00	67,124,000
マブチモーター	83,800	2,396.50	200,826,700
ニデック	376,000	7,952.00	2,989,952,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,300	392.00	4,429,600
トレックス・セミコンダクター	8,900	1,827.00	16,260,300
東光高岳	10,400	2,092.00	21,756,800
ダブル・スコープ	48,800	458.00	22,350,400
ダイヘン	16,100	8,550.00	137,655,000
ヤーマン	33,300	954.00	31,768,200
JVCケンウッド	134,700	828.00	111,531,600
ミマキエンジニアリング	16,300	1,769.00	28,834,700
I-PEX	11,900	2,094.00	24,918,600
大崎電気工業	37,300	599.00	22,342,700
オムロン	130,000	5,331.00	693,030,000
日東工業	23,000	3,535.00	81,305,000
I D E C	25,100	2,720.00	68,272,000
正興電機製作所	2,100	1,513.00	3,177,300
不二電機工業	1,300	1,118.00	1,453,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	66,500	3,045.00	202,492,500
サクサホールディングス	1,300	2,810.00	3,653,000
メルコホールディングス	5,400	3,460.00	18,684,000
テクノメディカ	4,300	1,780.00	7,654,000
日本電気	223,700	11,525.00	2,578,142,500
富士通	1,567,100	2,334.00	3,657,611,400
沖電気工業	77,000	1,022.00	78,694,000
岩崎通信機	2,700	673.00	1,817,100
電気興業	6,900	2,107.00	14,538,300

サンケン電気	15,800	5,519.00	87,200,200
ナカヨ	900	1,141.00	1,026,900
アイホン	9,200	2,979.00	27,406,800
ルネサスエレクトロニクス	1,061,700	2,896.00	3,074,683,200
セイコーエプソン	218,500	2,434.50	531,938,250
ワコム	124,400	718.00	89,319,200
アルバック	37,300	11,160.00	416,268,000
アクセル	7,800	1,253.00	9,773,400
E I Z O	12,500	4,885.00	61,062,500
日本信号	38,800	1,002.00	38,877,600
京三製作所	35,700	596.00	21,277,200
能美防災	23,100	2,221.00	51,305,100
ホーチキ	12,800	2,086.00	26,700,800
星和電機	2,900	573.00	1,661,700
エレコム	40,800	1,527.00	62,301,600
パナソニック ホールディングス	2,011,800	1,335.50	2,686,758,900
シャープ	287,100	948.50	272,314,350
アンリツ	119,900	1,198.00	143,640,200
富士通ゼネラル	48,300	2,200.00	106,260,000
ソニーグループ	1,192,800	12,650.00	15,088,920,000
T D K	269,700	7,610.00	2,052,417,000
帝国通信工業	7,600	1,967.00	14,949,200
タムラ製作所	67,800	668.00	45,290,400
アルプスアルパイン	152,200	1,458.00	221,907,600
池上通信機	1,800	760.00	1,368,000
日本電波工業	20,600	1,128.00	23,236,800
鈴木	9,200	1,435.00	13,202,000
メイコー	16,900	6,810.00	115,089,000
日本トリム	3,900	3,240.00	12,636,000
ローランド ディー . ジー .	9,500	5,340.00	50,730,000
フォスター電機	12,600	1,450.00	18,270,000
S M K	4,500	2,436.00	10,962,000
ヨコオ	15,200	2,002.00	30,430,400
ホシデン	38,800	1,942.00	75,349,600
ヒロセ電機	25,100	17,510.00	439,501,000
日本航空電子工業	40,700	2,470.00	100,529,000
T O A	19,400	1,061.00	20,583,400
マクセル	37,700	1,612.00	60,772,400
古野電気	22,200	2,040.00	45,288,000
スミダコーポレーション	23,000	1,176.00	27,048,000
アイコム	6,600	3,010.00	19,866,000
リオン	7,100	3,110.00	22,081,000

横河電機	186,300	4,106.00	764,947,800
新電元工業	6,500	2,989.00	19,428,500
アズビル	116,000	4,294.00	498,104,000
東亜ディーケーケー	2,900	848.00	2,459,200
日本光電工業	72,400	4,593.00	332,533,200
チノー	7,000	2,545.00	17,815,000
共和電業	5,200	460.00	2,392,000
日本電子材料	10,400	3,335.00	34,684,000
堀場製作所	32,200	12,995.00	418,439,000
アドバンテスト	483,100	5,591.00	2,701,012,100
小野測器	2,600	674.00	1,752,400
エスペック	13,600	3,255.00	44,268,000
キーエンス	168,700	71,770.00	12,107,599,000
日置電機	8,000	7,230.00	57,840,000
シスメックス	436,600	2,666.50	1,164,193,900
日本マイクロニクス	30,300	5,990.00	181,497,000
メガチップス	13,400	4,205.00	56,347,000
O B A R A G R O U P	10,600	4,195.00	44,467,000
澤藤電機	800	1,219.00	975,200
原田工業	2,800	595.00	1,666,000
コーセル	18,200	1,427.00	25,971,400
イリソ電子工業	15,600	3,100.00	48,360,000
オブテックスグループ	31,000	1,783.00	55,273,000
千代田インテグレ	6,700	2,850.00	19,095,000
レーザーテック	77,300	43,430.00	3,357,139,000
スタンレー電気	108,000	2,834.00	306,072,000
ウシオ電機	74,700	2,097.50	156,683,250
岡谷電機産業	5,100	244.00	1,244,400
ヘリオス テクノ ホールディング	6,000	485.00	2,910,000
エノモト	1,700	1,499.00	2,548,300
日本セラミック	13,800	2,507.00	34,596,600
遠藤照明	2,700	1,621.00	4,376,700
古河電池	12,600	1,144.00	14,414,400
双信電機	3,500	479.00	1,676,500
山一電機	15,200	3,670.00	55,784,000
図研	14,700	3,960.00	58,212,000
日本電子	42,300	6,707.00	283,706,100
カシオ計算機	121,800	1,145.50	139,521,900
ファナック	822,200	4,591.00	3,774,720,200
日本シイエムケイ	39,900	575.00	22,942,500
エンプラス	4,900	7,430.00	36,407,000
大真空	25,400	694.00	17,627,600

ローム	311,900	2,003.00	624,735,700
浜松ホトニクス	135,400	4,767.00	645,451,800
三井ハイテック	15,000	7,206.00	108,090,000
新光電気工業	59,700	5,589.00	333,663,300
京セラ	1,047,800	1,829.00	1,916,426,200
太陽誘電	82,200	3,269.00	268,711,800
村田製作所	1,534,200	2,996.50	4,597,230,300
双葉電子工業	32,600	523.00	17,049,800
北陸電気工業	2,200	1,381.00	3,038,200
ニチコン	44,400	1,195.00	53,058,000
日本ケミコン	18,100	1,593.00	28,833,300
K O A	25,700	1,505.00	38,678,500
市光工業	30,800	560.00	17,248,000
小糸製作所	174,800	2,146.50	375,208,200
ミツバ	31,600	1,046.00	33,053,600
S C R E E Nホールディングス	57,700	15,095.00	870,981,500
キャノン電子	18,700	2,250.00	42,075,000
キャノン	841,000	4,443.00	3,736,563,000
リコー	422,800	1,293.50	546,891,800
象印マホービン	45,900	1,468.00	67,381,200
M U T O Hホールディングス	900	2,539.00	2,285,100
東京エレクトロン	356,900	35,790.00	12,773,451,000
イノテック	11,300	1,729.00	19,537,700
トヨタ紡織	71,000	2,248.00	159,608,000
芦森工業	1,200	2,378.00	2,853,600
ユニプレス	30,300	1,485.00	44,995,500
豊田自動織機	143,800	14,670.00	2,109,546,000
モリタホールディングス	29,600	1,788.00	52,924,800
三櫻工業	25,800	1,001.00	25,825,800
デンソー	1,391,200	2,538.00	3,530,865,600
東海理化電機製作所	47,600	2,166.00	103,101,600
川崎重工業	137,600	5,792.00	796,979,200
名村造船所	47,200	1,889.00	89,160,800
日本車輛製造	5,600	2,301.00	12,885,600
三菱ロジスネクスト	26,900	1,597.00	42,959,300
近畿車輛	800	1,958.00	1,566,400
日産自動車	2,275,500	552.50	1,257,213,750
いすゞ自動車	490,200	2,026.00	993,145,200
トヨタ自動車	9,258,700	3,393.00	31,414,769,100
日野自動車	253,600	442.90	112,319,440
三菱自動車工業	657,800	426.00	280,222,800
エフテック	4,000	649.00	2,596,000

レシップホールディングス	2,400	574.00	1,377,600
GMB	1,100	1,291.00	1,420,100
ファルテック	1,200	567.00	680,400
武蔵精密工業	41,300	1,723.00	71,159,900
日産車体	17,100	950.00	16,245,000
新明和工業	48,600	1,352.00	65,707,200
極東開発工業	27,800	2,500.00	69,500,000
トピー工業	13,700	2,435.00	33,359,500
ティラド	3,800	3,605.00	13,699,000
曙ブレーキ工業	102,900	141.00	14,508,900
タチエス	31,100	1,980.00	61,578,000
NOK	65,500	2,129.00	139,449,500
フタバ産業	45,300	892.00	40,407,600
カヤバ	15,900	5,140.00	81,726,000
大同メタル工業	33,100	584.00	19,330,400
プレス工業	67,400	671.00	45,225,400
ミクニ	7,200	403.00	2,901,600
太平洋工業	38,700	1,526.00	59,056,200
アイシン	130,100	5,650.00	735,065,000
マツダ	557,700	1,572.00	876,704,400
今仙電機製作所	3,600	622.00	2,239,200
本田技研工業	3,995,200	1,734.00	6,927,676,800
スズキ	1,238,800	1,863.00	2,307,884,400
SUBARU	522,900	3,319.00	1,735,505,100
安永	2,500	618.00	1,545,000
ヤマハ発動機	728,700	1,494.50	1,089,042,150
TBK	6,200	305.00	1,891,000
エクセディ	27,600	2,833.00	78,190,800
豊田合成	48,300	3,011.00	145,431,300
愛三工業	28,000	1,414.00	39,592,000
盟和産業	800	1,005.00	804,000
日本プラスト	4,900	435.00	2,131,500
ヨロズ	15,900	1,066.00	16,949,400
エフ・シー・シー	29,900	2,168.00	64,823,200
シマノ	68,000	25,445.00	1,730,260,000
テイ・エス テック	60,100	1,845.00	110,884,500
ジャムコ	9,200	1,428.00	13,137,600
テルモ	940,000	2,645.00	2,486,300,000
クリエートメディック	1,800	977.00	1,758,600
日機装	39,300	1,261.00	49,557,300
日本エム・ディ・エム	13,400	632.00	8,468,800
島津製作所	224,000	4,219.00	945,056,000

JMS	15,600	532.00	8,299,200
長野計器	12,300	3,020.00	37,146,000
ブイ・テクノロジー	8,900	2,717.00	24,181,300
東京計器	12,900	3,165.00	40,828,500
愛知時計電機	7,300	2,107.00	15,381,100
インターアクション	10,200	1,480.00	15,096,000
オーバル	4,900	452.00	2,214,800
東京精密	34,500	11,100.00	382,950,000
マニー	67,500	1,844.00	124,470,000
ニコン	243,800	1,623.50	395,809,300
トプコン	82,000	1,717.00	140,794,000
オリンパス	996,100	2,545.00	2,535,074,500
理研計器	23,900	3,835.00	91,656,500
タムロン	10,300	7,900.00	81,370,000
HOYA	331,900	18,490.00	6,136,831,000
シード	3,400	571.00	1,941,400
ノーリツ鋼機	16,000	4,115.00	65,840,000
A & Dホロンホールディングス	24,600	2,932.00	72,127,200
朝日インテック	205,500	2,135.00	438,742,500
シチズン時計	155,100	1,002.00	155,410,200
リズム	1,300	3,995.00	5,193,500
大研医器	4,800	549.00	2,635,200
メニコン	58,000	1,344.00	77,952,000
シンシア	700	471.00	329,700
松風	7,600	3,370.00	25,612,000
セイコーグループ	23,500	4,395.00	103,282,500
ニプロ	140,600	1,180.00	165,908,000
KYORITSU	8,300	166.00	1,377,800
中本パックス	1,800	1,648.00	2,966,400
パラマウントベッドホールディングス	35,000	2,570.00	89,950,000
トランザクション	11,100	1,823.00	20,235,300
粧美堂	1,500	546.00	819,000
ニホンフラッシュ	15,800	900.00	14,220,000
前田工織	14,600	3,170.00	46,282,000
永大産業	6,600	242.00	1,597,200
アートネイチャー	15,200	813.00	12,357,600
フルヤ金属	5,300	13,120.00	69,536,000
バンダイナムコホールディングス	461,900	3,036.00	1,402,328,400
アイフィスジャパン	1,500	581.00	871,500
SHOEI	47,400	2,015.00	95,511,000
フランスベッドホールディングス	21,800	1,167.00	25,440,600
パイロットコーポレーション	23,700	4,384.00	103,900,800

萩原工業	11,300	1,518.00	17,153,400
フジシールインターナショナル	34,100	2,310.00	78,771,000
タカラトミー	76,700	2,725.50	209,045,850
広済堂ホールディングス	49,000	591.00	28,959,000
エステールホールディングス	1,300	644.00	837,200
タカノ	2,100	943.00	1,980,300
プロネクサス	17,500	1,253.00	21,927,500
ホクシン	4,300	118.00	507,400
ウッドワン	2,000	932.00	1,864,000
TOPPANホールディングス	207,300	3,903.00	809,091,900
大日本印刷	174,800	4,771.00	833,970,800
共同印刷	4,700	3,420.00	16,074,000
NISSHA	28,900	1,822.00	52,655,800
光村印刷	500	1,558.00	779,000
TAKARA & COMPANY	10,000	2,673.00	26,730,000
アシックス	143,700	8,452.00	1,214,552,400
ツツミ	3,900	2,186.00	8,525,400
ローランド	12,400	4,045.00	50,158,000
小松ウオール工業	6,900	3,235.00	22,321,500
ヤマハ	106,300	3,372.00	358,443,600
河合楽器製作所	5,100	3,305.00	16,855,500
クリナップ	16,500	705.00	11,632,500
ピジョン	107,400	1,509.50	162,120,300
キングジム	14,900	892.00	13,290,800
リンテック	33,800	3,285.00	111,033,000
イトーキ	34,400	1,541.00	53,010,400
任天堂	1,064,600	8,252.00	8,785,079,200
三菱鉛筆	23,900	2,322.00	55,495,800
タカラスタANDARD	35,300	1,715.00	60,539,500
コクヨ	69,000	2,596.00	179,124,000
ナカバヤシ	18,200	528.00	9,609,600
グローブライド	15,100	1,989.00	30,033,900
オカムラ	50,800	2,201.00	111,810,800
美津濃	16,800	7,570.00	127,176,000
東京電力ホールディングス	1,520,000	978.90	1,487,928,000
中部電力	621,300	2,026.00	1,258,753,800
関西電力	651,100	2,564.50	1,669,745,950
中国電力	292,900	1,047.00	306,666,300
北陸電力	172,400	1,087.50	187,485,000
東北電力	443,900	1,318.00	585,060,200
四国電力	157,000	1,420.00	222,940,000
九州電力	388,700	1,760.00	684,112,000

北海道電力	162,900	1,549.00	252,332,100
沖縄電力	43,100	1,115.00	48,056,500
電源開発	138,500	2,554.00	353,729,000
エフオン	12,300	408.00	5,018,400
イーレックス	30,000	713.00	21,390,000
レノバ	45,000	1,029.00	46,305,000
東京瓦斯	328,300	3,357.00	1,102,103,100
大阪瓦斯	336,000	3,421.00	1,149,456,000
東邦瓦斯	73,000	3,837.00	280,101,000
北海道瓦斯	10,100	3,490.00	35,249,000
広島ガス	35,600	374.00	13,314,400
西部ガスホールディングス	17,600	1,921.00	33,809,600
静岡ガス	33,600	961.00	32,289,600
メタウォーター	20,200	1,957.00	39,531,400
SBSホールディングス	15,000	2,663.00	39,945,000
東武鉄道	185,200	2,725.00	504,670,000
相鉄ホールディングス	60,300	2,443.50	147,343,050
東急	472,800	1,826.50	863,569,200
京浜急行電鉄	208,700	1,173.50	244,909,450
小田急電鉄	278,800	1,623.00	452,492,400
京王電鉄	81,100	3,736.00	302,989,600
京成電鉄	108,700	5,803.00	630,786,100
富士急行	20,800	3,075.00	63,960,000
東日本旅客鉄道	929,300	2,841.00	2,640,141,300
西日本旅客鉄道	400,000	3,184.00	1,273,600,000
東海旅客鉄道	649,500	3,516.00	2,283,642,000
西武ホールディングス	204,000	2,310.00	471,240,000
鴻池運輸	28,700	2,221.00	63,742,700
西日本鉄道	45,000	2,468.00	111,060,000
ハマキョウレックス	14,400	3,995.00	57,528,000
サカイ引越センター	18,700	2,401.00	44,898,700
近鉄グループホールディングス	168,300	3,356.00	564,814,800
阪急阪神ホールディングス	224,500	4,059.00	911,245,500
南海電気鉄道	75,100	2,632.00	197,663,200
京阪ホールディングス	92,800	3,012.00	279,513,600
神戸電鉄	4,600	2,765.00	12,719,000
名古屋鉄道	173,600	2,030.50	352,494,800
山陽電気鉄道	12,700	2,073.00	26,327,100
アルプス物流	13,400	5,670.00	75,978,000
ヤマトホールディングス	204,600	1,756.50	359,379,900
山九	42,800	5,571.00	238,438,800
丸運	3,300	322.00	1,062,600

丸全昭和運輸	10,400	4,785.00	49,764,000
センコーグループホールディングス	89,100	1,137.00	101,306,700
トナミホールディングス	3,700	4,970.00	18,389,000
ニッコンホールディングス	53,600	2,925.00	156,780,000
日本石油輸送	600	2,920.00	1,752,000
福山通運	19,200	3,710.00	71,232,000
セイノーホールディングス	94,700	2,059.50	195,034,650
エスライングループ本社	1,600	1,550.00	2,480,000
神奈川中央交通	4,800	3,010.00	14,448,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	43,000	1,128.00	48,504,000
C & F ロジホールディングス	16,200	5,570.00	90,234,000
九州旅客鉄道	119,000	3,383.00	402,577,000
S Gホールディングス	282,700	1,600.00	452,320,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	57,100	7,682.00	438,642,200
日本郵船	482,700	4,899.00	2,364,747,300
商船三井	365,700	5,078.00	1,857,024,600
川崎汽船	405,900	2,325.00	943,717,500
N Sユナイテッド海運	9,200	4,970.00	45,724,000
飯野海運	62,300	1,316.00	81,986,800
共栄タンカー	1,700	1,133.00	1,926,100
乾汽船	20,400	1,059.00	21,603,600
日本航空	413,500	2,671.50	1,104,665,250
A N Aホールディングス	458,100	3,053.00	1,398,579,300
パスコ	1,100	1,867.00	2,053,700
トランコム	4,900	6,060.00	29,694,000
日新	12,800	4,435.00	56,768,000
三菱倉庫	41,300	5,148.00	212,612,400
三井倉庫ホールディングス	15,700	4,190.00	65,783,000
住友倉庫	45,200	2,525.00	114,130,000
澁澤倉庫	7,700	3,080.00	23,716,000
東陽倉庫	1,500	1,486.00	2,229,000
日本トランスシティ	33,900	856.00	29,018,400
ケイヒン	1,000	2,056.00	2,056,000
中央倉庫	9,000	1,165.00	10,485,000
川西倉庫	1,000	1,145.00	1,145,000
安田倉庫	11,500	1,454.00	16,721,000
ファイズホールディングス	800	990.00	792,000
東洋埠頭	1,600	1,353.00	2,164,800
上組	77,700	3,190.00	247,863,000
サンリツ	1,400	877.00	1,227,800
キムラユニティー	2,700	1,745.00	4,711,500
キューソー流通システム	8,600	1,202.00	10,337,200

東海運	3,300	289.00	953,700
エーアイティー	10,600	1,766.00	18,719,600
内外トランスライン	6,700	2,550.00	17,085,000
日本コンセプト	6,100	1,859.00	11,339,900
N E C ネットズエスアイ	65,900	2,237.00	147,418,300
クロスキャット	10,700	1,322.00	14,145,400
システナ	255,900	277.00	70,884,300
デジタルアーツ	10,700	3,620.00	38,734,000
日鉄ソリューションズ	28,900	4,935.00	142,621,500
キューブシステム	9,000	1,089.00	9,801,000
コア	7,500	1,875.00	14,062,500
手間いらず	2,900	3,045.00	8,830,500
ラクーンホールディングス	12,600	684.00	8,618,400
ソリトンシステムズ	8,700	1,166.00	10,144,200
ソフトクリエイイトホールディングス	13,900	1,941.00	26,979,900
T I S	178,800	2,856.50	510,742,200
テクミラホールディングス	2,600	395.00	1,027,000
グリー	56,700	505.00	28,633,500
G M O ペパボ	2,100	1,399.00	2,937,900
コーエーテクモホールディングス	106,000	1,356.50	143,789,000
三菱総合研究所	8,300	4,690.00	38,927,000
電算	700	1,483.00	1,038,100
A G S	2,300	970.00	2,231,000
ファインデックス	13,400	939.00	12,582,600
ブレインパッド	14,100	1,157.00	16,313,700
K L a b	31,100	232.00	7,215,200
ポールトゥウィンホールディングス	28,900	463.00	13,380,700
ネクソン	371,000	2,556.50	948,461,500
アイスタイル	56,500	443.00	25,029,500
エムアップホールディングス	20,700	1,217.00	25,191,900
エイチーム	11,300	668.00	7,548,400
エニグモ	21,600	330.00	7,128,000
テクノスジャパン	5,000	641.00	3,205,000
コロブラ	65,300	577.00	37,678,100
ブロードリーフ	80,300	494.00	39,668,200
クロス・マーケティンググループ	2,700	508.00	1,371,600
デジタルハーツホールディングス	10,600	931.00	9,868,600
メディアドゥ	7,600	1,374.00	10,442,400
じげん	49,300	603.00	29,727,900
ブイキューブ	20,300	249.00	5,054,700
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	610.00	793,000
サイバーリンクス	2,200	722.00	1,588,400

フィックスターズ	19,000	1,817.00	34,523,000
CARTA HOLDINGS	8,000	1,586.00	12,688,000
オブティム	17,400	745.00	12,963,000
セレス	6,800	1,994.00	13,559,200
SHIFT	11,200	16,785.00	187,992,000
ティーガイア	17,700	1,940.00	34,338,000
セック	2,300	4,335.00	9,970,500
テクマトリックス	30,900	1,768.00	54,631,200
プロシップ	8,100	1,411.00	11,429,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44,000	2,543.50	111,914,000
GMOペイメントゲートウェイ	38,600	7,354.00	283,864,400
ザッパラス	1,300	421.00	547,300
システムリサーチ	11,600	1,533.00	17,782,800
インターネットイニシアティブ	80,800	2,311.50	186,769,200
さくらインターネット	19,000	5,320.00	101,080,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	2,861.00	14,877,200
SRAホールディングス	8,700	4,020.00	34,974,000
システムインテグレータ	1,700	371.00	630,700
朝日ネット	18,200	637.00	11,593,400
eBASE	23,800	686.00	16,326,800
アバントグループ	21,400	1,320.00	28,248,000
アドソル日進	7,100	1,614.00	11,459,400
ODKソリューションズ	1,100	598.00	657,800
フリービット	7,400	1,406.00	10,404,400
コムチュア	24,400	1,847.00	45,066,800
アステリア	13,300	541.00	7,195,300
アイル	9,500	2,651.00	25,184,500
マークラインズ	9,200	3,125.00	28,750,000
メディカル・データ・ビジョン	20,200	463.00	9,352,600
gumi	27,500	371.00	10,202,500
ショーケース	1,300	291.00	378,300
モバイルファクトリー	1,200	674.00	808,800
テラスカイ	7,300	2,006.00	14,643,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,800	1,671.00	14,704,800
PCIホールディングス	2,300	937.00	2,155,100
アイビーシー	900	475.00	427,500
ネオジャパン	5,700	1,399.00	7,974,300
PR TIMES	3,400	1,833.00	6,232,200
ラクス	80,000	1,749.50	139,960,000
ランドコンピュータ	2,700	826.00	2,230,200
ダブルスタンダード	5,100	1,709.00	8,715,900
オープンドア	9,900	605.00	5,989,500

アカツキ	8,200	2,124.00	17,416,800
ベネフィットジャパン	400	1,149.00	459,600
U b i c o mホールディングス	5,300	1,164.00	6,169,200
カナミックネットワーク	21,300	504.00	10,735,200
ノムラシステムコーポレーション	6,200	134.00	830,800
チェンジホールディングス	36,800	1,201.00	44,196,800
シンクロ・フード	3,600	525.00	1,890,000
オークネット	6,300	2,496.00	15,724,800
キャピタル・アセット・プランニング	1,100	799.00	878,900
セグエグループ	5,200	582.00	3,026,400
エイトレッド	900	1,485.00	1,336,500
マクロミル	33,200	862.00	28,618,400
ビーグリー	1,200	1,091.00	1,309,200
オロ	6,100	2,804.00	17,104,400
ユーザーローカル	7,100	2,028.00	14,398,800
テモナ	1,400	222.00	310,800
ニーズウェル	3,100	804.00	2,492,400
マネーフォワード	37,800	5,477.00	207,030,600
サインポスト	2,200	639.00	1,405,800
S u n A s t e r i s k	12,000	882.00	10,584,000
プラスアルファ・コンサルティング	21,300	1,858.00	39,575,400
電算システムホールディングス	7,500	2,544.00	19,080,000
A p p i e r G r o u p	57,900	1,291.00	74,748,900
ビジョナル	19,800	7,640.00	151,272,000
ソルクシーズ	4,600	318.00	1,462,800
フェイス	1,600	433.00	692,800
プロトコーポレーション	18,500	1,341.00	24,808,500
ハイマックス	5,300	1,344.00	7,123,200
野村総合研究所	366,200	4,194.00	1,535,842,800
C Eホールディングス	2,700	544.00	1,468,800
日本システム技術	14,100	1,587.00	22,376,700
インテージホールディングス	19,100	1,391.00	26,568,100
東邦システムサイエンス	6,900	1,338.00	9,232,200
ソースネクスト	77,500	198.00	15,345,000
インフォコム	21,700	3,935.00	85,389,500
シンプレクス・ホールディングス	25,700	2,717.00	69,826,900
H E R O Z	6,700	1,281.00	8,582,700
ラクスル	40,800	870.00	35,496,000
メルカリ	82,500	1,857.00	153,202,500
I P S	4,900	2,361.00	11,568,900
F I G	6,500	324.00	2,106,000
システムサポート	6,600	1,885.00	12,441,000

イーソル	12,200	942.00	11,492,400
東海ソフト	900	1,358.00	1,222,200
ウイングアーク1st	17,600	2,887.00	50,811,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,700	938.00	5,346,600
サーバーワークス	3,500	3,040.00	10,640,000
東名	600	2,360.00	1,416,000
ヴィッツ	600	817.00	490,200
トピラシステムズ	1,600	778.00	1,244,800
Sansan	55,500	1,591.00	88,300,500
Link-Uグループ	1,100	619.00	680,900
ギフトィ	14,800	1,065.00	15,762,000
メドレー	22,700	3,315.00	75,250,500
ベース	5,900	2,977.00	17,564,300
JMDC	28,800	2,771.50	79,819,200
フォーカスシステムズ	11,300	1,096.00	12,384,800
クレスコ	13,900	2,318.00	32,220,200
フジ・メディア・ホールディングス	162,400	1,672.00	271,532,800
オービック	56,500	20,245.00	1,143,842,500
ジャストシステム	24,300	2,601.00	63,204,300
TDCソフト	31,700	1,093.00	34,648,100
LINEヤフー	2,407,800	381.00	917,371,800
トレンドマイクロ	80,000	7,314.00	585,120,000
IDホールディングス	11,400	1,430.00	16,302,000
日本オラクル	32,400	12,120.00	392,688,000
アルファシステムズ	4,400	2,771.00	12,192,400
フューチャー	36,100	1,483.00	53,536,300
CAC Holdings	9,100	1,890.00	17,199,000
SBテクノロジー	7,100	2,945.00	20,909,500
トーセ	1,600	692.00	1,107,200
オービックビジネスコンサルタント	23,800	6,719.00	159,912,200
アイティフォー	21,700	1,301.00	28,231,700
東計電算	4,700	3,565.00	16,755,500
エクスネット	800	1,502.00	1,201,600
大塚商会	167,700	2,945.50	493,960,350
サイボウズ	23,300	1,574.00	36,674,200
電通総研	20,600	5,280.00	108,768,000
ACCESS	17,600	1,454.00	25,590,400
デジタルガレージ	27,000	2,461.00	66,447,000
EMシステムズ	28,200	620.00	17,484,000
ウェザーニューズ	5,200	4,660.00	24,232,000
CIJ	42,200	445.00	18,779,000
ビジネスエンジニアリング	3,500	3,505.00	12,267,500

日本エンタープライズ	5,900	134.00	790,600
WOWOW	12,700	1,040.00	13,208,000
スカラ	15,700	709.00	11,131,300
インテリジェント ウェイブ	3,000	1,071.00	3,213,000
ANYCOLOR	23,900	2,136.00	51,050,400
IMAGICA GROUP	17,000	523.00	8,891,000
ネットワンシステムズ	67,900	2,943.50	199,863,650
システムソフト	59,100	71.00	4,196,100
アルゴグラフィックス	15,500	4,100.00	63,550,000
マーベラス	27,500	613.00	16,857,500
エイベックス	28,800	1,203.00	34,646,400
BIPROGY	55,300	4,118.00	227,725,400
都築電気	8,900	2,234.00	19,882,600
TBSホールディングス	85,000	3,463.00	294,355,000
日本テレビホールディングス	149,700	2,032.50	304,265,250
朝日放送グループホールディングス	15,900	652.00	10,366,800
テレビ朝日ホールディングス	41,100	1,926.00	79,158,600
スカパーJ SATホールディングス	131,400	862.00	113,266,800
テレビ東京ホールディングス	12,200	3,050.00	37,210,000
日本BS放送	2,000	890.00	1,780,000
ビジョン	25,500	1,246.00	31,773,000
スマートバリュー	1,600	435.00	696,000
U-NEXT HOLDINGS	19,000	4,440.00	84,360,000
ワイヤレスゲート	2,500	236.00	590,000
日本通信	166,600	183.00	30,487,800
クロップス	700	1,059.00	741,300
日本電信電話	50,303,700	152.60	7,676,344,620
KDDI	1,306,800	4,302.00	5,621,853,600
ソフトバンク	2,699,100	1,897.50	5,121,542,250
光通信	17,000	24,380.00	414,460,000
エムティーアイ	11,600	785.00	9,106,000
GMOインターネットグループ	62,200	2,405.50	149,622,100
ファイバーゲート	9,100	1,224.00	11,138,400
アйдママーケティングコミュニケーション	1,600	230.00	368,000
KADOKAWA	89,400	3,100.00	277,140,000
学研ホールディングス	30,400	987.00	30,004,800
ゼンリン	28,900	859.00	24,825,100
昭文社ホールディングス	2,400	360.00	864,000
インプレスホールディングス	5,700	158.00	900,600
アイネット	10,200	2,284.00	23,296,800
松竹	8,800	9,359.00	82,359,200
東宝	94,100	4,850.00	456,385,000

東映	27,900	3,445.00	96,115,500
NTTデータグループ	442,200	2,482.50	1,097,761,500
ピー・シー・エー	9,700	1,940.00	18,818,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	2,089.00	13,787,400
D T S	35,500	4,145.00	147,147,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,300	4,781.00	369,571,300
シーイーシー	21,300	1,757.00	37,424,100
カプコン	302,500	2,698.00	816,145,000
アイ・エス・ビー	8,700	1,382.00	12,023,400
S C S K	118,300	2,969.00	351,232,700
N S W	7,500	2,998.00	22,485,000
アイネス	13,200	1,643.00	21,687,600
T K C	29,400	3,350.00	98,490,000
富士ソフト	34,000	6,430.00	218,620,000
N S D	60,000	2,815.00	168,900,000
コナミグループ	63,300	10,740.00	679,842,000
福井コンピュータホールディングス	10,400	2,188.00	22,755,200
J B C Cホールディングス	11,200	3,075.00	34,440,000
ミロク情報サービス	15,400	1,825.00	28,105,000
ソフトバンクグループ	834,200	8,515.00	7,103,213,000
リョーサン菱洋ホールディングス	33,600	3,140.00	105,504,000
高千穂交易	6,300	3,650.00	22,995,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,000	2,189.00	2,189,000
伊藤忠食品	4,000	7,200.00	28,800,000
エレマテック	16,000	1,997.00	31,952,000
あらた	27,300	3,195.00	87,223,500
トーメンデバイス	2,600	7,240.00	18,824,000
東京エレクトロン デバイス	17,800	4,675.00	83,215,000
円谷フィールズホールディングス	30,600	1,486.00	45,471,600
双日	198,600	4,122.00	818,629,200
アルフレッサ ホールディングス	179,100	2,147.00	384,527,700
横浜冷凍	48,400	1,011.00	48,932,400
ラサ商事	7,900	1,802.00	14,235,800
アルコニックス	23,500	1,426.00	33,511,000
神戸物産	138,000	3,385.00	467,130,000
ハイパー	1,400	301.00	421,400
あい ホールディングス	28,600	2,476.00	70,813,600
ディーブイエックス	1,600	1,000.00	1,600,000
ダイワボウホールディングス	79,000	2,703.00	213,537,000
マクニカホールディングス	42,200	6,557.00	276,705,400
ラクト・ジャパン	7,000	2,698.00	18,886,000
グリムス	7,500	2,064.00	15,480,000

バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,000	1,238.00	33,426,000
八洲電機	14,400	1,456.00	20,966,400
メディアスホールディングス	10,400	851.00	8,850,400
レスター	15,200	2,885.00	43,852,000
ジオリーブグループ	1,400	1,209.00	1,692,600
大光	3,100	630.00	1,953,000
O C H Iホールディングス	1,400	1,484.00	2,077,600
T O K A Iホールディングス	96,900	964.00	93,411,600
黒谷	1,600	704.00	1,126,400
C o m i n i x	1,200	855.00	1,026,000
三洋貿易	20,000	1,600.00	32,000,000
ビューティガレージ	5,600	2,019.00	11,306,400
ウイン・パートナーズ	11,600	1,157.00	13,421,200
ミタチ産業	1,700	1,172.00	1,992,400
シップヘルスケアホールディングス	64,100	2,326.50	149,128,650
明治電機工業	6,600	1,663.00	10,975,800
デリカフーズホールディングス	2,600	572.00	1,487,200
スターティアホールディングス	1,600	2,046.00	3,273,600
コメダホールディングス	43,700	2,630.00	114,931,000
ピーバンドットコム	800	377.00	301,600
アセンテック	6,900	569.00	3,926,100
富士興産	1,700	1,677.00	2,850,900
協栄産業	600	2,755.00	1,653,000
フルサト・マルカホールディングス	15,900	2,140.00	34,026,000
ヤマエグループホールディングス	15,700	2,345.00	36,816,500
小野建	17,800	1,618.00	28,800,400
南陽	2,400	1,121.00	2,690,400
佐島電機	11,200	2,209.00	24,740,800
エコートレーディング	1,200	1,226.00	1,471,200
伯東	10,200	5,130.00	52,326,000
コンドーテック	13,700	1,285.00	17,604,500
中山福	3,200	363.00	1,161,600
ナガイレーベン	22,500	2,370.00	53,325,000
三菱食品	16,500	5,200.00	85,800,000
松田産業	13,600	2,811.00	38,229,600
第一興商	69,000	1,692.00	116,748,000
メディバルホールディングス	181,400	2,243.50	406,970,900
S P K	7,900	2,058.00	16,258,200
萩原電気ホールディングス	7,700	4,105.00	31,608,500
アズワン	55,600	2,372.00	131,883,200
スズデン	6,200	1,844.00	11,432,800
尾家産業	1,400	1,990.00	2,786,000

シモジマ	11,900	1,279.00	15,220,100
ドウシシャ	16,500	2,209.00	36,448,500
小津産業	1,300	1,800.00	2,340,000
高速	10,600	2,161.00	22,906,600
たけびし	6,800	2,108.00	14,334,400
リックス	3,900	3,080.00	12,012,000
丸文	15,900	1,221.00	19,413,900
ハピネット	15,200	3,370.00	51,224,000
橋本総業ホールディングス	7,100	1,269.00	9,009,900
日本ライフライン	52,000	1,134.00	58,968,000
タカショー	15,600	563.00	8,782,800
I D O M	47,200	1,320.00	62,304,000
進和	10,900	2,720.00	29,648,000
エスケイジャパン	1,500	865.00	1,297,500
ダイトロン	7,000	3,135.00	21,945,000
シークス	25,400	1,316.00	33,426,400
田中商事	1,700	792.00	1,346,400
オーハシテクニカ	9,400	1,673.00	15,726,200
白銅	5,000	2,867.00	14,335,000
ダイコー通産	600	1,403.00	841,800
伊藤忠商事	1,199,200	7,231.00	8,671,415,200
丸紅	1,479,800	3,057.00	4,523,748,600
高島	4,000	1,064.00	4,256,000
長瀬産業	81,800	3,098.00	253,416,400
蝶理	11,200	3,575.00	40,040,000
豊田通商	156,300	9,458.00	1,478,285,400
三共生興	24,700	726.00	17,932,200
兼松	74,600	2,644.00	197,242,400
ツカモトコーポレーション	800	1,193.00	954,400
三井物産	1,336,300	8,174.00	10,922,916,200
日本紙パルプ商事	8,500	5,970.00	50,745,000
カメイ	19,000	2,039.00	38,741,000
東都水産	500	6,300.00	3,150,000
O U G ホールディングス	900	2,647.00	2,382,300
スターゼン	12,300	2,827.00	34,772,100
山善	54,100	1,394.00	75,415,400
椿本興業	11,100	2,191.00	24,320,100
住友商事	1,079,700	4,070.00	4,394,379,000
内田洋行	7,200	6,950.00	50,040,000
三菱商事	3,425,600	3,328.00	11,400,396,800
第一実業	16,800	2,337.00	39,261,600
キャノンマーケティングジャパン	41,300	4,394.00	181,472,200

西華産業	7,000	3,790.00	26,530,000
佐藤商事	12,400	1,657.00	20,546,800
東京産業	16,300	636.00	10,366,800
ユアサ商事	13,900	5,590.00	77,701,000
神鋼商事	4,500	7,110.00	31,995,000
トルク	4,300	243.00	1,044,900
阪和興業	32,000	6,490.00	207,680,000
正栄食品工業	11,900	4,400.00	52,360,000
カナデン	13,400	1,570.00	21,038,000
RYODEN	14,400	2,524.00	36,345,600
岩谷産業	40,600	9,042.00	367,105,200
ナイス	1,800	1,893.00	3,407,400
ニチモウ	1,900	2,029.00	3,855,100
極東貿易	10,700	1,729.00	18,500,300
アステナホールディングス	33,600	488.00	16,396,800
三愛オブリ	41,600	2,066.00	85,945,600
稲畑産業	35,300	3,315.00	117,019,500
G S I クレオス	9,600	2,196.00	21,081,600
明和産業	21,100	726.00	15,318,600
クワザワホールディングス	2,100	890.00	1,869,000
ワキタ	29,500	1,580.00	46,610,000
東邦ホールディングス	49,100	3,775.00	185,352,500
サンゲツ	41,100	2,983.00	122,601,300
ミツウロコグループホールディングス	22,800	1,245.00	28,386,000
シナネンホールディングス	4,900	4,515.00	22,123,500
伊藤忠エネクス	44,200	1,532.00	67,714,400
サンリオ	144,900	2,352.50	340,877,250
サンワテクノス	9,100	2,240.00	20,384,000
新光商事	24,000	957.00	22,968,000
トーヨー	7,000	3,095.00	21,665,000
三信電気	7,200	2,143.00	15,429,600
東陽テクニカ	18,000	1,510.00	27,180,000
モスフードサービス	26,200	3,495.00	91,569,000
加賀電子	16,300	6,110.00	99,593,000
ソーダニッカ	15,800	1,026.00	16,210,800
立花エレテック	11,800	2,952.00	34,833,600
フォーバル	7,000	1,371.00	9,597,000
PALTAC	24,000	4,320.00	103,680,000
三谷産業	31,200	355.00	11,076,000
西本Wismettacホールディングス	4,500	4,195.00	18,877,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	500	2,707.00	1,353,500
コア商事ホールディングス	12,500	869.00	10,862,500

K P Pグループホールディングス	46,200	844.00	38,992,800
ヤマタネ	7,900	2,812.00	22,214,800
丸紅建材リース	500	3,120.00	1,560,000
泉州電業	11,100	5,750.00	63,825,000
トラスコ中山	37,500	2,518.00	94,425,000
オートバックスセブン	62,100	1,520.00	94,392,000
モリト	12,800	1,504.00	19,251,200
加藤産業	22,100	4,140.00	91,494,000
北恵	1,500	861.00	1,291,500
イエローハット	28,300	2,019.00	57,137,700
J Kホールディングス	13,700	1,041.00	14,261,700
日伝	12,000	3,070.00	36,840,000
北沢産業	3,600	353.00	1,270,800
杉本商事	8,600	2,440.00	20,984,000
因幡電機産業	46,300	3,725.00	172,467,500
東テク	17,900	2,670.00	47,793,000
ミスミグループ本社	269,400	2,689.00	724,416,600
アルテック	3,200	284.00	908,800
タキヒヨー	1,400	1,165.00	1,631,000
蔵王産業	1,100	2,539.00	2,792,900
スズケン	63,700	4,640.00	295,568,000
ジェコス	10,700	1,009.00	10,796,300
サンエー	13,700	4,650.00	63,705,000
カワチ薬品	14,100	2,794.00	39,395,400
エービーシー・マート	78,200	3,041.00	237,806,200
ハードオフコーポレーション	7,300	1,983.00	14,475,900
アスクル	43,200	2,225.00	96,120,000
ゲオホールディングス	20,200	1,755.00	35,451,000
アダストリア	21,600	3,600.00	77,760,000
くら寿司	21,000	4,850.00	101,850,000
キャンドウ	6,500	2,887.00	18,765,500
I Kホールディングス	3,000	433.00	1,299,000
パルグループホールディングス	35,200	1,806.00	63,571,200
エディオン	70,900	1,541.00	109,256,900
サーラコーポレーション	37,900	820.00	31,078,000
ワッツ	3,000	671.00	2,013,000
ハローズ	8,200	4,200.00	34,440,000
あみやき亭	4,400	6,140.00	27,016,000
大黒天物産	5,500	7,830.00	43,065,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,677.00	26,832,000
ファーマライズホールディングス	1,900	654.00	1,242,600
アルペン	14,900	1,999.00	29,785,100

ハブ	2,400	845.00	2,028,000
クオールホールディングス	24,700	1,490.00	36,803,000
ジーンズホールディングス	13,700	3,740.00	51,238,000
ビックカメラ	107,000	1,463.00	156,541,000
D C Mホールディングス	94,500	1,477.00	139,576,500
M o n o t a R O	253,100	1,602.00	405,466,200
東京一番フーズ	2,400	515.00	1,236,000
きちりホールディングス	1,700	949.00	1,613,300
J . フロント リテイリング	205,000	1,477.50	302,887,500
ドトール・日レスホールディングス	31,800	2,141.00	68,083,800
マツキヨココカラ & カンパニー	324,700	2,289.00	743,238,300
ブロンコビリー	10,600	4,030.00	42,718,000
Z O Z O	113,800	3,643.00	414,573,400
トレジャー・ファクトリー	11,300	1,595.00	18,023,500
物語コーポレーション	29,900	3,485.00	104,201,500
三越伊勢丹ホールディングス	300,800	2,970.50	893,526,400
H a m e e	7,500	1,288.00	9,660,000
マーケットエンタープライズ	1,000	780.00	780,000
ウエルシアホールディングス	92,700	2,169.50	201,112,650
クリエイトSDホールディングス	25,400	3,350.00	85,090,000
丸善C H I ホールディングス	8,000	333.00	2,664,000
ミサワ	1,800	619.00	1,114,200
ティーライフ	1,100	1,397.00	1,536,700
チムニー	1,800	1,301.00	2,341,800
シュッピン	16,400	1,252.00	20,532,800
オイシックス・ラ・大地	24,300	1,182.00	28,722,600
ネクステージ	40,900	2,758.00	112,802,200
ジョイフル本田	52,100	2,092.00	108,993,200
エターナルホスピタリティグループ	6,700	3,860.00	25,862,000
ホットランド	13,800	2,459.00	33,934,200
すかいらーくホールディングス	244,000	2,185.50	533,262,000
S F Pホールディングス	8,600	2,062.00	17,733,200
綿半ホールディングス	14,100	1,595.00	22,489,500
ヨシックスホールディングス	4,200	2,811.00	11,806,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,200	876.00	43,975,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	528.00	4,593,600
B E E N O S	10,800	2,085.00	22,518,000
あさひ	16,800	1,406.00	23,620,800
日本調剤	12,000	1,437.00	17,244,000
コスモス薬品	15,200	12,990.00	197,448,000
トーエル	3,100	789.00	2,445,900
セブン&アイ・ホールディングス	1,826,500	2,025.00	3,698,662,500

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	120,800	1,093.00	132,034,400
ツルハホールディングス	37,500	9,408.00	352,800,000
サンマルクホールディングス	14,500	2,106.00	30,537,000
フェリシモ	1,700	920.00	1,564,000
トリドールホールディングス	50,100	3,772.00	188,977,200
T O K Y O B A S E	21,500	299.00	6,428,500
ウイルプラスホールディングス	1,500	1,037.00	1,555,500
J Mホールディングス	13,600	2,753.00	37,440,800
サツドラホールディングス	2,800	878.00	2,458,400
アレンザホールディングス	13,700	1,109.00	15,193,300
串カツ田中ホールディングス	5,000	1,615.00	8,075,000
パロックジャパンリミテッド	14,300	774.00	11,068,200
クスリのアオキホールディングス	53,800	3,118.00	167,748,400
力の源ホールディングス	10,300	1,441.00	14,842,300
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	95,300	2,933.00	279,514,900
メディカルシステムネットワーク	19,900	625.00	12,437,500
はるやまホールディングス	3,400	587.00	1,995,800
ノジマ	52,000	1,680.00	87,360,000
カップ・クリエイト	28,000	1,635.00	45,780,000
ライトオン	4,500	385.00	1,732,500
良品計画	212,600	2,384.00	506,838,400
パリミキホールディングス	8,300	359.00	2,979,700
アドヴァングループ	16,900	1,020.00	17,238,000
アルビス	6,000	2,617.00	15,702,000
コナカ	7,000	304.00	2,128,000
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,590.00	1,590,000
G - 7ホールディングス	19,700	1,540.00	30,338,000
イオン北海道	52,900	935.00	49,461,500
コジマ	34,800	859.00	29,893,200
ヒマラヤ	2,500	911.00	2,277,500
コーナン商事	21,900	4,360.00	95,484,000
エコス	6,800	2,296.00	15,612,800
ワタミ	18,800	906.00	17,032,800
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	360,300	3,948.00	1,422,464,400
西松屋チェーン	35,300	2,243.00	79,177,900
ゼンショーホールディングス	90,900	6,287.00	571,488,300
幸楽苑ホールディングス	13,200	1,246.00	16,447,200
ハークスレイ	2,200	780.00	1,716,000
サイゼリヤ	26,400	5,280.00	139,392,000
V Tホールディングス	69,700	490.00	34,153,000

魚力	6,400	2,370.00	15,168,000
フジ・コーポレーション	8,700	1,797.00	15,633,900
ユナイテッドアローズ	21,200	1,722.00	36,506,400
ハイデイ日高	26,600	2,881.00	76,634,600
YU-WA Creation Holdings	5,700	139.00	792,300
コロワイド	76,700	1,967.00	150,868,900
壱番屋	70,800	1,097.00	77,667,600
PLANT	1,500	1,628.00	2,442,000
スギホールディングス	108,000	2,385.50	257,634,000
薬王堂ホールディングス	8,800	2,803.00	24,666,400
スクロール	26,900	1,034.00	27,814,600
ヨンドシーホールディングス	17,100	1,885.00	32,233,500
木曽路	27,100	2,463.00	66,747,300
SRSホールディングス	29,700	1,174.00	34,867,800
千趣会	32,800	316.00	10,364,800
リテールパートナーズ	26,700	1,664.00	44,428,800
上新電機	17,800	2,532.00	45,069,600
日本瓦斯	94,700	2,416.00	228,795,200
ロイヤルホールディングス	31,400	2,626.00	82,456,400
いなげや	17,400	1,236.00	21,506,400
チヨダ	17,400	898.00	15,625,200
ライフコーポレーション	18,700	3,975.00	74,332,500
リンガーハット	23,000	2,302.00	52,946,000
MrMaxHD	23,000	649.00	14,927,000
AOKIホールディングス	38,500	1,273.00	49,010,500
オークワ	25,800	931.00	24,019,800
コメリ	27,500	3,740.00	102,850,000
青山商事	38,400	1,481.00	56,870,400
しまむら	41,900	7,582.00	317,685,800
はせがわ	3,800	341.00	1,295,800
高島屋	123,300	2,429.50	299,557,350
松屋	30,400	961.00	29,214,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	79,000	2,248.00	177,592,000
近鉄百貨店	7,800	2,049.00	15,982,200
丸井グループ	118,500	2,301.00	272,668,500
アクシアル リテイリング	49,000	995.00	48,755,000
イオン	604,800	3,322.00	2,009,145,600
イズミ	31,700	3,345.00	106,036,500
平和堂	29,900	2,324.00	69,487,600
フジ	27,400	1,913.00	52,416,200
ヤオコー	21,100	8,940.00	188,634,000
ゼビオホールディングス	24,500	1,083.00	26,533,500

ケーズホールディングス	120,100	1,412.50	169,641,250
Olympicグループ	3,300	508.00	1,676,400
日産東京販売ホールディングス	9,400	513.00	4,822,200
シルバーライフ	5,200	895.00	4,654,000
Genky DrugStores	7,900	5,590.00	44,161,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,200	1,300.00	1,560,000
ブックオフグループホールディングス	11,900	1,554.00	18,492,600
ギフトホールディングス	7,700	2,843.00	21,891,100
アインホールディングス	24,600	5,946.00	146,271,600
元気寿司	10,200	3,190.00	32,538,000
ヤマダホールディングス	549,500	434.00	238,483,000
アークランズ	53,300	1,905.00	101,536,500
ニトリホールディングス	65,000	17,845.00	1,159,925,000
グルメ軒屋	14,800	1,079.00	15,969,200
愛眼	4,400	182.00	800,800
ケユーホールディングス	8,700	1,202.00	10,457,400
吉野家ホールディングス	65,800	2,866.00	188,582,800
松屋フーズホールディングス	8,500	5,300.00	45,050,000
サガミホールディングス	27,000	1,539.00	41,553,000
関西フードマーケット	12,300	2,343.00	28,818,900
王将フードサービス	13,300	8,900.00	118,370,000
ミニストップ	13,000	1,564.00	20,332,000
アークス	32,800	2,921.00	95,808,800
パローホールディングス	34,200	2,319.00	79,309,800
ベルク	8,900	7,300.00	64,970,000
大庄	9,800	1,211.00	11,867,800
ファーストリテイリング	100,300	40,310.00	4,043,093,000
サンドラッグ	60,300	3,976.00	239,752,800
サックスパーホールディングス	15,500	777.00	12,043,500
ヤマザワ	1,500	1,272.00	1,908,000
やまや	1,300	3,085.00	4,010,500
ベルーナ	43,500	712.00	30,972,000
いよぎんホールディングス	197,600	1,336.50	264,092,400
しずおかフィナンシャルグループ	369,000	1,510.00	557,190,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	139,800	1,586.00	221,722,800
楽天銀行	77,000	2,767.00	213,059,000
京都フィナンシャルグループ	210,400	2,629.00	553,141,600
島根銀行	1,600	550.00	880,000
じもとホールディングス	4,900	379.00	1,857,100
めぶきフィナンシャルグループ	769,600	577.40	444,367,040
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,300	4,730.00	100,749,000
九州フィナンシャルグループ	321,400	953.60	306,487,040

ゆうちょ銀行	1,824,900	1,520.50	2,774,760,450
富山第一銀行	52,700	1,113.00	58,655,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	891,100	933.30	831,663,630
西日本フィナンシャルホールディングス	93,200	1,971.00	183,697,200
三十三フィナンシャルグループ	14,900	2,009.00	29,934,100
第四北越フィナンシャルグループ	26,100	4,745.00	123,844,500
ひろぎんホールディングス	236,400	1,194.50	282,379,800
おきなわフィナンシャルグループ	14,200	2,577.00	36,593,400
十六フィナンシャルグループ	21,500	4,650.00	99,975,000
北國フィナンシャルホールディングス	17,500	4,980.00	87,150,000
プロクレアホールディングス	19,000	1,793.00	34,067,000
あいちフィナンシャルグループ	34,100	2,611.00	89,035,100
あおぞら銀行	119,300	2,358.00	281,309,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,113,500	1,571.00	15,888,308,500
りそなホールディングス	1,920,600	993.40	1,907,924,040
三井住友トラスト・ホールディングス	596,300	3,566.00	2,126,405,800
三井住友フィナンシャルグループ	1,180,700	9,789.00	11,557,872,300
千葉銀行	462,800	1,379.00	638,201,200
群馬銀行	322,300	1,025.50	330,518,650
武蔵野銀行	23,200	3,130.00	72,616,000
千葉興業銀行	35,300	965.00	34,064,500
筑波銀行	72,900	312.00	22,744,800
七十七銀行	48,300	4,690.00	226,527,000
秋田銀行	11,100	2,288.00	25,396,800
山形銀行	18,400	1,095.00	20,148,000
岩手銀行	10,500	2,558.00	26,859,000
東邦銀行	131,400	362.00	47,566,800
東北銀行	2,700	1,199.00	3,237,300
ふくおかフィナンシャルグループ	144,600	4,268.00	617,152,800
スルガ銀行	146,400	971.00	142,154,400
八十二銀行	356,400	1,037.00	369,586,800
山梨中央銀行	18,600	1,916.00	35,637,600
大垣共立銀行	31,700	2,185.00	69,264,500
福井銀行	14,800	1,932.00	28,593,600
清水銀行	6,600	1,570.00	10,362,000
富山銀行	900	1,817.00	1,635,300
滋賀銀行	27,600	4,150.00	114,540,000
南都銀行	25,000	3,385.00	84,625,000
百五銀行	156,200	645.00	100,749,000
紀陽銀行	59,400	1,852.00	110,008,800
ほくほくフィナンシャルグループ	102,800	2,081.50	213,978,200
山陰合同銀行	103,900	1,433.00	148,888,700

鳥取銀行	1,900	1,355.00	2,574,500
百十四銀行	16,300	3,185.00	51,915,500
四国銀行	24,300	1,089.00	26,462,700
阿波銀行	23,300	2,749.00	64,051,700
大分銀行	10,000	3,425.00	34,250,000
宮崎銀行	10,000	3,360.00	33,600,000
佐賀銀行	9,700	2,584.00	25,064,800
琉球銀行	35,300	1,244.00	43,913,200
セブン銀行	520,500	261.50	136,110,750
みずほフィナンシャルグループ	2,241,600	3,145.00	7,049,832,000
高知銀行	1,900	879.00	1,670,100
山口フィナンシャルグループ	162,800	1,781.00	289,946,800
名古屋銀行	10,600	7,210.00	76,426,000
北洋銀行	251,600	549.00	138,128,400
大光銀行	1,800	1,517.00	2,730,600
愛媛銀行	22,400	1,167.00	26,140,800
トマト銀行	2,000	1,190.00	2,380,000
京葉銀行	68,400	793.00	54,241,200
栃木銀行	82,900	366.00	30,341,400
北日本銀行	5,400	2,540.00	13,716,000
東和銀行	30,500	677.00	20,648,500
福島銀行	5,800	267.00	1,548,600
大東銀行	2,400	718.00	1,723,200
トモニホールディングス	157,200	402.00	63,194,400
フィデアホールディングス	17,200	1,576.00	27,107,200
池田泉州ホールディングス	230,300	389.00	89,586,700
F P G	61,800	2,057.00	127,122,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	27,000	1,297.00	35,019,000
マーキュリアホールディングス	2,900	854.00	2,476,600
S B I ホールディングス	266,500	3,954.00	1,053,741,000
ジャフコ グループ	49,500	1,850.00	91,575,000
大和証券グループ本社	1,286,500	1,120.50	1,441,523,250
野村ホールディングス	2,792,800	929.00	2,594,511,200
岡三証券グループ	145,900	757.00	110,446,300
丸三証券	55,300	1,039.00	57,456,700
東洋証券	44,300	370.00	16,391,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	197,300	581.00	114,631,300
光世証券	1,400	637.00	891,800
水戸証券	49,200	537.00	26,420,400
いちよし証券	31,200	818.00	25,521,600
松井証券	81,800	805.00	65,849,000
マネックスグループ	162,800	813.00	132,356,400

極東証券	22,800	1,470.00	33,516,000
岩井コスモホールディングス	19,000	2,245.00	42,655,000
アイザワ証券グループ	24,000	1,920.00	46,080,000
マネーパートナーズグループ	6,000	259.00	1,554,000
スパークス・グループ	18,500	1,727.00	31,949,500
かんぽ生命保険	169,100	2,856.00	482,949,600
F P パートナー	4,400	4,260.00	18,744,000
S O M P O ホールディングス	749,500	3,075.00	2,304,712,500
アニコム ホールディングス	56,400	588.00	33,163,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,115,500	3,188.00	3,556,214,000
第一生命ホールディングス	780,800	3,880.00	3,029,504,000
東京海上ホールディングス	1,621,400	5,160.00	8,366,424,000
T & D ホールディングス	445,900	2,572.50	1,147,077,750
アドバンスクリエイト	10,600	1,003.00	10,631,800
N E X Y Z . G r o u p	2,600	611.00	1,588,600
全国保証	43,500	5,562.00	241,947,000
あんしん保証	4,600	221.00	1,016,600
イントラスト	2,700	800.00	2,160,000
日本モーゲージサービス	4,100	407.00	1,668,700
C a s a	2,700	867.00	2,340,900
S B I アルヒ	16,600	847.00	14,060,200
プレミアグループ	28,300	2,133.00	60,363,900
ネットプロテクションズホールディングス	57,700	173.00	9,982,100
クレディセゾン	105,400	3,253.00	342,866,200
芙蓉総合リース	15,300	12,655.00	193,621,500
みずほリース	139,500	1,072.00	149,544,000
東京センチュリー	124,500	1,462.50	182,081,250
日本証券金融	61,400	1,599.00	98,178,600
アイフル	245,700	389.00	95,577,300
リコーリース	15,900	5,110.00	81,249,000
イオンフィナンシャルサービス	95,800	1,315.50	126,024,900
アコム	297,700	395.00	117,591,500
ジャックス	17,800	4,960.00	88,288,000
オリエントコーポレーション	54,700	1,044.00	57,106,800
オリックス	996,100	3,329.00	3,316,016,900
三菱H C キャピタル	740,500	1,015.50	751,977,750
九州リースサービス	2,600	1,125.00	2,925,000
日本取引所グループ	428,300	3,757.00	1,609,123,100
イー・ギャランティ	27,400	1,370.00	37,538,000
アサックス	3,100	837.00	2,594,700
N E C キャピタルソリューション	8,300	3,935.00	32,660,500
r o b o t h o m e	49,800	168.00	8,366,400

大東建託	60,900	16,315.00	993,583,500
いちご	192,500	391.00	75,267,500
日本駐車場開発	200,500	195.00	39,097,500
スター・マイカ・ホールディングス	20,200	608.00	12,281,600
S R Eホールディングス	7,300	3,745.00	27,338,500
A Dワークスグループ	14,000	231.00	3,234,000
ヒューリック	387,700	1,454.00	563,715,800
野村不動産ホールディングス	92,600	3,881.00	359,380,600
三重交通グループホールディングス	36,500	564.00	20,586,000
サムティ	26,600	2,623.00	69,771,800
ディア・ライフ	28,800	856.00	24,652,800
地主	12,900	2,404.00	31,011,600
プレサンスコーポレーション	26,600	1,715.00	45,619,000
ハウスコム	1,500	969.00	1,453,500
J P M C	10,000	1,193.00	11,930,000
サンセイランディック	2,100	999.00	2,097,900
フージャースホールディングス	25,600	1,084.00	27,750,400
オープンハウスグループ	61,000	4,490.00	273,890,000
東急不動産ホールディングス	499,800	1,040.50	520,041,900
飯田グループホールディングス	159,400	2,088.00	332,827,200
イーランド	1,200	1,560.00	1,872,000
ムゲンエステート	4,100	1,131.00	4,637,100
A n d D oホールディングス	10,000	1,170.00	11,700,000
シーアールイー	9,700	1,328.00	12,881,600
ケイアイスター不動産	8,100	3,395.00	27,499,500
グッドコムアセット	16,100	678.00	10,915,800
ジェイ・エス・ビー	8,500	2,739.00	23,281,500
ロードスターキャピタル	11,000	2,948.00	32,428,000
テンポイノベーション	2,300	846.00	1,945,800
フェイスネットワーク	1,900	1,719.00	3,266,100
霞ヶ関キャピタル	6,800	17,120.00	116,416,000
パーク24	108,200	1,660.50	179,666,100
パラカ	6,200	1,950.00	12,090,000
三井不動産	2,304,300	1,402.50	3,231,780,750
三菱地所	1,085,700	2,541.50	2,759,306,550
平和不動産	27,100	3,875.00	105,012,500
東京建物	145,300	2,442.50	354,895,250
京阪神ビルディング	31,400	1,483.00	46,566,200
住友不動産	240,300	4,861.00	1,168,098,300
テーオーシー	30,300	697.00	21,119,100
レオパレス21	166,200	524.00	87,088,800
スターツコーポレーション	24,000	3,340.00	80,160,000

フジ住宅	21,700	741.00	16,079,700
空港施設	24,300	597.00	14,507,100
明和地所	11,200	942.00	10,550,400
ゴールドクレスト	13,700	2,364.00	32,386,800
エスリード	8,000	4,005.00	32,040,000
日神グループホールディングス	27,700	522.00	14,459,400
日本エスコン	31,100	1,046.00	32,530,600
MIRARTHホールディングス	76,300	485.00	37,005,500
A V A N T I A	3,700	830.00	3,071,000
イオンモール	86,400	1,859.00	160,617,600
毎日コムネット	2,700	793.00	2,141,100
ファースト住建	2,700	1,051.00	2,837,700
カチタス	44,900	1,636.00	73,456,400
トーセイ	27,900	2,200.00	61,380,000
穴吹興産	1,600	2,231.00	3,569,600
サンフロンティア不動産	24,900	1,971.00	49,077,900
F Jネクストホールディングス	17,900	1,245.00	22,285,500
インテリックス	1,300	549.00	713,700
ランドビジネス	2,000	246.00	492,000
サンネクスタグループ	2,300	1,028.00	2,364,400
グランディハウス	14,900	581.00	8,656,900
日本空港ビルデング	58,800	5,385.00	316,638,000
明豊ファシリティワークス	3,200	895.00	2,864,000
L I F U L L	60,600	161.00	9,756,600
M I X I	37,300	2,770.00	103,321,000
ジェイエシーリクルートメント	63,000	681.00	42,903,000
日本M & Aセンターホールディングス	276,500	736.00	203,504,000
メンバーズ	6,200	835.00	5,177,000
中広	1,500	504.00	756,000
UTグループ	22,600	2,925.00	66,105,000
アイティメディア	6,800	1,813.00	12,328,400
ケアネット	35,900	523.00	18,775,700
E・Jホールディングス	10,300	1,858.00	19,137,400
オープンアップグループ	52,200	2,050.00	107,010,000
コシダカホールディングス	52,200	836.00	43,639,200
アルトナー	2,500	2,126.00	5,315,000
パソナグループ	21,100	2,240.00	47,264,000
C D S	1,600	1,770.00	2,832,000
リンクアンドモチベーション	49,900	451.00	22,504,900
エス・エム・エス	60,900	1,909.50	116,288,550
サニーサイドアップグループ	2,400	680.00	1,632,000
パーソルホールディングス	1,765,700	227.20	401,167,040

リニカル	4,300	395.00	1,698,500
クックパッド	49,000	168.00	8,232,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,100	766.00	2,374,600
学情	9,000	1,757.00	15,813,000
スタジオアリス	8,800	2,025.00	17,820,000
エプロ	1,900	815.00	1,548,500
N J S	3,900	3,380.00	13,182,000
総合警備保障	289,800	929.00	269,224,200
カカクコム	112,600	1,911.00	215,178,600
アイロムグループ	7,100	2,782.00	19,752,200
セントケア・ホールディング	12,900	821.00	10,590,900
サイネックス	1,300	722.00	938,600
ルネサンス	13,700	930.00	12,741,000
ディップ	26,600	2,636.00	70,117,600
デジタルホールディングス	9,200	1,041.00	9,577,200
新日本科学	15,900	1,301.00	20,685,900
キャリアデザインセンター	1,200	1,698.00	2,037,600
エムスリー	342,700	1,551.00	531,527,700
ツカダ・グローバルホールディング	3,700	476.00	1,761,200
ウェルネット	5,600	603.00	3,376,800
ワールドホールディングス	7,900	2,265.00	17,893,500
ディー・エヌ・エー	61,800	1,461.50	90,320,700
博報堂D Yホールディングス	221,200	1,362.00	301,274,400
ぐるなび	33,100	307.00	10,161,700
タカミヤ	24,000	482.00	11,568,000
ファンコミュニケーションズ	24,900	408.00	10,159,200
ライク	6,600	1,602.00	10,573,200
A o b a - B B T	2,800	349.00	977,200
エスプール	50,600	322.00	16,293,200
W D Bホールディングス	9,000	1,643.00	14,787,000
ティア	4,400	461.00	2,028,400
C D G	800	1,285.00	1,028,000
アドウェイズ	24,500	404.00	9,898,000
バリューコマース	15,400	1,040.00	16,016,000
インフォマート	180,700	312.00	56,378,400
J Pホールディングス	44,900	500.00	22,450,000
エコナックホールディングス	6,900	127.00	876,300
C Lホールディングス	4,300	1,407.00	6,050,100
プレステージ・インターナショナル	81,500	639.00	52,078,500
アミューズ	10,700	1,599.00	17,109,300
ドリームインキュベータ	6,000	2,223.00	13,338,000
クイック	12,200	2,145.00	26,169,000

T A C	4,100	180.00	738,000
電通グループ	170,400	4,168.00	710,227,200
イオンファンタジー	6,300	2,234.00	14,074,200
シーティーエス	22,200	768.00	17,049,600
H . U . グループホールディングス	50,900	2,472.00	125,824,800
アルプス技研	16,500	2,631.00	43,411,500
日本空調サービス	18,900	948.00	17,917,200
オリエンタルランド	917,400	4,567.00	4,189,765,800
ダスキン	38,500	3,549.00	136,636,500
明光ネットワークジャパン	21,400	716.00	15,322,400
ファルコホールディングス	7,800	2,299.00	17,932,200
ラウンドワン	163,700	718.00	117,536,600
リゾートトラスト	75,400	2,544.50	191,855,300
ビー・エム・エル	21,400	2,792.00	59,748,800
リソー教育	89,500	257.00	23,001,500
早稲田アカデミー	9,800	1,504.00	14,739,200
ユー・エス・エス	389,100	1,251.50	486,958,650
東京個別指導学院	21,200	410.00	8,692,000
サイバーエージェント	383,300	1,008.00	386,366,400
楽天グループ	1,487,600	775.90	1,154,228,840
クリーク・アンド・リバー社	8,900	1,682.00	14,969,800
S B I グローバルアセットマネジメント	34,300	653.00	22,397,900
テー・オー・ダブリュー	34,600	353.00	12,213,800
山田コンサルティンググループ	7,700	1,932.00	14,876,400
セントラルスポーツ	6,600	2,489.00	16,427,400
フルキャストホールディングス	16,700	1,414.00	23,613,800
エン・ジャパン	28,300	2,661.00	75,306,300
リソルホールディングス	600	4,915.00	2,949,000
テクノプロ・ホールディングス	101,600	2,651.00	269,341,600
アトラグループ	1,700	163.00	277,100
アイ・アールジャパンホールディングス	9,200	1,229.00	11,306,800
K e e P e r 技研	10,800	3,755.00	40,554,000
ファーストロジック	2,300	497.00	1,143,100
三機サービス	1,200	1,253.00	1,503,600
G u n o s y	14,100	702.00	9,898,200
デザインワン・ジャパン	3,600	137.00	493,200
イー・ガーディアン	8,400	1,863.00	15,649,200
リブセンス	3,700	237.00	876,900
ジャパンマテリアル	53,200	1,974.00	105,016,800
ベクトル	21,400	1,294.00	27,691,600
ウチヤマホールディングス	3,200	343.00	1,097,600
チャーム・ケア・コーポレーション	14,600	1,444.00	21,082,400

キャリアリンク	6,500	2,438.00	15,847,000
I B J	13,700	596.00	8,165,200
アサンテ	8,700	1,685.00	14,659,500
バリューHR	15,300	1,319.00	20,180,700
M & Aキャピタルパートナーズ	14,100	2,060.00	29,046,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	1,059.00	7,518,900
E R Iホールディングス	1,700	2,349.00	3,993,300
アビスト	1,000	3,290.00	3,290,000
シグマクシス・ホールディングス	22,900	1,374.00	31,464,600
ウィルグループ	14,700	972.00	14,288,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	8,600	140.00	1,204,000
メドピア	15,500	573.00	8,881,500
レアジョブ	1,500	452.00	678,000
リクルートホールディングス	1,248,400	7,838.00	9,784,959,200
エラン	23,200	862.00	19,998,400
土木管理総合試験所	3,400	324.00	1,101,600
日本郵政	2,037,100	1,457.00	2,968,054,700
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,585.00	29,798,000
鎌倉新書	15,200	536.00	8,147,200
S M N	1,800	300.00	540,000
グローバルキッズCOMPANY	1,500	639.00	958,500
エアトリ	12,900	1,259.00	16,241,100
アトラエ	13,700	575.00	7,877,500
ストライク	8,600	4,210.00	36,206,000
ソラスト	48,300	469.00	22,652,700
セラク	5,500	1,093.00	6,011,500
インソース	37,900	929.00	35,209,100
ベイカレント・コンサルティング	127,500	3,249.00	414,247,500
Orchestra Holdings	4,000	1,353.00	5,412,000
アイモバイル	22,600	462.00	10,441,200
キャリアインデックス	3,400	174.00	591,600
MS - Japan	7,300	1,052.00	7,679,600
船場	1,400	1,225.00	1,715,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	56,300	2,825.00	159,047,500
フルテック	1,000	1,117.00	1,117,000
GameWith	3,400	288.00	979,200
MS & Consulting	1,200	600.00	720,000
エル・ティー・エス	2,100	2,067.00	4,340,700
ミダックホールディングス	10,700	1,417.00	15,161,900
キュービーネットホールディングス	10,200	1,135.00	11,577,000
R P Aホールディングス	24,500	249.00	6,100,500
スプリックス	2,000	778.00	1,556,000

マネジメントソリューションズ	7,600	1,750.00	13,300,000
プロレド・パートナーズ	4,800	596.00	2,860,800
テノ・ホールディングス	1,300	424.00	551,200
フロンティア・マネジメント	4,500	1,238.00	5,571,000
コプロ・ホールディングス	2,000	1,504.00	3,008,000
ギークス	1,300	463.00	601,900
アンビスホールディングス	37,200	2,055.00	76,446,000
カーブスホールディングス	47,700	729.00	34,773,300
フォーラムエンジニアリング	23,900	850.00	20,315,000
Fast Fitness Japan	6,100	1,219.00	7,435,900
ダイレクトマーケティングミックス	18,900	235.00	4,441,500
ポピンズ	2,800	1,255.00	3,514,000
LITALICO	13,600	1,773.00	24,112,800
コンフィデンス・インターワークス	700	1,801.00	1,260,700
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	472.00	1,699,200
リログループ	87,000	1,581.50	137,590,500
東祥	12,400	721.00	8,940,400
ID&Eホールディングス	10,500	4,180.00	43,890,000
ビーウィズ	3,700	1,960.00	7,252,000
TREホールディングス	33,400	1,179.00	39,378,600
人・夢・技術グループ	7,100	1,696.00	12,041,600
NISSOホールディングス	15,300	837.00	12,806,100
大栄環境	31,600	2,533.00	80,042,800
日本管財ホールディングス	18,300	2,549.00	46,646,700
M&A総研ホールディングス	18,500	3,980.00	73,630,000
エイチ・アイ・エス	50,500	1,691.00	85,395,500
ラックランド	8,000	1,790.00	14,320,000
共立メンテナンス	54,500	3,114.00	169,713,000
イチネンホールディングス	18,500	1,606.00	29,711,000
建設技術研究所	9,000	5,060.00	45,540,000
スペース	11,600	1,049.00	12,168,400
燦ホールディングス	16,500	1,161.00	19,156,500
スバル興業	5,800	2,750.00	15,950,000
東京テアトル	2,100	1,108.00	2,326,800
タナベコンサルティンググループ	6,500	1,011.00	6,571,500
ナガワ	5,400	7,440.00	40,176,000
東京都競馬	14,600	4,190.00	61,174,000
カナモト	27,000	2,625.00	70,875,000
ニシオホールディングス	16,100	3,865.00	62,226,500
トランス・コスモス	21,600	3,305.00	71,388,000
乃村工藝社	75,900	823.00	62,465,700
藤田観光	6,900	6,200.00	42,780,000

KNT-CTホールディングス	10,300	1,296.00	13,348,800	
トーカイ	15,500	2,066.00	32,023,000	
セコム	176,600	10,020.00	1,769,532,000	
セントラル警備保障	9,400	2,888.00	27,147,200	
丹青社	33,900	830.00	28,137,000	
メイテックグループホールディングス	62,200	3,078.00	191,451,600	
応用地質	16,300	2,578.00	42,021,400	
船井総研ホールディングス	34,800	2,202.00	76,629,600	
進学会ホールディングス	2,500	239.00	597,500	
オオバ	4,100	1,072.00	4,395,200	
いであ	1,700	2,387.00	4,057,900	
学究社	7,000	2,078.00	14,546,000	
イオンディライト	18,700	3,835.00	71,714,500	
ナック	15,200	527.00	8,010,400	
ダイセキ	35,500	3,100.00	110,050,000	
ステップ	6,400	1,930.00	12,352,000	
合 計	270,769,200		652,955,918,130	

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,675,773,099
コール・ローン	1,085,031,385
株式	729,884,498,931
投資信託受益証券	133,333,305
投資証券	13,276,829,439
派生商品評価勘定	475,388,387
未収入金	20,090,378
未収配当金	1,071,258,530
未収利息	2,019
差入委託証拠金	6,750,260,442
流動資産合計	766,372,465,915
資産合計	766,372,465,915
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,459,253
前受金	465,943,309
未払解約金	966,061,112

	2024年 5月24日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,441,463,674
負債合計	1,441,463,674
純資産の部	
元本等	
元本	115,374,339,720
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	649,556,662,521
元本等合計	764,931,002,241
純資産合計	764,931,002,241
負債純資産合計	766,372,465,915

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金

2024年 5月24日現在	
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,374,339,720口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 6.6300円 (1万口当たり純資産額) (66,300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 5月24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 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	121,801,757,578円
期中追加設定元本額	12,205,476,639円
期中一部解約元本額	18,632,894,497円
期末元本額	115,374,339,720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）	1,442,631,388円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,530,473円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,213,793,635円
世界経済インデックスファンド	13,963,128,330円
外国株式インデックス・オープン	889,227,012円
D C マイセクション2 5	535,585,042円
D C マイセクション5 0	3,036,590,848円
D C マイセクション7 5	4,047,300,321円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,155,681,220円
D C マイセクションS 2 5	321,710,284円
D C マイセクションS 5 0	1,778,536,321円
D C マイセクションS 7 5	1,931,377,907円
D C ターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	12,907,867円
D C ターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	125,320,810円
D C ターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	101,874,872円
D C 世界経済インデックスファンド	9,217,515,490円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	890,445,445円
マイセクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,770,669円
マイセクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,805,608円
外国株式インデックス・オープンV A 1（適格機関投資家専用）	19,962,700円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	5,360,270円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	27,737,963円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	6,183,882円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	17,961,616円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	124,109,685円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	111,649,471円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	873,377,114円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	56,273,050円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	12,523,031円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	95,785,969円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	31,423,278円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	680,179,754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）	729,918,299円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,159,466,999円
コア投資戦略ファンド（安定型）	111,815,412円
コア投資戦略ファンド（成長型）	273,795,458円
分散投資コア戦略ファンドA	1,464,570,400円
分散投資コア戦略ファンドS	6,892,035,311円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,522,553,678円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	999,415,785円
コア投資戦略ファンド（切替型）	119,535,001円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	430,477,547円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,098,115円
S M T インデックスバランス・オープン	113,770,931円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	67,997,457円
外国株式S M T B セレクション（SMA専用）	4,902,262,860円
S M T 世界経済インデックス・オープン	254,799,704円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,169,068,355円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	191,033,286円

区分	2024年 5月24日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,415,949円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,242,596,296円
グローバル経済コア	677,103,053円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,541,807円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,887,650円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	114,572,329円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,143,797円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	173,104,278円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	168,483,630円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,090,073円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	92,231,792円
10資産分散投資ファンド	61,825,769円
グローバル10資産バランスファンド	14,878,668円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	21,804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	23,954円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	24,991円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	24,991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	21,884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	13,729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	12,139円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	1,502円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	47,178,246円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	201,502,131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）	574,284,267円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,410,656,822円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	122,583,106円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,868,495円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	76,666,067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）	78,259,753円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	161,828,459円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	156,318,641円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	155,645,401円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	157,998,954円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	156,432,494円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	78,612,474円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	99,558,131円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	133,149,239,558
投資信託受益証券	17,198,107
投資証券	577,229,082
合計	133,709,270,533

(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 5月24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	20,684,454,306	-	21,150,397,615	465,943,309
合計		20,684,454,306	-	21,150,397,615	465,943,309

(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 5月24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	301,018,400	-	301,032,575	14,175
	アメリカドル	224,595,800	-	224,602,235	6,435
	ユーロ	76,422,600	-	76,430,340	7,740
合計		301,018,400	-	301,032,575	14,175

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	29.52	690,531.84	
	BAKER HUGHES CO	77,332	31.81	2,459,930.92	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	157.11	2,843,533.89	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	89.11	755,831.02	
	CHEVRON CORP	138,024	156.94	21,661,486.56	
	CONOCOPHILLIPS	92,757	117.65	10,912,861.05	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.07	1,476,560.22	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	48.23	2,423,846.88	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	191.96	2,546,733.32	
	EOG RESOURCES INC	45,763	124.03	5,675,984.89	
	EQT CORPORATION	27,026	39.91	1,078,607.66	
	EXXON MOBIL	350,257	113.51	39,757,672.07	
	HALLIBURTON CO	70,302	35.98	2,529,465.96	
	HESS CORP	21,602	150.28	3,246,348.56	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	56.36	756,858.44	

KINDER MORGAN INC	160,038	19.08	3,053,525.04
MARATHON OIL CORP	50,360	25.77	1,297,777.20
MARATHON PETROLEUM CORP	29,195	176.56	5,154,669.20
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	61.96	3,061,195.76
ONEOK INC	43,535	80.19	3,491,071.65
OVINTIV INC	20,398	48.28	984,815.44
PHILLIPS 66	34,260	142.19	4,871,429.40
SCHLUMBERGER	110,287	46.32	5,108,493.84
TARGA RESOURCES CORP	17,298	113.85	1,969,377.30
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	608.43	972,879.57
VALERO ENERGY CORP	26,282	162.56	4,272,401.92
WILLIAMS COS	90,577	40.11	3,633,043.47
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	263.00	4,596,977.00
ALBEMARLE CORP	8,403	122.95	1,033,148.85
AMCOR PLC	110,292	9.88	1,089,684.96
AVERY DENNISON CORP	6,638	227.03	1,507,025.14
BALL CORP	25,896	68.56	1,775,429.76
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	151.59	1,300,945.38
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,499	78.26	1,291,211.74
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	16.92	727,560.00
CORTEVA INC	56,865	55.57	3,159,988.05
CROWN HOLDINGS INC	9,940	83.37	828,697.80
DOW INC	51,980	56.92	2,958,701.60
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	78.93	2,693,012.67
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	99.05	874,809.60
ECOLAB INC	20,345	233.13	4,743,029.85
FMC CORP	8,264	60.05	496,253.20
FREEMONT-MCMORAN INC	110,698	51.20	5,667,737.60
INT'L PAPER CO	25,191	44.16	1,112,434.56
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	94.47	1,823,932.29
LINDE PLC	37,432	432.30	16,181,853.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	97.42	1,923,557.90
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	573.46	2,877,048.82
MOSAIC CO/THE	27,732	31.04	860,801.28
NEWMONT CORPORATION	86,194	41.23	3,553,778.62
NUCOR CORP	18,727	171.53	3,212,242.31
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,221	180.24	1,121,273.04
PPG INDUSTRIES INC	17,495	131.02	2,292,194.90
RELIANCE INC	4,126	304.80	1,257,604.80
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	111.96	1,170,653.76
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,426	303.09	5,584,736.34
STEEL DYNAMICS INC	11,618	133.57	1,551,816.26

VULCAN MATERIALS CO	10,153	257.21	2,611,453.13
WESTLAKE CORP	2,222	156.70	348,187.40
WESTROCK CO	21,356	53.02	1,132,295.12
3 M COMPANY	43,663	99.51	4,344,905.13
AECOM	10,456	89.25	933,198.00
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	91.22	1,339,018.38
ALLEGION PLC	7,721	121.56	938,564.76
AMETEK INC	17,753	172.72	3,066,298.16
AXON ENTERPRISE INC	5,367	279.99	1,502,706.33
BOEING CO	43,809	172.21	7,544,347.89
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	166.36	1,584,079.92
CARLISLE COS INC	3,456	423.20	1,462,579.20
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	64.35	3,993,754.05
CATERPILLAR	39,504	350.70	13,854,052.80
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	10.68	865,357.68
CUMMINS INC	11,452	283.90	3,251,222.80
DEERE&CO	20,534	379.24	7,787,314.16
DOVER CORP	10,657	184.28	1,963,871.96
EATON CORP	30,932	338.42	10,468,007.44
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	112.49	4,950,684.90
FASTENAL CO	44,011	65.80	2,895,923.80
FERGUSON PLC	16,260	207.43	3,372,811.80
FORTIVE CORP	25,894	75.58	1,957,068.52
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	70.03	722,009.30
GE VERNOVA INC	20,868	161.67	3,373,729.56
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	296.52	5,384,506.68
GENERAL ELECTRIC CO	83,474	165.26	13,794,913.24
GRACO INC	13,378	81.56	1,091,109.68
GRAINGER (WW) INC	3,363	954.70	3,210,656.10
HEICO CORP	3,640	215.86	785,730.40
HEICO CORP-CLASS A	5,700	174.29	993,453.00
HONEYWELL INTL INC	51,027	199.39	10,174,273.53
HOWMET AEROSPACE INC	28,204	82.42	2,324,573.68
HUBBELL INC	4,458	400.61	1,785,919.38
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	252.88	868,137.04
IDEX CORP	5,916	215.54	1,275,134.64
ILLINOIS TOOL WORKS	22,812	241.45	5,507,957.40
INGERSOLL-RAND INC	31,562	95.10	3,001,546.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	38.45	488,315.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	73.26	3,682,487.16
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	223.11	3,275,701.02
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	491.82	1,242,337.32

LOCKHEED MARTIN CORP	17,553	467.08	8,198,655.24
MASCO CORP	18,934	68.74	1,301,523.16
NORDSON CORP	4,121	237.90	980,385.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,303	467.21	5,280,874.63
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	97.13	2,983,542.21
OWENS CORNING	6,460	176.67	1,141,288.20
PACCAR INC	40,380	108.87	4,396,170.60
PARKER HANNIFIN CORP	9,881	526.57	5,203,038.17
PENTAIR PLC	14,383	82.53	1,187,028.99
QUANTA SERVICES INC	11,573	276.55	3,200,513.15
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	262.04	2,218,430.64
RTX CORP	112,196	105.41	11,826,580.36
SMITH (A.O.) CORP	9,016	84.07	757,975.12
SNAP-ON INC	4,000	270.28	1,081,120.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	86.00	1,083,428.00
TEXTRON	13,876	87.75	1,217,619.00
TORO CO	8,812	83.11	732,365.32
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	332.92	5,992,560.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,240	1,330.72	5,642,252.80
UNITED RENTALS INC	5,364	666.77	3,576,554.28
VERTIV HOLDINGS CO-A	26,201	101.24	2,652,589.24
WABTEC CORP	13,304	169.48	2,254,761.92
WATSCO INC	2,656	478.81	1,271,719.36
XYLEM INC	17,693	143.72	2,542,837.96
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	251.49	8,027,309.31
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	152.36	1,407,806.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	8,232	201.69	1,660,312.08
CINTAS CORP	7,043	696.07	4,902,421.01
COPART INC	69,100	53.52	3,698,232.00
DAYFORCE INC	10,668	60.80	648,614.40
EQUIFAX INC	9,160	237.16	2,172,385.60
JACOBS SOLUTIONS INC	8,836	138.52	1,223,962.72
LEIDOS HOLDINGS	9,314	149.77	1,394,957.78
PAYCHEX INC	24,118	125.66	3,030,667.88
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	174.44	738,753.40
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	164.19	562,022.37
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	186.33	3,066,060.15
ROBERT HALF INC	7,185	66.84	480,245.40
ROLLINS INC	25,466	45.38	1,155,647.08
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	61.96	954,307.92
TRANSUNION	15,741	74.89	1,178,843.49
VERALTO CORP	17,691	99.86	1,766,623.26

VERISK ANALYTICS INC	10,738	249.25	2,676,446.50
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	164.56	3,254,174.00
WASTE MANAGEMENT INC	30,660	209.49	6,422,963.40
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	84.59	707,806.36
CSX CORP	152,551	33.50	5,110,458.50
DELTA AIR LINES INC	9,648	51.20	493,977.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	116.69	1,432,953.20
FEDEX CORP	18,863	249.29	4,702,357.27
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.67	414,750.37
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	157.88	907,494.24
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	46.93	639,327.39
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	226.30	4,069,326.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,712	171.57	2,524,137.84
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	26.65	360,654.45
U-HAUL HOLDING CO	6,606	61.93	409,109.58
UBER TECHNOLOGIES INC	144,319	63.60	9,178,688.40
UNION PACIFIC CORP	46,736	232.71	10,875,934.56
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	139.10	7,729,369.70
APTIV PLC	21,896	80.28	1,757,810.88
BORGWARNER INC	19,781	35.08	693,917.48
FORD MOTOR COMPANY	314,432	12.11	3,807,771.52
GENERAL MOTORS CO	103,664	43.73	4,533,226.72
LEAR CORP	3,688	123.84	456,721.92
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	9.95	510,793.20
TESLA INC	221,215	173.74	38,433,894.10
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	904.65	1,902,478.95
DR HORTON INC	22,973	142.82	3,281,003.86
GARMIN LTD	11,170	162.73	1,817,694.10
HASBRO INC	10,572	60.35	638,020.20
LENNAR CORP-CL A	18,864	154.52	2,914,865.28
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	299.73	2,583,415.96
NIKE B	94,445	91.40	8,632,273.00
NVR INC	247	7,392.14	1,825,858.58
PULTE GROUP INC	16,747	112.74	1,888,056.78
AIRBNB INC-CLASS A	32,814	141.04	4,628,086.56
BOOKING HOLDINGS INC	2,694	3,752.68	10,109,719.92
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	32.53	571,226.80
CARNIVAL CORPORATION	71,810	14.78	1,061,351.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,089	3,138.28	6,555,866.92
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	147.66	1,359,505.62
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	502.13	1,430,066.24
DOORDASH INC - A	19,212	110.39	2,120,812.68

DRAFTKINGS INC	32,654	40.60	1,325,752.40
EXPEDIA GROUP INC	9,628	110.49	1,063,797.72
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	200.03	3,927,589.05
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	146.82	556,007.34
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	44.80	1,369,312.00
MARRIOTT INTL A	19,516	232.06	4,528,882.96
MCDONALD'S CORP	55,965	257.93	14,435,052.45
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	38.93	885,813.22
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,429	146.31	2,696,346.99
STARBUCKS CORP	88,273	78.30	6,912,217.26
VAIL RESORTS INC	3,014	189.93	572,449.02
WYNN RESORTS LTD	6,702	94.09	630,591.18
YUM BRANDS INC	22,162	137.01	3,036,415.62
ALPHABET INC-CL A	456,849	173.55	79,286,143.95
ALPHABET INC-CL C	397,755	175.06	69,630,990.30
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	268.41	1,930,404.72
COMCAST CORP-CL A	309,993	38.68	11,990,529.24
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	134.40	2,652,115.20
FOX CORP - CLASS A	21,544	32.97	710,305.68
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.65	317,074.25
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	31.40	895,245.40
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	50.59	463,050.27
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	70.73	1,087,756.67
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	22.17	301,157.28
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	93.48	1,085,583.24
MATCH GROUP INC	22,730	29.48	670,080.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	171,346	465.78	79,809,539.88
NETFLIX INC	33,607	635.67	21,362,961.69
NEWS CORP-CLASS A	33,479	25.88	866,436.52
OMNICOM GROUP	14,048	94.22	1,323,602.56
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	11.79	383,269.32
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	41.30	1,890,177.10
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	31.97	1,122,562.61
ROKU INC	9,122	56.20	512,656.40
SEA LTD-ADR	28,338	71.73	2,032,684.74
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	2.73	165,077.64
SNAP INC - A	91,303	15.18	1,385,979.54
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	152.33	1,960,030.11
THE WALT DISNEY CO	142,615	100.66	14,355,625.90
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	92.51	3,106,763.33
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	7.70	1,366,080.10
AMAZON.COM	717,541	181.05	129,910,798.05

AUTOZONE INC	1,368	2,777.54	3,799,674.72
BATH & BODY WORKS INC	19,328	48.31	933,735.68
BEST BUY COMPANY INC	15,285	69.63	1,064,294.55
BURLINGTON STORES INC	5,108	186.64	953,357.12
CARMAX INC	10,695	68.93	737,206.35
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	186.60	923,670.00
EBAY	41,952	52.81	2,215,485.12
ETSY INC	10,294	62.08	639,051.52
GENUINE PARTS CO	9,903	145.65	1,442,371.95
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	29.45	206,150.00
HOME DEPOT	77,067	326.89	25,192,431.63
LKQ CORP	19,286	42.40	817,726.40
LOWES COMPANIES	44,328	217.48	9,640,453.44
MERCADOLIBRE INC	3,573	1,707.40	6,100,540.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	975.87	4,466,556.99
POOL CORP	2,664	365.09	972,599.76
ROSS STORES INC	25,425	131.86	3,352,540.50
TJX COMPANIES INC	88,680	100.16	8,882,188.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	283.26	2,222,457.96
ULTA BEAUTY INC	3,920	376.14	1,474,468.80
WILLIAMS-SONOMA INC	4,460	284.56	1,269,137.60
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	20.48	512,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,237	796.34	27,264,292.58
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	139.12	2,265,847.44
DOLLAR TREE INC	16,318	114.60	1,870,042.80
KROGER CO	50,664	53.31	2,700,897.84
SYSCO CORP	40,090	72.87	2,921,358.30
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,264	144.41	5,092,474.24
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	15.95	822,493.65
WALMART INC	347,772	64.84	22,549,536.48
ALTRIA GROUP INC	139,093	45.64	6,348,204.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	60.72	2,466,324.96
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	46.32	1,111,957.92
BUNGE GLOBAL SA	11,604	102.37	1,187,901.48
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.64	724,261.16
CELSIUS HOLDINGS INC	9,973	91.70	914,573.96
COCA-COLA CO	316,878	62.09	19,674,955.02
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	72.93	1,122,761.39
CONAGRA BRANDS INC	33,324	30.44	1,014,382.56
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	245.12	3,217,445.12
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	40.58	537,360.36
GENERAL MILLS INC	43,531	69.09	3,007,556.79

HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	201.04	2,199,779.68
HORMEL FOODS CORP	23,338	34.75	810,995.50
JM SMUCKER CO	7,850	110.40	866,640.00
KELLANOVA	18,819	61.33	1,154,169.27
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	33.98	2,757,578.94
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	35.80	2,468,911.20
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	87.74	1,042,000.24
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	72.15	1,305,337.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	53.72	788,018.68
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	68.85	7,258,924.35
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	52.64	3,071,438.72
PEPSICO INC	105,521	179.27	18,916,749.67
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	99.65	11,856,655.95
TYSON FOODS INC	23,306	60.32	1,405,817.92
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	106.42	2,058,801.32
CLOROX COMPANY	9,570	131.29	1,256,445.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	93.73	5,805,448.74
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	126.13	2,371,244.00
KENVUE INC	133,461	19.44	2,594,481.84
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	131.84	3,543,463.68
PROCTER & GAMBLE CO	181,466	165.49	30,030,808.34
ABBOTT LABORATORIES	133,298	104.23	13,893,650.54
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	252.39	1,325,804.67
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	34.00	1,413,584.00
BECTON DICKINSON & CO	22,142	230.35	5,100,409.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	74.38	8,339,559.98
CARDINAL HEALTH	19,151	96.05	1,839,453.55
CENCORA INC	13,171	219.82	2,895,249.22
CENTENE CORP	40,934	77.33	3,165,426.22
COOPER COS INC/THE	16,848	94.44	1,591,125.12
CVS HEALTH CORP	99,034	55.65	5,511,242.10
DAVITA INC	4,627	132.25	611,920.75
DEXCOM INC	28,772	125.60	3,613,763.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,175	87.46	4,213,385.50
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	543.94	9,917,114.08
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	79.33	2,617,731.34
HCA HEALTHCARE INC	15,457	315.32	4,873,901.24
HENRY SCHEIN INC	8,755	71.52	626,157.60
HOLOGIC INC	18,875	73.99	1,396,561.25
HUMANA INC	9,818	352.22	3,458,095.96
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	516.10	3,428,968.40
INSULET CORP	5,246	170.79	895,964.34

INTUITIVE SURGICAL INC	27,005	398.39	10,758,521.95
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	197.09	1,290,545.32
MCKESSON CORP	10,179	558.03	5,680,187.37
MEDTRONIC PLC	102,632	81.38	8,352,192.16
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	341.00	1,549,845.00
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	140.04	1,215,407.16
RESMED INC	10,920	211.58	2,310,453.60
SOLVENTUM CORP	10,915	59.93	654,135.95
STERIS PLC	8,172	226.81	1,853,491.32
STRYKER CORP	26,379	330.12	8,708,235.48
TELEFLEX INC	3,934	206.54	812,528.36
THE CIGNA GROUP	22,963	337.83	7,757,590.29
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,401	516.83	36,902,178.83
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	176.91	826,523.52
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	204.58	2,555,408.78
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	115.85	1,767,175.90
ABBVIE INC	136,294	158.26	21,569,888.44
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	150.55	3,280,635.05
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	149.38	1,440,471.34
AMGEN	40,959	306.50	12,553,933.50
AVANTOR INC	49,647	24.18	1,200,464.46
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	290.25	537,833.25
BIO-TECHNE CORP	12,980	80.41	1,043,721.80
BIOGEN INC	10,740	218.06	2,341,964.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	75.90	1,122,029.70
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	155,274	41.54	6,450,081.96
CATALENT INC	13,739	54.65	750,836.35
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	217.55	914,580.20
DANAHER CORP	54,787	261.40	14,321,321.80
ELI LILLY & CO	62,224	808.45	50,304,992.80
EXACT SCIENCES CORP	12,208	54.08	660,208.64
GILEAD SCIENCES INC	96,270	66.17	6,370,185.90
ILLUMINA INC	11,423	105.85	1,209,124.55
INCYTE CORP	15,212	57.45	873,929.40
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	227.09	3,142,017.24
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	103.94	516,685.74
JOHNSON & JOHNSON	185,343	149.70	27,745,847.10
MERCK & CO	195,618	131.09	25,643,563.62
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,479.30	2,406,821.10
MODERNA INC	24,153	164.01	3,961,333.53
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	140.51	947,318.42
PFIZER	432,739	28.69	12,415,281.91

REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	980.57	8,165,206.39
REPLIGEN CORP	4,353	158.78	691,169.34
REVVITY INC	8,524	111.89	953,750.36
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	26.85	807,728.55
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	16.76	1,544,283.16
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,059	585.03	17,585,416.77
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	276.50	1,000,377.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	450.80	8,960,100.80
VIATRIS INC	89,720	10.53	944,751.60
WATERS CORP	4,749	336.79	1,599,415.71
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	328.59	1,894,978.53
ZOETIS INC	35,994	170.90	6,151,374.60
BANK OF AMERICA CORP	549,785	39.17	21,535,078.45
CITIGROUP	146,698	63.02	9,244,907.96
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	35.12	1,388,012.64
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	36.82	2,003,744.40
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,748.20	1,339,121.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	13.58	1,549,640.96
JPMORGAN CHASE & CO	222,518	196.92	43,818,244.56
KEY CORP	71,223	14.46	1,029,884.58
M & T BANK CORP	13,791	149.51	2,061,892.41
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	152.77	4,817,296.41
REGIONS FINL CORP	70,810	18.92	1,339,725.20
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	38.24	4,066,518.08
US BANCORP	117,317	40.02	4,695,026.34
WELLS FARGO & CO	281,146	59.68	16,778,793.28
ALLY FINANCIAL INC	21,529	38.36	825,852.44
AMERICAN EXPRESS	45,006	235.46	10,597,112.76
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	434.15	3,393,316.40
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	29,517	112.88	3,331,878.96
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	144.75	1,849,905.00
BANK NEW YORK CO	56,329	58.33	3,285,670.57
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	405.88	41,114,426.36
BLACKROCK INC	11,583	784.55	9,087,442.65
BLACKSTONE INC	55,334	123.11	6,812,168.74
BLOCK INC	42,352	66.62	2,821,490.24
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	137.49	4,138,036.53
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	43.96	688,809.24
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	180.41	1,588,149.23
CME GROUP INC	27,997	212.07	5,937,323.79
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	218.86	2,756,541.70
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	30.34	584,014.66

CORPAY INC	6,039	269.95	1,630,228.05
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	122.81	2,331,793.47
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	40.43	1,131,352.69
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	436.36	1,373,661.28
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	76.31	3,469,815.70
FISERV INC	46,319	150.20	6,957,113.80
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	23.13	602,999.10
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	73.80	318,520.80
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	103.24	2,142,126.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,012	458.15	11,459,247.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	135.40	5,974,118.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	168.33	877,504.29
KKR & CO INC	44,805	103.98	4,658,823.90
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	274.49	1,506,950.10
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	214.49	687,869.43
MASTERCARD INC-CLASS A	64,870	451.21	29,269,992.70
MOODY'S CORP	12,577	407.02	5,119,090.54
MORGAN STANLEY	93,827	98.92	9,281,366.84
MSCI INC	5,952	490.40	2,918,860.80
NASDAQ INC	29,020	61.52	1,785,310.40
NORTHERN TRUST CORP	15,902	82.86	1,317,639.72
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	61.58	4,882,431.88
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	116.91	2,136,530.25
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	123.39	1,910,817.54
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	19.24	614,006.12
S&P GLOBAL INC	25,151	436.28	10,972,878.28
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	72.34	8,470,652.30
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	67.73	646,821.50
STATE STREET CORP	22,335	74.81	1,670,881.35
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	42.86	1,251,340.56
TOAST INC-CLASS A	20,341	25.38	516,254.58
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	110.69	1,002,962.09
VISA INC-CLASS A SHARES	122,188	274.23	33,507,615.24
AFLAC	43,196	86.78	3,748,548.88
ALLSTATE CORP	20,722	164.00	3,398,408.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	128.57	812,433.83
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	77.58	4,230,747.72
AON PLC	15,249	279.30	4,259,045.70
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	101.93	3,031,092.41
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,294	250.96	4,089,142.24
ASSURANT INC	4,726	166.71	787,871.46
BROWN & BROWN INC	20,155	89.11	1,796,012.05

CHUBB LTD	30,987	263.08	8,152,059.96
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	117.11	1,301,092.10
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	382.97	829,513.02
EVEREST GROUP LTD	3,288	387.38	1,273,705.44
FNF GROUP	20,461	49.91	1,021,208.51
GLOBE LIFE INC	6,909	80.55	556,519.95
HARTFORD FINANCIAL SVCS	21,873	100.65	2,201,517.45
LOEWS CORP	16,402	74.16	1,216,372.32
MARKEL GROUP INC	1,007	1,616.13	1,627,442.91
MARSH & MCLENNAN COS	38,224	207.99	7,950,209.76
METLIFE INC	48,925	71.65	3,505,476.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	81.42	1,509,201.12
PROGRESSIVE CORP	45,236	203.18	9,191,050.48
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,057	117.85	3,424,367.45
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	212.24	3,639,279.28
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	252.50	1,953,592.50
WR BERKLEY CORP	14,360	78.85	1,132,286.00
WEYERHAEUSER CO	52,615	30.11	1,584,237.65
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	305.93	14,792,633.29
ADOBE INC	34,893	483.31	16,864,135.83
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	93.96	1,079,036.64
ANSYS INC	6,794	328.18	2,229,654.92
APPLOVIN CORP-CLASS A	12,260	79.26	971,727.60
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	219.03	524,357.82
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	174.18	1,991,922.48
AUTODESK INC	17,030	215.16	3,664,174.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	52.68	780,348.84
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	52.61	391,576.23
CADENCE DESIGN SYSTEMS	20,540	294.69	6,052,932.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	153.50	1,083,403.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	73.62	1,698,192.54
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,006	68.47	2,533,800.82
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	31.00	381,300.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,478	342.35	5,983,593.30
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	239.86	743,566.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	122.12	2,537,653.60
DOCUSIGN INC	14,969	57.32	858,023.08
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	23.17	534,485.56
DYNATRACE INC	22,028	47.60	1,048,532.80
EPAM SYSTEMS INC	4,768	186.90	891,139.20
FAIR ISAAC CORP	1,816	1,353.18	2,457,374.88
FORTINET INC	49,270	60.93	3,002,021.10

GARTNER INC	5,859	445.69	2,611,297.71
GEN DIGITAL INC	43,555	24.67	1,074,501.85
GODADDY INC - CLASS A	11,388	138.56	1,577,921.28
HUBSPOT INC	3,646	594.86	2,168,859.56
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,082	170.67	12,131,564.94
INTUIT INC	21,468	662.26	14,217,397.68
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	225.35	1,057,792.90
MICROSOFT CORP	545,058	427.00	232,739,766.00
MONDAY.COM LTD	1,631	244.72	399,138.32
MONGODB INC	5,325	355.18	1,891,333.50
OKTA INC	11,505	98.74	1,136,003.70
ORACLE CORP	126,564	124.09	15,705,326.76
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	20.72	3,044,161.68
PALO ALTO NETWORKS INC	24,532	311.44	7,640,246.08
PTC INC	9,741	182.60	1,778,706.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	544.62	4,605,306.72
SALESFORCE INC	74,662	278.57	20,798,593.34
SAMSARA INC-CL A	13,283	39.47	524,280.01
SERVICENOW INC	15,986	758.15	12,119,785.90
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,702	154.58	3,354,695.16
SYNOPSYS INC	11,896	586.30	6,974,624.80
TWILIO INC - A	12,842	58.93	756,779.06
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	491.13	1,639,883.07
UIPATH INC - CLASS A	28,419	19.04	541,097.76
UNITY SOFTWARE INC	16,437	19.60	322,165.20
VERISIGN INC	6,723	172.00	1,156,356.00
WIX.COM LTD	5,010	165.21	827,702.10
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	260.90	4,287,108.80
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	62.42	1,302,642.98
ZSCALER INC	7,204	171.91	1,238,439.64
AMPHENOL CORPORATION	45,860	136.40	6,255,304.00
APPLE INC	1,133,924	186.88	211,907,717.12
ARISTA NETWORKS INC	20,702	301.42	6,239,996.84
CDW CORP/DE	9,823	231.57	2,274,712.11
CISCO SYSTEMS	312,372	46.60	14,556,535.20
CORNING	66,604	36.12	2,405,736.48
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	153.57	2,783,302.68
F5 INC	4,851	169.95	824,427.45
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	18.24	1,777,159.68
HP INC	68,329	32.65	2,230,941.85
JABIL INC	9,340	118.79	1,109,498.60
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	34.59	875,853.39

KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	143.84	1,990,457.92
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	363.35	4,781,322.65
NETAPP INC	15,191	114.04	1,732,381.64
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	93.46	1,359,656.08
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,881	847.38	3,288,681.78
TE CONNECTIVITY LTD	23,161	150.00	3,474,150.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	400.98	1,331,253.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	56.87	1,007,622.66
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	74.16	1,912,586.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	324.06	1,348,737.72
AT&T INC	548,004	17.47	9,573,629.88
LIBERTY GLOBAL LTD-C	18,869	16.48	310,961.12
T-MOBILE US INC	40,175	164.97	6,627,669.75
VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	39.43	12,706,514.65
AES CORP	54,375	20.56	1,117,950.00
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	50.01	1,039,107.78
AMEREN CORPORATION	20,898	71.50	1,494,207.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	89.28	3,635,481.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	128.60	1,860,584.80
ATMOS ENERGY CORP	11,302	113.99	1,288,314.98
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	29.35	1,393,127.10
CMS ENERGY CORP	23,697	60.87	1,442,436.39
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	93.87	2,597,852.25
CONSTELLATION ENERGY	25,114	221.16	5,554,212.24
DOMINION ENERGY INC	62,863	52.54	3,302,822.02
DTE ENERGY COMPANY	15,851	112.06	1,776,263.06
DUKE ENERGY CORP	60,351	101.79	6,143,128.29
EDISON INTL	30,900	74.25	2,294,325.00
ENTERGY CORP	16,181	109.40	1,770,201.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.11	757,006.89
EVERGY INC	18,475	53.41	986,749.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	57.53	1,579,198.50
EXELON CORP	73,907	37.03	2,736,776.21
FIRSTENERGY CORP	39,425	39.14	1,543,094.50
NEXTERA ENERGY INC	156,893	75.32	11,817,180.76
NISOURCE INC	32,351	28.08	908,416.08
NRG ENERGY INC	19,068	81.09	1,546,224.12
PG&E CORP	148,742	18.38	2,733,877.96
PPL CORPORATION	58,459	28.78	1,682,450.02
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	73.55	2,961,564.30
SEMPRA	49,744	75.86	3,773,579.84
SOUTHERN CO	82,430	77.17	6,361,123.10

	VISTRA CORP	28,652	96.13	2,754,316.76
	WEC ENERGY GROUP INC	23,447	80.67	1,891,469.49
	XCEL ENERGY INC	41,562	54.05	2,246,426.10
	ADVANCED MICRO DEVICES	124,711	160.43	20,007,385.73
	ANALOG DEVICES	37,792	234.56	8,864,491.52
	APPLIED MATERIALS	64,814	217.95	14,126,211.30
	BROADCOM INC	34,367	1,393.29	47,883,197.43
	ENPHASE ENERGY INC	9,617	117.50	1,129,997.50
	ENTEGRIS INC	12,389	128.35	1,590,128.15
	FIRST SOLAR INC	7,921	249.81	1,978,745.01
	INTEL CORP	328,277	30.08	9,874,572.16
	KLA CORP	10,294	765.10	7,875,939.40
	LAM RESEARCH CORP	10,237	958.13	9,808,376.81
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	74.02	812,591.56
	MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	75.02	5,082,529.98
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	98.14	3,996,064.52
	MICRON TECHNOLOGY	85,302	126.27	10,771,083.54
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	746.39	2,635,503.09
	NVIDIA CORP	190,578	1,037.99	197,818,058.22
	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	272.72	5,266,223.20
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	71.65	2,293,588.15
	QORVO INC	8,678	96.86	840,551.08
	QUALCOMM	87,162	201.76	17,585,805.12
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	91.21	1,025,382.82
	TERADYNE INC	12,318	140.25	1,727,599.50
	TEXAS INSTRUMENTS	69,576	197.29	13,726,649.04
	CBRE GROUP INC-A	22,995	87.65	2,015,511.75
	COSTAR GROUP INC	33,027	85.69	2,830,083.63
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.45	340,515.00
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	39.88	470,942.92
	アメリカドル 小計	26,363,915		3,499,654,199.34 (550,005,653,968)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	38,058	25.06	953,733.48
	CAMECO CORP	31,793	71.00	2,257,303.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,602	103.55	8,553,437.10
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	27.40	3,049,428.20
	ENBRIDGE	166,986	49.45	8,257,457.70
	IMPERIAL OIL	12,043	93.49	1,125,900.07
	KEYERA CORP	18,607	36.04	670,596.28
	MEG ENERGY CORP	27,250	29.20	795,700.00
	PARKLAND CORP	7,149	38.92	278,239.08
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	49.79	1,898,542.49

SUNCOR ENERGY	98,973	55.15	5,458,360.95
TC ENERGY CORP	82,559	52.36	4,322,789.24
TOURMALINE OIL CORP	25,009	66.99	1,675,352.91
AGNICO EAGLE MINES	36,100	92.46	3,337,806.00
BARRICK GOLD CORP	133,727	23.29	3,114,501.83
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	71.08	662,607.76
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	17.75	769,640.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,641	166.53	2,604,695.73
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	18.91	980,426.77
KINROSS GOLD CORP	108,451	10.83	1,174,524.33
LUNDIN MINING CORP	65,800	16.23	1,067,934.00
NUTRIEN LTD	37,152	81.31	3,020,829.12
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	28.61	641,321.76
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	69.22	2,449,418.92
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	111.55	390,982.75
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	76.47	2,439,851.82
CAE INC	25,999	25.80	670,774.20
STANTEC INC	9,001	109.17	982,639.17
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	121.44	633,066.72
WSP GLOBAL INC	9,951	207.00	2,059,857.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	24.31	791,995.49
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	21,664	42.94	930,252.16
RB GLOBAL INC	14,445	102.85	1,485,668.25
THOMSON REUTERS CORP	11,495	237.19	2,726,499.05
AIR CANADA	13,805	18.41	254,150.05
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	173.49	7,327,697.13
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	108.97	7,968,431.25
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	181.38	1,058,715.06
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	61.51	1,245,823.54
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	91.42	280,659.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	48.81	479,314.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	92.32	2,130,099.36
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	139.35	628,886.55
DOLLARAMA INC	22,000	123.98	2,727,560.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,865	79.37	4,592,745.05
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	34.19	236,936.70
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	156.25	2,017,656.25
METRO INC	18,840	74.29	1,399,623.60
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	194.79	1,017,972.54
SAPUTO INC	20,898	27.94	583,890.12
BANK MONTREAL	56,278	129.87	7,308,823.86
BANK NOVA SCOTIA	91,232	64.98	5,928,255.36

	CANADIAN IMPERIAL BANK	71,075	66.19	4,704,454.25	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	113.96	3,150,538.16	
	ROYAL BANK OF CANADA	109,143	143.67	15,680,574.81	
	TORONTO-DOMINION BANK	136,393	75.58	10,308,582.94	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	54.45	1,579,104.45	
	BROOKFIELD CORP	104,769	60.70	6,359,478.30	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	36.49	280,425.65	
	ONEX CORP	6,603	97.61	644,518.83	
	TMX GROUP LTD	23,425	36.63	858,057.75	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,550.00	2,718,700.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	42.78	1,017,650.64	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	92.89	648,093.53	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	227.14	3,010,740.70	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	135,007	35.92	4,849,451.44	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	40.24	1,753,538.48	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	69.11	3,014,163.54	
	CGI INC - CL A	16,084	142.97	2,299,529.48	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	3,722.08	5,780,390.24	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	135.90	949,125.60	
	OPEN TEXT CORP	20,463	41.71	853,511.73	
	SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	79.19	7,454,154.70	
	BCE INC	6,203	46.44	288,067.32	
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	29.17	443,384.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	53.59	1,494,142.79	
	TELUS CORP	32,908	22.49	740,100.92	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	30.37	740,876.15	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	43.31	489,186.45	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.44	324,586.56	
	EMERA INC	25,484	49.05	1,249,990.20	
	FORTIS INC	35,547	54.51	1,937,666.97	
	HYDRO ONE LTD	29,579	39.94	1,181,385.26	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	23.78	424,568.12	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	196.33	528,127.70	
	カナダドル 小計	3,115,615		207,176,241.01 (23,709,249,021)	
ユーロ	ENI	174,687	14.48	2,530,865.25	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	19.83	786,497.46	
	NESTE OIL OYJ	32,766	19.77	647,947.65	
	OMV AG	12,549	47.06	590,555.94	
	REPSOL SA	89,536	14.91	1,334,981.76	
	TENARIS SA	40,648	15.60	634,312.04	
	TOTALENERGIES SE	167,596	65.70	11,011,057.20	

AIR LIQUIDE	40,571	181.72	7,372,562.12
AKZO NOBEL	12,357	64.66	799,003.62
ARCELORMITTAL	42,704	23.74	1,013,792.96
ARKEMA	4,369	94.00	410,686.00
BASF SE	70,406	48.44	3,410,466.64
COVESTRO AG	14,454	47.78	690,612.12
DSM-FIRMENICH AG	13,707	105.85	1,450,885.95
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	20.20	323,947.40
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	99.34	1,069,395.10
OCI NV	7,248	26.03	188,665.44
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	45.15	880,605.60
STORA ENSO OYJ R	42,169	13.44	566,962.20
SYENSQO SA	5,356	93.39	500,196.84
SYMRISE AG	10,018	105.50	1,056,899.00
UMICORE	17,605	18.76	330,269.80
UPM KYMMENE OYJ	42,324	35.22	1,490,651.28
VOESTALPINE AG	7,152	26.74	191,244.48
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,593	39.74	659,405.82
AIRBUS SE	46,092	161.28	7,433,717.76
ALSTOM	24,388	18.22	444,349.36
BOUYGUES ORD	16,606	35.40	587,852.40
BRENTAG SE	9,500	67.28	639,160.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	38.99	1,531,449.22
DASSAULT AVIATION SA	2,130	206.20	439,206.00
EIFFAGE	5,924	101.10	598,916.40
FERROVIAL SE	37,026	36.72	1,359,594.72
GEA GROUP AG	13,382	37.80	505,839.60
IMCD NV	4,641	140.25	650,900.25
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	90.50	1,122,019.00
KNORR-BREMSE AG	5,022	72.50	364,095.00
KONE OYJ-B	26,369	48.46	1,277,841.74
LEGRAND SA	19,340	103.60	2,003,624.00
LEONARDO SPA	31,340	23.58	738,997.20
METSO CORPORATION	51,970	11.41	593,237.55
MTU AERO ENGINES AG	3,962	234.30	928,296.60
PRYSMIAN SPA	21,155	59.70	1,262,953.50
RATIONAL AG	483	821.00	396,543.00
REXEL SA	17,411	28.22	491,338.42
RHEINMETALL AG	3,203	534.00	1,710,402.00
SAFRAN SA	26,619	217.70	5,794,956.30
SAINT-GOBAIN	36,177	81.38	2,944,084.26
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	235.75	9,936,862.50

SIEMENS	58,485	177.18	10,362,372.30
SIEMENS ENERGY AG	36,841	24.57	905,183.37
THALES SA	6,657	167.85	1,117,377.45
VINCI S.A.	39,327	114.65	4,508,840.55
WARTSILA OYJ	41,917	19.29	808,578.93
BUREAU VERITAS SA	25,073	27.70	694,522.10
RANDSTAD NV	10,680	50.38	538,058.40
TELEPERFORMANCE	4,734	104.10	492,809.40
WOLTERS KLUWER	19,155	149.80	2,869,419.00
ADP	2,382	126.60	301,561.20
AENA SME SA	5,508	179.80	990,338.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	6.46	292,915.78
DHL GROUP	74,810	38.62	2,889,162.20
GETLINK	21,115	16.09	339,740.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	92.72	2,282,488.24
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	88.20	440,206.20
CONTINENTAL AG	8,168	60.92	497,594.56
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	75.62	775,407.48
FERRARI NV	10,026	384.60	3,855,999.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,436	65.71	4,168,379.56
MICHELIN	49,034	36.46	1,787,779.64
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	48.07	564,582.15
RENAULT SA	11,597	47.81	554,452.57
STELLANTIS NV	166,407	20.36	3,388,046.52
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	118.00	1,808,704.00
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	138.00	343,068.00
ADIDAS AG	12,783	222.90	2,849,330.70
HERMES INTERNATIONAL	2,420	2,188.00	5,294,960.00
KERING	5,534	332.65	1,840,885.10
LVMH	21,429	752.80	16,131,751.20
MONCLER SPA	14,605	60.94	890,028.70
PUMA SE	9,220	48.25	444,865.00
SEB SA	2,282	112.50	256,725.00
ACCOR	14,436	40.90	590,432.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	64.98	2,389,444.56
DELIVERY HERO SE	13,414	29.89	400,944.46
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	34.00	275,672.00
SODEXO	6,173	86.10	531,495.30
BOLLORE SE	31,761	6.23	197,871.03
PUBLICIS GROUPE	17,217	106.95	1,841,358.15
SCOUT24 SE	7,536	73.05	550,504.80
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	28.68	1,887,889.68

VIVENDI SE	61,243	10.13	620,391.59
D' IETEREN GROUP	2,217	203.60	451,381.20
INDITEX	87,257	44.33	3,868,102.81
PROSUS	112,590	34.91	3,931,079.85
ZALANDO SE	17,664	23.25	410,688.00
CARREFOUR	39,746	16.27	646,667.42
JERONIMO MARTINS	21,861	20.44	446,838.84
KESKO OYJ-B SHS	20,083	17.00	341,411.00
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	29.11	2,063,899.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,097	59.88	3,898,008.36
DANONE (GROUPE)	51,810	59.24	3,069,224.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	9.54	323,053.02
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	77.20	734,326.40
HEINEKEN NV	23,160	94.46	2,187,693.60
JDE PEET'S BV	7,000	21.90	153,300.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	78.60	857,761.80
LOTUS BAKERIES	38	9,900.00	376,200.00
PERNOD-RICARD	15,339	142.20	2,181,205.80
REMY COINTREAU	1,032	88.05	90,867.60
BEIERSDORF AG	7,430	146.30	1,087,009.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	74.25	651,915.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	15,018	83.56	1,254,904.08
LOREAL	18,546	450.95	8,363,318.70
AMPLIFON SPA	11,650	33.56	390,974.00
BIOMERIEUX	3,044	94.70	288,266.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	92.35	316,760.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	98.34	203,563.80
ESSILORLUXOTTICA	22,901	209.50	4,797,759.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	38.38	651,884.30
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.36	955,420.04
KONINKLIJKE PHILIPS	56,030	24.70	1,383,941.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	53.70	1,158,147.90
ARGENX SE	4,935	335.50	1,655,692.50
BAYER	78,462	27.58	2,164,374.27
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	57.72	589,898.40
GRIFOLS SA	27,685	9.15	253,317.75
IPSEN	3,532	123.60	436,555.20
MERCK KGAA	9,152	169.05	1,547,145.60
ORION OYJ-CLASS B	10,139	37.60	381,226.40
QIAGEN N.V.	16,526	40.13	663,271.01
RECORDATI SPA	6,099	48.52	295,923.48
SANOFI	87,091	90.16	7,852,124.56

SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	262.20	478,252.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	192.15	496,131.30
UCB (GROUPE)	9,389	129.50	1,215,875.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	44,853	15.63	701,052.39
AIB GROUP PLC	145,826	5.18	755,378.68
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	10.03	4,504,701.46
BANCO BPM SPA	77,744	6.48	503,936.60
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.78	5,850,368.78
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	10.60	936,806.80
BNP PARIBAS	77,707	67.09	5,213,362.63
CAIXABANK	275,085	5.09	1,401,282.99
COMMERZBANK AG	81,889	15.57	1,275,011.73
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	15.72	1,370,622.45
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	47.20	1,197,747.20
FINECOBANK SPA	41,585	15.03	625,230.47
ING GROEP NV-CVA	256,546	16.44	4,217,616.24
INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.54	4,058,223.76
KBC GROEP NV	18,057	68.94	1,244,849.58
MEDIOBANCA	33,860	14.60	494,356.00
NORDEA BANK ABP	236,636	11.27	2,666,887.72
SOCIETE GENERALE	53,019	27.44	1,455,106.45
UNICREDIT SPA	116,219	36.14	4,200,735.75
ADYEN NV	1,609	1,198.20	1,927,903.80
AMUNDI SA	4,626	70.80	327,520.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	140,740	15.54	2,187,944.04
DEUTSCHE BOERSE	14,123	184.70	2,608,518.10
EDENRED	20,131	45.56	917,168.36
EURAZEO SA	3,357	76.80	257,817.60
EURONEXT NV	6,480	90.50	586,440.00
EXOR NV	7,825	105.10	822,407.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	70.50	600,307.50
NEXI SPA	48,458	6.11	296,272.21
SOFINA	1,238	221.00	273,598.00
WORLDLINE SA	20,332	11.22	228,226.70
AEGON LTD	101,846	6.26	637,963.34
AGEAS	11,086	47.50	526,585.00
ALLIANZ SE-REG	30,116	264.00	7,950,624.00
ASR NEDERLAND NV	11,959	47.95	573,434.05
ASSICURAZIONI GENERALI	84,111	23.37	1,965,674.07
AXA SA	144,204	33.38	4,813,529.52
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	226.10	1,007,275.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	455.10	4,739,411.40

NN GROUP NV	22,941	45.05	1,033,492.05
POSTE ITALIANE SPA	46,035	12.42	571,754.70
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	40.46	1,340,520.72
TALANX AG	5,053	73.05	369,121.65
BECHTLE AG	7,659	46.94	359,513.46
CAPGEMINI SA	12,235	213.30	2,609,725.50
DASSAULT SYSTEMES SA	49,547	39.17	1,940,755.99
NEMETSCHKE SE	5,455	92.30	503,496.50
SAP SE	81,129	181.36	14,713,555.44
NOKIA OYJ	396,129	3.59	1,424,281.81
CELLNEX TELECOM SA	34,475	34.05	1,173,873.75
DEUTSCHE TELEKOM	253,485	21.77	5,518,368.45
ELISA A	10,227	41.80	427,488.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	9.98	303,294.37
KPN (KON.)	290,883	3.43	998,601.33
ORANGE	153,281	10.60	1,625,545.00
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.24	210,154.06
TELEFONICA	373,259	4.16	1,556,116.77
ACCIONA SA	2,181	124.90	272,406.90
E.ON SE	166,881	12.33	2,057,642.73
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	14.71	319,971.92
ELIA GROUP SA/NV	987	96.90	95,640.30
ENAGAS	21,663	13.82	299,382.66
ENDESA	25,972	18.22	473,209.84
ENEL	640,374	6.60	4,230,310.64
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.73	881,121.52
ENGIE	146,393	15.48	2,266,163.64
FORTUM OYJ	32,550	14.39	468,394.50
IBERDROLA SA	476,876	12.11	5,777,352.74
REDEIA CORP SA	30,678	16.33	500,971.74
RWE STAMM	44,929	34.60	1,554,543.40
SNAM SPA	147,559	4.26	629,634.25
TERNA SPA	95,819	7.65	733,398.62
VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	30.55	1,520,809.55
VERBUND AG	6,430	76.45	491,573.50
ASM INTERNATIONAL NV	3,856	673.80	2,598,172.80
ASML HOLDING NV	31,092	876.40	27,249,028.80
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	140.25	891,569.25
INFINEON TECHNOLOGIES	104,721	38.07	3,986,728.47
STMICROELECTRONICS NV	50,286	38.90	1,956,125.40
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	83.90	442,572.50
VONOVIA SE	52,580	28.41	1,493,797.80

	ユーロ 小計	13,838,177		407,628,289.35 (69,264,198,926)	
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.82	6,346,791.95	
	SHELL PLC-NEW	502,076	27.72	13,920,057.10	
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	26.45	2,468,965.78	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	22.59	674,447.04	
	CRH PLC	52,103	63.40	3,303,330.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	45.94	501,848.56	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.87	296,979.48	
	GLENCORE PLC	793,369	4.83	3,835,542.43	
	MONDI PLC	37,918	15.75	597,208.50	
	RIO TINTO PLC REG	88,047	56.80	5,001,069.60	
	ASHTED GROUP PLC	33,317	57.16	1,904,399.72	
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	13.97	3,353,456.59	
	BUNZL PLC	29,337	30.22	886,564.14	
	DCC PLC	6,622	56.70	375,467.40	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	6.21	628,739.28	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	4.40	2,800,543.23	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	17.33	458,829.08	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	91.30	503,428.20	
	EXPERIAN PLC	74,157	37.23	2,760,865.11	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	49.54	688,110.60	
	RELX PLC	145,542	34.90	5,079,415.80	
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.08	742,428.22	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.06	370,987.73	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	52.35	363,937.20	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	10.51	312,945.76	
	PERSIMMON PLC	25,686	14.71	377,969.49	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.47	390,345.71	
	COMPASS GROUP PLC	129,701	22.31	2,893,629.31	
	ENTAIN PLC	49,630	7.16	355,450.06	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	158.55	2,067,809.10	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	79.02	1,093,083.66	
	PEARSON	55,305	9.45	522,853.47	
WHITBREAD PLC	17,434	29.56	515,349.04		
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	7.49	543,175.15		
INFORMA PLC	110,598	8.39	927,917.22		
WPP PLC	85,821	8.22	705,448.62		
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.21	251,292.37		
KINGFISHER PLC	153,717	2.58	397,665.87		
NEXT PLC	8,464	93.08	787,829.12		
OCADO GROUP PLC	54,753	3.52	192,785.31		

SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.77	411,481.29
TESCO PLC	525,585	3.12	1,641,401.95
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	27.14	698,583.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	24.24	3,829,435.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.68	497,132.80
DIAGEO	174,682	27.09	4,733,008.79
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	19.40	1,328,473.20
HALEON PLC	530,525	3.28	1,744,896.72
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	44.41	2,514,538.61
UNILEVER PLC	193,307	43.12	8,335,397.84
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	9.82	674,014.47
ASTRAZENECA	118,805	124.04	14,736,572.20
GSK PLC	319,416	17.78	5,679,216.48
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.59	350,856.90
BARCLAYS	1,129,529	2.15	2,428,487.35
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,478,895	6.91	10,225,080.03
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.55	2,693,323.91
NATWEST GROUP PLC	426,244	3.07	1,309,421.56
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	7.75	1,474,492.88
3I GROUP PLC	74,757	29.27	2,188,137.39
ABRDN PLC	153,430	1.56	239,350.80
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	11.20	370,484.80
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,529	93.28	3,034,305.12
M&G PLC	131,539	2.01	264,788.00
SCHRODERS PLC	39,932	3.91	156,134.12
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	4.88	199,757.92
WISE PLC - A	49,048	7.98	391,403.04
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	27.05	439,697.75
AVIVA PLC	193,334	4.82	933,609.88
LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.45	1,221,586.40
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	4.96	252,964.96
PRUDENTIAL	212,226	7.68	1,631,593.48
SAGE GROUP PLC	76,660	10.78	826,778.10
HALMA PLC	31,069	23.09	717,383.21
BT GROUP PLC	464,863	1.27	591,770.59
VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.74	1,220,792.87
CENTRICA PLC	453,631	1.43	652,775.00
NATIONAL GRID PLC	285,439	10.05	2,868,661.95
SEVERN TRENT PLC	17,468	25.03	437,224.04
SSE PLC	81,692	17.69	1,445,539.94
UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.24	517,939.20
	20,916,176		156,107,456.54

	イギリスポンド 小計			(31,148,120,803)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	15.00	260,970.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	753.00	432,222.00
	GIVAUDAN-REG	742	4,239.00	3,145,338.00
	HOLCIM LTD	38,804	79.46	3,083,365.84
	SIG GROUP AG	26,203	19.17	502,311.51
	SIKA AG-BR	12,257	283.90	3,479,762.30
	ABB LTD	124,889	48.97	6,115,814.33
	GEBERIT AG-REG	2,530	564.80	1,428,944.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	234.50	480,256.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	239.40	740,224.80
	VAT GROUP AG	1,956	499.20	976,435.20
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	36.06	535,707.36
	SGS SA	12,959	84.64	1,096,849.76
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	243.70	921,429.70
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	142.25	5,828,693.75
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	192.35	477,605.05
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	37.15	146,296.70
	AVOLTA AG	7,820	35.28	275,889.60
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,591.00	445,480.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	108,200.00	865,600.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,700.00	877,400.00
	NESTLE SA - REGISTERED	205,438	93.30	19,167,365.40
	ALCON INC	38,399	82.76	3,177,901.24
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	297.30	1,155,605.10
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	120.00	1,024,800.00
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	86.65	160,302.50
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	512.00	2,834,432.00
	NOVARTIS	158,232	92.77	14,679,182.64
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	254.80	564,382.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	54,075	232.10	12,550,807.50
	SANDOZ GROUP AG	30,458	32.32	984,402.56
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	92.80	230,793.60
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	56.00	856,184.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,259.00	2,297,675.00
	UBS GROUP AG	249,657	27.94	6,975,416.58
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	152.90	651,965.60
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	129.30	382,081.50
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	625.00	1,324,375.00
	SWISS RE LTD	24,330	111.20	2,705,496.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	471.70	5,396,248.00
	TEMENOS AG - REG	5,150	58.40	300,760.00

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	87.98	1,056,287.88	
	SWISSCOM	1,856	494.00	916,864.00	
	BKW AG	1,744	144.60	252,182.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	84.90	482,147.10	
	スイスフラン 小計	1,167,106		112,244,253.50 (19,281,317,866)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	22,252	367.30	8,173,159.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	451.20	2,428,809.60	
	SCA SV CELLULOSA B	55,976	162.25	9,082,106.00	
	ALFA LAVAL AB	18,955	492.90	9,342,919.50	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	313.30	23,803,594.10	
	ATLAS COPCO A	207,097	205.50	42,558,433.50	
	ATLAS COPCO B	114,624	177.85	20,385,878.40	
	BEIJER REF AB	26,868	169.50	4,554,126.00	
	EPIROC AB-A	53,479	224.20	11,989,991.80	
	EPIROC AB-B	28,804	204.60	5,893,298.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	90.16	3,490,273.92	
	INDUTRADE AB	22,644	280.00	6,340,320.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	304.40	4,262,208.80	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	287.60	5,168,172.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	54.20	6,658,361.60	
	SAAB AB-B	25,552	249.50	6,375,224.00	
	SANDVIK AB	87,594	239.10	20,943,725.40	
	SKANSKA B	25,507	189.85	4,842,503.95	
	SKF AB-B	21,050	235.10	4,948,855.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	294.40	3,978,521.60	
	VOLVO B	114,238	286.40	32,717,763.20	
	SECURITAS B	28,375	113.80	3,229,075.00	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	32.45	1,617,275.55	
	EVOLUTION AB	13,186	1,173.00	15,467,178.00	
	HENNES & MAURITZ B	40,961	185.90	7,614,649.90	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	277.20	13,714,192.80	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	189.10	3,365,223.60	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	280.20	4,016,667.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	150.50	17,189,809.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	98.52	11,894,910.72	
SWEDBANK AB-A	71,421	218.50	15,605,488.50		
EQT AB	31,471	339.80	10,693,845.80		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	371.00	4,384,478.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	370.30	4,135,510.40		
INVESTOR AB-B SHS	128,538	285.00	36,633,330.00		
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	577.50	4,204,200.00		

	ERICSSON (LM) B	214,689	63.62	13,658,514.18	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	118.95	20,471,176.05	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	101.55	4,748,681.10	
	TELIA CO AB	123,760	26.42	3,269,739.20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	71.96	4,080,132.00	
	SAGAX AB-B	17,402	286.80	4,990,893.60	
	スウェーデンクローナ 小計	2,455,074		442,923,216.77 (6,484,395,893)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	264.00	7,740,480.00	
	EQUINOR ASA	66,436	310.45	20,625,056.20	
	NORSK HYDRO	100,517	68.58	6,893,455.86	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	325.80	4,071,848.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	905.00	7,823,725.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	114.00	2,179,338.00	
	MOWI ASA	31,968	195.05	6,235,358.40	
	ORKLA	39,191	82.25	3,223,459.75	
	SALMAR ASA	5,423	661.00	3,584,603.00	
	DNB BANK ASA	71,795	201.50	14,466,692.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	183.60	3,410,186.40	
	TELENOR ASA	51,193	123.90	6,342,812.70	
	ノルウェークローネ 小計	454,677		86,597,016.21 (1,275,574,048)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	425.00	12,797,600.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,752.00	2,077,760.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	83,415	191.10	15,940,606.50	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,100.00	2,430,900.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	11,515.00	3,523,590.00	
	DSV A/S	14,203	1,061.50	15,076,484.50	
	PANDORA A/S	6,512	1,140.00	7,423,680.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	950.00	6,469,500.00	
	COLOPLAST-B	9,737	859.40	8,367,977.80	
	DEMANT A/S	8,512	329.80	2,807,257.60	
	GENMAB A/S	4,878	2,025.00	9,877,950.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	937.40	237,189,384.60	
	DANSKE BANK A/S	48,617	202.10	9,825,495.70	
	TRYG A/S	29,772	144.00	4,287,168.00	
ORSTED A/S	12,910	404.20	5,218,222.00		
	デンマーククローネ 小計	509,787		343,313,576.70 (7,817,250,141)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	35.50	732,329.50	
	SANTOS	224,634	7.66	1,720,696.44	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	27.75	3,916,496.25	

BHP GROUP LTD	388,318	44.91	17,439,361.38
BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	21.48	746,859.60
FORTESCUE LTD	137,312	26.99	3,706,050.88
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	30,758	48.24	1,483,765.92
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	76.73	1,105,602.57
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	14.20	1,046,284.40
ORICA LTD	38,288	18.69	715,602.72
PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.00	837,940.00
RIO TINTO LTD	28,272	133.50	3,774,312.00
SOUTH32 LTD	346,773	3.85	1,335,076.05
REECE LTD	16,814	25.54	429,429.56
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	39.52	499,137.60
BRAMBLES LTD	108,007	14.39	1,554,220.73
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	27.16	1,205,252.16
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.69	441,290.79
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.16	523,600.00
TRANSURBAN GROUP	224,973	12.75	2,868,405.75
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	45.31	2,093,775.10
IDP EDUCATION LTD	17,793	17.04	303,192.72
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.10	928,266.30
CAR GROUP LTD	29,334	34.76	1,019,649.84
REA GROUP LTD	3,586	188.41	675,638.26
SEEK LTD	28,001	22.90	641,222.90
WESFARMERS LTD	90,757	66.31	6,018,096.67
COLES GROUP LTD	108,486	16.28	1,766,152.08
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.00	549,505.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	31.51	2,901,157.21
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.04	770,078.40
COCHLEAR LIMITED	4,783	322.03	1,540,269.49
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	49.43	598,449.01
SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	25.44	1,064,129.76
CSL LIMITED	37,640	282.00	10,614,480.00
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	28.38	6,766,444.74
COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	120.73	15,756,834.49
NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	34.40	8,283,967.20
WESTPAC BANKING	276,117	26.87	7,419,263.79
ASX LTD	14,549	63.50	923,861.50
MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	193.74	5,471,411.34
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.15	444,055.80
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	6.45	1,074,969.90
MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.66	849,789.78
QBE INSURANCE GROUP	104,083	18.05	1,878,698.15

	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	16.11	1,528,259.04	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	100.02	1,380,376.02	
	XERO LTD	11,340	134.84	1,529,085.60	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.46	1,067,295.82	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	10.35	1,609,787.25	
	オーストラリアドル 小計	5,197,730		133,549,877.46 (13,857,135,285)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.73	637,423.53	
	EBOS GROUP LTD	14,283	35.29	504,047.07	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	28.49	1,139,030.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	4.24	563,737.68	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.42	414,815.46	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	6.21	686,478.24	
	ニュージーランドドル 小計	444,838		3,945,532.18 (377,824,161)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,996	41.60	9,526,233.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	99.40	10,635,800.00	
	MTR CORP	125,000	28.50	3,562,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	20.20	2,424,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	39.85	6,933,900.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	19.98	3,956,040.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.63	3,706,234.63	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	25.35	7,136,025.00	
	HANG SENG BANK	59,400	112.30	6,670,620.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	277.80	24,529,740.00	
	AIA GROUP LTD	864,200	61.65	53,277,930.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	47.25	1,771,875.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	66.40	9,063,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.38	5,771,711.66	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	47.35	5,303,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	34.55	4,214,961.80	
	ESR GROUP LTD	157,000	11.84	1,858,880.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	7.98	1,380,540.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	26.15	3,274,712.20	
	SINO LAND CO	315,400	8.89	2,803,906.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	79.25	8,321,250.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	70.05	3,117,225.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	15.00	1,443,000.00		
WHARF HOLDINGS	84,000	27.15	2,280,600.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	26.05	3,204,150.00		
	香港ドル 小計	5,440,678		186,168,634.89 (3,745,712,933)	

シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	27.31	218,480.00
	KEPPEL LTD	112,800	6.67	752,376.00
	SEATRIM LTD	107,639	1.58	170,069.62
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.16	613,184.00
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.71	726,907.72
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.91	266,448.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.14	560,804.00
	DBS GROUP	155,760	35.85	5,583,996.00
	OCBC BANK	257,100	14.49	3,725,379.00
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	30.55	2,871,700.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.47	625,020.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	2.41	1,499,364.63
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.19	436,479.00
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.65	689,265.00
CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	5.91	252,948.00	
シンガポールドル 小計		2,537,574		18,992,420.97 (2,207,868,937)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	17.96	1,067,308.92
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	730.10	1,566,794.60
	BANK HAPOLIM BM	98,310	33.14	3,257,993.40
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	29.19	3,284,225.28
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.52	1,842,740.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	133.60	1,670,400.80
	NICE LTD	4,991	722.10	3,604,001.10
	AZRIELI GROUP	1,537	224.50	345,056.50
イスラエルシェケル 小計		390,926		16,638,520.60 (710,196,949)
合 計		82,832,273		729,884,498,931 (729,884,498,931)

(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	727,954.60	
	オーストラリアドル 小計		83,290	727,954.60	(75,532,569)
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,872,800.00	
			315,000	2,872,800.00	

		香港ドル 小計		(57,800,736)	
		投資信託受益証券合計	398,290	133,333,305	(133,333,305)
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,482,730.77	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	900,812.18	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	6,771,714.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	722,606.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,264,095.08	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	672,837.84	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	805,973.49	
		CROWN CASTLE INC	32,235	3,191,587.35	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,348	3,321,253.00	
		EQUINIX INC	7,333	5,628,297.49	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	877,807.00	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,692,361.30	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,342,733.85	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,238,292.59	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	805,227.50	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,042,725.60	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,030,429.95	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,553,676.16	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,849,285.28	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	889,447.29	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,222,199.40	
		PROLOGIS INC	71,288	7,530,864.32	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,250,342.92	
		REALTY INCOME CORP	64,068	3,351,397.08	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	741,526.97	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	1,686,461.07	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,979	3,758,122.14	
		SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,288,287.00	
		UDR INC	23,815	924,260.15	
		VENTAS INC	31,565	1,489,552.35	
		VICI PROPERTIES INC	83,762	2,395,593.20	
		WELLTOWER INC	43,994	4,397,640.24	
		WP CAREY INC	16,024	918,655.92	
		アメリカドル 小計	925,374	72,038,797.12	(11,321,617,355)
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	218,009.07	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	270,455.40	
		カナダドル 小計	20,377	488,464.47	(55,899,873)

ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	245,321.28	
	GECINA SA	3,139	309,662.35	
	KLEPIERRE	17,225	436,137.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	828,454.20	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	350,744.24	
ユーロ 小計		48,695	2,170,319.07 (368,780,616)	
イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	363,345.49	
	SEGRO PLC	78,133	700,384.21	
イギリスポンド 小計		134,422	1,063,729.70 (212,245,987)	
オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	656,748.20	
	GOODMAN GROUP	135,303	4,623,303.51	
	GPT GROUP	167,884	725,258.88	
	MIRVAC GROUP	266,683	541,366.49	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,204,854.28	
	STOCKLAND	207,412	933,354.00	
	VICINITY CENTERS	305,149	593,514.80	
オーストラリアドル 小計		1,557,804	9,278,400.16 (962,726,800)	
香港ドル	LINK REIT	166,900	5,591,150.00	
香港ドル 小計		166,900	5,591,150.00 (112,493,938)	
シンガポ ールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	755,807.08	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	673,672.71	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	390,800.82	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	270,600.00	
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,090,880.61 (243,064,870)	
投資証券合計		3,979,428	13,276,829,439 (13,276,829,439)	
合計			13,410,162,744 (13,410,162,744)	

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
	株式 591銘柄	98.0%				74.0%

アメリカドル	投資証券 33銘柄				2.0%	1.5%
カナダドル	株式 85銘柄	99.8%				3.2%
	新株予約権 1銘柄 証券					
	投資証券 2銘柄				0.2%	0.0%
ユーロ	株式 217銘柄	99.5%				9.3%
	投資証券 5銘柄				0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 81銘柄	99.3%				4.2%
	投資証券 2銘柄				0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%				2.6%
スウェーデンクローナ	株式 42銘柄	100.0%				0.9%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%				0.2%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	100.0%				1.1%
オーストラリアドル	株式 50銘柄	93.0%				1.9%
	投資信託受益証券 1銘柄			0.5%		0.0%
	投資証券 7銘柄				6.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%				0.1%
香港ドル	株式 25銘柄	95.7%				0.5%
	投資信託受益証券 1銘柄			1.5%		0.0%
	投資証券 1銘柄				2.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 15銘柄	90.1%				0.3%
	投資証券 4銘柄				9.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%				0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	9,112,106,639
コール・ローン	176,071,263
株式	199,613,035,751

	2024年 5月24日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	506,733,854
投資証券	223,917,833
派生商品評価勘定	328,591,966
未収入金	2,476,744
未収配当金	382,955,523
未収利息	327
差入委託証拠金	2,092,065,725
流動資産合計	212,437,955,625
資産合計	212,437,955,625
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,409,324
前受金	315,962,322
未払解約金	36,966,387
流動負債合計	365,338,033
負債合計	365,338,033
純資産の部	
元本等	
元本	45,060,646,602
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	167,011,970,990
元本等合計	212,072,617,592
純資産合計	212,072,617,592
負債純資産合計	212,437,955,625

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

2024年 5月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	45,060,646,602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) 4.7064円 (47,064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 5月24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 5月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2024年 5月24日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	41,605,821,743円
期中追加設定元本額	7,878,362,584円
期中一部解約元本額	4,423,537,725円
期末元本額	45,060,646,602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	7,217,378,987円
世界経済インデックスファンド	11,921,765,618円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,172,675,699円
DC世界経済インデックスファンド	7,678,656,127円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	80,809,175円
コア投資戦略ファンド（安定型）	56,489,423円
コア投資戦略ファンド（成長型）	136,653,244円
分散投資コア戦略ファンドA	310,316,270円
分散投資コア戦略ファンドS	1,419,462,050円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,304,456,776円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	801,070,147円
コア投資戦略ファンド（切替型）	57,039,289円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	363,501,346円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,231,787円
SMT インデックスバランス・オープン	95,603,506円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,287,415,109円
SMT 世界経済インデックス・オープン	281,358,446円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,290,536,423円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	210,917,925円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,239,653円
グローバル経済コア	627,736,749円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	415,928,685円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	57,500,179円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	14,488,359円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	117,671,972円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	114,659,082円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	50,427,191円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	62,951,806円
10資産分散投資ファンド	17,935,218円
グローバル10資産バランスファンド	21,266,808円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	43,544円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,558,591,697円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	134,279,857円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,724,525円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	12,484,374円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	22,668,111円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	25,868,474,360	
投資信託受益証券	8,043,537	
投資証券	32,621,611	
合計	25,843,896,286	

(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 5月24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	11,394,551,049	-	11,710,513,371	315,962,322
合計		11,394,551,049	-	11,710,513,371	315,962,322

(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 5月24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	162,951,935	-	163,176,154	224,219
	アメリカドル	162,951,935	-	163,176,154	224,219
	売建	1,402,924	-	1,406,823	3,899
	ブラジルリアル	1,402,924	-	1,406,823	3,899
合計		164,354,859	-	164,582,977	220,320

(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

	評価額
--	-----

通貨	銘柄	株式数 (株)	単価	金額	備考
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.92	268,066.20	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	17.52	647,013.60	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,912	116.55	1,854,543.60	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	24.51	1,785,087.81	
	NIO INC - ADR	231,271	4.80	1,110,100.80	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	36.05	1,471,777.30	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	11.83	937,740.44	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	35.39	2,351,736.28	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	26.99	331,518.17	
	IQIYI INC-ADR	59,454	4.77	283,595.58	
	KANZHUN LTD	38,815	21.44	832,193.60	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	14.50	2,298,931.50	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	101,071	153.63	15,527,537.73	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	15.91	869,895.16	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	39.50	584,126.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	903,900	1.58	1,431,777.60	
	CREDICORP LTD	10,882	163.13	1,775,180.66	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	-	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	20.04	415,890.12	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.06	291,232.44	
	KE HOLDINGS INC	114,048	16.99	1,937,675.52	
アメリカドル 小計		2,392,750		37,005,620.11 (5,815,803,256)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	12.73	33,916,042.53	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	105.85	51,749,218.20	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	275.93	9,657,550.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	29.96	5,349,417.92	
	ALFA S.A.B. -A	313,500	12.16	3,812,160.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	141.99	14,482,980.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	580.61	19,493,980.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	173.75	9,226,125.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	326.41	19,578,071.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	184.81	7,888,614.85	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	66.39	54,923,119.20	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	165.90	13,583,062.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	195.92	61,350,388.80	

	GRUMA S.A.B. -B	25,960	321.02	8,333,679.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	67.97	19,004,412.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	36.31	6,601,158.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	60.95	8,697,565.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	451,600	160.21	72,350,836.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	271,700	46.86	12,731,862.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	16.39	57,714,762.60	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	20.14	4,452,954.00	
	メキシコペソ 小計	10,289,640		494,897,960.35 (4,652,535,725)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	13.92	2,256,432.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	38.44	24,374,804.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	778,040	36.81	28,639,652.40	
	PRIO SA	130,000	44.47	5,781,100.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	23.87	3,625,853.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	13.10	1,302,140.00	
	GERDAU SA-PREF	186,708	18.45	3,444,762.60	
	SUZANO SA	121,779	50.10	6,101,127.90	
	VALE SA	581,587	65.05	37,832,234.35	
	WEG SA	314,144	39.03	12,261,040.32	
	CCR SA	248,600	12.29	3,055,294.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	45.70	6,276,438.00	
	RUMO SA	244,300	20.49	5,005,707.00	
	LOJAS RENNER S.A.	216,447	13.40	2,900,389.80	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	1.42	433,810.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	22.45	3,883,850.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	10.39	1,377,714.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	26.66	5,046,204.80	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	13.18	3,950,046.00	
	AMBEV SA	756,200	11.96	9,044,152.00	
	JBS SA	110,000	29.48	3,242,800.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	15.59	1,563,801.72	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.26	4,452,356.04	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	29.20	2,794,440.00	
	HYPERA SA	54,500	30.09	1,639,905.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	11.64	3,794,907.72	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	12.88	10,666,984.16	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	26.94	8,432,220.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	32.16	27,062,028.96	
	ITAUSA SA	824,701	10.03	8,271,751.03	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	11.11	11,730,037.99	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	33.22	3,617,658.00	

	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	15.63	2,219,460.00	
	TOTVS SA	124,500	29.68	3,695,160.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	89,400	45.90	4,103,460.00	
	TIM SA	96,100	16.51	1,586,611.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	40.56	1,500,720.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	36.14	7,650,838.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	10.38	2,858,392.50	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	75.36	3,805,680.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	9.40	1,923,240.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	34.76	945,472.00	
	ENEVA SA	102,200	12.60	1,287,720.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	43.96	2,033,150.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	29.65	4,895,215.00	
	ブラジルリアル 小計	13,138,408		292,366,761.29 (8,923,676,761)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	7,670.00	693,544,410.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,955.60	265,893,154.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	44,119.00	937,572,869.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	56.20	138,318,765.60	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	13.05	552,884,547.60	
	FALABELLA SA	70,837	2,800.00	198,343,600.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,875.00	574,560,000.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	110.00	834,152,330.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	27,051.00	189,059,439.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	45.40	524,377,672.60	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	92.40	322,597,506.00	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	58.14	148,912,702.92	
	チリペソ 小計	70,645,682		5,380,216,996.72 (928,883,704)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	35,820.00	1,816,002,360.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	34,800.00	2,142,462,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,260.00	922,330,860.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,880,795,220.00 (198,204,213)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	28.56	148,540.56	
	MYTILINEOS S.A.	20,295	37.06	752,132.70	
	OPAP SA	44,643	14.95	667,412.85	
	JUMBO SA	19,341	27.60	533,811.60	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.71	451,267.78	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	2.09	894,666.81	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	8.31	1,112,966.61	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.75	424,875.72	

	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.78	361,132.46	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.62	649,465.04	
	ユーロ 小計	1,109,898		5,996,272.13 (1,018,886,560)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	192.30	27,420,057.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	48.52	12,560,275.36	
	SASA POLYESTER SANAYI	368,879	48.40	17,853,743.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	60.50	12,047,486.00	
	KOC HOLDING AS	89,884	255.50	22,965,362.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	54.40	16,251,891.20	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	215.90	7,577,442.30	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	317.50	27,500,262.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	1,168.00	19,120,160.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	314.75	9,947,044.25	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	484.50	39,354,966.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	20,274	779.00	15,793,446.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	66.55	39,010,478.65	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	103.60	21,898,139.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	961,147	15.37	14,772,829.39	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	36.02	13,367,994.54	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	92.70	13,264,535.70		
	トルコリラ 小計	3,902,208		330,706,113.69 (1,616,061,565)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	780.00	10,376,340.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	97.30	5,907,083.00	
	CEZ AS	25,283	940.00	23,766,020.00	
	チェココルナ 小計	99,296		40,049,443.00 (275,167,708)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	3,044.00	292,278,792.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,255.00	265,997,955.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	18,010.00	720,778,210.00	
	ハンガリーフォリント 小計	164,780		1,279,054,957.00 (562,638,368)	
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	66.93	6,892,384.47	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	157.05	3,170,211.30	
	BUDIMEX	2,656	785.00	2,084,960.00	
	LPP SA	230	17,120.00	3,937,600.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	142.15	952,973.60	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	39.92	3,345,096.40	
	PEPCO GROUP NV	22,887	21.96	502,598.52	
	DINO POLSKA SA	9,471	408.90	3,872,691.90	
	BANK PEKAO SA	27,684	161.90	4,482,039.60	

	M BANK SA	1,423	638.40	908,443.20
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	58.34	9,329,732.80
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	512.20	3,761,084.60
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	50.98	4,411,248.42
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	7.43	742,312.40
	ポーランドズロチ 小計	631,607		48,393,377.21 (1,928,195,400)
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	-
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	722,000	0.00	0.07
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	-
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
	ロシアルーブル 小計	761,240,136		76.07 (130)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	8.96	2,947,840.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	8.37	2,025,540.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	5.12	19,811,328.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	36.65	21,092,075.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	10.62	233,640.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	7.67	29,146,000.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	19.20	8,236,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	5.48	6,137,600.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	20.05	4,761,875.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	11.42	6,343,810.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	3.37	2,453,360.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	7.35	5,953,500.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	23.80	1,286,152.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	17.16	4,015,440.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	16.96	4,155,200.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	13.90	2,515,900.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	17.48	15,819,400.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.66	1,006,500.00
	BOC AVIATION LTD	68,800	58.05	3,993,840.00

CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	3.73	2,036,580.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.38	3,092,280.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	9.94	4,393,480.00
CITIC LTD	1,038,000	8.52	8,843,760.00
CRRC CORP LTD-H	936,000	4.70	4,399,200.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.71	1,356,480.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	25.20	1,965,600.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	6.13	980,800.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	18.92	3,150,180.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	408,800	15.00	6,132,000.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	30.90	1,925,070.00
AIR CHINA LIMITED-H	630,000	4.36	2,746,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	11.50	4,433,790.50
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	12.48	6,465,264.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.37	1,346,656.38
JD LOGISTICS INC	326,200	9.63	3,141,306.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	8.27	2,662,940.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	131.80	2,306,500.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.13	1,590,300.00
BYD CO LTD-H	187,000	211.60	39,569,200.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	2.75	731,500.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	44.65	6,429,600.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	10.04	9,517,920.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	13.96	6,892,750.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	3.32	1,189,702.08
LI AUTO INC-CLASS A	190,542	78.90	15,033,763.80
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	32.80	5,482,913.60
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	13.62	3,187,080.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	30.60	2,653,020.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	87.30	20,969,460.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.77	2,089,260.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	28.90	8,976,340.00
LI NING CO LTD	380,000	22.70	8,626,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	78.70	12,497,560.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	18.92	4,427,280.00
MEITUAN-CLASS B	873,750	119.50	104,413,125.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	61.50	15,036,750.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	17.90	2,985,720.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	10.74	848,460.00
TRIP.COM GROUP LTD	96,607	418.40	40,420,368.80
BAIDU INC-CLASS A	379,500	99.05	37,589,475.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	119.80	4,983,680.00

CHINA LITERATURE LTD	51,600	27.40	1,413,840.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	2.16	2,738,880.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	25.95	4,442,640.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	59.15	26,759,460.00
NETEASE INC	338,630	141.50	47,916,145.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,128,100	381.80	430,708,580.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	78.65	215,130,401.20
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	70.75	636,750.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	10.56	2,661,120.00
JD.COM INC - CL A	414,161	123.70	51,231,715.70
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	43.45	1,864,178.80
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	34.60	2,235,160.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	5.49	2,250,900.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	15.22	1,400,240.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	3.07	2,406,880.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	18.76	825,440.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	27.70	5,358,565.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	133.78	2,033,456.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.25	2,397,000.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	16.00	9,232,000.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	34.00	8,364,000.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	44.75	15,599,850.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	8.46	1,649,700.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	9.76	4,060,160.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	60.20	6,983,200.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.63	4,518,880.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	51.15	4,634,190.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	27.35	2,393,125.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	34.60	2,608,840.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	5.15	2,055,880.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.86	1,522,824.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	21.45	4,101,240.00
AKESO INC	61,000	48.05	2,931,050.00
BEIGENE LTD	110,905	97.80	10,846,509.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	6.77	1,672,190.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.44	8,939,750.40
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.95	2,017,050.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	10.98	2,437,560.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	17.28	2,108,160.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	37.00	7,511,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	13.10	956,300.00

SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.93	5,775,030.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	37.65	2,397,853.20
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	12.88	8,088,640.00
ZAI LAB LTD	128,250	15.20	1,949,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	3.81	14,992,350.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.91	52,539,452.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	6.15	8,434,571.25
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.96	7,763,392.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	5.85	97,119,477.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.59	971,250.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	37.10	26,913,193.30
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	3.10	5,691,290.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	10,851,515	4.70	51,002,120.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.55	8,417,500.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.79	657,280.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.53	2,187,990.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	10.16	3,568,192.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	12.80	3,657,920.00
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.29	1,509,600.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	8.14	721,204.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.91	1,396,652.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.58	2,548,280.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	12.14	16,024,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	21.20	8,195,920.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.86	1,630,452.64
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	17.20	1,812,880.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.81	5,277,180.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	10.22	12,236,283.36
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	42.60	50,182,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	14.08	1,634,688.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	8.57	4,225,010.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	24.90	5,515,350.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	32.90	5,280,450.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	19.62	1,314,540.00
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	11.32	17,976,160.00
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	43.50	5,198,250.00
XIAOMI CORP-CLASS B	2,554,200	18.94	48,376,548.00
ZTE CORP-H	82,908	16.68	1,382,905.44
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.93	6,586,260.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.90	1,660,050.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.52	1,537,200.00
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	2.90	4,141,200.00

	CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	8.19	3,819,816.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	6.74	3,046,480.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.55	2,364,300.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	28.00	5,510,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	21.55	5,546,970.00	
	ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	76.15	8,909,550.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	4.59	2,047,140.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.96	3,491,840.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	8.21	4,499,080.00	
	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	16.04	1,026,560.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.45	4,566,050.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	18.30	1,647,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	5.33	4,775,610.71	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	18.08	1,653,488.32	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	16.02	9,364,330.80	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	5.73	1,289,250.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.60	17,099,107.60	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	31.00	3,689,000.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	6.82	2,151,710.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	6.91	2,356,310.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	14.32	4,918,920.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	6.06	1,942,836.00	
	香港ドル 小計	135,728,622		2,075,217,839.38 (41,753,382,928)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	20.42	1,805,128.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.92	2,881,488.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	5.36	4,060,736.00	
	GAMUDA BHD	164,102	6.00	984,612.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.89	972,039.94	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	10.00	1,072,810.00	
	MISC BHD	217,540	8.45	1,838,213.00	
	GENTING BHD	271,600	4.73	1,284,668.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.75	1,016,675.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.85	561,382.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.98	1,075,953.20	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	21.86	2,548,045.32	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	128.00	2,329,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	14.92	2,439,121.60	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.48	808,704.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.40	1,087,002.40	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.25	2,946,250.00	

	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.30	1,293,010.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	6.88	8,484,429.76	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.60	2,377,323.20	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.99	8,806,234.95	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.20	10,685,220.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.52	1,210,795.44	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.88	1,558,336.32	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.06	2,021,880.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.76	1,007,304.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.55	1,778,665.60	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	18.32	2,718,688.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	13.10	5,787,252.50	
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	3.88	3,153,276.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	5.38	2,686,772.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	3.23	887,281.00	
	マレーシアリングット 小計	13,499,909		84,168,897.73 (2,803,194,637)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	154.00	30,923,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	33.50	56,434,100.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	49.75	14,606,848.75	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	24.60	5,077,440.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	37.00	17,986,958.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	33.75	6,841,125.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	248.00	32,339,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	65.50	42,895,950.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.05	6,576,850.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	5.95	4,816,525.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.80	3,079,140.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	31.50	26,741,547.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	32.00	5,830,400.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	9.85	8,275,329.75	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	18.00	14,263,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	58.75	56,188,500.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	29.50	7,018,345.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	23.20	12,908,480.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	28.75	54,282,875.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	250.00	20,675,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	134.00	17,848,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	17.00	7,457,050.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	107.00	16,178,400.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.74	15,185,328.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	43.25	4,389,875.00	

	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	45.75	4,108,350.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	77.00	38,192,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	207.00	42,186,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	67.50	8,224,875.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	8.30	16,729,629.40	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	23.70	5,211,630.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	48.25	3,290,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	41.25	28,631,625.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	59.75	22,609,400.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	6.75	5,886,000.00	
	タイパーツ 小計	27,392,940		663,891,225.90 (2,841,454,446)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	37.80	8,994,132.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	625.00	34,006,250.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	31.80	18,638,711.40	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	895.00	32,475,075.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	351.20	53,779,256.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	229.00	13,971,290.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	107.00	10,224,920.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	124.00	29,115,448.00	
	BDO UNIBANK INC	394,773	136.50	53,886,514.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	68.45	37,310,520.65	
	PLDT INC	10,460	1,400.00	14,644,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	374.80	19,931,864.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	29.40	37,658,460.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	28.70	44,581,145.00	
	フィリピンペソ 小計	5,297,000		409,217,586.55 (1,106,196,979)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,920.00	6,313,916,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	22,600.00	4,540,340,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	10,550.00	11,642,980,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,525.00	1,503,345,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	1,185.00	3,427,267,665.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	9,625.00	7,257,250,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,820.00	4,577,697,540.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	3,950.00	1,559,870,800.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	4,710.00	15,436,083,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	66.00	8,886,233,664.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,830.00	8,882,521,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	5,225.00	4,980,992,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	10,475.00	6,278,715,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	6,150.00	8,633,370,000.00	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,060.00	3,541,644,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,560.00	6,534,060,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	9,425.00	88,307,537,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	6,050.00	36,915,841,600.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	4,760.00	12,302,696,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	4,720.00	56,783,969,440.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	765.00	2,173,059,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	2,940.00	26,161,590,000.00	
	インドネシアルピア 小計	201,300,808		326,640,979,709.00 (3,233,745,699)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	68,800.00	356,384,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	67,800.00	433,038,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	104,200.00	1,046,584,800.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	32,250.00	589,401,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	31,450.00	351,894,050.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	514,000.00	618,856,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	88,100.00	474,770,900.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	146,500.00	278,057,000.00	
	LG CHEM LTD	9,272	394,000.00	3,653,168,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	256,000.00	224,512,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	117,300.00	271,666,800.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	387,500.00	4,566,687,500.00	
	SKC CO LTD	1,432	117,000.00	167,544,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	57,700.00	698,054,600.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	18,120.00	1,485,894,360.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	202,500.00	1,666,980,000.00	
	ECOPRO CO LTD	15,665	96,800.00	1,516,372,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	84,900.00	235,088,100.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	43,100.00	284,158,300.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	201,500.00	1,173,939,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	30,800.00	457,349,200.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	132,800.00	280,872,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	128,700.00	806,820,300.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	33,950.00	331,623,600.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	53,500.00	717,756,000.00	
	L&F CO LTD	4,327	154,600.00	668,954,200.00	
	LG CORP	16,658	80,600.00	1,342,634,800.00	
	LG ENERGY SOLUTION	8,760	362,000.00	3,171,120,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	261,500.00	1,244,217,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	45,300.00	391,709,100.00	
	SAMSUNG C&T CORP	15,406	142,100.00	2,189,192,600.00	
	SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	24,250.00	734,775,000.00	

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	9,500.00	904,105,500.00
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	47,550.00	111,171,900.00
SK INC	6,394	150,100.00	959,739,400.00
SK SQUARE CO LTD	19,731	83,300.00	1,643,592,300.00
HANJIN KAL CORP	7,812	63,400.00	495,280,800.00
HMM CO LTD	35,545	16,600.00	590,047,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	188,000.00	525,084,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	21,200.00	568,626,400.00
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	18,150	45,000.00	816,750,000.00
HANON SYSTEMS	19,000	5,270.00	100,130,000.00
HYUNDAI MOBIS	10,148	227,500.00	2,308,670,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	271,500.00	6,366,132,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	165,500.00	999,951,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	162,900.00	561,842,100.00
KIA CORP	45,204	120,500.00	5,447,082,000.00
COWAY CO LTD	9,036	58,300.00	526,798,800.00
LG ELECTRONICS INC	17,254	95,400.00	1,646,031,600.00
KANGWON LAND INC	28,528	15,130.00	431,628,640.00
HYBE CO LTD	4,975	198,100.00	985,547,500.00
KAKAO CORP	52,020	45,450.00	2,364,309,000.00
KRAFTON INC	3,793	256,000.00	971,008,000.00
NAVER CORP	21,578	182,100.00	3,929,353,800.00
NCSOFT CORPORATION	2,709	215,000.00	582,435,000.00
NETMARBLE CORP	2,465	64,500.00	158,992,500.00
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	346,500.00	637,213,500.00
KT&G CORP	19,456	87,100.00	1,694,617,600.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	93,500.00	293,777,000.00
AMOREPACIFIC CORP	3,762	188,000.00	707,256,000.00
LG H&H CO LTD	1,321	460,000.00	607,660,000.00
HLB INC	23,903	48,700.00	1,164,076,100.00
CELLTRION INC	24,444	183,500.00	4,485,474,000.00
CELLTRION PHARM INC	2,169	92,800.00	201,283,200.00
HANMI PHARM CO LTD	1,202	303,500.00	364,807,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	770,000.00	2,588,740,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	85,200.00	272,384,400.00
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	57,700.00	121,170,000.00
YUHAN CORPORATION	13,854	71,800.00	994,717,200.00
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	61,300.00	3,141,563,700.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,720.00	388,687,600.00
KAKAObANK CORP	35,459	23,200.00	822,648,800.00
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	77,300.00	4,993,502,700.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	47,550.00	3,222,843,900.00

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	14,480.00	1,648,026,720.00	
	KAKAOPAY CORP	3,065	33,300.00	102,064,500.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	68,400.00	314,776,800.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	77,500.00	1,315,562,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,590.00	235,403,850.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,480.00	151,095,360.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	38,000.00	605,986,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	99,200.00	999,340,800.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	347,500.00	2,135,040,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	86,700.00	1,051,757,700.00	
	POSCO DX CO LTD	9,010	38,450.00	346,434,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	167,700.00	1,221,526,800.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,978	140,100.00	557,317,800.00	
	LG DISPLAY CO LTD	51,846	10,180.00	527,792,280.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	237,000.00	638,952,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	158,200.00	1,460,660,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	806,665	78,300.00	63,161,869,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	64,500.00	9,151,066,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	405,500.00	4,161,646,500.00	
	KT CORP	10,500	36,250.00	380,625,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	9,810.00	217,046,250.00	
	SK TELECOM	9,563	51,900.00	496,319,700.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,990.00	884,357,600.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	146,400.00	1,059,643,200.00	
	SK HYNIX INC	91,166	200,000.00	18,233,200,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,622,835		204,184,319,210.00 (23,460,778,277)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	68.60	16,343,264.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	43.95	19,961,035.20	
	CHINA STEEL	1,779,261	24.15	42,969,153.15	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	54.80	29,704,942.80	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	67.00	40,054,208.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	53.70	41,389,382.40	
	TAIWAN CEMENT	1,268,419	34.00	43,126,246.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	1,120.00	35,343,840.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	33.65	12,182,242.20	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,785.00	16,065,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	37.15	18,657,212.95	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	22.05	10,253,250.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	35.20	13,587,200.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	209.00	38,291,935.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	30.10	14,207,200.00	

WAN HAI LINES LIMITED	74,635	71.10	5,306,548.50
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	71.30	15,472,100.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	58.50	27,089,068.50
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	476.50	19,029,980.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	157.50	12,426,907.50
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	362.00	11,222,000.00
POU CHEN	273,780	37.60	10,294,128.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	606.00	32,760,360.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	272.50	24,128,240.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	80.80	62,732,716.00
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	417.00	10,425,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	18.35	11,163,736.30
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	38.00	117,429,006.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,474,537	28.65	70,895,485.05
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	28.95	47,864,714.10
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	25.50	38,718,205.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,066,087	40.10	82,850,088.70
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	22.75	40,755,351.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	18.70	37,412,173.70
TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	16.95	13,538,304.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	26.40	39,994,046.40
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	47.45	32,739,788.25
CHAILEASE HOLDING CO LTD	287,702	150.50	43,299,151.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,919,822	33.15	63,642,099.30
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	54.80	83,901,923.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	14.00	36,067,164.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	72.50	98,125,197.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.81	17,019,739.46
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	510.00	43,860,000.00
ACER INC	617,803	53.30	32,928,899.90
ADVANTECH CO LTD	76,261	361.50	27,568,351.50
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	520.00	66,087,840.00
AUO CORP	1,268,072	18.00	22,825,296.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	228.00	27,063,600.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	38.15	30,739,744.00
DELTA ELECTRONICS INC	347,903	329.50	114,634,038.50
E INK HOLDINGS INC	144,000	225.50	32,472,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	317.00	23,775,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,185,248	173.00	378,047,904.00
INNOLUX CORP	1,320,576	13.90	18,356,006.40
INVENTEC CO LTD	455,511	54.00	24,597,594.00
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,190.00	32,937,600.00

	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	112.00	39,586,624.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	186.50	18,650,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	189.00	3,969,000.00	
	PEGATRON CORP	340,474	106.50	36,260,481.00	
	QUANTA COMPUTER INC	463,270	284.00	131,568,680.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	82.70	16,713,670.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	191.00	40,301,000.00	
	WISTRON CORP	427,000	114.00	48,678,000.00	
	WIWYNN CORP	16,000	2,740.00	43,840,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	88.00	22,940,896.00	
	YAGEO CORPORATION	64,588	638.00	41,207,144.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	118.50	16,343,757.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	127.00	74,208,005.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	84.30	18,208,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	107.00	26,236,400.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	2,720.00	32,640,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	161.50	83,061,872.50	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,295.00	27,540,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,430.00	18,590,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	520.00	21,840,000.00	
	MEDIATEK INC	253,804	1,205.00	305,833,820.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	64.20	16,627,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	624.00	59,932,080.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	20,000	721.00	14,420,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	26.55	15,292,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	539.00	46,323,816.00	
	SILERGY CORP	53,000	478.00	25,334,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,160,389	875.00	3,640,340,375.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	56.00	110,656,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	101.00	18,988,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	363,030	25.70	9,329,871.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	43.25	12,070,080.25	
	新台湾ドル 小計	58,180,450		7,411,866,180.61 (36,115,800,338)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	149,952	647.35	97,071,427.20	
	COAL INDIA LTD	295,479	497.25	146,926,932.75	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	125,486	535.60	67,210,301.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	167.90	100,242,344.40	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	283.35	152,940,429.30	
	PETRONET LNG LTD	83,779	308.30	25,829,065.70	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	506,553	2,973.20	1,506,083,379.60	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	646.05	47,505,994.65	

APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,696.25	44,833,583.75
ASIAN PAINTS LTD	67,203	2,902.45	195,053,347.35
BERGER PAINTS INDIA LTD	35,338	488.40	17,259,079.20
GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,453.20	114,915,247.60
HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	676.55	167,033,429.50
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	1,073.70	74,916,343.80
JSW STEEL LTD	99,332	917.50	91,137,110.00
NMDC LTD	146,261	266.00	38,905,426.00
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,661.40	46,854,935.80
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,987.80	87,124,248.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	25,655.55	35,584,247.85
SRF LTD	33,773	2,305.35	77,858,585.55
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	5,508.80	55,154,105.60
TATA STEEL LTD	1,137,948	175.45	199,652,976.60
ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	10,164.55	201,786,646.60
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	510.35	35,546,387.85
VEDANTA LTD	107,173	472.40	50,628,525.20
ABB LTD INDIA	11,720	8,417.60	98,654,272.00
ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,391.20	114,113,880.00
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	212.40	51,395,065.20
ASTRAL LTD	19,918	2,104.85	41,924,402.30
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	288.40	146,335,602.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	304.85	46,277,144.55
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	636.05	44,781,736.30
CUMMINS INDIA LTD	20,968	3,755.60	78,747,420.80
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,852.40	66,067,698.40
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	4,949.65	179,751,489.40
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	3,586.15	385,833,878.50
POLYCAB INDIA LTD	7,354	6,641.05	48,838,281.70
SIEMENS INDIA LTD	11,025	7,373.60	81,293,940.00
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	48.25	72,375,000.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	1,121.70	25,791,248.10
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,443.00	150,911,826.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	1,107.00	29,285,685.00
GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	87.25	34,419,950.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	4,400.55	116,398,948.05
BAJAJ AUTO LTD	9,644	8,967.40	86,481,605.60
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	3,051.65	26,949,121.15
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,493.55	45,287,423.10
EICHER MOTORS LTD	26,253	4,853.90	127,429,436.70
HERO MOTOCORP LTD	21,431	5,146.00	110,283,926.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	2,610.05	391,799,825.60

MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,929.90	314,843,065.00
MRF LTD	432	130,196.30	56,244,801.60
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	137.30	71,565,565.50
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	627.40	37,197,918.60
TATA MOTORS LTD	277,381	962.05	266,854,391.05
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	648.25	48,618,750.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,823.85	80,882,075.20
TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,175.90	89,764,578.60
PAGE INDUSTRIES LTD	886	35,663.70	31,598,038.20
TITAN CO LTD	56,531	3,450.35	195,051,735.85
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	567.30	93,319,148.10
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	474.80	20,857,964.00
ZOMATO LTD	1,054,701	186.80	197,018,146.80
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	6,442.00	92,481,352.00
TRENT LTD	37,950	4,699.30	178,338,435.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	4,797.35	137,165,831.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,280.90	117,003,620.40
ITC LTD	480,447	441.20	211,973,216.40
MARICO LTD	81,711	608.20	49,696,630.20
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,472.85	127,252,861.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,117.55	104,199,244.45
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,174.15	68,781,707.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,502.00	120,697,716.00
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,713.70	70,556,200.00
DABUR INDIA LTD	144,837	559.55	81,043,543.35
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,320.10	83,689,059.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,380.65	342,956,439.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	5,962.50	86,825,925.00
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	801.75	96,363,134.25
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,228.75	43,516,181.25
CIPLA LTD	88,546	1,488.65	131,814,002.90
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	4,110.60	90,153,679.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,892.25	107,951,912.25
LUPIN LTD	48,134	1,631.60	78,535,434.40
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,494.95	250,374,226.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	2,691.80	32,893,796.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	619.25	18,660,479.50
AXIS BANK LTD	391,573	1,164.95	456,162,966.35
BANDHAN BANK LTD	74,811	188.50	14,101,873.50
BANK OF BARODA	248,313	269.30	66,870,690.90
HDFC BANK LTD	485,940	1,492.20	725,119,668.00
ICICI BANK LTD	879,852	1,134.80	998,456,049.60

IDFC FIRST BANK LTD	531,028	78.04	41,441,425.12
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,439.95	69,643,181.75
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,708.65	318,398,384.25
PUNJAB NATIONAL BANK	272,403	126.60	34,486,219.80
STATE BANK OF INDIA	314,786	832.35	262,012,127.10
UNION BANK OF INDIA	238,889	152.55	36,442,516.95
YES BANK LTD	2,352,478	23.08	54,295,192.24
BAJAJ FINANCE LTD	49,376	6,826.25	337,052,920.00
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,608.55	123,152,196.55
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	8,164.85	24,453,725.75
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,278.95	107,429,242.10
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	3,824.00	54,197,552.00
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	367.85	173,324,298.70
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,719.90	21,366,317.70
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	37,520	356.20	13,364,624.00
POWER FINANCE CORPORATION	205,755	467.00	96,087,585.00
REC LTD	186,584	537.10	100,214,266.40
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	710.70	43,135,936.50
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	2,400.75	131,309,021.25
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	566.65	79,404,664.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,661.50	55,877,906.50
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	585.00	26,509,860.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,445.45	105,136,251.20
HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,353.40	221,042,701.60
INFOSYS LTD	553,283	1,472.90	814,930,530.70
LTIMINDTREE LTD	15,699	4,827.95	75,793,987.05
MPHASIS LTD	19,317	2,395.75	46,278,702.75
PERSISTENT SYSTEMS LTD	15,982	3,568.40	57,030,168.80
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	3,895.10	593,453,540.90
TATA ELXSI LTD	4,179	7,425.75	31,032,209.25
TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,337.70	126,809,946.90
WIPRO LTD	247,008	465.90	115,081,027.20
BHARTI AIRTEL LTD	389,936	1,373.95	535,752,567.20
TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,833.55	36,348,295.20
ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,889.15	114,675,183.30
ADANI POWER LTD	167,705	710.95	119,229,869.75
GAIL INDIA LTD	504,548	200.45	101,136,646.60
INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	454.20	12,138,040.80
NTPC LTD	664,141	372.30	247,259,694.30
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	319.75	256,113,355.00
TATA POWER CO LTD	199,512	449.00	89,580,888.00
DLF LTD	126,742	847.35	107,394,833.70

	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,812.95	83,719,017.90
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,331.30	55,837,384.60
	インドルピー 小計	24,204,501		18,916,308,968.46 (35,940,987,040)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	14.83	888,524.62
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.10	1,929,650.84
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.76	2,300,823.36
	INDUSTRIES QATAR	282,919	11.74	3,321,469.06
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.01	2,133,534.86
	DUKHAN BANK	319,751	3.68	1,177,003.43
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.46	2,822,316.36
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.40	2,231,143.20
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	17.46	5,854,355.46
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	13.50	10,007,577.00
	OOREDOO QSC	72,800	9.55	695,240.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	14.78	1,426,447.36
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.98	618,320.20
	カタールリアル 小計	5,782,030		35,406,405.75 (1,529,556,728)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	184.02	6,296,612.34
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	724.30	7,236,481.30
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	445.16	30,022,925.88
	GOLD FIELDS LTD	144,200	290.26	41,855,492.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	172.07	17,183,082.27
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	102.78	15,504,054.66
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	520.10	9,194,847.90
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	140.71	6,763,788.99
	SASOL LTD	88,115	130.58	11,506,056.70
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	23.18	18,531,598.70
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	252.39	12,695,974.17
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,907.25	119,526,684.75
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	18.36	8,731,612.08
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	61.18	10,787,012.88
	BID CORP LTD	58,066	422.34	24,523,594.44
	CLICKS GROUP LTD	35,422	306.17	10,845,153.74
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	264.99	22,583,507.76
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	229.03	12,867,363.46
	ABSA GROUP LTD	140,135	153.96	21,575,184.60
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,260.00	32,996,000.00
NEDBANK GROUP LTD	63,111	240.00	15,146,640.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	188.65	45,832,328.85	
FIRSTRAND LTD	816,636	68.16	55,661,909.76	

	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	470.92	8,093,702.04	
	REMGRO LTD	74,679	126.25	9,428,223.75	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	117.00	11,557,143.00	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	11.29	11,003,866.24	
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	43.10	10,251,938.40	
	SANLAM LTD	307,490	74.17	22,806,533.30	
	MTN GROUP LTD	255,377	85.65	21,873,040.05	
	VODACOM GROUP	79,334	95.24	7,555,770.16	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	67,336	131.10	8,827,749.60	
	南アフリカランド 小計	5,817,702		669,265,873.77 (5,695,452,585)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.05	1,065,274.30	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.25	1,402,199.50	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.54	1,571,837.88	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.01	3,776,154.30	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	11.48	2,132,765.88	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.52	2,898,794.88	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	15.95	5,705,299.05	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	11.98	8,673,747.62	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	15.72	10,094,409.36	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.74	4,166,269.94	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	7.95	8,813,910.60	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	6,135,824		50,300,663.31 (2,156,389,436)	
クウェートディ ナール	BOUBYAN BANK K.S.C	171,769	0.58	99,797.78	
	GULF BANK	162,936	0.25	42,200.42	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,585,286	0.74	1,179,452.78	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.86	1,212,063.65	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.45	136,244.97	
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.83	125,077.88	
	クウェートディナール 小計	3,771,632		2,794,837.48 (1,433,528,040)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	9.10	1,334,970.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	42.00	3,738,000.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	17.20	1,100,800.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.98	714,210.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	9.91	991,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	25.61	2,463,682.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	10.74	2,553,886.08	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	11.19	890,724.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	23.21	229,779.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	24.95	774,697.50	

YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	34.18	957,040.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	7.67	1,260,181.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	24.86	731,878.40
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.96	2,571,720.00
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	20.66	432,413.80
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	16.37	337,222.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	12.71	1,171,862.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	19.29	401,232.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	52.70	542,810.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	34.25	383,600.00
GEM CO LTD-A	289,800	6.57	1,903,986.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	20.14	499,995.64
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	15.09	559,839.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	7.34	1,082,650.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.17	1,805,657.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	53.97	1,208,928.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.57	723,770.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.28	256,800.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	9.38	209,174.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	61.85	627,159.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	22.00	336,600.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	10.86	511,506.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	16.51	1,307,592.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.01	58,695.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	17.37	826,812.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	10.43	505,333.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	18.55	1,029,061.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	29.07	210,815.64
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	28.96	519,542.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.68	1,054,688.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	16.92	274,780.80
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	5.47	599,938.66
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.85	528,990.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	31.16	336,528.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	15.60	778,440.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	49.14	488,451.60
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	37.43	426,702.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	15.80	154,840.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.93	1,303,188.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	89.09	3,590,327.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	26.72	394,173.44
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	42.22	695,996.70

YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	45.18	82,227.60
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	39.85	163,385.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	26.36	985,864.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	28.84	213,704.40
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	23.88	3,090,072.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	17.84	4,800,744.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	35.38	403,332.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	42.57	659,835.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	34.19	287,196.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	10.14	648,960.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	35.44	1,956,819.60
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.22	1,338,882.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.01	1,843,101.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.79	3,256,296.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	204.34	11,193,745.20
CRRC CORP LTD-A	185,800	6.85	1,272,730.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	17.37	750,384.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	38.06	1,502,342.38
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	4.91	111,948.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	60.16	144,384.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	7.85	157,871.35
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	102.63	386,915.10
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	21.16	122,728.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	51.90	594,566.40
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	14.54	597,594.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	18.93	910,533.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.31	1,095,279.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	10.42	377,204.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	22.24	1,867,715.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	98.89	587,406.60
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	46.28	580,073.52
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.36	874,752.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.71	700,149.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.21	2,049,007.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	60.09	1,706,135.37
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	7.61	190,706.60
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	102.49	1,024,900.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	14.71	598,697.00
TBEA CO LTD-A	29,274	14.56	426,229.44
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	16.24	701,568.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	7.64	1,523,416.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	21.65	684,140.00

ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	67.50	557,550.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	22.22	162,206.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	8.14	652,014.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	38.15	419,650.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.65	1,728,135.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.16	2,049,036.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.96	158,400.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	14.13	2,592,855.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.06	1,133,130.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	38.52	2,045,412.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	35.79	190,367.01
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.59	248,196.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	17.35	966,395.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	9.34	203,985.60
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	36.97	558,986.40
BYD CO LTD -A	17,000	214.95	3,654,150.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	125.06	1,125,540.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	14.60	632,939.20
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	46.33	857,105.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	16.24	557,032.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	102.54	861,336.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.08	471,144.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	45,700	58.31	2,664,767.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.18	604,068.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.40	840,035.60
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	53.11	148,708.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	41.22	1,793,070.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	25.99	721,482.40
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	38.04	301,733.28
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	65.74	3,339,592.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	74.47	573,419.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	30.05	3,038,055.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	56.88	455,040.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	28.78	754,036.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	10.16	340,156.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	15.43	378,035.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.10	487,760.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.66	928,404.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	25.10	409,130.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	9.62	219,336.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.96	243,540.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	75.81	1,570,783.20

SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	5.91	653,055.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	21.26	473,906.66
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	46.34	657,842.64
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	31.37	335,659.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	255.67	409,072.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	43.88	96,536.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	70.55	1,291,065.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	96.28	288,840.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	4.76	283,220.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	70.70	558,530.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	37.09	2,004,974.13
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	16.91	463,334.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	52.06	885,020.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	25.52	2,005,361.60
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	29.29	1,004,705.58
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	54.44	941,812.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	95.85	872,235.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	56.63	317,128.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	27.01	310,615.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,692.01	21,996,130.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	183.65	3,379,160.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	47.65	1,599,038.70
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	10.38	278,184.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	22.69	1,139,038.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	257.45	2,414,881.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	47.18	537,852.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	21.83	833,032.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	153.60	6,374,400.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	31.41	317,241.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	15.35	455,895.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	12.45	1,142,275.05
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.52	504,320.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	37.25	105,715.50
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	31.62	307,346.40
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,694	7.56	164,006.64
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	15.49	229,252.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.37	108,550.80
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	310.00	4,619,000.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	63.80	127,600.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	78.98	1,483,244.40
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	83,180	28.48	2,368,966.40
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	45.05	1,279,420.00

BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	65.32	685,010.84
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	61.10	553,993.70
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	112.98	248,556.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	59.91	611,082.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	34.18	507,573.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	68.69	1,524,437.17
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	55.11	440,880.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	18.82	354,757.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	217.20	632,486.40
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	43.05	5,127,341.10
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	13.72	379,797.04
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	28.28	539,525.84
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.03	450,623.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	18.93	205,958.40
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	27.80	194,600.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	18.78	177,283.20
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	33.25	373,464.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	13.99	237,830.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	43.29	712,726.56
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	54.03	537,058.20
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	3,900	232.46	906,594.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.41	157,038.20
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	19.52	680,232.96
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.40	4,541,240.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.89	341,620.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	15.84	2,493,216.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	7.07	3,619,133.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	13.90	1,566,530.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	8.29	1,904,544.60
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	10.04	1,480,900.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	25.55	1,489,565.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.90	359,450.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.11	888,039.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.26	2,723,078.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	35.50	6,603,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.99	1,091,664.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	3.06	1,227,610.80
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.96	831,024.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	5.49	3,176,514.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	18.11	3,721,605.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.40	1,361,160.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.05	714,575.00

SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	8.52	3,725,796.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.95	361,375.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	9.95	790,030.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.37	422,522.10
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.78	115,022.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	7.33	342,311.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.39	412,417.40
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	18.87	2,662,179.60
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	21.82	525,862.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	12.76	1,498,368.52
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.42	59,112.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.50	331,100.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.03	789,618.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	5.59	959,685.61
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.76	1,971,876.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	13.72	991,956.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.67	1,014,173.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	116.60	629,640.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.86	436,590.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.47	625,056.90
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.25	334,752.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.59	951,048.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.52	2,005,552.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.86	440,040.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	11.42	499,054.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.28	1,976,944.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	29.67	2,972,934.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	44.78	4,692,944.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	8.31	223,539.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	281.00	1,355,263.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	32.64	1,053,162.24
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	20.90	346,145.80
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	42.65	460,620.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	55.06	165,180.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	39.95	380,763.45
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	50.70	278,850.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	11.65	153,430.50
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	28.78	1,090,762.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	4.26	2,618,196.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	28.58	800,240.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	9.42	327,816.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	46.44	422,604.00

FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	25.62	4,229,862.00
GOERTEK INC -A	26,900	16.69	448,961.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	4.78	239,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	33.99	237,930.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	39.02	769,162.24
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	14.90	250,320.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	32.51	1,510,089.50
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	87.60	151,372.80
NINESTAR CORP-A	18,543	28.17	522,356.31
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	20.41	495,963.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	94.32	448,963.20
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	139.08	894,979.80
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	16.02	456,570.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.51	506,022.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	7.65	359,550.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	23.69	434,474.60
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	30.45	127,890.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	6.69	359,319.90
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	87.80	412,660.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	36.87	580,702.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.15	519,645.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	173.79	1,511,973.00
ZTE CORP-A	76,400	27.00	2,062,800.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.64	1,961,792.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	9.48	1,647,624.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.60	1,109,980.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	26.15	8,626,362.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.28	1,016,368.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	5.12	1,616,384.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	16.37	2,895,853.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	17.10	1,578,330.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	133.64	948,443.08
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	56.87	576,548.06
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	183.70	2,098,221.40
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	37.53	789,330.96
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	81.26	509,662.72
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	26.75	566,244.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	18.20	136,500.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	71.32	2,933,035.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	59.00	442,500.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	15.32	523,974.64
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	25.39	756,622.00

	JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	7.88	181,129.68
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	18.93	1,899,436.20
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	50.80	1,069,594.00
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	293.16	908,796.00
	SG MICRO CORP-A	4,095	74.17	303,726.15
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	67.80	535,620.00
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,920	90.61	355,191.20
	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	137.30	562,380.80
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	11.46	422,587.50
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.20	268,550.00
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	21.32	478,975.12
	TONGWEI CO LTD-A	66,600	22.88	1,523,808.00
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	21.89	556,400.02
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	56.10	384,789.90
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	96.00	699,840.00
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	36.33	515,886.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	33.31	567,002.82
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	10.36	566,692.00
	CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	9.56	513,372.00
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.51	1,835,028.00
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	10.91	892,438.00
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	11.51	147,328.00
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	2.91	230,763.00
	オフショア人民元 小計	26,251,793		370,381,908.69 (8,017,583,101)
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	80,157	17.44	1,397,938.08
	SAUDI ARABIAN OIL CO	465,520	29.95	13,942,324.00
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	39.25	462,168.75
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	110.60	4,137,877.80
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	31.55	1,490,453.55
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	49.95	10,531,657.80
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	136.20	1,273,333.80
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	76.80	12,584,217.60
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	21.84	1,863,454.32
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	8.46	875,026.26
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	37.10	1,895,030.90
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	211.20	888,518.40
	JARIR MARKETING CO	125,000	13.12	1,640,000.00
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	134.80	866,898.80
	ALMARAI CO	56,483	53.20	3,004,895.60
	SAVOLA	36,289	44.95	1,631,190.55
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	166.40	1,137,011.20

DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	284.00	4,657,316.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	117.20	1,866,292.80	
AL RAJHI BANK	324,926	79.10	25,701,646.60	
ALINMA BANK	201,652	30.85	6,220,964.20	
ARAB NATIONAL BANK	114,708	20.50	2,351,514.00	
BANK AL-JAZIRA	122,367	15.64	1,913,819.88	
BANK ALBILAD	112,127	33.50	3,756,254.50	
BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	34.45	3,267,065.75	
RIYAD BANK	234,479	25.15	5,897,146.85	
SAUDI AWWAL BANK	147,895	39.15	5,790,089.25	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	12.94	1,142,602.00	
THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	33.95	16,661,777.30	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	236.80	2,594,617.60	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	229.80	3,268,445.40	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	142.20	2,368,341.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	279.80	1,235,876.60	
ELM CO	4,094	842.40	3,448,785.60	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	51.60	2,520,350.40	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	11.96	1,082,475.68	
SAUDI TELECOM CO	339,167	36.85	12,498,303.95	
ACWA POWER CO	16,955	480.20	8,141,791.00	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	61.90	995,413.90	
SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	17.82	2,888,782.38	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	12.52	1,264,407.32	
サウジアラビアリアル 小計	4,290,619		181,156,077.37 (7,604,932,127)	
合 計	1,384,053,844		199,613,035,751 (199,613,035,751)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	15,671,065.60	
		メキシコペソ 小計	97,360	15,671,065.60 (147,323,687)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,517,762.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,292,085.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,684,122.00	
		KLABIN SA-UNIT	110,000	2,281,400.00	
ブラジルリアル 小計	393,600	11,775,369.00 (359,410,167)			
投資信託受益証券合計		490,960	506,733,854 (506,733,854)		

投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	15,360,911.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	126,346	8,457,601.24		
	メキシコペソ 小計		740,046	23,818,512.24	(223,917,833)	
投資証券合計			740,046	223,917,833	(223,917,833)	
合計				730,651,687	(730,651,687)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 26銘柄	100.0%			2.9%
メキシコペソ	株式 21銘柄	92.6%			2.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		2.9%		0.1%
	投資証券 2銘柄			4.5%	0.1%
ブラジルリアル	株式 45銘柄	96.1%			4.5%
	投資信託受 益証券 4銘柄		3.9%		0.2%
チリペソ	株式 12銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%			0.5%
トルコリラ	株式 17銘柄	100.0%			0.8%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%			1.0%
ロシアルーブル	株式 14銘柄	100.0%			0.0%
香港ドル	株式 168銘柄	100.0%			20.8%
マレーシアリンギット	株式 32銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 35銘柄	100.0%			1.4%
フィリピンペソ	株式 14銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%			1.6%
韓国ウォン	株式 99銘柄	100.0%			11.7%
新台湾ドル	株式 89銘柄	100.0%			18.0%
インドルピー	株式 136銘柄	100.0%			17.9%
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%			2.8%

アラブ首長国連邦 ディルハム	株式	11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	327銘柄	100.0%			4.0%
サウジアラビアリアル	株式	41銘柄	100.0%			3.8%

(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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	813,815,743
国債証券	554,946,491,010
地方債証券	33,000,685,303
特殊債券	37,293,685,712
社債券	31,419,237,000
未収入金	689,715,000
未収利息	1,354,432,062
前払費用	39,935,498
流動資産合計	659,557,997,328
資産合計	659,557,997,328
負債の部	
流動負債	
未払金	833,424,860
未払解約金	409,445,182
流動負債合計	1,242,870,042
負債合計	1,242,870,042
純資産の部	
元本等	
元本	504,887,869,424
剰余金	
剰余金又は欠損金()	153,427,257,862
元本等合計	658,315,127,286
純資産合計	658,315,127,286
負債純資産合計	659,557,997,328

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 5月24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。

2024年 5月24日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	504,887,869,424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 98,632,000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 1.3039円 (1万口当たり純資産額) (13,039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 5月24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 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	463,653,275,174円
期中追加設定元本額	71,103,172,121円
期中一部解約元本額	29,868,577,871円
期末元本額	504,887,869,424円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	5,126,250,339円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,481,798円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,987,571,337円
世界経済インデックスファンド	7,620,285,651円
D C マイセレクション 2 5	29,670,326,877円
D C マイセレクション 5 0	38,441,675,126円
D C マイセレクション 7 5	13,058,110,476円
D C 日本債券インデックス・オープン	396,447,278円
D C 日本債券インデックス・オープン S	87,128,309,453円
D C 日本債券インデックス・オープン P	61,426,444,454円
D C マイセレクション S 2 5	17,790,498,277円
D C マイセレクション S 5 0	21,528,089,372円
D C マイセレクション S 7 5	5,961,498,889円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	351,232,216円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,056,374,720円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,255,403,163円
D C 世界経済インデックスファンド	4,813,046,940円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	2,254,689円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	22,629,970円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	8,968,360円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,321,333円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	56,406,128円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	103,023,970円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	28,376,519円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	24,034,042円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,030,324,511円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	743,697,048円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,277,069,786円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	65,515,307円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	44,505,217円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	905,649,595円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,019,219,378円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,342,114,954円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	94,200,741円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	6,338,310,242円
日本債券ファンド・シリーズ 1	17,618,390,540円
分散投資コア戦略ファンド A	18,842,053,099円
分散投資コア戦略ファンド S	26,903,202,649円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	326,930,930円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,010,485,329円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	89,465,093円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,843,236円
S M T インデックスバランス・オープン	73,269,601円
S M T 世界経済インデックス・オープン	61,757,362円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	151,676,054円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	228,932,369円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	19,836,882円
グローバル経済コア	401,990,258円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	50,892,245円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	41,897,320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	163,503,466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	93,899,161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	27,958,926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	20,933,567円

区分	2024年 5月24日現在
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,054,643,415円
10資産分散投資ファンド	462,411,118円
グローバル10資産バランスファンド	492,794,608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	162,493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	147,264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	139,965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	139,965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	161,936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	219,546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	230,560円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	279,544円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	104,380,158,883円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	64,927,446円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,488,860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）	497,150,338円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	31,408,207,340
地方債証券	922,298,779
特殊債券	1,221,044,584
社債券	653,822,000
合計	34,205,372,703

(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449回利付国債（2年）	1,090,000,000	1,088,234,200	
	第450回利付国債（2年）	1,140,000,000	1,137,879,600	
	第451回利付国債（2年）	1,180,000,000	1,177,356,800	
	第452回利付国債（2年）	3,140,000,000	3,131,867,400	
	第453回利付国債（2年）	1,650,000,000	1,645,116,000	
	第454回利付国債（2年）	2,890,000,000	2,883,988,800	
	第455回利付国債（2年）	1,050,000,000	1,045,873,500	
	第456回利付国債（2年）	1,100,000,000	1,096,843,000	
	第457回利付国債（2年）	2,720,000,000	2,711,105,600	
	第458回利付国債（2年）	1,490,000,000	1,487,124,300	
	第459回利付国債（2年）	30,000,000	29,933,700	
	第460回利付国債（2年）	1,170,000,000	1,169,204,400	

第144回利付国債(5年)	6,580,000,000	6,573,683,200	
第145回利付国債(5年)	5,020,000,000	5,012,721,000	
第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	4,787,232,000	
第147回利付国債(5年)	5,040,000,000	5,011,776,000	
第148回利付国債(5年)	5,890,000,000	5,847,709,800	
第149回利付国債(5年)	5,680,000,000	5,632,969,600	
第150回利付国債(5年)	5,310,000,000	5,259,342,600	
第151回利付国債(5年)	3,250,000,000	3,214,705,000	
第152回利付国債(5年)	690,000,000	684,335,100	
第153回利付国債(5年)	5,620,000,000	5,551,042,600	
第154回利付国債(5年)	4,990,000,000	4,936,906,400	
第155回利付国債(5年)	2,670,000,000	2,656,383,000	
第156回利付国債(5年)	3,650,000,000	3,618,573,500	
第157回利付国債(5年)	2,460,000,000	2,435,547,600	
第158回利付国債(5年)	3,270,000,000	3,225,266,400	
第159回利付国債(5年)	950,000,000	935,227,500	
第160回利付国債(5年)	2,950,000,000	2,915,868,500	
第161回利付国債(5年)	1,410,000,000	1,399,312,200	
第162回利付国債(5年)	1,630,000,000	1,614,841,000	
第163回利付国債(5年)	3,480,000,000	3,462,356,400	
第164回利付国債(5年)	1,750,000,000	1,721,930,000	
第165回利付国債(5年)	2,510,000,000	2,480,934,200	
第166回利付国債(5年)	1,540,000,000	1,529,358,600	
第167回利付国債(5年)	1,570,000,000	1,556,388,100	
第168回利付国債(5年)	280,000,000	280,196,000	
第1回利付国債(40年)	740,000,000	800,657,800	
第2回利付国債(40年)	1,030,000,000	1,071,261,800	
第3回利付国債(40年)	730,000,000	756,783,700	
第4回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,187,030,000	
第5回利付国債(40年)	1,150,000,000	1,133,785,000	
第6回利付国債(40年)	1,630,000,000	1,564,441,400	
第7回利付国債(40年)	1,460,000,000	1,332,162,400	
第8回利付国債(40年)	1,310,000,000	1,099,365,100	
第9回利付国債(40年)	2,260,000,000	1,362,260,200	
第10回利付国債(40年)	2,040,000,000	1,446,400,800	
第11回利付国債(40年)	1,765,000,000	1,193,316,500	
第12回利付国債(40年)	1,630,000,000	968,220,000	
第13回利付国債(40年)	2,330,000,000	1,359,531,700	
第14回利付国債(40年)	2,310,000,000	1,435,803,600	
第15回利付国債(40年)	2,950,000,000	2,026,827,000	
第16回利付国債(40年)	2,840,000,000	2,139,144,800	
第17回利付国債(40年)	10,000,000	9,751,600	

第339回利付国債(10年)	5,810,000,000	5,822,956,300	
第340回利付国債(10年)	4,430,000,000	4,441,030,700	
第341回利付国債(10年)	5,030,000,000	5,032,313,800	
第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	4,741,531,200	
第343回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,650,805,900	
第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,864,010,000	
第345回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,845,254,400	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,702,792,500	
第347回利付国債(10年)	3,840,000,000	3,803,942,400	
第348回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,214,673,600	
第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	5,097,460,800	
第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	6,480,122,400	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	4,759,815,750	
第352回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,154,959,800	
第353回利付国債(10年)	4,415,000,000	4,325,507,950	
第354回利付国債(10年)	4,420,000,000	4,320,638,400	
第355回利付国債(10年)	4,570,000,000	4,460,914,100	
第356回利付国債(10年)	4,580,000,000	4,464,263,400	
第357回利付国債(10年)	3,780,000,000	3,678,166,800	
第358回利付国債(10年)	4,110,000,000	3,991,179,900	
第359回利付国債(10年)	4,565,000,000	4,422,343,750	
第360回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,247,117,600	
第361回利付国債(10年)	5,060,000,000	4,875,461,800	
第362回利付国債(10年)	4,450,000,000	4,274,937,000	
第363回利付国債(10年)	5,220,000,000	4,998,985,200	
第364回利付国債(10年)	5,320,000,000	5,076,556,800	
第365回利付国債(10年)	5,077,000,000	4,826,856,210	
第366回利付国債(10年)	5,760,000,000	5,501,779,200	
第367回利付国債(10年)	5,280,000,000	5,026,612,800	
第368回利付国債(10年)	5,490,000,000	5,208,692,400	
第369回利付国債(10年)	5,130,000,000	4,976,664,300	
第370回利付国債(10年)	6,110,000,000	5,910,386,300	
第371回利付国債(10年)	4,790,000,000	4,577,707,200	
第372回利付国債(10年)	5,220,000,000	5,155,167,600	
第373回利付国債(10年)	5,300,000,000	5,121,549,000	
第374回利付国債(10年)	1,980,000,000	1,943,726,400	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	122,755,600	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	176,216,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	131,815,200	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	125,635,400	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	55,083,000	
第6回利付国債(30年)	580,000,000	648,967,800	

第7回利付国債(30年)	380,000,000	423,711,400
第8回利付国債(30年)	850,000,000	915,756,000
第9回利付国債(30年)	240,000,000	250,639,200
第10回利付国債(30年)	160,000,000	162,878,400
第11回利付国債(30年)	260,000,000	277,781,400
第12回利付国債(30年)	190,000,000	209,600,400
第13回利付国債(30年)	400,000,000	437,600,000
第14回利付国債(30年)	750,000,000	848,002,500
第15回利付国債(30年)	340,000,000	388,059,000
第16回利付国債(30年)	200,000,000	228,378,000
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,279,352,100
第18回利付国債(30年)	315,000,000	353,578,050
第19回利付国債(30年)	530,000,000	594,792,500
第20回利付国債(30年)	480,000,000	549,014,400
第21回利付国債(30年)	750,000,000	841,920,000
第22回利付国債(30年)	300,000,000	343,191,000
第23回利付国債(30年)	430,000,000	492,027,500
第24回利付国債(30年)	680,000,000	778,205,600
第25回利付国債(30年)	600,000,000	672,438,000
第26回利付国債(30年)	1,510,000,000	1,708,383,800
第27回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,907,240,200
第28回利付国債(30年)	1,830,000,000	2,088,377,700
第29回利付国債(30年)	1,670,000,000	1,879,267,700
第30回利付国債(30年)	1,970,000,000	2,187,527,400
第31回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,531,600,000
第32回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,877,429,000
第33回利付国債(30年)	2,290,000,000	2,424,194,000
第34回利付国債(30年)	2,145,000,000	2,324,751,000
第35回利付国債(30年)	2,480,000,000	2,605,661,600
第36回利付国債(30年)	2,420,000,000	2,533,110,800
第37回利付国債(30年)	2,715,000,000	2,786,947,500
第38回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,569,921,600
第39回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,835,964,000
第40回利付国債(30年)	1,190,000,000	1,190,844,900
第41回利付国債(30年)	1,310,000,000	1,286,380,700
第42回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,497,808,800
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,358,488,700
第44回利付国債(30年)	1,270,000,000	1,239,113,600
第45回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,504,240,000
第46回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,707,578,600
第47回利付国債(30年)	1,620,000,000	1,544,556,600
第48回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,713,836,300
第49回利付国債(30年)	1,750,000,000	1,600,217,500

第50回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,506,303,700	
第51回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,382,191,800	
第52回利付国債(30年)	1,860,000,000	1,384,621,200	
第53回利付国債(30年)	1,530,000,000	1,160,826,300	
第54回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,408,941,200	
第55回利付国債(30年)	1,620,000,000	1,277,856,000	
第56回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,383,448,000	
第57回利付国債(30年)	1,480,000,000	1,158,410,800	
第58回利付国債(30年)	2,130,000,000	1,660,100,700	
第59回利付国債(30年)	1,430,000,000	1,083,954,300	
第60回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,292,247,700	
第61回利付国債(30年)	1,250,000,000	938,987,500	
第62回利付国債(30年)	1,285,000,000	910,962,200	
第63回利付国債(30年)	1,380,000,000	946,555,800	
第64回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,037,156,800	
第65回利付国債(30年)	1,385,000,000	940,872,050	
第66回利付国債(30年)	1,495,000,000	1,010,365,850	
第67回利付国債(30年)	1,665,000,000	1,185,380,100	
第68回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,106,180,400	
第69回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,169,761,600	
第70回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,389,753,600	
第71回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,059,958,200	
第72回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,228,310,100	
第73回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,302,355,600	
第74回利付国債(30年)	1,770,000,000	1,372,705,800	
第75回利付国債(30年)	1,610,000,000	1,346,877,700	
第76回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,506,436,800	
第77回利付国債(30年)	2,010,000,000	1,801,583,100	
第78回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,278,225,000	
第79回利付国債(30年)	1,350,000,000	1,091,299,500	
第80回利付国債(30年)	2,070,000,000	1,937,954,700	
第81回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,123,554,600	
第82回利付国債(30年)	820,000,000	765,765,200	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	173,090,600	
第79回利付国債(20年)	270,000,000	275,197,500	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	224,468,200	
第81回利付国債(20年)	390,000,000	399,172,800	
第82回利付国債(20年)	600,000,000	614,898,000	
第83回利付国債(20年)	290,000,000	298,302,700	
第84回利付国債(20年)	470,000,000	482,722,900	
第85回利付国債(20年)	290,000,000	299,361,200	
第86回利付国債(20年)	510,000,000	528,303,900	

第 8 7 回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,851,003,200
第 8 8 回利付国債(20年)	420,000,000	436,795,800
第 8 9 回利付国債(20年)	350,000,000	363,279,000
第 9 0 回利付国債(20年)	630,000,000	656,642,700
第 9 1 回利付国債(20年)	450,000,000	470,065,500
第 9 2 回利付国債(20年)	880,000,000	918,596,800
第 9 3 回利付国債(20年)	410,000,000	428,429,500
第 9 4 回利付国債(20年)	610,000,000	639,115,300
第 9 5 回利付国債(20年)	830,000,000	877,758,200
第 9 6 回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,671,853,200
第 9 7 回利付国債(20年)	900,000,000	952,569,000
第 9 8 回利付国債(20年)	440,000,000	464,261,600
第 9 9 回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,598,304,800
第 1 0 0 回利付国債(20年)	480,000,000	511,492,800
第 1 0 1 回利付国債(20年)	715,000,000	767,273,650
第 1 0 2 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,270,600,400
第 1 0 3 回利付国債(20年)	400,000,000	429,116,000
第 1 0 4 回利付国債(20年)	160,000,000	170,369,600
第 1 0 5 回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,259,520,200
第 1 0 6 回利付国債(20年)	680,000,000	728,701,600
第 1 0 7 回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,176,483,000
第 1 0 8 回利付国債(20年)	840,000,000	890,912,400
第 1 0 9 回利付国債(20年)	920,000,000	977,555,200
第 1 1 0 回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,179,123,000
第 1 1 1 回利付国債(20年)	970,000,000	1,048,356,600
第 1 1 2 回利付国債(20年)	990,000,000	1,065,101,400
第 1 1 3 回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,180,064,800
第 1 1 4 回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,381,610,000
第 1 1 5 回利付国債(20年)	700,000,000	761,565,000
第 1 1 6 回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,810,728,000
第 1 1 7 回利付国債(20年)	1,480,000,000	1,605,607,600
第 1 1 8 回利付国債(20年)	660,000,000	713,869,200
第 1 1 9 回利付国債(20年)	530,000,000	567,052,300
第 1 2 0 回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,449,323,000
第 1 2 1 回利付国債(20年)	1,470,000,000	1,583,910,300
第 1 2 2 回利付国債(20年)	900,000,000	964,269,000
第 1 2 3 回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,964,988,000
第 1 2 4 回利付国債(20年)	760,000,000	824,873,600
第 1 2 5 回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,364,062,000
第 1 2 6 回利付国債(20年)	930,000,000	1,010,593,800
第 1 2 7 回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,101,742,800
第 1 2 8 回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,449,236,800
第 1 2 9 回利付国債(20年)	740,000,000	795,337,200

第130回利付国債（20年）	1,685,000,000	1,811,492,950	
第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,377,874,800	
第132回利付国債（20年）	790,000,000	843,735,800	
第133回利付国債（20年）	1,810,000,000	1,946,781,700	
第134回利付国債（20年）	1,640,000,000	1,765,148,400	
第135回利付国債（20年）	130,000,000	138,910,200	
第136回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,220,345,500	
第137回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,282,800,000	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,401,061,900	
第139回利付国債（20年）	480,000,000	509,284,800	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,661,635,700	
第141回利付国債（20年）	1,650,000,000	1,764,097,500	
第142回利付国債（20年）	1,265,000,000	1,362,594,750	
第143回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,759,915,400	
第144回利付国債（20年）	1,160,000,000	1,220,320,000	
第145回利付国債（20年）	2,275,000,000	2,430,587,250	
第146回利付国債（20年）	2,670,000,000	2,849,931,300	
第147回利付国債（20年）	2,740,000,000	2,897,440,400	
第148回利付国債（20年）	2,260,000,000	2,366,265,200	
第149回利付国債（20年）	2,980,000,000	3,116,245,600	
第150回利付国債（20年）	2,970,000,000	3,072,465,000	
第151回利付国債（20年）	2,515,000,000	2,547,242,300	
第152回利付国債（20年）	2,680,000,000	2,708,515,200	
第153回利付国債（20年）	2,350,000,000	2,393,992,000	
第154回利付国債（20年）	2,845,000,000	2,862,098,450	
第155回利付国債（20年）	2,640,000,000	2,592,928,800	
第156回利付国債（20年）	2,690,000,000	2,457,153,600	
第157回利付国債（20年）	3,200,000,000	2,838,784,000	
第158回利付国債（20年）	2,880,000,000	2,639,548,800	
第159回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,217,312,000	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	1,937,582,400	
第161回利付国債（20年）	2,390,000,000	2,188,475,200	
第162回利付国債（20年）	1,650,000,000	1,503,513,000	
第163回利付国債（20年）	2,610,000,000	2,367,870,300	
第164回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,109,655,500	
第165回利付国債（20年）	2,410,000,000	2,133,789,900	
第166回利付国債（20年）	1,890,000,000	1,712,793,600	
第167回利付国債（20年）	2,430,000,000	2,129,311,800	
第168回利付国債（20年）	1,630,000,000	1,399,110,500	
第169回利付国債（20年）	2,040,000,000	1,713,885,600	
第170回利付国債（20年）	2,550,000,000	2,129,071,500	
第171回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,627,231,200	

	第172回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,468,285,000
	第173回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,002,488,000
	第174回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,099,115,700
	第175回利付国債(20年)	2,270,000,000	1,905,551,500
	第176回利付国債(20年)	2,350,000,000	1,961,991,500
	第177回利付国債(20年)	2,460,000,000	2,006,425,200
	第178回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,080,612,800
	第179回利付国債(20年)	2,685,000,000	2,204,411,850
	第180回利付国債(20年)	2,200,000,000	1,898,116,000
	第181回利付国債(20年)	2,430,000,000	2,124,597,600
	第182回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,128,012,000
	第183回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,354,668,500
	第184回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,093,598,000
	第185回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,174,406,000
	第186回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,209,150,400
	第187回利付国債(20年)	1,900,000,000	1,741,103,000
	第188回利付国債(20年)	690,000,000	664,021,500
	国債証券合計	579,557,000,000	554,946,491,010
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	99,075,000
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	70,902,000
	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	99,123,000
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	110,613,000
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	107,083,000
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	101,967,000
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	98,089,000
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	212,322,000
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,517,000
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,270,000
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	71,700,000
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	212,892,000
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	212,012,000
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	198,920,000
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,023,000
	第765回東京都公募公債	100,000,000	99,248,000
	第770回東京都公募公債	100,000,000	99,047,000
	第781回東京都公募公債	300,000,000	295,041,000
	第800回東京都公募公債	200,000,000	193,500,000
	第830回東京都公募公債	300,000,000	285,474,000
	平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	99,676,000
	平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,330,000
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,307,000

平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	195,892,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	193,252,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	97,948,000	
第31回1号宮城県公募公債（10年）	200,000,000	200,578,000	
第39回1号宮城県公募公債（10年）	100,000,000	96,475,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	200,000,000	228,386,000	
第11回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	107,108,000	
第15回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	214,996,000	
第17回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,016,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	106,190,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	102,429,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	99,749,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	99,207,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	99,047,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	193,446,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	204,530,560	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	215,152,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	321,102,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	106,194,000	
第399回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,288,000	
第400回大阪府公募公債（10年）	300,000,000	300,891,000	
第402回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,215,000	
第407回大阪府公募公債（10年）	156,000,000	155,000,040	
第410回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	198,040,000	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	195,964,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,930,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	96,219,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	153,067,200	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	173,660,760	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	190,602,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	107,900,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	106,775,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	88,843,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	90,598,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	134,840,660	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	106,051,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,072,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,117,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	102,015,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	433,468,000	

第35回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	88,403,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	290,949,000	
第1回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	102,477,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	92,550,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	76,658,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,129,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,217,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	99,078,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	99,138,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	99,037,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	299,119,000	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	161,424,450	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	108,007,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	100,016,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,724,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,230,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	198,246,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	269,598,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,570,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	75,575,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	193,300,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	96,541,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	141,416,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,086,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	107,391,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	215,142,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	125,494,235	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,067,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	375,445,200	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	95,781,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	97,611,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	105,866,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	107,053,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	80,714,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	544,308,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	216,128,000	

第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	179,768,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	214,996,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	178,492,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,180,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,151,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,385,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,074,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	96,208,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	95,970,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	142,306,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,029,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	106,362,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,987,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,190,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,575,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	104,489,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	100,559,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,172,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	75,575,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	88,904,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	290,130,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	95,651,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	88,713,000	
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	97,357,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	97,098,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	214,106,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	107,707,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	106,129,000	
第20回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	90,478,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,154,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	119,082,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	289,731,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	96,429,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	125,867,300	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	97,943,000	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,174,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	288,126,000	

令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	286,581,000	
令和6年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	298,605,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	97,254,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	213,650,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	97,052,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	98,937,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	125,798,772	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,262,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,233,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,462,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,372,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,468,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,304,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,560,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,985,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,235,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,374,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,114,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	587,180,286	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,991,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	295,659,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,482,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	189,744,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	190,492,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,258,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,392,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,913,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債（10年）	100,000,000	95,863,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	96,974,140	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,211,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	98,950,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	97,730,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	192,358,000	
第13回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	216,116,000	
第15回大阪市公募公債（30年）	100,000,000	70,427,000	
第19回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	99,302,000	
第22回大阪市公募公債（20年）	600,000,000	536,868,000	
第24回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	91,454,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	191,460,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	113,445,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	112,205,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	106,451,000	

第11回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	97,072,000	
第499回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	99,285,000	
第512回名古屋市公募公債（10年）	300,000,000	290,058,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,468,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	192,824,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	99,213,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	120,000,000	125,197,200	
平成20年度第1回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	214,272,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	108,549,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債（20年）	100,000,000	106,247,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	70,948,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債（30年）	100,000,000	70,628,000	
第20回横浜市公募公債（20年）	300,000,000	322,548,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,294,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,224,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	99,210,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	98,620,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	98,627,000	
第30回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	204,292,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	290,094,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	95,695,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債（15年）	100,000,000	102,751,000	
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	100,000,000	100,687,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	99,741,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債（10年）	200,000,000	193,256,000	
第11回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	106,819,000	
第13回川崎市公募公債（30年）	200,000,000	179,068,000	
第17回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	104,546,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,227,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	96,166,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,209,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,389,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	107,635,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	100,000,000	103,963,000	
2023年度第8回福岡市公募公債（10年）	100,000,000	97,699,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,195,700	

	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	168,026,300	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	532,235,000	
	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	298,749,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	193,154,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	284,835,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	95,344,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	96,527,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,250,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	97,627,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	105,927,000	
	地方債証券合計	33,502,430,000	33,000,685,303	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	92,444,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	63,657,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,091,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,076,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	53,109,000	
	第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	130,000,000	133,634,800	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,988,000	
	第21回道路債券	100,000,000	114,418,000	
	第28回道路債券	200,000,000	230,078,000	
	第33回道路債券	200,000,000	231,592,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,693,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,835,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,174,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,138,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,365,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,156,000	
	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	216,636,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,098,000	
	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	107,857,000	
	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	108,696,000	
	第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,980,000	

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	107,012,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	93,528,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,696,000	
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	105,203,000	
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	105,839,000	
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	105,987,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	536,214,000	
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	106,868,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	73,822,000	
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	207,496,000	
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	103,046,000	
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	205,306,000	
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	99,949,000	
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	200,880,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	162,392,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	112,281,120	
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	199,898,000	
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	99,614,000	
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	71,933,000	
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	244,324,990	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,347,000	
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	110,966,240	
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	203,179,600	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,906,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,063,000	
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	99,113,000	
	200,000,000	198,118,000	

第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	280,824,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,694,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	95,100,000	
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	98,937,000	
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	118,536,000	
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	196,822,000	
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	266,631,000	
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	210,522,500	
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	96,816,000	
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	96,539,000	
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	269,712,000	
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	115,357,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	334,104,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	102,201,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	342,861,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	227,626,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	112,181,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	215,150,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	211,810,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	139,250,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	104,285,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	533,435,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	105,423,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	105,571,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	521,865,000	
第43回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	98,809,000	
第45回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	99,343,000	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,291,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,386,000	

F 7 7 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,802,000	
第 7 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,525,000	
第 7 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,075,000	
第 8 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,629,000	
第 8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,373,000	
第 8 3 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,528,000	
第 8 6 回地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ）	300,000,000	245,538,000	
第 8 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,990,000	
第 9 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,091,000	
第 9 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	248,668,210	
第 9 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	355,266,400	
第 9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,008,000	
第 9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,953,000	
第 1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	108,691,000	
第 1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	153,677,160	
第 1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,412,000	
第 1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,509,000	
第 1 1 9 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,145,000	
第 1 2 0 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,748,000	
F 1 2 9 回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	705,964,000	
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,878,000	
F 1 4 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,528,000	
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,158,000	
第 1 6 9 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	193,142,000	
第 1 7 0 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,315,000	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,774,000	
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,711,000	
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,721,000	
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,153,000	
F 2 2 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,850,000	
F 2 4 6 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,894,000	
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,832,000	
第 2 9 回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	98,912,000	
第 3 3 回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	198,166,000	
第 2 7 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,167,000	
第 2 8 回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,538,000	
第 3 0 回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	297,852,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	107,647,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	108,664,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,209,980	

第44回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	115,972,740	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,005,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	207,240,600	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	184,086,540	
第117回都市再生債券	200,000,000	199,708,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	110,348,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	61,320,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	128,698,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	87,619,000	
第17回政府保証民間都市開発債券	300,000,000	298,842,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	96,356,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	85,920,000	84,772,968	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,805,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	59,972,000	59,271,527	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	104,795,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	104,046,000	102,455,136	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	117,960,000	115,616,134	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	41,954,000	41,220,224	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	148,914,000	145,925,296	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	102,312,000	100,359,887	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,008,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,106,000	13,453,833	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,723,000	13,087,895	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,253,000	14,749,004	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,593,000	17,162,969	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,496,000	18,139,677	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,821,000	18,444,735	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,136,000	38,391,568	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,781,000	17,308,762	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,175,000	17,727,004	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,769,000	17,322,041	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,928,000	16,445,660	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,780,000	34,708,274	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,775,000	18,269,678	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,795,000	24,344,902	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,605,000	23,132,374	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,782,000	23,331,046	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,782,000	49,774,225	

第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,134,000	61,494,690	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,783,000	31,888,519	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,430,000	99,517,651	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,234,000	33,629,152	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,709,000	29,092,265	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,648,000	27,808,911	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,628,000	33,063,910	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	162,097,500	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,176,000	85,670,872	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	115,740,000	116,239,996	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,793,000	33,733,862	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,204,000	35,123,030	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,038,000	35,802,311	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,725,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,319,000	112,379,585	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,874,000	38,365,916	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,502,000	80,601,153	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,595,000	45,563,852	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,730,000	48,337,062	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	308,730,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,883,000	47,766,512	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,375,000	150,206,272	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,122,000	100,745,037	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,469,000	49,193,143	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,346,000	52,844,420	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,504,000	56,750,331	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,003,000	62,035,559	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,319,000	61,182,347	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,970,000	61,980,134	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,396,000	62,718,325	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,667,000	62,793,647	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,809,000	64,544,218	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	276,200,000	259,194,365	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,534,000	64,112,186	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,313,000	63,899,980	

第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,325,000	64,823,727	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,304,000	131,712,284	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,302,000	129,255,666	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,058,000	132,889,576	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,942,000	66,199,527	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,258,000	131,433,506	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,372,000	66,497,292	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,006,000	133,679,329	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,360,000	133,967,523	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,064,000	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,345,000	68,427,951	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,739,000	68,043,697	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,747,000	67,325,893	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,672,000	138,615,226	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,866,000	69,649,539	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,786,000	68,788,910	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	152,462,000	139,832,047	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,588,000	70,554,647	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	234,405,000	211,979,473	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,136,000	142,898,015	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,792,000	73,994,969	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,435,000	74,333,868	
第158回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,991,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,700,000	152,727,206	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,442,000	77,216,298	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,172,000	155,467,437	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,742,000	156,503,332	
	85,251,000	77,929,644	

第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券			
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,740,000	157,652,167	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,966,000	156,625,371	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,998,000	79,565,760	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,045,000	80,002,089	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,908,000	238,841,401	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,076,000	80,065,487	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,716,000	81,800,357	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,509,000	82,447,634	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,762,000	83,660,781	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,636,000	84,535,126	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,086,000	170,251,357	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,688,000	88,364,647	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,570,000	179,967,287	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,834,000	91,503,429	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	86,388,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,563,000	92,184,847	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,875,000	92,323,790	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,410,000	188,538,818	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,523,000	95,004,956	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,981,000	95,738,214	
第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,000,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	71,202,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	276,063,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,521,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,272,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,336,000	
い第850号商工債	200,000,000	198,322,000	
い第876号商工債	400,000,000	394,276,000	
い第878号商工債	100,000,000	98,347,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,178,000	

	第379回信金中金債（5年）	100,000,000	98,966,000	
	第384回信金中金債（5年）	200,000,000	197,376,000	
	第385回信金中金債（5年）	400,000,000	394,648,000	
	第394回信金中金債（5年）	100,000,000	98,491,000	
	第16号商工債（10年）	100,000,000	99,898,000	
	第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,186,000	
	第20回アンデス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	298,332,000	
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	105,459,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	96,485,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	193,506,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	481,320,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,697,000	
	第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,760,000	
	第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,297,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,058,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,150,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,920,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,969,000	
	第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	397,704,000	
	第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,038,000	
	第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	198,382,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,508,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	598,104,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,072,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,152,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,826,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,718,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,127,000	
	第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,355,000	
	第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,915,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,004,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	182,948,000	
	特殊債券合計	38,253,918,000	37,293,685,712	
社債券	第27回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,804,000	
	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	200,000,000	200,000,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,003,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,018,000	

第33回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	98,762,000	
第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	397,864,000	
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	99,414,000	
第8回ピー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債(2023)	400,000,000	397,172,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	95,891,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,535,000	
第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,004,000	
第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,937,000	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	296,853,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	94,653,000	
第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,707,000	
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	99,609,000	
第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,562,000	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,102,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,379,000	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	95,993,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	99,734,000	
第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	198,794,000	
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	98,740,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	97,884,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,333,000	
第10回J・フロントリテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,361,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,181,000	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,463,000	
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	99,491,000	
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	198,980,000	
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	99,447,000	
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	99,387,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,695,000	
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	98,024,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,414,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	97,986,000	

第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,515,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	93,746,000	
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	98,240,000	
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	197,210,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,392,000	
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	77,417,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,132,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	98,040,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,731,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	194,022,000	
第2回株式会社A D E K A無担保社債	100,000,000	98,977,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	281,691,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,639,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,704,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	299,037,000	
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	99,413,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	94,826,000	
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	95,823,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,814,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,281,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	97,437,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	95,358,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,134,000	
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,181,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	98,671,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,423,000	
第14回株式会社L I X I L無担保社債	100,000,000	98,726,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,219,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	96,882,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,566,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	102,330,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,218,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,720,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	98,943,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,646,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	95,826,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,344,000	

第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,294,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,344,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,310,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,423,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,616,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,767,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,121,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,407,000	
第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	200,010,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,213,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	197,318,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	190,204,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	99,006,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,089,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	198,960,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	81,507,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,998,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,690,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	193,870,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,769,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,317,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	95,633,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	97,743,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,066,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	98,386,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,511,000	
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	95,941,000	
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	98,701,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,147,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,582,000	
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,388,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,244,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	198,792,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	385,736,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	98,276,000	
第26回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	193,096,000	
第30回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	298,533,000	

第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,335,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,093,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,378,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,615,000	
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	300,000,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,530,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,614,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,038,000	
第44回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,798,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,563,000	
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	98,822,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,937,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,628,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,457,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,894,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	95,976,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,378,000	
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	198,278,000	
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	199,276,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,238,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,537,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,947,000	
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	98,239,000	
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	99,135,000	
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	98,516,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,310,000	
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	197,490,000	
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	198,820,000	
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	197,352,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	198,954,000	

第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	194,802,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	184,834,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,228,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	81,908,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,302,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	94,743,000	
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	85,384,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,462,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	76,038,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	82,582,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,702,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	70,161,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	83,661,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	98,138,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,292,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	213,990,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,484,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,870,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	80,290,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,373,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,357,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	70,667,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,042,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	62,201,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,001,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	106,434,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	66,942,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	78,545,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	80,802,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,317,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,474,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,831,000	

第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	70,083,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	58,870,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	49,130,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	63,143,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,952,000	
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	141,482,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	99,334,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	97,668,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,587,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,467,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	167,178,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,298,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,081,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	90,469,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	81,315,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	94,570,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,172,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	198,268,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,803,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,276,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,807,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	95,319,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,942,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,823,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,025,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,665,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	194,406,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	96,167,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	290,208,000	
第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,881,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,928,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	194,170,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	177,232,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,681,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,742,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	193,342,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	94,939,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,343,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,497,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	94,551,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	198,258,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,029,000	

第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,177,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,469,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,482,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,560,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	94,497,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	193,240,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,608,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,243,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	86,543,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	97,386,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,767,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	88,423,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,947,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,976,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,959,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,840,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	96,695,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	197,656,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,730,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,697,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,161,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	263,697,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,480,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	93,053,000	
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,423,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	94,086,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	198,538,000	
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	99,399,000	
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	97,565,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	70,365,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	191,444,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	189,382,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	80,530,000	
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	197,034,000	
社債券合計	32,700,000,000	31,419,237,000	
合計		656,660,099,025	

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,164,365,816
コール・ローン	2,438,384,128
国債証券	341,064,820,727
派生商品評価勘定	15,120,671
未収入金	2,988,890
未収利息	2,475,366,405
前払金	6,681,619
前払費用	254,648,730
差入委託証拠金	207,693,015
流動資産合計	347,630,070,001
資産合計	347,630,070,001
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,217,439
未払金	4,725,119
未払解約金	567,251,904
流動負債合計	580,194,462
負債合計	580,194,462
純資産の部	
元本等	
元本	95,258,832,835
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	251,791,042,704
元本等合計	347,049,875,539
純資産合計	347,049,875,539
負債純資産合計	347,630,070,001

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5月24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>(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</p>

2024年 5月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	95,258,832,835口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.6432円 (36,432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 5月24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 5月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2024年 5月24日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	84,697,279,481円
期中追加設定元本額	17,040,969,470円
期中一部解約元本額	6,479,416,116円
期末元本額	95,258,832,835円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,092,973,918円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	489,015,401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）	2,365,641,307円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,289,236円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,751,299,663円
世界経済インデックスファンド	22,489,224,948円
DCマイセレクション25	1,863,203,902円
DCマイセレクション50	1,809,365,047円
DCマイセレクション75	1,450,612,492円
DC外国債券インデックス・オープン	2,226,068,670円
DCマイセレクションS25	1,109,811,755円
DCマイセレクションS50	988,882,353円
DCマイセレクションS75	575,026,900円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,224,847円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,338,125円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,225,526円
DC世界経済インデックスファンド	14,535,243,932円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	780,807,928円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,041,844円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	997,055円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	13,645,496円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	22,855,843円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	46,572,182円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,436,368円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,767,118円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	724,073,805円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	356,741,086円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,500,288,290円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	50,453,080円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	26,173,354円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	330,942,666円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	125,953,518円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	164,222,411円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	629,965,197円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,483,356,779円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	617,217,612円
外国債券ファンド・シリーズ1	763,970,652円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円

区分	2024年 5月24日現在
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）	780,080,718円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,496,265,072円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	220,832,634円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,803,112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）	1,229,684,446円
SMT インデックスバランス・オープン	178,127,342円
SMT 世界経済インデックス・オープン	428,285,267円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	630,401,481円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	951,887,499円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,319,554円
グローバル経済コア	1,133,875,233円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	23,023,584円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,888,309円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	65,777,232円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	90,987,768円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	45,239,646円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	62,028,348円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	754,851,784円
10資産分散投資ファンド	35,744,317円
グローバル10資産バランスファンド	25,083,306円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,342円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,496円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,344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	21,744円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	21,683円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	16,457円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	13,024,320,297円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	269,315,338円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	142,122,851円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	128,451,498円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	757,873,806
合計	757,873,806

(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 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	債券先物取引 買建	1,534,409,009	-	6,681,619
	合計	1,534,409,009	-	6,681,619

(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 5月24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	1,688,023,330	-	1,701,608,181	13,584,851
	アメリカドル	818,430,970	-	825,591,349	7,160,379
	カナダドル	68,303,195	-	68,468,880	165,685
	ユーロ	523,313,405	-	527,229,281	3,915,876
	イギリスポンド	96,010,750	-	97,467,615	1,456,865
	オフショア人民元	181,965,010	-	182,851,056	886,046
	合計		1,688,023,330	-	1,701,608,181

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,709,906.74	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,602,726.57	
		T 0.25% 07/31/25	7,640,000.00	7,215,025.00	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,938,383.78	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,811,914.07	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,362,132.80	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,404,843.76	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,650,816.96	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,804,980.45	
		T 0.375% 09/30/27	6,580,000.00	5,714,832.77	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,796,679.68	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,715,781.24	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,161,445.29	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,603,852.33	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,089,980.46	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,128,198.42	

T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,076,771.87	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,521,630.85	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,691,406.25	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,265,070.35	
T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	9,860,062.50	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,453,570.31	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,177,099.60	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,334,374.97	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,392,675.76	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,558,671.86	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,774,140.62	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,683,125.00	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,670,482.61	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,367,187.52	
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,648,232.41	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	8,910,200.15	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,297,548.45	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,041,875.04	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,039,893.75	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,130,460.94	
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	10,432,970.45	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,481,943.77	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,042,500.00	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,724,919.90	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,269,101.54	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,885,722.69	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,403,830.10	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,263,515.62	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,416,757.83	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,521,861.12	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,890,746.10	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,072,643.76	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,113,140.62	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,750,703.14	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,543,292.97	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,510,507.82	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,494,950.81	
T 1.5% 08/15/26	15,500,000.00	14,408,642.52	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,570,849.60	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,290,250.00	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,107,392.55	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	4,948,546.10	

T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,854,570.31
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,597,218.73
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,743,654.27
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,424,114.08
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,297,460.96
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,640,442.19
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,609,062.50
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,733,322.64
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,352,558.57
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,820,007.79
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,019,863.26
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,510,176.97
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,870,896.06
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,897,951.17
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,053,632.83
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,107,259.90
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,409,593.76
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,199,222.68
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,716,054.66
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,145,068.35
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,637,194.91
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	6,986,722.24
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,086,307.80
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,531,386.70
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,225,117.20
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,064,446.27
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,972,675.79
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,441,199.23
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,478,328.11
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,939,739.42
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,437,406.62
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	5,325,833.96
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,703,998.05
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	1,990,380.07
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,716,626.94
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,682,875.00
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,012,875.98
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,509,911.31
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,110,520.33
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,260,500.00
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,605,614.82
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,131,286.14
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,158,020.50

T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,246,894.51	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,359,814.46	
T 2.75% 08/15/32	12,900,000.00	11,362,078.12	
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,414,027.32	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,933,244.13	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,700,007.77	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,575,200.00	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,204,458.99	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,915,099.16	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,058,945.29	
T 2.875% 05/15/28	10,060,000.00	9,432,428.93	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,010,896.49	
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	3,893,628.88	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,462,625.03	
T 2.875% 05/15/52	10,800,000.00	7,858,687.50	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,731,846.47	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,319,660.96	
T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,683,773.39	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,735,152.33	
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	701,548.43	
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,714,531.25	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,657,250.98	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,322,781.25	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,671,823.25	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	3,011,706.25	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,223,265.65	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	854,314.45	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,055,585.92	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,695,350.79	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,958,546.82	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,460,931.25	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	5,863,400.40	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,682,875.98	
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	9,805,325.36	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,426,749.03	
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,825,214.84	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,516,972.01	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,490,128.33	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,928,990.24	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,279,542.98	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,796,250.00	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,402,874.94	

T 3.5% 02/15/39	770,000.00	688,322.85
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,316,318.35
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,841,207.02
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,207,883.17
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	8,067,138.64
T 3.625% 05/15/53	2,300,000.00	1,942,781.25
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,057,605.45
T 3.75% 04/15/26	6,570,000.00	6,428,976.00
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,878,535.16
T 3.75% 11/15/43	4,730,000.00	4,152,792.18
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,382,695.28
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,244,189.45
T 3.875% 08/15/33	8,170,000.00	7,792,137.50
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,332,357.42
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,430,481.25
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	7,873,396.87
T 3% 02/15/47	6,600,000.00	5,029,664.04
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	756,484.38
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	752,968.75
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,949,089.85
T 3% 05/15/45	700,000.00	540,667.96
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,441,731.63
T 3% 07/15/25	11,150,000.00	10,886,929.68
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,451,337.88
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,883,039.05
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,086,960.94
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,858,496.10
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,171,640.63
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,771,359.37
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	3,976,744.14
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,004,679.67
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,047,869.12
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,640,429.74
T 4.25% 02/15/54	3,250,000.00	3,073,027.35
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	873,421.87
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,821,835.97
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	710,342.19
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	992,031.25
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,858,660.16
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	631,972.65
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	5,937,539.04
T 4.375% 08/31/28	14,150,000.00	14,036,689.48
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	941,737.49

	T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,465,546.87
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,104,732.02
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	551,869.14
	T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	9,923,437.50
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,693,791.02
	T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,277,966.45
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,390,835.15
	T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,028,400.97
	T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,477,048.42
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	763,242.18
	T 4.75% 11/15/53	3,180,000.00	3,266,456.25
	T 4.875% 10/31/30	2,500,000.00	2,550,000.00
	T 4% 01/15/27	3,200,000.00	3,139,375.00
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,393,613.26
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,036,402.33
	T 4% 07/31/30	3,980,000.00	3,870,161.31
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,383,435.53
	T 4% 11/15/52	7,400,000.00	6,697,722.68
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	423,062.50
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,336,664.05
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,059,687.50
	T 5% 08/31/25	4,250,000.00	4,242,529.30
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,733,136.72
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,519,328.12
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,143,638.67
	アメリカドル 小計	1,160,890,000.00	1,020,242,550.50 (160,341,319,236)
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,128,230.38
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,866,770.32
	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	1,904,868.49
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,748,667.29
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,160,225.17
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	864,049.55
	CAN 1.5% 06/01/31	3,770,000.00	3,276,485.24
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,116,617.75
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	1,987,866.00
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	745,187.90
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,429,308.32
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,251,285.92
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	225,575.52
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,111,951.56
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,120,533.80

	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,546,943.04
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	917,434.42
	CAN 2.75% 12/01/55	1,420,000.00	1,225,124.48
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	529,037.34
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	384,572.14
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,349,071.83
	CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,679,391.12
	CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	2,031,823.40
	CAN 3.25% 12/01/33	1,310,000.00	1,271,267.64
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,148,709.52
	CAN 3.5% 08/01/25	920,000.00	909,294.90
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	951,656.06
	CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,311,288.31
	CAN 3% 06/01/34	1,850,000.00	1,754,953.61
	CAN 3% 10/01/25	3,290,000.00	3,228,339.70
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	777,668.67
	CAN 4.5% 02/01/26	300,000.00	300,866.45
	CAN 4.5% 11/01/25	1,330,000.00	1,331,310.52
	CAN 4% 03/01/29	2,400,000.00	2,432,812.28
	CAN 4% 05/01/26	2,250,000.00	2,241,240.47
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,636,402.40
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,882,660.85
	CAN 5% 06/01/37	630,000.00	720,453.54
	カナダドル 小計	65,620,000.00	60,499,945.90 (6,923,613,808)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	8,715,784.50
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	29,615,202.90
	MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,247,649.15
	MBONO 7.5% 05/26/33	24,150,000.00	20,903,757.00
	MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,395,048.80
	MBONO 7.75% 05/29/31	41,040,000.00	36,855,151.20
	MBONO 7.75% 11/13/42	31,010,000.00	25,465,567.05
	MBONO 7.75% 11/23/34	10,250,000.00	8,922,163.75
	MBONO 7% 09/03/26	9,290,000.00	8,671,750.50
	MBONO 8.5% 03/01/29	14,540,000.00	13,816,126.10
	MBONO 8.5% 05/31/29	30,830,000.00	29,216,357.80
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,294,714.80
	MBONO 8% 07/31/53	21,820,000.00	17,993,099.30
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,469,906.00
		メキシコペソ 小計	349,130,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,199,226.92
	BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	989,778.68

BGB 0.4% 06/22/40	660,000.00	419,925.00
BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	179,588.46
BGB 0.8% 06/22/25	2,000,000.00	1,944,758.00
BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,413,264.87
BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,470,918.40
BGB 0.9% 06/22/29	1,670,000.00	1,513,485.93
BGB 0% 10/22/27	900,000.00	814,247.10
BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,175,110.20
BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,133,430.34
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	652,240.05
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	651,400.00
BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	763,877.52
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	766,946.40
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	548,827.50
BGB 1% 06/22/26	1,840,000.00	1,761,540.56
BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,367,054.52
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	643,822.96
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	508,562.16
BGB 2.7% 10/22/29	180,000.00	177,916.86
BGB 2.75% 04/22/39	560,000.00	522,996.88
BGB 2.85% 10/22/34	680,000.00	663,530.40
BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	974,481.48
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	440,675.84
BGB 3.5% 06/22/55	530,000.00	523,435.95
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	972,190.38
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,444,281.20
BGB 3% 06/22/34	1,050,000.00	1,041,901.35
BGB 4.25% 03/28/41	1,750,000.00	1,945,328.00
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,166,200.84
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,155,016.80
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,225,378.88
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,114,460.10
BKO 2.5% 03/19/26	250,000.00	247,121.50
BKO 2.8% 06/12/25	1,490,000.00	1,481,219.43
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,356,322.56
BKO 3.1% 12/12/25	1,820,000.00	1,816,161.62
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,493,614.08
BTPS 0.45% 02/15/29	1,880,000.00	1,639,506.64
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,817,450.95
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,156,660.70
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,567,689.60
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,190,977.10
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,450,983.76

BTPS 0.95% 03/01/37	1,320,000.00	922,389.60	
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,890,180.56	
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,913,469.34	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,377,959.45	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,768,904.74	
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,102,452.80	
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,998,570.50	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,204,464.50	
BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	826,157.50	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,584,485.98	
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	1,997,208.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	904,531.36	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,254,878.60	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	788,150.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,360,823.95	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,041,622.20	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,430,000.00	2,108,826.90	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,260,221.54	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,350,000.00	816,577.20	
BTPS 1.8% 03/01/41	960,000.00	689,144.64	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,650,870.80	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,320,000.00	2,227,963.28	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,400,935.68	
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	418,327.81	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	674,199.60	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,203,553.88	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,377,510.75	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,600,000.00	2,339,170.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,380,000.00	995,490.60	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,637,253.02	
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,302,939.80	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,717,599.84	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	866,472.66	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	604,520.54	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,532,342.06	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,385,763.80	
BTPS 2.95% 02/15/27	330,000.00	325,924.50	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,110,000.00	975,288.18	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,153,020.64	
BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,150,628.32	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,249,560.24	
BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,698,570.60	

BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,953,557.46
BTPS 3.35% 03/01/35	1,890,000.00	1,799,671.23
BTPS 3.4% 04/01/28	2,000,000.00	2,000,152.00
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,607,414.90
BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	909,657.84
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,363,917.60
BTPS 3.7% 06/15/30	1,030,000.00	1,038,888.90
BTPS 3.8% 04/15/26	1,440,000.00	1,448,364.96
BTPS 3.8% 08/01/28	1,760,000.00	1,786,016.32
BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,377,851.58
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	867,584.34
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,911,909.00
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,126,353.70
BTPS 4.1% 02/01/29	440,000.00	452,644.28
BTPS 4.15% 10/01/39	460,000.00	459,208.80
BTPS 4.2% 03/01/34	1,920,000.00	1,977,196.80
BTPS 4.35% 11/01/33	1,800,000.00	1,878,004.80
BTPS 4.4% 05/01/33	1,060,000.00	1,112,638.54
BTPS 4.45% 09/01/43	1,560,000.00	1,597,377.60
BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,115,455.68
BTPS 4.5% 10/01/53	1,510,000.00	1,548,731.50
BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,768,588.11
BTPS 4.75% 09/01/44	1,600,000.00	1,706,496.00
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,085,319.30
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	889,764.48
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,282,558.75
BTPS 4% 11/15/30	1,800,000.00	1,844,496.00
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,934,632.16
BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,953,327.37
BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,616,888.24
BTPS 5% 08/01/34	3,170,000.00	3,475,557.88
BTPS 5% 09/01/40	2,260,000.00	2,473,443.44
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,971,221.48
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,311,271.32
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,523,997.30
DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,808,742.99
DBR 0.25% 02/15/29	1,370,000.00	1,226,895.96
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,890,658.93
DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,870,214.75
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,254,852.96
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	325,745.56
DBR 0% 02/15/30	970,000.00	838,269.15
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,401,103.90

DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,551,492.20	
DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,787,378.79	
DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,771,708.14	
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,736,288.20	
DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,579,391.50	
DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,007,948.10	
DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,265,244.60	
DBR 0% 08/15/31	3,990,000.00	3,328,805.13	
DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,279,319.44	
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,431,431.68	
DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,201,747.46	
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,769,943.81	
DBR 1.25% 08/15/48	3,490,000.00	2,581,762.40	
DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,960,540.80	
DBR 1.8% 08/15/53	3,050,000.00	2,491,487.05	
DBR 1% 05/15/38	2,080,000.00	1,666,007.20	
DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,363,726.61	
DBR 2.1% 11/15/29	3,430,000.00	3,337,379.02	
DBR 2.2% 02/15/34	1,830,000.00	1,766,575.86	
DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,531,566.20	
DBR 2.4% 11/15/30	1,390,000.00	1,372,697.97	
DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,807,063.06	
DBR 2.5% 08/15/46	2,920,000.00	2,795,718.96	
DBR 2.5% 08/15/54	1,330,000.00	1,270,981.25	
DBR 2.6% 08/15/33	1,790,000.00	1,791,578.78	
DBR 3.25% 07/04/42	2,030,000.00	2,165,116.80	
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	2,922,372.70	
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,141,573.90	
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,541,761.65	
DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,528,448.45	
DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,487,163.14	
DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,634,398.46	
DBR 5.625% 01/04/28	2,810,000.00	3,082,322.72	
DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,481,709.37	
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	2,977,345.80	
FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	4,000,034.61	
FRTR 0.5% 05/25/25	3,950,000.00	3,836,546.50	
FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,271,193.00	
FRTR 0.5% 05/25/29	5,040,000.00	4,473,947.52	
FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,756,836.31	
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	479,592.64	
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,188,952.73	

FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	4,791,940.40
FRTR 0.75% 05/25/28	5,410,000.00	4,961,841.01
FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,538,719.56
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,554,701.60
FRTR 0.75% 11/25/28	3,850,000.00	3,496,390.97
FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,801,906.96
FRTR 0% 02/25/27	4,000,000.00	3,680,736.00
FRTR 0% 05/25/32	3,780,000.00	2,988,502.02
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,111,532.30
FRTR 0% 11/25/30	5,810,000.00	4,812,632.16
FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	3,928,386.39
FRTR 1.25% 05/25/34	4,460,000.00	3,762,589.80
FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,598,643.80
FRTR 1.25% 05/25/38	2,740,000.00	2,120,044.86
FRTR 1.5% 05/25/31	6,080,000.00	5,533,401.92
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	2,044,482.10
FRTR 1.75% 05/25/66	1,680,000.00	1,089,694.14
FRTR 1.75% 06/25/39	3,250,000.00	2,666,079.00
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,683,270.76
FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,515,236.20
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,436,607.79
FRTR 2.5% 05/25/43	1,440,000.00	1,257,857.28
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,094,334.98
FRTR 2.75% 02/25/29	4,370,000.00	4,327,265.77
FRTR 2.75% 10/25/27	4,730,000.00	4,687,888.81
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,197,618.28
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,682,645.00
FRTR 3.25% 05/25/45	2,860,000.00	2,794,403.04
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,757,093.44
FRTR 3.5% 11/25/33	3,100,000.00	3,206,565.60
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,196,018.59
FRTR 3% 05/25/54	2,380,000.00	2,161,380.34
FRTR 3% 06/25/49	770,000.00	715,255.31
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	3,952,188.48
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,798,760.52
FRTR 4% 04/25/55	2,540,000.00	2,781,122.96
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	1,967,209.72
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,316,329.58
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,594,690.56
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,238,152.94
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	1,968,215.70
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	618,437.47
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	661,609.03

IRISH 0.35% 10/18/32	380,000.00	309,368.64
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	524,206.80
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	238,479.12
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	714,118.02
IRISH 0% 10/18/31	1,070,000.00	869,200.59
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	901,320.70
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	376,551.00
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	427,566.63
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	564,316.00
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	631,997.00
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	960,521.00
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	906,963.90
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	193,318.16
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	809,952.36
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	361,871.10
NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,845,576.26
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	835,218.72
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,022,981.82
NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,658,508.94
NETHER 0.5% 07/15/32	1,150,000.00	957,991.82
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	842,238.00
NETHER 0.75% 07/15/28	1,610,000.00	1,479,659.23
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,131,075.96
NETHER 0% 01/15/27	1,730,000.00	1,600,544.10
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,413,324.01
NETHER 0% 01/15/38	1,170,000.00	784,007.64
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	806,500.44
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,139,400.00
NETHER 0% 07/15/31	1,370,000.00	1,125,472.35
NETHER 2.5% 01/15/30	1,000,000.00	982,966.69
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,511,725.85
NETHER 2.5% 07/15/33	1,320,000.00	1,282,663.24
NETHER 2.5% 07/15/34	500,000.00	482,906.50
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,788,884.80
NETHER 2% 01/15/54	1,120,000.00	920,803.07
NETHER 3.25% 01/15/44	680,000.00	708,155.40
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,878,755.00
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,839,392.88
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,664,906.22
OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,901,199.12
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,350,980.15
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,501,214.52

OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,829,866.66
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,383,913.25
OBL 2.1% 04/12/29	1,480,000.00	1,441,451.92
OBL 2.2% 04/13/28	2,950,000.00	2,892,386.50
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,216,454.20
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	506,815.92
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,258,330.53
RAGB 0.5% 04/20/27	1,490,000.00	1,387,261.52
RAGB 0.7% 04/20/71	350,000.00	151,882.15
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	812,079.84
RAGB 0.75% 03/20/51	780,000.00	440,496.42
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,401,866.36
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	101,899.89
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,052,685.66
RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,251,656.72
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,370,255.04
RAGB 0% 10/20/28	880,000.00	774,043.60
RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	344,302.01
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,155,868.42
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	779,714.02
RAGB 1.5% 11/02/86	310,000.00	180,792.00
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	504,197.21
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	476,333.00
RAGB 2.4% 05/23/34	930,000.00	876,292.50
RAGB 2.9% 02/20/33	1,500,000.00	1,483,719.00
RAGB 2.9% 02/20/34	720,000.00	709,199.28
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	219,684.08
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	688,731.40
RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	429,655.60
RAGB 3.45% 10/20/30	230,000.00	236,259.68
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	469,102.57
RAGB 4.15% 03/15/37	1,460,000.00	1,607,278.66
RAGB 4.85% 03/15/26	1,170,000.00	1,203,618.78
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,291,528.64
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	309,359.60
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	206,941.85
RFGB 0.125% 09/15/31	630,000.00	513,463.86
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	187,885.35
RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	542,421.12
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	302,449.40
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	497,946.96
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	658,025.65
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	466,846.52

RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	440,469.66	
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	426,585.72	
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	428,476.20	
RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	598,736.16	
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	535,292.47	
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	333,903.08	
RFGB 1.375% 04/15/47	610,000.00	431,384.07	
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	507,188.79	
RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	430,899.76	
RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	378,728.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	545,438.85	
RFGB 2.875% 04/15/29	240,000.00	238,870.99	
RFGB 2.95% 04/15/55	230,000.00	217,899.70	
RFGB 3% 09/15/33	580,000.00	577,541.96	
RFGB 4% 07/04/25	640,000.00	644,156.16	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,790,489.80	
SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,766,862.71	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,123,349.42	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,970,000.00	1,728,966.56	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,821,171.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,269,351.28	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,452,279.50	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,048,075.60	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,519,036.81	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,674,362.75	
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,724,680.90	
SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,954,625.84	
SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,466,777.05	
SPGB 1.25% 10/31/30	2,980,000.00	2,659,647.02	
SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	1,979,572.05	
SPGB 1.4% 04/30/28	2,450,000.00	2,298,467.50	
SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,916,774.60	
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,493,038.20	
SPGB 1.45% 10/31/27	2,280,000.00	2,157,712.20	
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	320,397.00	
SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,431,300.00	
SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,424,951.97	
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,873,597.56	
SPGB 1.9% 10/31/52	1,810,000.00	1,203,215.60	
SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,243,415.40	
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,892,277.42	
SPGB 1% 07/30/42	1,180,000.00	762,178.52	

	SPGB 1% 10/31/50	2,000,000.00	1,076,600.00	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,544,489.07	
	SPGB 2.35% 07/30/33	2,190,000.00	2,029,974.51	
	SPGB 2.55% 10/31/32	2,530,000.00	2,403,813.72	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,410,794.46	
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,670,000.00	1,653,889.51	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,850,000.00	1,604,209.00	
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,990,000.00	1,970,428.35	
	SPGB 3.25% 04/30/34	2,150,000.00	2,129,472.87	
	SPGB 3.45% 07/30/43	1,190,000.00	1,135,736.00	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,530,000.00	1,379,685.15	
	SPGB 3.5% 05/31/29	660,000.00	672,144.00	
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,311,143.75	
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,330,000.00	1,364,997.62	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,800,000.00	1,927,679.40	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,879,777.04	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,116,725.84	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,981,472.80	
	SPGB 4% 10/31/54	650,000.00	656,179.55	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,710,000.00	4,023,665.66	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,695,559.52	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,659,308.75	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,435,430.91	
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,025,228.75	
	ユーロ 小計	685,160,000.00	632,180,881.69 (107,420,175,416)	
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,171,969.34	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,300,034.50	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	2,063,282.89	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,980,000.00	2,703,724.20	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,930,000.00	1,527,962.47	
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,842,361.60	
	UKT 0.5% 10/22/61	2,150,000.00	628,173.23	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,341,322.64	
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,518,525.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,450,000.00	571,590.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	746,640.00	
	UKT 0.875% 07/31/33	3,400,000.00	2,539,895.20	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,410,000.00	1,190,619.22	
	UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,310,348.52	
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	374,115.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,138,275.00	
UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,157,794.30		

UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,225,511.00	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,503,504.64	
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	941,978.16	
UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	568,965.79	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	961,802.02	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	685,514.52	
UKT 1.625% 10/22/71	1,550,000.00	697,663.06	
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	621,507.60	
UKT 1.75% 07/22/57	1,740,000.00	903,408.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,385,559.00	
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	2,937,859.20	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	882,530.00	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,297,218.84	
UKT 3.25% 01/22/44	2,010,000.00	1,648,341.10	
UKT 3.25% 01/31/33	3,960,000.00	3,686,919.19	
UKT 3.5% 01/22/45	1,820,000.00	1,539,174.00	
UKT 3.5% 07/22/68	1,470,000.00	1,180,704.00	
UKT 3.5% 10/22/25	2,350,000.00	2,305,777.70	
UKT 3.75% 01/29/38	1,930,000.00	1,789,303.00	
UKT 3.75% 03/07/27	650,000.00	636,558.00	
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	984,227.50	
UKT 3.75% 10/22/53	2,910,000.00	2,475,734.88	
UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,305,598.00	
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,870,340.97	
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,330,523.04	
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,230,249.00	
UKT 4.25% 12/07/27	1,800,000.00	1,797,426.71	
UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,395,447.52	
UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,664,508.00	
UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,504,981.31	
UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,581,850.00	
UKT 4.375% 07/31/54	430,000.00	407,640.00	
UKT 4.5% 06/07/28	2,690,000.00	2,707,719.03	
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,413,683.37	
UKT 4.5% 12/07/42	2,440,000.00	2,403,156.00	
UKT 4.625% 01/31/34	1,780,000.00	1,830,811.88	
UKT 4.75% 10/22/43	1,030,000.00	1,042,027.09	
UKT 4.75% 12/07/30	1,710,000.00	1,770,260.40	
UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,437,464.84	
UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,115,020.75	
UKT 4% 10/22/63	1,190,000.00	1,057,077.00	
UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,159,946.00	

イギリスポンド 小計		107,290,000.00	88,012,125.22 (17,561,059,345)
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,822,098.39
	SGB 0.75% 05/12/28	6,780,000.00	6,330,271.07
	SGB 0.75% 11/12/29	6,440,000.00	5,895,285.92
	SGB 1.75% 11/11/33	4,360,000.00	4,117,586.73
	SGB 1% 11/12/26	7,580,000.00	7,266,327.24
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,441,676.22
	SGB 2.5% 05/12/25	7,560,000.00	7,507,279.43
	SGB 3.5% 03/30/39	3,970,000.00	4,443,224.00
スウェーデンクローナ 小計		46,670,000.00	44,823,749.00 (656,219,685)
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,039,291.20
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,545,200.40
	NGB 1.5% 02/19/26	4,520,000.00	4,340,646.40
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,391,166.08
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,730,047.98
	NGB 2.125% 05/18/32	3,730,000.00	3,321,938.00
	NGB 2% 04/26/28	4,650,000.00	4,369,465.50
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,834,917.90
	NGB 3.625% 04/13/34	2,470,000.00	2,448,415.26
	NGB 3% 08/15/33	4,630,000.00	4,371,698.31
ノルウェークローネ 小計		40,570,000.00	37,392,787.03 (550,795,752)
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,570,000.00	2,894,502.06
	DGB 0.5% 11/15/27	4,430,000.00	4,110,184.56
	DGB 0.5% 11/15/29	5,570,000.00	4,990,924.97
	DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,429,247.70
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,434,964.43
	DGB 2.25% 11/15/33	3,680,000.00	3,574,644.53
	DGB 4.5% 11/15/39	9,470,000.00	11,515,863.76
デンマーククローネ 小計		41,820,000.00	38,950,332.01 (886,899,059)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	2,005,571.46
	POLGB 0% 10/25/25	940,000.00	874,540.18
	POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,006,802.50
	POLGB 1.75% 04/25/32	3,560,000.00	2,682,552.56
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,620,886.20
	POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,071,192.49
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,270,000.00	2,966,073.12
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,224,962.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,480,000.00	4,382,922.88
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,110,000.00	2,016,980.65

	POLGB 5.75% 04/25/29	4,320,000.00	4,349,657.66	
	POLGB 6% 10/25/33	4,350,000.00	4,431,553.80	
	POLGB 7.5% 07/25/28	3,610,000.00	3,866,060.91	
	ポーランドズロチ 小計	49,230,000.00	45,499,756.41 (1,812,901,394)	
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,984,342.01	
	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,208,096.01	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,770,000.00	2,223,737.69	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	2,018,655.91	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	1,038,882.85	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,000,000.00	1,652,050.34	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,221,886.28	
	ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,410,052.32	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,389,120.25	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,151,628.36	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,050,885.56	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,470,000.00	1,271,398.52	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,471,732.21	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,579,920.98	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,780,000.00	1,672,433.69	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,810,000.00	1,753,434.89	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	817,092.97	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,690,000.00	1,579,425.96	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,220,000.00	1,147,013.04	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,980,000.00	1,899,357.21	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,043,760.01	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,663,287.72	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,770,000.00	1,778,150.49	
ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,073,149.19		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,010,000.00	2,054,744.61		
ACGB 4.75% 06/21/54	720,000.00	737,806.60		
	オーストラリアドル 小計	47,940,000.00	42,892,045.67 (4,450,478,658)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	990,000.00	835,090.22	
	NZGB 0.5% 05/15/26	730,000.00	671,210.12	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	815,615.70	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	291,223.71	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	503,117.74	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	402,501.32	
	NZGB 2% 05/15/32	700,000.00	576,463.80	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,320,000.00	1,206,020.85	
	NZGB 3% 04/20/29	830,000.00	773,499.53	

	NZGB 4.25% 05/15/34	450,000.00	432,782.46
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	836,132.92
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	487,993.77
	NZGB 4.5% 05/15/35	440,000.00	429,542.63
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	379,007.09
ニュージーランドドル 小計		9,860,000.00	8,640,201.86 (827,385,730)
シンガポールドドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	757,373.00
	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	826,413.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	501,592.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	730,000.00	555,530.00
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	315,548.10
	SIGB 2.125% 06/01/26	830,000.00	809,291.50
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	684,000.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	889,560.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	380,000.00	340,025.90
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	703,296.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	460,000.00	438,748.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	756,958.40
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	586,845.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	637,975.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	414,792.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	710,000.00	694,025.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	837,055.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	742,960.00
	SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	148,424.25
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	459,620.00
シンガポールドドル 小計		12,860,000.00	12,100,032.15 (1,406,628,737)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,530,250.60
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,506,651.75
	MGS 3.519% 04/20/28	710,000.00	706,399.19
	MGS 3.582% 07/15/32	1,310,000.00	1,282,684.50
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,935,602.74
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,272,515.43
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,760,559.26
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,873,207.31
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,178,236.66
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,139,520.58
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,988,257.36
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,492,112.92
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	604,847.04
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,701,988.86

	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,990,215.51	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,548,156.93	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,796,503.45	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,562,814.04	
	MGS 4.457% 03/31/53	1,090,000.00	1,130,961.11	
	MGS 4.498% 04/15/30	3,070,000.00	3,184,839.18	
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	362,600.31	
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	920,973.82	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,970,000.00	2,119,841.93	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,059,134.02	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,986,728.30	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,010,731.76	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,859,962.94	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,139,110.37	
	マレーシアリングット 小計	49,630,000.00	50,645,407.87 (1,686,714,921)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,412,583.25	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,340,312.30	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	2,510,000.00	1,943,857.45	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,630,000.00	1,757,465.14	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,342,527.66	
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	2,884,611.86	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,462,342.76	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	1,420,000.00	903,473.00	
	ILGOV 2% 03/31/27	2,030,000.00	1,900,873.93	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,040,000.00	1,970,164.88	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,065,514.39	
	ILGOV 4% 03/30/35	760,000.00	702,720.47	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	1,962,761.17	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,396,917.84	
	イスラエルシェケル 小計	30,790,000.00	27,046,126.10 (1,154,434,141)	
オフショア 人民元	CGB 2.18% 08/15/26	28,600,000.00	28,749,023.16	
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,180,635.05	
	CGB 2.22% 09/25/25	27,270,000.00	27,421,220.33	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,433,480.12	
	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,513,156.49	
	CGB 2.33% 12/15/25	35,250,000.00	35,532,592.20	
	CGB 2.37% 01/15/29	19,460,000.00	19,669,247.54	
	CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,333,552.45	
	CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	43,193,296.12	
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	43,023,035.77	
	CGB 2.44% 10/15/27	17,700,000.00	17,928,590.19	

CGB 2.46% 02/15/26	29,300,000.00	29,588,417.48	
CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,283,114.00	
CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,853,981.70	
CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,149,109.13	
CGB 2.52% 08/25/33	58,370,000.00	59,186,748.06	
CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	30,964,112.40	
CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	27,729,540.05	
CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	32,657,462.88	
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	31,056,908.65	
CGB 2.62% 04/15/28	23,550,000.00	23,980,654.14	
CGB 2.62% 06/25/30	36,400,000.00	37,139,640.72	
CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,383,557.36	
CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	38,919,716.47	
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	35,204,668.72	
CGB 2.67% 11/25/33	13,600,000.00	13,998,567.04	
CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	34,313,317.80	
CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,459,974.45	
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	19,916,810.20	
CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,942,493.60	
CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	26,198,323.76	
CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	11,023,371.12	
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,223,707.62	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,774,911.10	
CGB 2.8% 03/25/30	42,000,000.00	43,284,767.40	
CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,760,189.94	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,826,447.01	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,779,864.67	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	25,181,823.29	
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	30,176,798.40	
CGB 2% 06/15/25	43,900,000.00	44,018,995.34	
CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	13,049,027.62	
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,768,320.51	
CGB 3.02% 10/22/25	53,270,000.00	54,230,175.76	
CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,215,329.60	
CGB 3.12% 10/25/52	8,970,000.00	9,808,097.59	
CGB 3.19% 04/15/53	18,160,000.00	20,348,828.43	
CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,312,229.09	
CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,764,375.23	
CGB 3.32% 04/15/52	13,750,000.00	15,579,067.62	
CGB 3.39% 03/16/50	20,930,000.00	23,913,175.92	
CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,772,779.88	
CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	16,304,651.36	

	CGB 3.81% 09/14/50	19,620,000.00	23,903,773.90	
	CGB 3.86% 07/22/49	17,280,000.00	21,101,624.06	
	CGB 3% 10/15/53	9,330,000.00	10,143,109.50	
	CGB 4.08% 10/22/48	15,720,000.00	19,785,984.28	
	オフショア人民元 小計	1,449,280,000.00	1,498,956,374.27 (32,447,608,842)	
	合計		341,064,820,727 (341,064,820,727)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 211銘柄	100.0%	47.0%
カナダドル	国債証券 38銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 366銘柄	100.0%	31.5%
イギリスポンド	国債証券 59銘柄	100.0%	5.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 57銘柄	100.0%	9.5%

(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。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	354,246,151

	2024年 5月24日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	694,086,998
国債証券	79,646,783,282
派生商品評価勘定	928,936
未収利息	545,379,091
前払金	1,653,326
前払費用	91,292,581
差入委託証拠金	27,497,748
流動資産合計	81,361,868,113
資産合計	81,361,868,113
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	726,164,536
未払金	1,485,283
未払解約金	175,189
流動負債合計	727,825,008
負債合計	727,825,008
純資産の部	
元本等	
元本	98,796,580,345
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,162,537,240
元本等合計	80,634,043,105
純資産合計	80,634,043,105
負債純資産合計	81,361,868,113

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5月24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 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		98,796,580,345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	18,162,537,240円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8162円 (8,162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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い債券先物取引及び為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	78,562,074,860円
期中追加設定元本額	24,773,047,981円

区分	2024年 5月24日現在
期中一部解約元本額	4,538,542,496円
期末元本額	98,796,580,345円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	21,453,874,695円
分散投資コア戦略ファンドS	31,713,603,424円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	1,478,894,049円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	682,078,427円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	150,800,819円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	39,606,697円
10資産分散投資ファンド	744,832,819円
グローバル10資産バランスファンド	103,916,547円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	13,043,030,966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）	2,629,545,499円
私募外国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	2,739,729,910円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,683,268,554円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,717,172,469円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,701,167,704円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,596,187,558円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,560,533,952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）	3,390,905,856円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,367,430,400円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	565,135,215	
合計	565,135,215	

(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（為替ヘッジあり）」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引	522,754,308	-	521,100,982	1,653,326
	買建				
合計		522,754,308	-	521,100,982	1,653,326

(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はありません。

通貨関連

（2024年 5月24日現在）

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

市場取引以外の取引	売建	79,341,927,802	-	80,065,510,076	723,582,274
	アメリカドル	37,236,069,677	-	37,416,652,784	180,583,107
	カナダドル	1,611,114,736	-	1,613,964,353	2,849,617
	メキシコペソ	682,041,017	-	699,808,032	17,767,015
	ユーロ	25,025,133,372	-	25,388,400,230	363,266,858
	イギリスポンド	4,035,476,451	-	4,106,240,859	70,764,408
	スウェーデンクローナ	151,582,344	-	155,514,518	3,932,174
	ノルウェークローネ	125,433,719	-	130,240,413	4,806,694
	デンマーククローネ	208,010,645	-	210,828,102	2,817,457
	ポーランドズロチ	418,089,898	-	429,592,299	11,502,401
	オーストラリアドル	1,021,492,919	-	1,037,580,476	16,087,557
	ニュージーランドドル	188,663,136	-	194,591,718	5,928,582
	シンガポールドル	327,021,884	-	330,614,352	3,592,468
	マレーシアリングギット	391,560,152	-	397,281,328	5,721,176
	イスラエルシケル	271,590,516	-	277,404,770	5,814,254
オフショア人民元	7,648,647,336	-	7,676,795,842	28,148,506	
合計	79,341,927,802	-	80,065,510,076	723,582,274	

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	1,000,000.00	951,258.14	
		T 0.25% 06/30/25	1,940,000.00	1,839,286.72	
		T 0.25% 07/31/25	600,000.00	566,625.00	
		T 0.25% 08/31/25	2,550,000.00	2,398,643.54	
		T 0.25% 09/30/25	1,250,000.00	1,171,630.86	
		T 0.25% 10/31/25	1,240,000.00	1,158,067.96	
		T 0.375% 01/31/26	1,550,000.00	1,434,688.47	
		T 0.375% 04/30/25	1,550,000.00	1,482,345.78	
		T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	873,632.81	

T 0.375% 09/30/27	1,020,000.00	885,885.93	
T 0.375% 11/30/25	800,000.00	745,781.24	
T 0.375% 12/31/25	1,700,000.00	1,579,207.02	
T 0.5% 02/28/26	650,000.00	601,097.65	
T 0.5% 04/30/27	1,900,000.00	1,682,761.71	
T 0.5% 05/31/27	1,350,000.00	1,191,849.60	
T 0.5% 06/30/27	320,000.00	281,756.24	
T 0.5% 08/31/27	1,150,000.00	1,006,070.31	
T 0.5% 10/31/27	1,200,000.00	1,043,460.93	
T 0.625% 03/31/27	2,260,000.00	2,016,343.75	
T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,293,342.19	
T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	912,968.75	
T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,598,009.37	
T 0.625% 11/30/27	1,670,000.00	1,454,302.53	
T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,189,384.76	
T 0.75% 01/31/28	1,970,000.00	1,713,361.32	
T 0.75% 03/31/26	2,200,000.00	2,038,179.68	
T 0.75% 04/30/26	2,150,000.00	1,985,726.56	
T 0.75% 05/31/26	1,200,000.00	1,104,937.50	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,871,305.66	
T 0.875% 06/30/26	1,000,000.00	920,898.44	
T 0.875% 11/15/30	2,630,000.00	2,101,688.46	
T 1.125% 02/15/31	3,190,000.00	2,578,230.28	
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	725,906.24	
T 1.125% 02/29/28	740,000.00	651,373.44	
T 1.125% 05/15/40	1,040,000.00	632,450.00	
T 1.125% 08/15/40	830,000.00	499,669.72	
T 1.125% 08/31/28	2,450,000.00	2,124,752.91	
T 1.125% 10/31/26	2,290,000.00	2,097,720.51	
T 1.25% 03/31/28	2,120,000.00	1,870,485.94	
T 1.25% 04/30/28	5,040,000.00	4,436,775.00	
T 1.25% 05/15/50	650,000.00	319,134.76	
T 1.25% 05/31/28	960,000.00	843,056.24	
T 1.25% 06/30/28	1,950,000.00	1,708,573.24	
T 1.25% 08/15/31	1,660,000.00	1,331,566.41	
T 1.25% 09/30/28	1,840,000.00	1,600,512.50	
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,466,687.50	
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,189,119.13	
T 1.375% 08/15/50	1,780,000.00	902,724.22	
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	407,446.87	
T 1.375% 10/31/28	1,650,000.00	1,440,301.76	
T 1.375% 11/15/31	2,620,000.00	2,106,234.37	

T 1.375% 11/15/40	1,390,000.00	868,912.89
T 1.375% 12/31/28	1,500,000.00	1,303,564.45
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	551,050.78
T 1.5% 02/15/30	1,770,000.00	1,503,255.47
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,747,628.89
T 1.5% 11/30/28	1,930,000.00	1,690,898.63
T 1.625% 02/15/26	1,200,000.00	1,133,625.00
T 1.625% 05/15/26	2,020,000.00	1,895,722.65
T 1.625% 05/15/31	2,010,000.00	1,668,888.86
T 1.625% 08/15/29	870,000.00	754,589.06
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	306,835.54
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	241,170.31
T 1.625% 11/15/50	1,320,000.00	716,177.33
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	370,218.75
T 1.75% 01/31/29	1,800,000.00	1,589,238.28
T 1.75% 08/15/41	1,630,000.00	1,068,350.39
T 1.75% 11/15/29	1,050,000.00	913,171.87
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	834,292.97
T 1.875% 02/15/32	2,260,000.00	1,876,903.51
T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,029,859.37
T 1.875% 02/15/51	2,190,000.00	1,267,548.04
T 1.875% 02/28/27	700,000.00	648,292.96
T 1.875% 02/28/29	2,400,000.00	2,128,031.25
T 1.875% 06/30/26	100,000.00	94,048.82
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	215,858.59
T 1.875% 11/15/51	690,000.00	396,844.33
T 1% 07/31/28	980,000.00	847,508.59
T 2.125% 05/15/25	280,000.00	271,875.36
T 2.125% 05/31/26	420,000.00	397,785.93
T 2.25% 02/15/27	1,120,000.00	1,049,212.50
T 2.25% 02/15/52	1,300,000.00	821,132.80
T 2.25% 03/31/26	220,000.00	209,588.67
T 2.25% 05/15/41	1,270,000.00	911,646.67
T 2.25% 08/15/27	1,150,000.00	1,067,029.29
T 2.25% 08/15/46	630,000.00	417,301.17
T 2.25% 08/15/49	1,010,000.00	648,491.01
T 2.25% 11/15/25	830,000.00	797,010.74
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	591,012.49
T 2.375% 02/15/42	1,520,000.00	1,097,903.12
T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,205,468.36
T 2.375% 04/30/26	310,000.00	295,492.96
T 2.375% 05/15/27	340,000.00	318,178.90
T 2.375% 05/15/29	790,000.00	714,733.98

T 2.375% 05/15/51	2,550,000.00	1,666,365.22	
T 2.375% 11/15/49	810,000.00	534,204.49	
T 2.5% 02/15/45	450,000.00	318,744.13	
T 2.5% 02/15/46	800,000.00	560,531.24	
T 2.5% 02/28/26	1,500,000.00	1,437,421.87	
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	300,370.11	
T 2.625% 01/31/26	290,000.00	278,864.45	
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,056,472.66	
T 2.625% 05/31/27	1,210,000.00	1,139,668.75	
T 2.625% 12/31/25	250,000.00	240,791.01	
T 2.75% 02/15/28	2,000,000.00	1,872,148.44	
T 2.75% 05/31/29	910,000.00	837,662.10	
T 2.75% 06/30/25	190,000.00	185,157.22	
T 2.75% 08/15/32	1,700,000.00	1,497,328.12	
T 2.75% 08/15/42	360,000.00	274,514.06	
T 2.75% 08/15/47	1,140,000.00	825,653.89	
T 2.75% 08/31/25	2,730,000.00	2,650,872.64	
T 2.75% 11/15/42	990,000.00	752,400.00	
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	614,357.42	
T 2.875% 04/30/25	880,000.00	861,321.81	
T 2.875% 05/15/28	4,230,000.00	3,966,120.71	
T 2.875% 05/15/32	2,730,000.00	2,435,618.55	
T 2.875% 05/15/43	1,280,000.00	986,899.99	
T 2.875% 05/15/49	1,030,000.00	756,003.91	
T 2.875% 05/15/52	860,000.00	625,784.37	
T 2.875% 05/31/25	1,460,000.00	1,426,307.81	
T 2.875% 07/31/25	500,000.00	487,148.44	
T 2.875% 08/15/28	2,090,000.00	1,953,660.14	
T 2.875% 08/15/45	150,000.00	113,162.10	
T 2.875% 11/15/46	550,000.00	410,480.46	
T 2.875% 11/30/25	540,000.00	522,871.87	
T 2% 02/15/50	1,170,000.00	705,084.96	
T 2% 08/15/25	650,000.00	626,031.25	
T 2% 08/15/51	1,580,000.00	940,316.01	
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,543,265.62	
T 2% 11/15/41	1,650,000.00	1,123,933.60	
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	146,453.90	
T 3.125% 02/15/43	630,000.00	506,583.98	
T 3.125% 05/15/48	760,000.00	587,545.31	
T 3.125% 08/15/25	3,700,000.00	3,612,414.04	
T 3.125% 08/15/44	470,000.00	373,172.65	
T 3.125% 08/31/27	1,020,000.00	972,466.40	

T 3.125% 08/31/29	620,000.00	579,494.14
T 3.125% 11/15/28	2,350,000.00	2,213,498.04
T 3.125% 11/15/41	230,000.00	187,908.20
T 3.25% 05/15/42	780,000.00	644,063.67
T 3.25% 06/30/27	1,300,000.00	1,246,476.55
T 3.25% 06/30/29	530,000.00	499,121.28
T 3.375% 05/15/33	4,010,000.00	3,682,542.75
T 3.375% 05/15/44	410,000.00	339,186.91
T 3.375% 08/15/42	730,000.00	612,244.72
T 3.375% 11/15/48	910,000.00	734,789.45
T 3.5% 01/31/28	640,000.00	615,724.99
T 3.5% 01/31/30	900,000.00	854,156.25
T 3.5% 02/15/33	3,800,000.00	3,529,546.85
T 3.5% 02/15/39	350,000.00	312,874.01
T 3.625% 02/15/44	990,000.00	851,902.72
T 3.625% 02/15/53	1,590,000.00	1,343,115.22
T 3.625% 03/31/28	1,000,000.00	965,429.69
T 3.625% 05/15/26	2,640,000.00	2,575,804.67
T 3.625% 05/15/53	650,000.00	549,046.87
T 3.625% 08/15/43	1,300,000.00	1,122,316.40
T 3.75% 04/15/26	1,900,000.00	1,859,216.80
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	232,882.81
T 3.75% 11/15/43	1,430,000.00	1,255,495.31
T 3.875% 01/15/26	1,000,000.00	981,953.12
T 3.875% 02/15/43	920,000.00	825,861.71
T 3.875% 05/15/43	250,000.00	224,121.09
T 3.875% 08/15/33	3,150,000.00	3,004,312.50
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	358,358.20
T 3.875% 09/30/29	1,400,000.00	1,356,687.50
T 3.875% 11/30/29	1,500,000.00	1,452,656.25
T 3.875% 12/31/27	1,500,000.00	1,462,441.41
T 3.875% 12/31/29	1,000,000.00	968,007.81
T 3% 02/15/47	730,000.00	556,311.32
T 3% 02/15/48	200,000.00	151,296.87
T 3% 02/15/49	1,560,000.00	1,174,631.24
T 3% 05/15/42	370,000.00	294,352.34
T 3% 05/15/45	330,000.00	254,886.32
T 3% 05/15/47	180,000.00	136,919.53
T 3% 07/15/25	2,000,000.00	1,952,812.50
T 3% 08/15/48	800,000.00	603,406.24
T 3% 08/15/52	1,500,000.00	1,120,107.42
T 3% 09/30/25	1,340,000.00	1,303,935.15
T 3% 10/31/25	270,000.00	262,358.78

T 3% 11/15/44	1,180,000.00	915,191.40	
T 3% 11/15/45	320,000.00	246,450.00	
T 4.125% 08/15/53	1,460,000.00	1,350,243.36	
T 4.125% 08/31/30	1,910,000.00	1,869,449.79	
T 4.125% 10/31/27	2,800,000.00	2,752,914.05	
T 4.125% 11/15/32	1,500,000.00	1,461,474.61	
T 4.25% 01/31/26	1,000,000.00	987,675.78	
T 4.25% 02/15/54	1,630,000.00	1,541,241.41	
T 4.25% 05/15/39	150,000.00	145,570.31	
T 4.25% 10/15/25	3,300,000.00	3,262,617.20	
T 4.25% 11/15/40	200,000.00	191,984.37	
T 4.375% 02/15/38	210,000.00	208,326.56	
T 4.375% 05/15/40	300,000.00	293,472.65	
T 4.375% 05/15/41	150,000.00	145,839.84	
T 4.375% 08/15/26	2,890,000.00	2,859,914.63	
T 4.375% 11/15/39	350,000.00	343,341.79	
T 4.375% 11/30/30	2,510,000.00	2,490,782.80	
T 4.5% 02/15/36	110,000.00	111,486.71	
T 4.5% 05/15/38	110,000.00	110,373.82	
T 4.5% 07/15/26	860,000.00	853,415.62	
T 4.5% 08/15/39	350,000.00	348,721.68	
T 4.5% 11/15/33	1,850,000.00	1,851,589.85	
T 4.625% 02/15/40	380,000.00	382,983.59	
T 4.625% 11/15/26	3,400,000.00	3,385,722.65	
T 4.75% 02/15/41	150,000.00	152,648.43	
T 4.75% 11/15/53	1,480,000.00	1,520,237.50	
T 4.875% 10/31/30	2,900,000.00	2,958,000.00	
T 4% 01/15/27	1,150,000.00	1,128,212.89	
T 4% 02/28/30	1,950,000.00	1,898,545.89	
T 4% 11/15/42	240,000.00	219,623.43	
T 4% 11/15/52	1,000,000.00	905,097.66	
T 5.0% 05/15/37	120,000.00	126,918.75	
T 5.25% 11/15/28	440,000.00	452,409.37	
T 5.375% 02/15/31	60,000.00	63,375.00	
T 5% 08/31/25	2,750,000.00	2,745,166.01	
T 6.0% 02/15/26	420,000.00	428,186.71	
T 6.25% 05/15/30	990,000.00	1,078,287.89	
アメリカドル 小計	270,300,000.00	238,269,496.75 (37,446,434,109)	
カナダドル			
CAN 0.25% 03/01/26	330,000.00	308,033.34	
CAN 0.5% 09/01/25	1,050,000.00	1,000,036.15	
CAN 0.5% 12/01/30	500,000.00	410,532.00	

	CAN 1.25% 03/01/27	230,000.00	213,932.69
	CAN 1.25% 06/01/30	690,000.00	602,363.35
	CAN 1.5% 06/01/26	170,000.00	161,415.85
	CAN 1.5% 06/01/31	1,060,000.00	921,239.87
	CAN 1.5% 12/01/31	620,000.00	533,785.36
	CAN 1.75% 12/01/53	680,000.00	462,927.69
	CAN 1% 06/01/27	340,000.00	312,794.92
	CAN 1% 09/01/26	530,000.00	495,119.87
	CAN 2.25% 06/01/25	160,000.00	156,410.74
	CAN 2.25% 06/01/29	250,000.00	234,974.50
	CAN 2.5% 12/01/32	400,000.00	367,295.91
	CAN 2.75% 06/01/33	280,000.00	261,457.89
	CAN 2.75% 09/01/27	350,000.00	338,393.78
	CAN 2.75% 12/01/48	270,000.00	235,911.70
	CAN 2.75% 12/01/55	350,000.00	301,967.29
	CAN 2.75% 12/01/64	120,000.00	102,394.32
	CAN 2% 06/01/28	290,000.00	272,014.44
	CAN 2% 06/01/32	550,000.00	488,150.98
	CAN 2% 12/01/51	860,000.00	631,308.59
	CAN 3.25% 09/01/28	960,000.00	942,294.90
	CAN 3.25% 12/01/33	190,000.00	184,382.33
	CAN 3.5% 03/01/28	190,000.00	188,150.69
	CAN 3.5% 08/01/25	700,000.00	691,854.82
	CAN 3.5% 12/01/45	220,000.00	218,087.84
	CAN 3% 04/01/26	490,000.00	479,500.95
	CAN 3% 06/01/34	340,000.00	322,532.01
	CAN 3% 10/01/25	600,000.00	588,754.96
	CAN 4.0% 06/01/41	190,000.00	199,671.68
	CAN 4% 05/01/26	350,000.00	348,637.40
	CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	241,616.46
	CAN 5.75% 06/01/33	620,000.00	720,524.50
	CAN 5% 06/01/37	180,000.00	205,843.86
	カナダドル 小計	15,330,000.00	14,144,313.63 (1,618,675,251)
メキシコ ン	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,529,085.00
	MBONO 5.5% 03/04/27	8,220,000.00	7,319,211.30
	MBONO 5.75% 03/05/26	12,850,000.00	11,861,948.59
	MBONO 7.5% 05/26/33	6,190,000.00	5,357,940.20
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,800,000.00	7,276,464.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	8,050,000.00	7,229,141.50
	MBONO 7.75% 11/13/42	7,430,000.00	6,101,553.15
	MBONO 7.75% 11/23/34	3,170,000.00	2,759,342.35
	MBONO 8.5% 03/01/29	4,410,000.00	4,190,448.15

	MBONO 8.5% 05/31/29	5,740,000.00	5,439,568.40
	MBONO 8.5% 11/18/38	5,790,000.00	5,213,084.40
	MBONO 8% 07/31/53	4,640,000.00	3,826,213.60
	MBONO 8% 11/07/47	5,920,000.00	4,926,091.20
	メキシコペソ 小計	81,710,000.00	73,030,091.84 (686,555,893)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	340,000.00	287,138.84
	BGB 0.35% 06/22/32	440,000.00	356,969.36
	BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	127,250.00
	BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	61,223.34
	BGB 0.8% 06/22/25	430,000.00	418,122.97
	BGB 0.8% 06/22/27	540,000.00	505,405.98
	BGB 0.8% 06/22/28	390,000.00	358,536.36
	BGB 0.9% 06/22/29	400,000.00	362,511.60
	BGB 0% 10/22/27	190,000.00	171,896.61
	BGB 0% 10/22/31	260,000.00	209,266.20
	BGB 1.25% 04/22/33	140,000.00	121,129.96
	BGB 1.4% 06/22/53	210,000.00	130,448.01
	BGB 1.45% 06/22/37	190,000.00	154,707.50
	BGB 1.6% 06/22/47	260,000.00	183,896.44
	BGB 1.7% 06/22/50	250,000.00	174,306.00
	BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	177,313.50
	BGB 1% 06/22/26	330,000.00	315,928.47
	BGB 1% 06/22/31	440,000.00	385,579.48
	BGB 2.15% 06/22/66	180,000.00	131,691.06
	BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	121,447.68
	BGB 2.75% 04/22/39	120,000.00	112,070.76
	BGB 3.3% 06/22/54	230,000.00	219,736.02
	BGB 3.45% 06/22/43	100,000.00	100,153.60
	BGB 3.5% 06/22/55	150,000.00	148,142.25
	BGB 3.75% 06/22/45	190,000.00	198,619.54
	BGB 3% 06/22/33	410,000.00	408,382.96
	BGB 3% 06/22/34	280,000.00	277,840.36
	BGB 4.25% 03/28/41	370,000.00	411,297.92
	BGB 4.5% 03/28/26	350,000.00	358,044.12
	BGB 4% 03/28/32	150,000.00	160,419.00
	BGB 5.5% 03/28/28	400,000.00	436,348.80
	BGB 5% 03/28/35	550,000.00	642,515.50
	BKO 2.5% 03/19/26	840,000.00	830,328.24
	BKO 2.8% 06/12/25	390,000.00	387,701.73
	BKO 3.1% 09/18/25	120,000.00	119,675.52
	BKO 3.1% 12/12/25	80,000.00	79,831.28

BTPS 0.25% 03/15/28	520,000.00	462,309.12
BTPS 0.5% 02/01/26	550,000.00	523,349.75
BTPS 0.5% 07/15/28	130,000.00	115,666.07
BTPS 0.6% 08/01/31	460,000.00	373,777.60
BTPS 0.85% 01/15/27	790,000.00	739,688.85
BTPS 0.9% 04/01/31	410,000.00	344,144.98
BTPS 0.95% 03/01/37	340,000.00	237,585.20
BTPS 0.95% 06/01/32	450,000.00	366,629.85
BTPS 0.95% 09/15/27	310,000.00	286,689.55
BTPS 0.95% 12/01/31	490,000.00	405,029.59
BTPS 0% 08/01/26	210,000.00	194,953.50
BTPS 1.1% 04/01/27	230,000.00	215,756.10
BTPS 1.2% 08/15/25	340,000.00	330,463.00
BTPS 1.25% 12/01/26	480,000.00	455,421.12
BTPS 1.35% 04/01/30	730,000.00	647,983.04
BTPS 1.45% 03/01/36	360,000.00	275,958.72
BTPS 1.45% 05/15/25	280,000.00	274,506.96
BTPS 1.5% 04/30/45	200,000.00	126,104.00
BTPS 1.5% 06/01/25	1,090,000.00	1,067,758.55
BTPS 1.6% 06/01/26	260,000.00	250,760.90
BTPS 1.65% 03/01/32	510,000.00	442,593.30
BTPS 1.65% 12/01/30	630,000.00	560,606.13
BTPS 1.7% 09/01/51	240,000.00	145,169.28
BTPS 1.8% 03/01/41	170,000.00	122,036.03
BTPS 1.85% 07/01/25	340,000.00	333,813.36
BTPS 2.05% 08/01/27	470,000.00	451,354.63
BTPS 2.1% 07/15/26	350,000.00	340,505.20
BTPS 2.15% 03/01/72	170,000.00	103,066.27
BTPS 2.15% 09/01/52	310,000.00	204,903.80
BTPS 2.2% 06/01/27	150,000.00	144,970.65
BTPS 2.25% 09/01/36	380,000.00	317,244.90
BTPS 2.45% 09/01/33	820,000.00	737,738.42
BTPS 2.45% 09/01/50	330,000.00	238,052.10
BTPS 2.5% 11/15/25	280,000.00	276,163.16
BTPS 2.5% 12/01/32	460,000.00	420,377.90
BTPS 2.65% 12/01/27	400,000.00	390,363.60
BTPS 2.7% 03/01/47	290,000.00	226,375.74
BTPS 2.8% 03/01/67	200,000.00	145,667.60
BTPS 2.8% 06/15/29	670,000.00	650,064.82
BTPS 2.8% 12/01/28	440,000.00	429,391.60
BTPS 2.95% 02/15/27	500,000.00	493,825.00
BTPS 2.95% 09/01/38	320,000.00	281,164.16
BTPS 2% 02/01/28	570,000.00	543,018.48

BTPS 2% 12/01/25	150,000.00	146,768.40
BTPS 3.1% 03/01/40	170,000.00	149,595.24
BTPS 3.25% 03/01/38	420,000.00	383,548.20
BTPS 3.25% 09/01/46	420,000.00	361,451.16
BTPS 3.35% 03/01/35	570,000.00	542,757.99
BTPS 3.4% 04/01/28	500,000.00	500,038.00
BTPS 3.45% 03/01/48	480,000.00	423,933.60
BTPS 3.5% 01/15/26	380,000.00	379,857.12
BTPS 3.5% 03/01/30	770,000.00	771,278.20
BTPS 3.6% 09/29/25	430,000.00	430,129.00
BTPS 3.7% 06/15/30	230,000.00	231,984.90
BTPS 3.8% 04/15/26	550,000.00	553,194.95
BTPS 3.8% 08/01/28	560,000.00	568,277.92
BTPS 3.85% 09/01/49	350,000.00	328,059.90
BTPS 3.85% 09/15/26	490,000.00	494,321.31
BTPS 3.85% 12/15/29	510,000.00	519,256.50
BTPS 3% 08/01/29	340,000.00	333,008.92
BTPS 4.1% 02/01/29	740,000.00	761,265.38
BTPS 4.2% 03/01/34	320,000.00	329,532.80
BTPS 4.35% 11/01/33	400,000.00	417,334.40
BTPS 4.4% 05/01/33	260,000.00	272,911.34
BTPS 4.45% 09/01/43	260,000.00	266,229.60
BTPS 4.5% 03/01/26	610,000.00	620,398.06
BTPS 4.5% 10/01/53	320,000.00	328,208.00
BTPS 4.75% 09/01/28	390,000.00	410,551.08
BTPS 4.75% 09/01/44	450,000.00	479,952.00
BTPS 4% 02/01/37	650,000.00	653,243.50
BTPS 4% 10/30/31	450,000.00	461,721.15
BTPS 4% 11/15/30	800,000.00	819,776.00
BTPS 5.0% 08/01/39	810,000.00	886,959.72
BTPS 5.25% 11/01/29	560,000.00	610,281.67
BTPS 5.75% 02/01/33	550,000.00	631,266.90
BTPS 5% 08/01/34	780,000.00	855,184.59
BTPS 5% 09/01/40	800,000.00	875,555.20
BTPS 6.5% 11/01/27	780,000.00	858,352.87
BTPS 6% 05/01/31	480,000.00	552,114.24
DBR 0.25% 02/15/29	470,000.00	420,905.91
DBR 0.25% 08/15/28	620,000.00	560,865.33
DBR 0.5% 02/15/26	470,000.00	449,666.97
DBR 0.5% 02/15/28	700,000.00	645,880.20
DBR 0.5% 08/15/27	190,000.00	176,833.30
DBR 0% 02/15/30	430,000.00	371,603.85

DBR 0% 02/15/31	490,000.00	413,578.86
DBR 0% 02/15/32	760,000.00	625,527.12
DBR 0% 05/15/35	480,000.00	360,479.75
DBR 0% 05/15/36	480,000.00	349,967.04
DBR 0% 08/15/26	910,000.00	852,747.35
DBR 0% 08/15/29	410,000.00	358,491.70
DBR 0% 08/15/30	950,000.00	811,723.70
DBR 0% 08/15/31	780,000.00	650,743.86
DBR 0% 08/15/50	1,070,000.00	532,504.76
DBR 0% 08/15/52	610,000.00	289,130.24
DBR 0% 11/15/27	820,000.00	746,046.66
DBR 0% 11/15/28	560,000.00	498,074.64
DBR 1.25% 08/15/48	890,000.00	658,386.40
DBR 1.7% 08/15/32	540,000.00	505,915.20
DBR 1.8% 08/15/53	800,000.00	653,504.80
DBR 1% 05/15/38	580,000.00	464,559.70
DBR 1% 08/15/25	390,000.00	379,363.53
DBR 2.1% 11/15/29	150,000.00	145,949.52
DBR 2.2% 02/15/34	580,000.00	559,898.36
DBR 2.3% 02/15/33	1,010,000.00	988,527.40
DBR 2.5% 07/04/44	580,000.00	555,664.36
DBR 2.5% 08/15/46	680,000.00	651,057.84
DBR 2.5% 08/15/54	270,000.00	258,018.75
DBR 2.6% 08/15/33	630,000.00	630,555.66
DBR 3.25% 07/04/42	450,000.00	479,952.00
DBR 4.0% 01/04/37	660,000.00	750,492.60
DBR 4.25% 07/04/39	400,000.00	473,276.00
DBR 4.75% 07/04/28	180,000.00	194,067.90
DBR 4.75% 07/04/34	480,000.00	569,791.20
DBR 4.75% 07/04/40	520,000.00	653,194.36
DBR 5.5% 01/04/31	860,000.00	1,008,252.46
DBR 5.625% 01/04/28	1,140,000.00	1,250,479.68
DBR 6.25% 01/04/30	900,000.00	1,066,830.74
DBR 6.5% 07/04/27	460,000.00	509,137.20
FRTR 0.25% 11/25/26	590,000.00	550,121.31
FRTR 0.5% 05/25/25	1,080,000.00	1,048,979.80
FRTR 0.5% 05/25/26	830,000.00	787,797.82
FRTR 0.5% 05/25/29	670,000.00	594,750.96
FRTR 0.5% 05/25/40	720,000.00	470,231.28
FRTR 0.5% 05/25/72	270,000.00	100,379.84
FRTR 0.5% 06/25/44	380,000.00	222,562.58
FRTR 0.75% 02/25/28	1,410,000.00	1,299,353.07
FRTR 0.75% 05/25/28	730,000.00	669,527.53

FRTR 0.75% 05/25/52	730,000.00	382,063.02
FRTR 0.75% 05/25/53	660,000.00	337,533.90
FRTR 0.75% 11/25/28	1,250,000.00	1,135,191.87
FRTR 0% 02/25/26	840,000.00	794,428.32
FRTR 0% 02/25/27	1,470,000.00	1,352,670.48
FRTR 0% 05/25/32	540,000.00	426,928.86
FRTR 0% 11/25/29	1,060,000.00	904,195.90
FRTR 0% 11/25/30	1,280,000.00	1,060,270.08
FRTR 0% 11/25/31	1,330,000.00	1,068,456.83
FRTR 1.25% 05/25/34	1,150,000.00	970,174.50
FRTR 1.25% 05/25/36	1,000,000.00	808,684.00
FRTR 1.25% 05/25/38	720,000.00	557,092.08
FRTR 1.5% 05/25/31	1,230,000.00	1,119,421.77
FRTR 1.5% 05/25/50	710,000.00	475,928.62
FRTR 1.75% 05/25/66	440,000.00	285,396.06
FRTR 1.75% 06/25/39	660,000.00	541,419.12
FRTR 1% 05/25/27	1,350,000.00	1,272,115.80
FRTR 1% 11/25/25	1,470,000.00	1,421,284.20
FRTR 2.5% 05/25/30	1,600,000.00	1,561,682.67
FRTR 2.5% 05/25/43	320,000.00	279,523.84
FRTR 2.5% 09/24/26	510,000.00	502,583.07
FRTR 2.75% 02/25/29	940,000.00	930,807.74
FRTR 2.75% 02/25/30	180,000.00	177,920.10
FRTR 2.75% 10/25/27	1,110,000.00	1,100,117.67
FRTR 2% 05/25/48	700,000.00	537,878.60
FRTR 2% 11/25/32	790,000.00	730,789.50
FRTR 3.25% 05/25/45	720,000.00	703,486.08
FRTR 3.5% 04/25/26	1,580,000.00	1,589,050.24
FRTR 3.5% 11/25/33	980,000.00	1,013,688.48
FRTR 3% 05/25/33	770,000.00	767,442.83
FRTR 3% 05/25/54	590,000.00	535,804.37
FRTR 3% 06/25/49	220,000.00	204,358.66
FRTR 4.5% 04/25/41	800,000.00	919,113.60
FRTR 4.75% 04/25/35	620,000.00	711,160.46
FRTR 4% 04/25/55	550,000.00	602,211.66
FRTR 4% 04/25/60	410,000.00	453,121.34
FRTR 4% 10/25/38	370,000.00	400,486.89
FRTR 5.5% 04/25/29	1,240,000.00	1,381,320.32
FRTR 5.75% 10/25/32	1,120,000.00	1,342,501.44
IRISH 0.2% 05/15/27	200,000.00	184,608.20
IRISH 0.2% 10/18/30	170,000.00	144,196.83
IRISH 0.35% 10/18/32	90,000.00	73,271.52

IRISH 0.4% 05/15/35	110,000.00	83,569.20
IRISH 0.55% 04/22/41	100,000.00	66,244.20
IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	157,662.42
IRISH 0% 10/18/31	140,000.00	113,727.18
IRISH 1.1% 05/15/29	230,000.00	211,534.45
IRISH 1.3% 05/15/33	50,000.00	43,785.00
IRISH 1.35% 03/18/31	240,000.00	218,331.90
IRISH 1.5% 05/15/50	190,000.00	134,025.05
IRISH 1.7% 05/15/37	170,000.00	145,188.50
IRISH 1% 05/15/26	270,000.00	259,340.67
IRISH 2.4% 05/15/30	190,000.00	185,293.70
IRISH 2.6% 10/18/34	40,000.00	38,663.63
IRISH 2% 02/18/45	260,000.00	214,885.32
IRISH 3% 10/18/43	120,000.00	117,363.60
NETHER 0.25% 07/15/25	410,000.00	396,170.82
NETHER 0.25% 07/15/29	90,000.00	79,125.98
NETHER 0.5% 01/15/40	370,000.00	257,485.22
NETHER 0.5% 07/15/26	390,000.00	369,610.56
NETHER 0.5% 07/15/32	150,000.00	124,955.45
NETHER 0.75% 07/15/27	310,000.00	290,104.20
NETHER 0.75% 07/15/28	380,000.00	349,236.34
NETHER 0% 01/15/26	290,000.00	275,640.36
NETHER 0% 01/15/27	380,000.00	351,564.60
NETHER 0% 01/15/29	250,000.00	219,460.25
NETHER 0% 01/15/38	250,000.00	167,523.00
NETHER 0% 01/15/52	350,000.00	162,227.10
NETHER 0% 07/15/30	300,000.00	253,200.00
NETHER 0% 07/15/31	340,000.00	279,314.29
NETHER 2.5% 01/15/30	310,000.00	304,719.66
NETHER 2.5% 01/15/33	430,000.00	419,382.01
NETHER 2.5% 07/15/33	310,000.00	301,231.51
NETHER 2.5% 07/15/34	120,000.00	115,897.56
NETHER 2.75% 01/15/47	410,000.00	398,610.20
NETHER 2% 01/15/54	300,000.00	246,643.68
NETHER 3.25% 01/15/44	140,000.00	145,796.70
NETHER 3.75% 01/15/42	430,000.00	475,214.50
NETHER 4% 01/15/37	420,000.00	465,388.56
NETHER 5.5% 01/15/28	430,000.00	467,914.82
OBL 0% 04/10/26	760,000.00	718,212.16
OBL 0% 04/16/27	1,020,000.00	940,392.06
OBL 0% 10/09/26	940,000.00	877,291.66
OBL 0% 10/10/25	270,000.00	258,516.00
OBL 1.3% 10/15/27	240,000.00	228,771.60

OBL 2.2% 04/13/28	200,000.00	196,094.00	
OBL 2.4% 10/19/28	1,210,000.00	1,194,826.60	
RAGB 0.25% 10/20/36	150,000.00	105,586.65	
RAGB 0.5% 02/20/29	340,000.00	303,427.22	
RAGB 0.5% 04/20/27	220,000.00	204,830.56	
RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	30,376.43	
RAGB 0.75% 02/20/28	270,000.00	249,160.86	
RAGB 0.75% 03/20/51	200,000.00	112,947.80	
RAGB 0.75% 10/20/26	420,000.00	397,826.94	
RAGB 0.85% 06/30/20	90,000.00	39,873.87	
RAGB 0.9% 02/20/32	280,000.00	239,635.76	
RAGB 0% 02/20/30	460,000.00	389,028.44	
RAGB 0% 02/20/31	460,000.00	377,435.52	
RAGB 0% 10/20/28	180,000.00	158,327.10	
RAGB 0% 10/20/40	130,000.00	77,171.14	
RAGB 1.2% 10/20/25	350,000.00	339,961.30	
RAGB 1.5% 02/20/47	160,000.00	115,513.18	
RAGB 1.5% 11/02/86	90,000.00	52,488.00	
RAGB 1.85% 05/23/49	140,000.00	106,950.92	
RAGB 2.1% 09/20/17	150,000.00	109,923.00	
RAGB 2.4% 05/23/34	180,000.00	169,605.00	
RAGB 2.9% 02/20/33	350,000.00	346,201.10	
RAGB 2.9% 02/20/34	100,000.00	98,499.90	
RAGB 2% 07/15/26	110,000.00	107,525.99	
RAGB 3.15% 06/20/44	240,000.00	236,136.48	
RAGB 3.15% 10/20/53	100,000.00	97,649.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	100,521.98	
RAGB 4.15% 03/15/37	370,000.00	407,324.04	
RAGB 4.85% 03/15/26	130,000.00	133,735.42	
RAGB 6.25% 07/15/27	300,000.00	328,354.73	
RFGB 0.125% 04/15/36	110,000.00	77,339.90	
RFGB 0.125% 04/15/52	110,000.00	49,486.09	
RFGB 0.125% 09/15/31	260,000.00	211,905.72	
RFGB 0.25% 09/15/40	90,000.00	56,365.60	
RFGB 0.5% 04/15/26	170,000.00	161,774.72	
RFGB 0.5% 04/15/43	150,000.00	92,586.55	
RFGB 0.5% 09/15/27	20,000.00	18,442.48	
RFGB 0.5% 09/15/28	170,000.00	153,238.85	
RFGB 0.5% 09/15/29	100,000.00	88,084.25	
RFGB 0.75% 04/15/31	210,000.00	181,369.86	
RFGB 0.875% 09/15/25	70,000.00	67,865.91	
RFGB 0% 09/15/26	110,000.00	102,461.70	

RFGB 0% 09/15/30	130,000.00	108,105.14
RFGB 1.125% 04/15/34	220,000.00	184,006.79
RFGB 1.375% 04/15/27	90,000.00	85,860.79
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	70,718.70
RFGB 1.5% 09/15/32	170,000.00	151,266.82
RFGB 2.625% 07/04/42	110,000.00	100,848.88
RFGB 2.75% 04/15/38	30,000.00	28,404.60
RFGB 2.75% 07/04/28	150,000.00	148,756.05
RFGB 2.875% 04/15/29	120,000.00	119,435.49
RFGB 2.95% 04/15/55	60,000.00	56,843.40
RFGB 4% 07/04/25	150,000.00	150,974.10
SPGB 0.1% 04/30/31	620,000.00	504,592.58
SPGB 0.5% 04/30/30	540,000.00	465,453.54
SPGB 0.5% 10/31/31	490,000.00	404,840.94
SPGB 0.6% 10/31/29	430,000.00	377,388.64
SPGB 0.7% 04/30/32	600,000.00	496,683.00
SPGB 0.8% 07/30/27	600,000.00	558,037.20
SPGB 0.8% 07/30/29	880,000.00	784,729.44
SPGB 0.85% 07/30/37	300,000.00	215,358.00
SPGB 0% 01/31/26	540,000.00	511,383.41
SPGB 0% 01/31/27	510,000.00	468,702.75
SPGB 0% 01/31/28	530,000.00	473,469.14
SPGB 0% 05/31/25	510,000.00	492,437.64
SPGB 1.2% 10/31/40	440,000.00	305,868.20
SPGB 1.25% 10/31/30	620,000.00	553,349.38
SPGB 1.3% 10/31/26	150,000.00	143,447.25
SPGB 1.4% 04/30/28	500,000.00	469,075.00
SPGB 1.4% 07/30/28	560,000.00	523,606.72
SPGB 1.45% 04/30/29	420,000.00	389,247.60
SPGB 1.45% 10/31/27	550,000.00	520,500.75
SPGB 1.45% 10/31/71	170,000.00	82,526.50
SPGB 1.5% 04/30/27	180,000.00	171,756.00
SPGB 1.6% 04/30/25	600,000.00	589,635.30
SPGB 1.85% 07/30/35	480,000.00	410,651.52
SPGB 1.9% 10/31/52	450,000.00	299,142.00
SPGB 1.95% 04/30/26	790,000.00	770,564.42
SPGB 1.95% 07/30/30	550,000.00	515,224.05
SPGB 1% 07/30/42	270,000.00	174,396.78
SPGB 1% 10/31/50	450,000.00	242,235.00
SPGB 2.15% 10/31/25	250,000.00	245,937.75
SPGB 2.35% 07/30/33	470,000.00	435,656.63
SPGB 2.5% 05/31/27	220,000.00	215,774.02
SPGB 2.55% 10/31/32	760,000.00	722,094.24

SPGB 2.7% 10/31/48	400,000.00	330,010.40	
SPGB 2.8% 05/31/26	670,000.00	663,536.51	
SPGB 2.9% 10/31/46	450,000.00	390,213.00	
SPGB 3.15% 04/30/33	430,000.00	425,770.95	
SPGB 3.25% 04/30/34	430,000.00	425,894.57	
SPGB 3.45% 07/30/43	290,000.00	276,776.00	
SPGB 3.45% 07/30/66	360,000.00	324,631.80	
SPGB 3.55% 10/31/33	620,000.00	631,237.50	
SPGB 3.9% 07/30/39	280,000.00	287,367.92	
SPGB 4.2% 01/31/37	480,000.00	514,047.84	
SPGB 4.65% 07/30/25	510,000.00	517,143.06	
SPGB 4.7% 07/30/41	420,000.00	472,885.56	
SPGB 4.9% 07/30/40	490,000.00	561,226.40	
SPGB 4% 10/31/54	150,000.00	151,426.05	
SPGB 5.15% 10/31/28	1,110,000.00	1,203,846.06	
SPGB 5.15% 10/31/44	350,000.00	417,919.60	
SPGB 5.75% 07/30/32	440,000.00	520,042.60	
SPGB 5.9% 07/30/26	960,000.00	1,012,127.11	
ユーロ 小計	159,080,000.00	147,455,077.27 (25,055,566,729)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	200,000.00	186,026.88
	UKT 0.125% 01/31/28	220,000.00	189,409.00
	UKT 0.25% 07/31/31	630,000.00	479,656.17
	UKT 0.375% 10/22/26	640,000.00	580,665.60
	UKT 0.375% 10/22/30	370,000.00	292,925.44
	UKT 0.5% 01/31/29	710,000.00	600,035.20
	UKT 0.5% 10/22/61	450,000.00	131,478.12
	UKT 0.625% 06/07/25	180,000.00	172,455.76
	UKT 0.625% 07/31/35	430,000.00	290,207.00
	UKT 0.625% 10/22/50	300,000.00	118,260.00
	UKT 0.875% 01/31/46	270,000.00	131,760.00
	UKT 0.875% 07/31/33	690,000.00	515,449.32
	UKT 0.875% 10/22/29	300,000.00	253,323.24
	UKT 1.125% 01/31/39	560,000.00	357,948.86
	UKT 1.125% 10/22/73	240,000.00	85,512.00
	UKT 1.25% 07/22/27	440,000.00	400,672.80
	UKT 1.25% 07/31/51	580,000.00	277,487.89
	UKT 1.25% 10/22/41	530,000.00	319,961.00
	UKT 1.5% 07/22/26	400,000.00	375,876.16
	UKT 1.5% 07/22/47	370,000.00	205,018.76
UKT 1.5% 07/31/53	140,000.00	69,872.99	
UKT 1.625% 10/22/28	240,000.00	215,731.29	

UKT 1.625% 10/22/54	300,000.00	153,473.40	
UKT 1.625% 10/22/71	290,000.00	130,530.50	
UKT 1.75% 01/22/49	320,000.00	184,150.40	
UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	228,448.00	
UKT 1.75% 09/07/37	500,000.00	366,550.00	
UKT 1% 01/31/32	880,000.00	698,734.08	
UKT 2.5% 07/22/65	350,000.00	217,525.00	
UKT 2% 09/07/25	330,000.00	318,521.94	
UKT 3.25% 01/22/44	630,000.00	516,644.22	
UKT 3.25% 01/31/33	790,000.00	735,521.74	
UKT 3.5% 01/22/45	460,000.00	389,022.00	
UKT 3.5% 07/22/68	350,000.00	281,120.00	
UKT 3.5% 10/22/25	1,160,000.00	1,138,171.12	
UKT 3.75% 01/29/38	450,000.00	417,195.00	
UKT 3.75% 03/07/27	300,000.00	293,796.00	
UKT 3.75% 07/22/52	290,000.00	248,196.50	
UKT 3.75% 10/22/53	780,000.00	663,599.04	
UKT 4.125% 01/29/27	580,000.00	574,026.00	
UKT 4.25% 03/07/36	390,000.00	385,943.37	
UKT 4.25% 06/07/32	380,000.00	383,029.36	
UKT 4.25% 09/07/39	300,000.00	290,610.00	
UKT 4.25% 12/07/27	470,000.00	469,328.08	
UKT 4.25% 12/07/40	340,000.00	327,208.38	
UKT 4.25% 12/07/46	410,000.00	385,564.00	
UKT 4.25% 12/07/49	270,000.00	252,388.17	
UKT 4.25% 12/07/55	430,000.00	400,115.00	
UKT 4.375% 07/31/54	160,000.00	151,680.00	
UKT 4.5% 06/07/28	460,000.00	463,030.02	
UKT 4.5% 09/07/34	310,000.00	315,281.90	
UKT 4.5% 12/07/42	430,000.00	423,507.00	
UKT 4.625% 01/31/34	540,000.00	555,414.84	
UKT 4.75% 10/22/43	200,000.00	202,335.36	
UKT 4.75% 12/07/30	450,000.00	465,858.00	
UKT 4.75% 12/07/38	320,000.00	328,563.39	
UKT 4% 01/22/60	290,000.00	258,684.80	
UKT 4% 10/22/63	340,000.00	302,022.00	
UKT 6.0% 12/07/28	380,000.00	408,348.00	
イギリスbond 小計	24,960,000.00	20,573,870.09 (4,105,104,299)	
スウェーデン ンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	1,100,000.00	940,561.12
	SGB 0.75% 05/12/28	1,590,000.00	1,484,532.59
	SGB 0.75% 11/12/29	1,740,000.00	1,592,825.69
	SGB 1.75% 11/11/33	830,000.00	783,852.51

	SGB 1% 11/12/26	1,890,000.00	1,811,788.71	
	SGB 2.25% 06/01/32	1,130,000.00	1,115,988.03	
	SGB 2.5% 05/12/25	1,680,000.00	1,668,284.31	
	SGB 3.5% 03/30/39	1,050,000.00	1,175,160.00	
スウェーデンクローナ 小計		11,010,000.00	10,572,992.96	(154,788,616)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	930,000.00	785,887.20	
	NGB 1.375% 08/19/30	1,230,000.00	1,075,114.71	
	NGB 1.5% 02/19/26	980,000.00	941,113.60	
	NGB 1.75% 02/17/27	1,240,000.00	1,176,035.84	
	NGB 1.75% 09/06/29	1,100,000.00	1,000,744.56	
	NGB 2.125% 05/18/32	910,000.00	810,446.00	
	NGB 2% 04/26/28	850,000.00	798,719.50	
	NGB 3.5% 10/06/42	360,000.00	355,145.40	
	NGB 3.625% 04/13/34	580,000.00	574,931.51	
	NGB 3% 08/15/33	1,350,000.00	1,274,685.25	
ノルウェークローネ 小計		9,530,000.00	8,792,823.57	(129,518,291)
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,340,000.00	696,343.40	
	DGB 0.5% 11/15/27	1,530,000.00	1,419,544.55	
	DGB 0.5% 11/15/29	1,130,000.00	1,012,521.58	
	DGB 0% 11/15/31	1,200,000.00	996,192.23	
	DGB 1.75% 11/15/25	1,350,000.00	1,324,268.59	
	DGB 2.25% 11/15/33	1,080,000.00	1,049,080.45	
	DGB 4.5% 11/15/39	2,200,000.00	2,675,279.85	
デンマーククローネ 小計		9,830,000.00	9,173,230.65	(208,874,461)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	310,000.00	275,100.51	
	POLGB 0% 10/25/25	280,000.00	260,501.33	
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,280,000.00	986,848.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	920,000.00	693,243.92	
	POLGB 2.5% 07/25/26	1,240,000.00	1,169,367.12	
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,060,000.00	972,054.98	
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,730,000.00	1,569,206.88	
	POLGB 2.75% 10/25/29	1,610,000.00	1,402,031.47	
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,130,000.00	1,105,514.03	
	POLGB 3.75% 05/25/27	480,000.00	458,839.20	
	POLGB 6% 10/25/33	890,000.00	906,685.72	
	POLGB 7.5% 07/25/28	710,000.00	760,361.01	
ポーランドズロチ 小計		11,640,000.00	10,559,754.17	(420,744,957)
オーストラリアドル	ACGB 0.25% 11/21/25	410,000.00	387,419.15	

	ACGB 0.5% 09/21/26	610,000.00	563,572.62
	ACGB 1.25% 05/21/32	310,000.00	248,865.95
	ACGB 1.5% 06/21/31	560,000.00	471,019.71
	ACGB 1.75% 06/21/51	450,000.00	251,342.62
	ACGB 1.75% 11/21/32	910,000.00	751,682.90
	ACGB 1% 11/21/31	740,000.00	591,437.35
	ACGB 1% 12/21/30	390,000.00	321,590.88
	ACGB 2.25% 05/21/28	450,000.00	422,367.64
	ACGB 2.5% 05/21/30	530,000.00	487,334.62
	ACGB 2.75% 05/21/41	260,000.00	205,436.27
	ACGB 2.75% 06/21/35	330,000.00	285,415.98
	ACGB 2.75% 11/21/27	510,000.00	490,577.40
	ACGB 2.75% 11/21/28	290,000.00	276,010.29
	ACGB 2.75% 11/21/29	350,000.00	328,849.32
	ACGB 3.25% 04/21/29	270,000.00	261,562.11
	ACGB 3.25% 06/21/39	230,000.00	199,927.00
	ACGB 3.5% 12/21/34	370,000.00	345,791.48
	ACGB 3.75% 04/21/37	290,000.00	272,650.64
	ACGB 3.75% 05/21/34	500,000.00	479,635.66
	ACGB 3% 03/21/47	330,000.00	255,141.33
	ACGB 3% 11/21/33	480,000.00	433,901.14
	ACGB 4.25% 04/21/26	470,000.00	472,164.25
	ACGB 4.5% 04/21/33	590,000.00	602,378.08
	ACGB 4.75% 04/21/27	410,000.00	419,127.01
	ACGB 4.75% 06/21/54	160,000.00	163,957.02
	オーストラリアドル 小計	11,200,000.00	9,989,158.42 (1,036,475,077)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	240,000.00	202,446.11
	NZGB 0.5% 05/15/26	110,000.00	101,141.25
	NZGB 1.5% 05/15/31	520,000.00	424,120.16
	NZGB 1.75% 05/15/41	100,000.00	63,309.50
	NZGB 2.75% 04/15/37	150,000.00	119,789.93
	NZGB 2.75% 05/15/51	170,000.00	114,042.04
	NZGB 2% 05/15/32	120,000.00	98,822.36
	NZGB 3.5% 04/14/33	110,000.00	100,501.73
	NZGB 3% 04/20/29	190,000.00	177,066.15
	NZGB 4.25% 05/15/34	120,000.00	115,408.65
	NZGB 4.5% 04/15/27	190,000.00	189,125.30
	NZGB 4.5% 05/15/30	220,000.00	219,099.24
	NZGB 5% 05/15/54	100,000.00	99,738.70
	ニュージーランドドル 小計	2,340,000.00	2,024,611.12 (193,876,760)
	SIGB 0.5% 11/01/25	110,000.00	105,457.00

シンガポールドル	SIGB 1.25% 11/01/26	140,000.00	132,986.00
	SIGB 1.625% 07/01/31	130,000.00	116,441.00
	SIGB 1.875% 03/01/50	280,000.00	213,080.00
	SIGB 2.125% 06/01/26	140,000.00	136,507.00
	SIGB 2.25% 08/01/36	150,000.00	135,000.00
	SIGB 2.375% 06/01/25	220,000.00	217,448.00
	SIGB 2.375% 07/01/39	70,000.00	62,636.35
	SIGB 2.625% 05/01/28	220,000.00	214,896.00
	SIGB 2.625% 08/01/32	240,000.00	228,912.00
	SIGB 2.75% 03/01/46	190,000.00	175,392.80
	SIGB 2.75% 04/01/42	240,000.00	223,560.00
	SIGB 2.875% 07/01/29	190,000.00	186,485.00
	SIGB 2.875% 09/01/27	60,000.00	59,256.00
	SIGB 2.875% 09/01/30	130,000.00	127,075.00
	SIGB 3.375% 09/01/33	130,000.00	131,105.00
	SIGB 3.5% 03/01/27	320,000.00	321,280.00
	SIGB 3% 08/01/72	70,000.00	65,660.00
	シンガポールドル 小計		3,030,000.00
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	300,000.00	278,227.38
	MGS 3.502% 05/31/27	470,000.00	468,957.83
	MGS 3.519% 04/20/28	540,000.00	537,261.36
	MGS 3.582% 07/15/32	320,000.00	313,327.51
	MGS 3.733% 06/15/28	590,000.00	591,128.19
	MGS 3.757% 05/22/40	910,000.00	876,266.54
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	497,333.12
	MGS 3.844% 04/15/33	420,000.00	418,482.48
	MGS 3.885% 08/15/29	650,000.00	655,487.88
	MGS 3.892% 03/15/27	790,000.00	796,655.98
	MGS 3.899% 11/16/27	420,000.00	423,892.43
	MGS 3.9% 11/30/26	50,000.00	50,447.63
	MGS 3.906% 07/15/26	580,000.00	584,685.47
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	151,064.10
	MGS 4.065% 06/15/50	450,000.00	438,305.19
	MGS 4.232% 06/30/31	440,000.00	450,276.72
	MGS 4.254% 05/31/35	600,000.00	615,944.04
	MGS 4.392% 04/15/26	270,000.00	274,587.21
	MGS 4.457% 03/31/53	480,000.00	498,037.92
	MGS 4.498% 04/15/30	480,000.00	497,955.31
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	402,264.42
	MGS 4.696% 10/15/42	160,000.00	172,169.90
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	259,379.76
MGS 4.762% 04/07/37	630,000.00	676,848.50	

	MGS 4.893% 06/08/38	310,000.00	338,764.59	
	MGS 4.921% 07/06/48	450,000.00	498,204.36	
	MGS 4.935% 09/30/43	130,000.00	143,771.21	
マレーシアリングット 小計		11,710,000.00	11,909,727.03	(396,646,312)
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	290,000.00	271,290.82	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	660,000.00	638,266.99	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	520,000.00	402,711.50	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	680,000.00	454,401.62	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	510,000.00	494,112.78	
	ILGOV 1% 03/31/30	1,240,000.00	1,013,291.42	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,240,000.00	1,130,853.70	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	250,000.00	159,062.13	
	ILGOV 2% 03/31/27	380,000.00	355,828.60	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	600,000.00	482,221.26	
	ILGOV 4% 03/30/35	30,000.00	27,738.96	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	480,000.00	501,130.51	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	440,000.00	458,689.44	
	イスラエルシェケル 小計		7,320,000.00	6,389,599.73
オフショア 人民元	CGB 1.99% 03/15/26	3,930,000.00	3,942,300.90	
	CGB 2.18% 08/15/26	9,580,000.00	9,629,917.54	
	CGB 2.18% 08/25/25	4,860,000.00	4,882,917.33	
	CGB 2.22% 09/25/25	10,400,000.00	10,457,671.12	
	CGB 2.24% 05/25/25	3,000,000.00	3,015,759.60	
	CGB 2.28% 11/25/25	11,360,000.00	11,440,249.30	
	CGB 2.3% 05/15/26	10,490,000.00	10,582,017.23	
	CGB 2.33% 12/15/25	2,500,000.00	2,520,042.00	
	CGB 2.37% 01/15/29	3,410,000.00	3,446,666.70	
	CGB 2.37% 01/20/27	8,330,000.00	8,416,100.54	
	CGB 2.39% 11/15/26	5,900,000.00	5,961,180.05	
	CGB 2.4% 07/15/28	9,890,000.00	9,985,867.72	
	CGB 2.44% 10/15/27	7,400,000.00	7,495,568.78	
	CGB 2.46% 02/15/26	9,080,000.00	9,169,379.88	
	CGB 2.48% 04/15/27	4,660,000.00	4,725,965.56	
	CGB 2.48% 09/25/28	4,400,000.00	4,458,774.32	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,594,514.55	
	CGB 2.52% 08/25/33	11,800,000.00	11,965,112.67	
	CGB 2.54% 12/25/30	5,520,000.00	5,603,996.73	
	CGB 2.55% 10/15/28	3,500,000.00	3,561,592.30	
	CGB 2.6% 09/01/32	160,000.00	163,032.57	
	CGB 2.6% 09/15/30	6,420,000.00	6,537,224.69	

CGB 2.62% 04/15/28	3,000,000.00	3,054,860.40	
CGB 2.62% 06/25/30	9,400,000.00	9,591,006.11	
CGB 2.62% 09/25/29	4,950,000.00	5,054,852.38	
CGB 2.64% 01/15/28	7,820,000.00	7,963,165.42	
CGB 2.67% 05/25/33	8,090,000.00	8,308,219.66	
CGB 2.68% 05/21/30	12,510,000.00	12,802,254.86	
CGB 2.69% 08/12/26	9,650,000.00	9,814,247.82	
CGB 2.69% 08/15/32	4,550,000.00	4,666,399.92	
CGB 2.75% 02/17/32	5,150,000.00	5,307,161.52	
CGB 2.75% 06/15/29	4,900,000.00	5,036,162.67	
CGB 2.76% 05/15/32	2,940,000.00	3,028,851.50	
CGB 2.79% 12/15/29	7,400,000.00	7,625,591.96	
CGB 2.8% 03/24/29	4,990,000.00	5,140,242.91	
CGB 2.8% 03/25/30	6,620,000.00	6,822,503.81	
CGB 2.8% 11/15/32	4,850,000.00	5,018,895.91	
CGB 2.85% 06/04/27	3,850,000.00	3,948,817.95	
CGB 2.88% 02/25/33	9,150,000.00	9,538,562.98	
CGB 2.89% 11/18/31	2,750,000.00	2,860,388.85	
CGB 2.91% 10/14/28	11,310,000.00	11,688,342.12	
CGB 2% 06/15/25	1,420,000.00	1,423,849.05	
CGB 3.01% 05/13/28	6,720,000.00	6,965,009.18	
CGB 3.02% 05/27/31	7,650,000.00	8,030,320.51	
CGB 3.02% 10/22/25	8,700,000.00	8,856,814.89	
CGB 3.03% 03/11/26	4,650,000.00	4,752,727.80	
CGB 3.12% 10/25/52	3,980,000.00	4,351,864.93	
CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,341,306.59	
CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,155,288.82	
CGB 3.19% 04/15/53	2,900,000.00	3,249,537.58	
CGB 3.25% 11/22/28	3,100,000.00	3,262,436.28	
CGB 3.27% 11/19/30	620,000.00	661,836.79	
CGB 3.28% 12/03/27	1,170,000.00	1,224,260.73	
CGB 3.32% 04/15/52	2,730,000.00	3,093,153.06	
CGB 3.39% 03/16/50	7,470,000.00	8,534,707.31	
CGB 3.53% 10/18/51	2,000,000.00	2,340,785.60	
CGB 3.72% 04/12/51	4,280,000.00	5,153,907.52	
CGB 3.81% 09/14/50	3,960,000.00	4,824,614.91	
CGB 3.86% 07/22/49	3,210,000.00	3,919,919.74	
CGB 4.08% 10/22/48	3,670,000.00	4,619,246.96	
オフショア人民元 小計	338,550,000.00	350,587,969.08 (7,589,107,649)	
合計		79,646,783,282 (79,646,783,282)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 216銘柄	100.0%	47.0%
カナダドル	国債証券 35銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 352銘柄	100.0%	31.5%
イギリスポンド	国債証券 59銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 27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 60銘柄	100.0%	9.5%

(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。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2024年 5月24日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	534,716,934
コール・ローン	2,257,249,128
国債証券	142,498,438,010
派生商品評価勘定	14,010,319
未収利息	2,457,383,981
前払費用	275,845,791
流動資産合計	148,037,644,163
資産合計	148,037,644,163
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,851,154
未払解約金	21,146,725
流動負債合計	22,997,879

	2024年 5月24日現在
項目	金額（円）
負債合計	22,997,879
純資産の部	
元本等	
元本	62,732,887,478
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,281,758,806
元本等合計	148,014,646,284
純資産合計	148,014,646,284
負債純資産合計	148,037,644,163

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 5月24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。 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。 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 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	62,732,887,478口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3594円 (1万口当たり純資産額) (23,594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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

	2024年 5月24日現在
--	---------------

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	52,278,352,105円
期中追加設定元本額	12,537,757,361円
期中一部解約元本額	2,083,221,988円
期末元本額	62,732,887,478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	4,982,528,173円
世界経済インデックスファンド	23,045,082,765円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,909,526,519円
DC世界経済インデックスファンド	15,009,079,960円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,495,065円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	801,887,070円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,642,684,135円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	229,660,950円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	106,566,714円
SMT インデックスバランス・オープン	184,607,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン	505,155,183円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	743,552,438円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,122,699,323円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,067,835円
グローバル経済コア	1,126,560,847円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	115,114,445円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	100,565,624円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	41,869,497円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	50,130,436円

区分	2024年 5月24日現在
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	290,615,973円
10資産分散投資ファンド	57,646,480円
グローバル10資産バランスファンド	39,008,626円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	315,918,291円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	151,498,122円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	223,114,107円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	218,907,727円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	217,965,256円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	217,835,361円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	215,675,366円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	139,420,198円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		720,155,351
合計		720,155,351

(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 5月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,119,872,582	-	2,132,031,747	12,159,165
	メキシコペソ	326,388,174	-	329,340,396	2,952,222
	チェココルナ	208,668,648	-	210,349,056	1,680,408
	ハンガリーフォリント	99,242,743	-	99,982,696	739,953
	ポーランドズロチ	255,235,795	-	257,614,709	2,378,914
	マレーシアリンギット	322,966,391	-	325,048,080	2,081,689
	タイバーツ	307,842,404	-	309,166,020	1,323,616
	南アフリカランド	282,264,855	-	281,946,326	318,529
	オフショア人民元	317,263,572	-	318,584,464	1,320,892
合計	2,119,872,582	-	2,132,031,747	12,159,165	

（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	39,552,332.00	
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,667,328.63	
		MBONO 5.5% 03/04/27	160,000,000.00	142,466,400.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	161,820,979.65	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	55,185,050.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	124,000,000.00	107,331,920.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	129,670,320.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	160,800,000.00	144,403,224.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000.00	101,418,817.50	
		MBONO 7.75% 11/23/34	46,100,000.00	40,127,975.50	
		MBONO 7% 09/03/26	85,600,000.00	79,903,320.00	
		MBONO 8.5% 03/01/29	52,000,000.00	49,411,180.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000.00	132,293,336.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	88,505,388.00	
		MBONO 8% 07/31/53	87,500,000.00	72,153,812.50	
		MBONO 8% 11/07/47	130,700,000.00	108,756,777.00	
		メキシコペソ 小計			1,704,950,000.00
ブラジルレアル	ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	64,862,578.26	
		BLTN 0% 01/01/28	7,400,000.00	5,020,723.65	
		BLTN 0% 01/01/30	20,200,000.00	10,951,268.40	
		BLTN 0% 07/01/25	59,000,000.00	52,769,069.00	
		BLTN 0% 07/01/26	78,000,000.00	62,701,147.08	
		BLTN 0% 07/01/27	68,000,000.00	48,989,983.23	
		BNTNF 10% 01/01/25	54,900,000.00	54,727,635.13	
		BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000.00	66,820,741.85	
		BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000.00	48,984,685.47	
		BNTNF 10% 01/01/31	21,850,000.00	20,308,008.02	
		BNTNF 10% 01/01/33	28,900,000.00	26,451,343.30	
		BNTNF 10% 01/01/35	8,000,000.00	7,228,294.44	
ブラジルレアル 小計			542,450,000.00	469,815,477.83 (14,339,801,977)	
チリペソ	チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	1,025,000,000.00	897,808,030.85	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,927,976,276.37	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	2,160,000,000.00	2,141,842,685.76	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	2,230,000,000.00	2,111,215,843.26	
		BTPCL 5% 03/01/35	2,360,000,000.00	2,196,567,146.76	
		BTPCL 5% 10/01/28	840,000,000.00	818,609,279.04	
		BTPCL 6% 01/01/43	2,000,000,000.00	2,018,757,534.00	

	BTPCL 6% 04/01/33	1,650,000,000.00	1,673,113,944.15	
	BTPCL 7% 05/01/34	620,000,000.00	672,680,396.22	
	チリペソ 小計	15,870,000,000.00	15,458,571,136.41 (2,668,891,389)	
コロンビア ペソ	COLTES 13.25% 02/09/33	10,000,000,000.00	11,333,061,100.00	
	COLTES 5.75% 11/03/27	25,000,000,000.00	21,993,228,750.00	
	COLTES 6.25% 11/26/25	46,800,000,000.00	44,959,354,596.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000.00	40,096,764,012.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000.00	35,402,753,153.60	
	COLTES 7% 03/26/31	10,700,000,000.00	8,945,526,778.00	
	コロンビアペソ 小計	198,210,000,000.00	162,730,688,389.60 (6,608,330,524)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	6,950,000.00	5,687,719.73	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	9,250,000.00	8,108,391.73	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	10,400,000.00	10,411,567.70	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	11,300,000.00	10,801,344.78	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,650,000.00	6,810,253.36	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	10,682,249.59	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,600,000.00	11,795,144.59	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	10,600,000.00	10,797,191.90	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	4,450,000.00	4,696,073.38	
	ペルーソル 小計	82,250,000.00	79,789,936.76 (3,353,930,096)	
ウルグアイ ペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,938,139.25	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,706,812.90	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	30,000,000.00	31,125,000.00	
	ウルグアイペソ 小計	72,000,000.00	71,769,952.15 (293,072,599)	
ドミニカペ ソ	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	42,290,670.80	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	38,241,296.32	
	ドミニカペソ 小計	72,000,000.00	80,531,967.12 (214,770,703)	
チェココ ルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	41,100,000.00	33,054,921.60	
	CZGB 0.25% 02/10/27	95,200,000.00	85,965,600.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	98,900,000.00	82,701,564.60	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	23,436,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	81,242,000.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	75,500,000.00	73,883,243.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40	34,700,000.00	23,961,911.50	
	CZGB 1.75% 06/23/32	86,500,000.00	72,555,335.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37	29,000,000.00	22,424,801.00	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	64,549,948.80	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	73,934,676.00	

	CZGB 2.5% 08/25/28	98,700,000.00	92,635,872.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	100,500,000.00	94,301,361.00	
	CZGB 2% 10/13/33	102,500,000.00	85,616,405.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35	57,000,000.00	53,544,261.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36	45,000,000.00	45,112,950.00	
	CZGB 4.5% 11/11/32	25,000,000.00	25,607,250.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	50,232,200.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	73,087,905.00	
	CZGB 5.75% 03/29/29	18,000,000.00	19,303,722.00	
	CZGB 5% 09/30/30	80,000,000.00	83,908,800.00	
	CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	30,403,836.00	
	CZGB 6% 02/26/26	68,000,000.00	70,193,000.00	
	チェココロナ 小計	1,465,600,000.00	1,361,657,563.50 (9,355,540,621)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	555,312,326.25	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	459,566,217.80	
	HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	769,234,147.50	
	HGB 2.25% 04/20/33	872,000,000.00	613,910,323.20	
	HGB 2.25% 06/22/34	291,000,000.00	196,603,615.80	
	HGB 2.75% 12/22/26	685,500,000.00	621,192,833.70	
	HGB 2% 05/23/29	733,000,000.00	587,778,699.70	
	HGB 3.25% 10/22/31	1,042,000,000.00	832,923,742.00	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	230,470,765.00	
	HGB 3% 08/21/30	715,000,000.00	578,503,640.00	
	HGB 3% 10/27/27	932,000,000.00	826,137,661.60	
	HGB 3% 10/27/38	530,000,000.00	346,903,550.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	603,000,000.00	560,004,894.00	
	HGB 4.75% 11/24/32	840,000,000.00	730,010,064.00	
	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	888,998,940.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	765,080,045.60	
	HGB 7% 10/24/35	200,000,000.00	202,298,000.00	
HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	242,828,250.00		
	ハンガリーフォリント 小計	11,671,000,000.00	10,007,757,716.15 (4,402,272,510)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	25,200,000.00	22,363,009.20	
	POLGB 0.75% 04/25/25	17,300,000.00	16,639,364.90	
	POLGB 0% 10/25/25	15,200,000.00	14,141,500.88	
	POLGB 1.25% 10/25/30	22,800,000.00	17,578,230.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	17,105,040.20	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	20,086,709.40	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	21,733,682.10	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	19,048,176.00	

	POLGB 2.75% 10/25/29	38,900,000.00	33,875,170.30	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,550,529.55	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	20,169,806.50	
	POLGB 6% 10/25/33	32,400,000.00	33,007,435.20	
	POLGB 7.5% 07/25/28	25,900,000.00	27,737,112.90	
	ポーランドズロチ 小計	310,550,000.00	286,035,767.13 (11,396,866,312)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,672,315.97	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	11,100,000.00	10,518,360.00	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,600,770.00	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	10,136,360.00	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,306,868.80	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,423,100.00	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,469,516.00	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,245,152.00	
	ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,520,020.00	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	10,200,000.00	8,688,989.34	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,604,355.00	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,278,684.97	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	6,500,000.00	6,424,247.57	
	ROMGB 5% 02/12/29	11,200,000.00	10,547,870.02	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	9,600,000.00	9,629,280.00	
	ROMGB 7.2% 05/31/27	3,800,000.00	3,895,233.70	
	ROMGB 7.2% 10/28/26	5,300,000.00	5,410,090.01	
	ROMGB 7.2% 10/30/33	5,300,000.00	5,506,489.59	
	ROMGB 7.35% 04/28/31	8,200,000.00	8,567,979.92	
	ROMGB 7.9% 02/24/38	6,100,000.00	6,667,544.00	
ROMGB 8.25% 09/29/32	6,800,000.00	7,464,700.00		
ROMGB 8.75% 10/30/28	7,500,000.00	8,138,388.00		
ROMGB 8% 04/29/30	7,500,000.00	7,981,462.50		
	ルーマニアレイ 小計	175,700,000.00	169,697,777.39 (5,796,214,254)	
マレーシア リングgit	MGS 2.632% 04/15/31	16,200,000.00	15,024,278.68	
	MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,610,863.24	
	MGS 3.582% 07/15/32	21,500,000.00	21,051,692.32	
	MGS 3.733% 06/15/28	43,000,000.00	43,082,224.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	26,336,142.88	
	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,156,263.25	
	MGS 3.882% 03/14/25	6,200,000.00	6,225,899.88	
	MGS 3.885% 08/15/29	51,800,000.00	52,237,342.22	
	MGS 3.899% 11/16/27	25,500,000.00	25,736,326.35	
	MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,633,080.67	
	MGS 3.906% 07/15/26	24,600,000.00	24,798,728.64	

	MGS 3.955% 09/15/25	33,900,000.00	34,140,486.60	
	MGS 4.065% 06/15/50	18,250,000.00	17,775,711.15	
	MGS 4.254% 05/31/35	13,650,000.00	14,012,726.91	
	MGS 4.457% 03/31/53	7,500,000.00	7,781,842.50	
	MGS 4.504% 04/30/29	9,400,000.00	9,738,408.46	
	MGS 4.642% 11/07/33	9,500,000.00	10,056,610.70	
	MGS 4.696% 10/15/42	26,800,000.00	28,838,458.92	
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,512,112.01	
	MGS 4.893% 06/08/38	20,200,000.00	22,074,337.80	
	MGS 4.921% 07/06/48	11,400,000.00	12,621,177.12	
	マレーシアリングット 小計	429,350,000.00	435,444,714.90 (14,502,224,962)	
タイパーツ	THAIGB 0.95% 06/17/25	172,200,000.00	169,608,820.50	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	84,000,000.00	83,557,253.64	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,065,808.86	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,198,059.14	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	138,100,000.00	131,226,419.13	
	THAIGB 1% 06/17/27	203,000,000.00	194,477,871.21	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	201,715,282.47	
	THAIGB 2.25% 03/17/27	83,000,000.00	82,643,792.22	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	141,848,474.64	
	THAIGB 2.4% 03/17/29	118,000,000.00	117,339,395.88	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	164,000,000.00	165,083,908.80	
	THAIGB 2.8% 06/17/34	60,000,000.00	59,932,822.20	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	92,343,718.10	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	102,660,722.80	
	THAIGB 2% 06/17/42	93,600,000.00	78,513,221.59	
	THAIGB 2% 12/17/31	123,000,000.00	117,039,292.08	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	152,574,720.51	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	157,000,000.00	163,778,741.90	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	140,000,000.00	145,550,062.00	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	164,468,975.16	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	114,000,000.00	116,554,865.40	
THAIGB 3.65% 06/20/31	136,500,000.00	144,918,309.90		
THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	193,272,894.00		
THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	107,696,223.32		
THAIGB 4.875% 06/22/29	169,500,000.00	188,333,806.05		
	タイパーツ 小計	3,220,300,000.00	3,224,403,461.50 (13,800,446,815)	
インドネシア アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,653,889,390.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	7,924,783,500.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	60,534,603,990.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000.00	106,938,363,100.00	

INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,630,881,280.00	
INDOGB 6.25% 06/15/36	37,800,000,000.00	36,341,196,696.00	
INDOGB 6.375% 04/15/32	63,000,000,000.00	61,448,036,580.00	
INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,217,373,045.00	
INDOGB 6.375% 08/15/28	82,500,000,000.00	81,304,574,175.00	
INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	73,933,522,980.00	
INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	53,021,200,000.00	
INDOGB 6.625% 02/15/34	82,000,000,000.00	80,920,060,000.00	
INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,815,996,200.00	
INDOGB 6.875% 04/15/29	49,000,000,000.00	49,118,335,000.00	
INDOGB 7.125% 06/15/38	24,000,000,000.00	24,484,560,000.00	
INDOGB 7.125% 06/15/42	62,800,000,000.00	64,117,500,040.00	
INDOGB 7.125% 06/15/43	28,500,000,000.00	29,057,887,500.00	
INDOGB 7.5% 04/15/40	51,000,000,000.00	53,610,868,500.00	
INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	36,531,358,430.00	
INDOGB 7.5% 06/15/35	36,700,000,000.00	38,606,752,170.00	
INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,218,993,200.00	
INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000.00	91,386,180,000.00	
INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,014,123,960.00	
INDOGB 7% 09/15/30	85,000,000,000.00	85,860,574,000.00	
INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	57,452,682,920.00	
INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,514,351,350.00	
INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,513,302,820.00	
INDOGB 8.375% 03/15/34	71,000,000,000.00	78,921,434,500.00	
INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,138,037,300.00	
INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,660,960,670.00	
INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	42,736,351,950.00	
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,117,946,940.00	
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,240,546,960.00	
インドネシアルピア 小計	1,466,800,000,000.00	1,496,987,229,146.00 (14,820,173,568)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	206,700,000.00	213,107,700.00
	SAGB 11.625% 03/31/53	35,000,000.00	32,441,500.00
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	46,059,990.00
	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	66,253,980.00
	SAGB 7% 02/28/31	122,700,000.00	100,221,360.00
	SAGB 8.25% 03/31/32	180,500,000.00	152,811,300.00
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	110,214,765.00
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	80,354,400.00
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	129,334,060.00
	SAGB 8.875% 02/28/35	230,000,000.00	187,450,000.00
	SAGB 8% 01/31/30	220,100,000.00	197,985,452.50

	SAGB 9% 01/31/40	162,300,000.00	122,812,410.00	
南アフリカランド 小計		1,782,000,000.00	1,439,046,917.50 (12,246,289,267)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,637,922.24	
	CGB 2.04% 02/25/27	26,000,000.00	26,059,280.00	
	CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,417,716.04	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,248,098.10	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,122,806.60	
	CGB 2.39% 11/15/26	2,000,000.00	2,020,739.00	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,096,934.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	16,600,000.00	16,814,384.02	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,157,497.60	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,476,440.78	
	CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,066,789.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,087,244.20	
	CGB 2.52% 08/25/33	15,700,000.00	15,919,683.82	
	CGB 2.54% 12/25/30	17,800,000.00	18,070,859.04	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	17,220,315.84	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	18,125,505.04	
	CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,611,758.90	
	CGB 2.62% 09/25/29	4,000,000.00	4,084,729.20	
	CGB 2.64% 01/15/28	23,200,000.00	23,624,736.32	
	CGB 2.67% 05/25/33	16,700,000.00	17,150,465.80	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,937,774.41	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,170,205.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,255,824.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,934,979.36	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,202,892.47	
	CGB 2.76% 05/15/32	13,000,000.00	13,392,880.80	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,365,824.80	
	CGB 2.8% 03/24/29	19,000,000.00	19,572,067.20	
	CGB 2.8% 03/25/30	9,000,000.00	9,275,307.30	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,244,756.61	
	CGB 2.85% 06/04/27	9,400,000.00	9,641,269.80	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,930,413.48	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,321,131.20	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,334,520.00	
CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,157,305.06		
CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,922,578.35		
CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,431,580.31		
CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,930,794.00		
CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	5,029,793.64		
CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,476,614.50		

	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,726,291.32	
	CGB 3.19% 04/15/53	6,200,000.00	6,947,287.24	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,099,687.92	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,664,622.20	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,839,707.64	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,484,531.40	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,149,853.99	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	15,031,269.42	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,532,092.40	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	10,299,456.64	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	10,235,564.00	
	CGB 3.81% 09/14/50	14,800,000.00	18,031,389.08	
	オフショア人民元 小計	634,300,000.00	657,584,171.08 (14,234,593,034)	
	合計		142,498,438,010 (142,498,438,010)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルリアル	国債証券 12銘柄	100.0%	10.1%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	1.9%
コロンビアペソ	国債証券 6銘柄	100.0%	4.6%
ペルーソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.4%
ウルグアイペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 23銘柄	100.0%	6.6%
ハンガリーフォリント	国債証券 18銘柄	100.0%	3.1%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	8.0%
ルーマニアレイ	国債証券 23銘柄	100.0%	4.1%
マレーシアリンギット	国債証券 21銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券 25銘柄	100.0%	9.7%
インドネシアルピア	国債証券 33銘柄	100.0%	10.4%
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 52銘柄	100.0%	10.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,403,461
コール・ローン	9,919,312
国債証券	2,483,025,369
派生商品評価勘定	3,695
未収利息	6,081,546
前払費用	850,543
流動資産合計	2,504,283,926
資産合計	2,504,283,926
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,792,123
未払金	113
未払解約金	6,128
流動負債合計	25,798,364
負債合計	25,798,364
純資産の部	
元本等	
元本	2,801,623,400
剰余金	
剰余金又は欠損金()	323,137,838
元本等合計	2,478,485,562
純資産合計	2,478,485,562
負債純資産合計	2,504,283,926

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 5月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

	2024年 5月24日現在
--	---------------

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,801,623,400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 323,137,838円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.8847円 (8,847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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2024年 5月24日現在
期首	2023年 5月25日
期首元本額	1,985,563,482円
期中追加設定元本額	838,800,892円
期中一部解約元本額	22,740,974円
期末元本額	2,801,623,400円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	118,001,238円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	2,161,306,869円
私募世界物価連動債パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	522,315,293円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,273,467
合計		4,273,467

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 5月24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	2,436,287,078	-	2,462,075,506	25,788,428
	アメリカドル	1,298,227,435	-	1,305,187,520	6,960,085
	カナダドル	42,291,693	-	42,388,307	96,614
	ユーロ	499,902,448	-	507,389,544	7,487,096
	イギリスポンド	534,081,091	-	543,954,298	9,873,207
	スウェーデンクローナ	18,010,517	-	18,465,817	455,300
	デンマーククローネ	4,238,295	-	4,297,972	59,677
	オーストラリアドル	27,398,161	-	27,869,798	471,637
	ニュージーランドドル	12,137,438	-	12,522,250	384,812
合計	2,436,287,078	-	2,462,075,506	25,788,428	

(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	TII 0.125% 01/15/30	340,000.00	367,881.82	
		TII 0.125% 01/15/31	190,000.00	199,380.56	
		TII 0.125% 01/15/32	310,000.00	299,496.59	
		TII 0.125% 02/15/51	80,000.00	55,049.78	
		TII 0.125% 02/15/52	100,000.00	63,135.64	
		TII 0.125% 04/15/26	170,000.00	192,626.50	
		TII 0.125% 04/15/27	180,000.00	185,955.60	
		TII 0.125% 07/15/26	220,000.00	272,764.12	
		TII 0.125% 07/15/30	190,000.00	205,322.06	
		TII 0.125% 07/15/31	180,000.00	182,415.64	
		TII 0.125% 10/15/25	140,000.00	162,705.45	
		TII 0.125% 10/15/26	320,000.00	346,233.41	
		TII 0.25% 02/15/50	110,000.00	80,994.15	
		TII 0.25% 07/15/29	150,000.00	166,496.04	
		TII 0.375% 01/15/27	130,000.00	158,863.37	
		TII 0.375% 07/15/25	280,000.00	358,991.77	
		TII 0.375% 07/15/27	130,000.00	156,297.10	
		TII 0.5% 01/15/28	310,000.00	367,053.55	
		TII 0.625% 01/15/26	160,000.00	202,858.10	
		TII 0.625% 02/15/43	120,000.00	121,591.24	
		TII 0.625% 07/15/32	360,000.00	343,835.72	
		TII 0.75% 02/15/42	150,000.00	160,945.16	
		TII 0.75% 02/15/45	100,000.00	98,675.55	
		TII 0.75% 07/15/28	140,000.00	164,190.30	
		TII 0.875% 01/15/29	340,000.00	395,150.38	
		TII 0.875% 02/15/47	80,000.00	77,195.78	
		TII 1.125% 01/15/33	210,000.00	201,954.33	
		TII 1.25% 04/15/28	120,000.00	119,765.37	
		TII 1.375% 02/15/44	150,000.00	171,280.36	
		TII 1.375% 07/15/33	210,000.00	202,254.22	
		TII 1.5% 02/15/53	80,000.00	70,293.69	
		TII 1.625% 10/15/27	180,000.00	185,603.44	
		TII 1.75% 01/15/28	90,000.00	131,263.18	
		TII 1.75% 01/15/34	190,000.00	185,803.01	
TII 1% 02/15/46	120,000.00	122,640.58			
TII 1% 02/15/48	110,000.00	105,926.50			
TII 1% 02/15/49	60,000.00	56,234.06			
TII 2.125% 02/15/40	70,000.00	99,469.15			

	TII 2.125% 02/15/41	100,000.00	140,435.26
	TII 2.125% 02/15/54	70,000.00	68,962.36
	TII 2.125% 04/15/29	70,000.00	70,300.18
	TII 2.375% 01/15/27	120,000.00	185,141.72
	TII 2.375% 10/15/28	180,000.00	184,784.11
	TII 2.5% 01/15/29	80,000.00	117,657.57
	TII 2% 01/15/26	110,000.00	170,740.56
	TII 3.375% 04/15/32	20,000.00	38,167.54
	TII 3.625% 04/15/28	90,000.00	181,881.80
	TII 3.875% 04/15/29	100,000.00	204,142.31
アメリカドル 小計		7,510,000.00	8,400,806.68 (1,320,270,777)
カナダドル	CANI 0.25% 12/01/54	10,000.00	7,828.06
	CANI 0.5% 12/01/50	40,000.00	36,955.37
	CANI 1.25% 12/01/47	50,000.00	58,510.90
	CANI 1.5% 12/01/44	40,000.00	52,304.57
	CANI 2% 12/01/41	30,000.00	43,903.66
	CANI 3% 12/01/36	30,000.00	52,131.88
	CANI 4.25% 12/01/26	20,000.00	38,472.17
	CANI 4% 12/01/31	40,000.00	80,659.28
カナダドル 小計		260,000.00	370,765.89 (42,430,448)
ユーロ	BTPS 1.3% 05/15/28	70,000.00	86,395.74
	BTPSI 0.1% 05/15/33	90,000.00	89,967.27
	BTPSI 0.15% 05/15/51	30,000.00	22,938.01
	BTPSI 0.4% 05/15/30	70,000.00	78,723.87
	BTPSI 0.65% 05/15/26	40,000.00	46,542.04
	BTPSI 1.25% 09/15/32	70,000.00	84,738.47
	BTPSI 1.5% 05/15/29	60,000.00	61,739.79
	BTPSI 1.8% 05/15/36	10,000.00	9,866.33
	BTPSI 2.35% 09/15/35	60,000.00	94,453.50
	BTPSI 2.4% 05/15/39	50,000.00	53,284.29
	BTPSI 2.55% 09/15/41	90,000.00	131,088.75
	BTPSI 3.1% 09/15/26	90,000.00	123,507.59
	DBRI 0.1% 04/15/26	90,000.00	110,144.59
	DBRI 0.1% 04/15/33	70,000.00	80,792.19
	DBRI 0.1% 04/15/46	70,000.00	81,554.04
	DBRI 0.5% 04/15/30	120,000.00	149,849.69
	FRTRI 0.1% 03/01/26	70,000.00	81,443.15
	FRTRI 0.1% 03/01/28	100,000.00	114,241.20
	FRTRI 0.1% 03/01/29	110,000.00	127,567.84
	FRTRI 0.1% 03/01/32	60,000.00	64,675.32
FRTRI 0.1% 03/01/36	50,000.00	51,683.73	

	FRTRI 0.1% 07/25/31	60,000.00	68,332.33
	FRTRI 0.1% 07/25/36	60,000.00	66,860.86
	FRTRI 0.1% 07/25/38	40,000.00	41,638.13
	FRTRI 0.1% 07/25/47	60,000.00	61,471.54
	FRTRI 0.1% 07/25/53	50,000.00	46,709.60
	FRTRI 0.55% 03/01/39	10,000.00	9,897.60
	FRTRI 0.6% 07/25/34	10,000.00	10,558.66
	FRTRI 0.7% 07/25/30	90,000.00	112,340.71
	FRTRI 1.8% 07/25/40	60,000.00	96,677.06
	FRTRI 1.85% 07/25/27	120,000.00	165,063.48
	FRTRI 3.15% 07/25/32	70,000.00	128,001.67
	FRTRI 3.4% 07/25/29	30,000.00	50,231.79
	SPGBEI 0.65% 11/30/27	60,000.00	73,475.38
	SPGBEI 0.7% 11/30/33	110,000.00	128,867.94
	SPGBEI 1% 11/30/30	120,000.00	149,180.19
	SPGBEI 2.05% 11/30/39	10,000.00	11,332.91
	ユーロ 小計	2,430,000.00	2,965,837.25 (503,955,065)
イギリスポ ンド	UKTI 0.125% 03/22/26	70,000.00	102,805.00
	UKTI 0.125% 03/22/29	80,000.00	127,550.48
	UKTI 0.125% 03/22/39	50,000.00	56,958.51
	UKTI 0.125% 03/22/44	70,000.00	89,267.00
	UKTI 0.125% 03/22/46	70,000.00	81,244.40
	UKTI 0.125% 03/22/51	60,000.00	56,904.57
	UKTI 0.125% 03/22/58	60,000.00	61,555.83
	UKTI 0.125% 03/22/68	70,000.00	68,569.21
	UKTI 0.125% 03/22/73	30,000.00	24,687.16
	UKTI 0.125% 08/10/28	100,000.00	136,450.37
	UKTI 0.125% 08/10/31	70,000.00	90,348.18
	UKTI 0.125% 08/10/41	50,000.00	58,408.92
	UKTI 0.125% 08/10/48	70,000.00	73,817.64
	UKTI 0.125% 11/22/36	70,000.00	95,569.50
	UKTI 0.125% 11/22/56	50,000.00	50,371.73
	UKTI 0.125% 11/22/65	40,000.00	38,154.64
	UKTI 0.25% 03/22/52	70,000.00	83,244.40
	UKTI 0.375% 03/22/62	60,000.00	71,872.55
	UKTI 0.5% 03/22/50	70,000.00	102,911.88
	UKTI 0.625% 03/22/40	80,000.00	133,434.18
	UKTI 0.625% 03/22/45	50,000.00	46,612.90
	UKTI 0.625% 11/22/42	70,000.00	115,977.84
	UKTI 0.75% 03/22/34	80,000.00	133,945.86
	UKTI 0.75% 11/22/33	70,000.00	73,544.44

	UKTI 0.75% 11/22/47	50,000.00	82,395.35
	UKTI 1.125% 11/22/37	70,000.00	137,736.20
	UKTI 1.25% 11/22/27	70,000.00	142,806.79
	UKTI 1.25% 11/22/32	60,000.00	113,335.15
	UKTI 1.25% 11/22/55	50,000.00	98,113.00
	UKTI 2% 01/26/35	50,000.00	123,270.00
	UKTI 4.125% 07/22/30	30,000.00	102,933.00
	イギリスポンド 小計	1,940,000.00	2,774,796.68 (553,655,181)
スウェーデン クローナ	SGBI 0.125% 06/01/26	140,000.00	178,817.73
	SGBI 0.125% 06/01/30	120,000.00	140,488.29
	SGBI 0.125% 06/01/32	140,000.00	176,210.32
	SGBI 0.125% 06/01/39	40,000.00	44,110.80
	SGBI 0.125% 12/01/27	140,000.00	174,776.75
	SGBI 1% 06/01/25	210,000.00	272,436.70
	SGBI 3.5% 12/01/28	150,000.00	267,077.86
	スウェーデンクローナ 小計	940,000.00	1,253,918.45 (18,357,366)
デンマーク クローネ	DGBI 0.1% 11/15/30	90,000.00	100,831.18
	DGBI 0.1% 11/15/34	80,000.00	83,334.75
	デンマーククローネ 小計	170,000.00	184,165.93 (4,193,458)
オーストラ リアドル	ACGBI 0.25% 11/21/32	60,000.00	61,277.70
	ACGBI 0.75% 11/21/27	20,000.00	24,044.90
	ACGBI 1.25% 08/21/40	20,000.00	23,214.60
	ACGBI 1% 02/21/50	30,000.00	29,097.30
	ACGBI 2.5% 09/20/30	20,000.00	30,014.10
	ACGBI 2% 08/21/35	20,000.00	27,125.10
	ACGBI 3% 09/20/25	50,000.00	74,248.25
	オーストラリアドル 小計	220,000.00	269,021.95 (27,913,717)
ニュージー ランドドル	NZGBI 2.5% 09/20/35	30,000.00	38,024.47
	NZGBI 2.5% 09/20/40	30,000.00	36,496.81
	NZGBI 2% 09/20/25	20,000.00	26,268.24
	NZGBI 3% 09/20/30	20,000.00	27,127.75
	ニューージーランドドル 小計	100,000.00	127,917.27 (12,249,357)
	合計		2,483,025,369 (2,483,025,369)

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 48銘柄	100.0%	53.2%
カナダドル	国債証券 8銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	国債証券 37銘柄	100.0%	20.3%
イギリスポンド	国債証券 31銘柄	100.0%	22.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.7%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
オーストラリアドル	国債証券 7銘柄	100.0%	1.1%
ニュージーランドドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.5%

(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 - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 5月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,316,012,489
投資証券	119,721,919,200
派生商品評価勘定	117,598,460
未収入金	65,600,296
未収配当金	812,508,099
未収利息	8,034
差入委託証拠金	281,022,389
流動資産合計	125,314,668,967
資産合計	125,314,668,967
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,324,690
前受金	95,923,870
未払金	79,626,941
未払解約金	205,354,219
流動負債合計	403,229,720
負債合計	403,229,720
純資産の部	
元本等	
元本	60,321,849,248
剰余金	
剰余金又は欠損金()	64,589,589,999
元本等合計	124,911,439,247
純資産合計	124,911,439,247
負債純資産合計	125,314,668,967

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 5月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2024年 5月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	60,321,849,248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) 2.0707円 (20,707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 5月24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 5月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2024年 5月24日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	64,195,508,562円
期中追加設定元本額	14,257,975,641円
期中一部解約元本額	18,131,634,955円
期末元本額	60,321,849,248円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,835,686,750円
SBI資産設計オープン（分配型）	7,017,462円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,694,500,614円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	30,620,572,487円
コア投資戦略ファンド（安定型）	994,368,691円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,667,921,955円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	2,029,781,182円
コア投資戦略ファンド（切替型）	749,595,751円
SMT インデックスバランス・オープン	24,347,891円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	211,531,584円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,229,352円
グローバル経済コア	430,351,333円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,167,052円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	558,100,289円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	142,018,424円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	1,069,263,811円
10資産分散投資ファンド	33,159,984円
グローバル10資産バランスファンド	41,779,153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）	345,203,810円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	14,532,566円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	958,035,867円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	73,049,915円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	497,337,313円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	274,176,146円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	3,355,763,810
合計	3,355,763,810

(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 5月24日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	5,085,668,630	-	5,181,592,500	95,923,870
合計		5,085,668,630	-	5,181,592,500	95,923,870

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,418	299,590,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,811	335,749,100	
	S O S i L A 物流リート投資法人	5,935	719,322,000	
	東海道リート投資法人	2,032	254,406,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	4,107	2,739,369,000	
	森ヒルズリート投資法人	13,988	1,842,219,600	
	産業ファンド投資法人	21,667	2,727,875,300	
	アドバンス・レジデンス投資法人	11,671	3,950,633,500	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	6,241	2,399,664,500	
	G L P 投資法人	39,956	5,246,222,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,849	1,953,566,000	
	日本プロロジスリート投資法人	20,722	5,329,698,400	
	星野リゾート・リート投資法人	2,195	1,237,980,000	
	O n e リート投資法人	2,075	543,027,500	
	イオンリート投資法人	14,592	1,948,032,000	
	ヒューリックリート投資法人	11,129	1,641,527,500	
	日本リート投資法人	3,864	1,327,284,000	
	積水ハウス・リート投資法人	35,745	2,895,345,000	
	トーセイ・リート投資法人	2,505	348,946,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	2,933	383,343,100	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,241	356,834,100		
野村不動産マスターファンド投資法人	38,467	5,531,554,600		
いちごホテルリート投資法人	1,971	222,328,800		
ラサールロジポート投資法人	15,206	2,305,229,600		

スターアジア不動産投資法人	18,333	1,121,979,600	
マリモ地方創生リート投資法人	1,833	243,422,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,948	2,152,380,000	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	1,819	139,517,300	
投資法人みらい	16,324	740,293,400	
三菱地所物流リート投資法人	4,108	1,598,012,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,121	748,178,100	
ザイマックス・リート投資法人	1,929	238,231,500	
タカラレーベン不動産投資法人	6,337	641,304,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,212	636,906,400	
日本ビルファンド投資法人	13,877	7,882,136,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	12,219	6,231,690,000	
日本都市ファンド投資法人	57,018	5,285,568,600	
オリックス不動産投資法人	23,702	3,827,873,000	
日本プライムリアルティ投資法人	8,135	2,708,955,000	
N T T 都市開発リート投資法人	12,060	1,447,200,000	
東急リアル・エステート投資法人	7,975	1,261,645,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	8,784	891,576,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,609	3,922,166,600	
森トラストリート投資法人	22,929	1,621,080,300	
インヴィンシブル投資法人	57,595	4,014,371,500	
フロンティア不動産投資法人	4,414	2,006,163,000	
平和不動産リート投資法人	8,888	1,207,879,200	
平和不動産リート投資法人	90	11,930,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,593	2,077,444,800	
福岡リート投資法人	6,152	997,854,400	
K D X 不動産投資法人	34,232	5,186,148,000	
いちごオフィスリート投資法人	9,747	813,874,500	
大和証券オフィス投資法人	2,464	1,431,584,000	
阪急阪神リート投資法人	5,672	778,765,600	
スターツプロシード投資法人	2,062	428,071,200	
大和ハウスリート投資法人	17,931	4,554,474,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,820	3,213,474,000	
大和証券リビング投資法人	17,517	1,851,546,900	
ジャパンエクセレント投資法人	10,338	1,268,472,600	
合計	756,107	119,721,919,200	

(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 5月24日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	445,794,525
コール・ローン	165,642,502
投資証券	117,425,833,582
派生商品評価勘定	3,244
未収入金	11,298,744
未収配当金	161,055,638
未収利息	308
流動資産合計	118,209,628,543
資産合計	118,209,628,543
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	61,180
未払解約金	195,475,558
流動負債合計	195,536,738
負債合計	195,536,738
純資産の部	
元本等	
元本	40,273,482,755
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	77,740,609,050
元本等合計	118,014,091,805
純資産合計	118,014,091,805
負債純資産合計	118,209,628,543

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 5月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p>

	2024年 5月24日現在
	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 5月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,273,482,755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) 2.9303円 (29,303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 5月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 5月24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 5月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年 5月25日
期首元本額		36,697,065,105円

区分	2024年 5月24日現在
期中追加設定元本額	11,033,671,204円
期中一部解約元本額	7,457,253,554円
期末元本額	40,273,482,755円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	52,519,744円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	87,964,983円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,511,824,483円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,874,429円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,053,183,148円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,288,404,458円
コア投資戦略ファンド（安定型）	448,238,308円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,264,283,849円
分散投資コア戦略ファンドA	942,204,271円
分散投資コア戦略ファンドS	1,481,866,335円
コア投資戦略ファンド（切替型）	551,271,242円
SMT インデックスバランス・オープン	112,137,175円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,782,592円
グローバル経済コア	322,513,259円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,414,157円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	423,012,432円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	107,663,726円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	278,521,966円
10資産分散投資ファンド	17,591,029円
グローバル10資産バランスファンド	31,261,350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）	1,113,609,105円
FOS用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	209,209,626円
FOS用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	112,522,429円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	57,468,175円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	46,459,792円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	89,136,147円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	86,957,205円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	86,582,627円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	87,023,198円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	86,160,305円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	74,224,050円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	55,382,324円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 5月24日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券		10,701,720,331
合計		10,701,720,331

(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 5月24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	61,665,320	-	61,668,564	3,244
	アメリカドル	50,259,200	-	50,260,640	1,440

オーストラリアドル	11,406,120	-	11,407,924	1,804
売建	38,591,680	-	38,652,860	61,180
アメリカドル	31,360,000	-	31,412,900	52,900
香港ドル	7,231,680	-	7,239,960	8,280
合計	100,257,000	-	100,321,424	57,936

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	56,433	937,352.13	
		AGREE REALTY CORP	57,588	3,397,692.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,332	714,111.36	
		ALEXANDER'S INC	1,336	280,292.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,101	10,685,077.59	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	86,754.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	608,073.68	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	181,189	6,535,487.23	
		AMERICOLD REALTY TRUST	152,253	3,845,910.78	
		APARTMENT INCOME REIT CO	81,449	3,149,632.83	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	70,959	572,639.13	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	118,612	1,700,896.08	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	35,039	395,239.92	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	21,420.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	80,963	15,703,583.48	
		BOSTON PROPERTIES	82,170	4,910,479.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	78,925.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	107,226	492,167.34	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	171,636	3,753,679.32	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	104,379	1,587,604.59	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	85,600.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	60,693	6,312,678.93	
		CARETRUST REIT INC	75,746	1,914,101.42	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	14,237	306,237.87			

CENTERSPACE	8,999	601,313.18	
CHATHAM LODGING TRUST	25,562	218,810.72	
CITY OFFICE REIT INC	15,298	72,053.58	
CLIPPER REALTY INC	7,300	27,521.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	342,892.20	
COPT DEFENSE PROPERTIES	62,548	1,504,279.40	
COUSINS PROPERTIES INC	85,700	1,958,245.00	
CTO REALTY GROWTH INC	12,400	217,372.00	
CUBESMART	127,882	5,376,159.28	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	123,244	1,032,784.72	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	368,800	226,812.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	184,314	26,218,666.50	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	267,472.00	
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	91,870	1,231,058.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,918	673,007.16	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	27,065	4,353,946.55	
ELME COMMUNITIES	50,407	802,983.51	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	75,879	684,428.58	
EPR PROPERTIES	41,990	1,699,755.20	
EQUINIX INC	53,585	41,128,095.05	
EQUITY COMMONWEALTH	59,311	1,139,364.31	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	106,209	6,616,820.70	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	197,133	12,888,555.54	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	90,564	2,434,360.32	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,819	9,498,197.43	
EXTRA SPACE STORAGE INC	120,555	17,194,759.65	
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	306,600.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	41,832	4,126,726.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,446	3,490,886.42	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	50,711	1,219,599.55	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	86,888.97	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	152,126	6,769,607.00	
GETTY REALTY CORP	27,420	749,114.40	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	21,056	297,942.40	
GLADSTONE LAND CORP	16,220	216,212.60	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	327,270.06	
GLOBAL NET LEASE INC	105,265	785,276.90	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	218,544	3,400,544.64	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	402,124	7,656,440.96	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	61,902	1,567,977.66	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	405,640	7,362,366.00	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,572	324,871.36	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	126,789	2,103,429.51	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	127,523.27	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	16,461	1,777,129.56	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,939	974,910.99	
INVITATION HOMES INC	328,936	11,354,870.72	
IRON MOUNTAIN INC	166,732	13,218,512.96	
JBG SMITH PROPERTIES	47,755	669,525.10	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	49,006.10	
KILROY REALTY CORPORATION	62,244	2,022,930.00	
KIMCO REALTY CORP	379,605	7,049,264.85	
KITE REALTY GROUP TRUST	126,646	2,659,566.00	
LTC PROPERTIES INC	22,450	767,116.50	
LXP INDUSTRIAL TRUST	162,604	1,385,386.08	
MACERICH CO/THE	126,143	1,879,530.70	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	57,626.31	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	333,202	1,679,338.08	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	66,945	8,898,329.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,694	1,608,090.12	
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,315	1,635,095.85	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	195,413.20	
NETSTREIT CORP	41,151	715,204.38	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,156	85,465.24	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	496,044.80	
NNN REIT INC	103,860	4,269,684.60	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	52,298.64	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	139,420	4,366,634.40	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	199,324.82	
ORION OFFICE REIT INC	34,844	120,560.24	
PARAMOUNT GROUP INC	100,128	447,572.16	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	119,531	1,900,542.90	
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	243,960.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	1,012,749.10	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	69,768	2,199,785.04	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	69,983	491,980.49	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	21,712	443,141.92	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	176,624.00	
PRIME US REIT	324,500	40,238.00	
PROLOGIS INC	527,365	55,710,838.60	
PUBLIC STORAGE	90,452	24,816,410.72	
REALTY INCOME CORP	474,669	24,829,935.39	

REGENCY CENTERS CORP	93,444	5,538,425.88
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	74,747	913,408.34
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	119,841	5,278,996.05
RLJ LODGING TRUST	86,118	867,208.26
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	34,031	3,505,873.62
SABRA HEALTH CARE REIT INC	130,495	1,846,504.25
SAFEHOLD INC	23,595	455,383.50
SAUL CENTERS INC	6,846	250,221.30
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	484,140.82
SIMON PROPERTY GROUP	186,018	26,909,363.88
SITE CENTERS CORP	106,031	1,503,519.58
SL GREEN REALTY CORP	37,677	1,888,748.01
STAG INDUSTRIAL INC	103,605	3,639,643.65
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	409,071.04
SUN COMMUNITIES INC	71,463	8,454,072.90
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	114,627	1,180,658.10
TANGER INC	61,543	1,662,276.43
TERRENO REALTY CORP	53,330	3,018,478.00
UDR INC	172,399	6,690,805.19
UMH PROPERTIES INC	33,009	496,125.27
UNITI GROUP INC	142,514	464,595.64
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	287,679.13
URBAN EDGE PROPERTIES	65,756	1,121,797.36
VENTAS INC	230,413	10,873,189.47
VERIS RESIDENTIAL INC	47,792	717,835.84
VICI PROPERTIES INC	590,189	16,879,405.40
VORNADO REALTY TRUST	90,043	2,105,205.34
WELLTOWER INC	315,898	31,577,164.08
WHITESTONE REIT	25,954	327,020.40
WP CAREY INC	124,616	7,144,235.28
XENIA HOTELS & RESORTS INC	62,425	885,186.50
アメリカドル 小計	14,833,936	575,281,505.25 (90,411,241,365)
カナダドル		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	638,282.26
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	194,112.00
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,593	969,724.62
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	151,050.00
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	65,000.00
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	46,706	2,083,554.66
CHOICE PROPERTIES REIT	90,496	1,173,733.12
	26,577	342,045.99

	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	373,523.10	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	73,332	926,916.48	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	47,614.96	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,799	881,434.75	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,458	1,201,110.40	
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	720,000.17	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	513,247.16	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	618,691.80	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	164,391.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	6,956	107,191.96	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	113,226.05	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,872	298,481.04	
	PRIMARIS REIT	30,375	405,810.00	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	81,760.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	87,939	1,535,414.94	
	SLATE GROCERY REIT	16,578	183,352.68	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	44,127	997,270.20	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,486	38,893.62	
	カナダドル 小計	901,557	14,825,832.96 (1,696,668,323)	
ユーロ	AEDIFICA	26,505	1,563,795.00	
	ALTAREA	2,775	285,825.00	
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	337,354.38	
	CARMILA	32,392	548,072.64	
	COFINIMMO	21,600	1,276,560.00	
	COVIVIO(FP)	27,273	1,348,377.12	
	CROMWELL REIT EUR	170,400	250,488.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	25,490	578,623.00	
	GECINA SA	29,616	2,921,618.40	
	HAMBORNER REIT AG	37,000	243,460.00	
	ICADE	17,487	486,838.08	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	63,052.14	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	153,544	935,850.68	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	270,000	266,220.00	
	KLEPIERRE	112,276	2,842,828.32	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,400	254,526.00	
	MERCIALYS	53,414	597,168.52	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	190,427	2,022,334.74	

	MONTEA NV	9,926	840,732.20
	NSI NV	7,359	140,556.90
	RETAIL ESTATES	6,645	463,821.00
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	17,995	733,296.25
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	57,448	4,552,179.52
	VASTNED RETAIL	10,650	254,002.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	100,084	2,718,281.44
	WERELDHAVE NV	24,249	331,726.32
	XIOR STUDENT HOUSING NV	18,383	533,107.00
	ユーロ 小計	1,515,015	27,390,695.15 (4,654,226,919)
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	120,899.41
	AEW UK REIT PLC	68,000	57,596.00
	ASSURA PLC	1,624,807	652,847.45
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	297,044.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	111,609	1,361,629.80
	BRITISH LAND CO PLC	542,437	2,164,323.63
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	67,164.76
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	171,021.48
	DERWENT LONDON PLC	64,392	1,428,214.56
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	316,908	286,167.92
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	143,805	599,666.85
	HAMMERSON PLC	2,355,550	643,065.15
	HELICAL PLC	65,400	151,074.00
	HOME REIT PLC	374,236	142,396.79
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	242,293	209,825.73
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	431,966	2,788,340.53
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	62,282.17
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,182,035	2,375,890.35
	NEWRIVER REIT PL	196,000	143,276.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	236,640.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	730,219	669,245.71
	PRS REIT PLC/THE	260,002	205,141.57
	REGIONAL REIT LTD	222,000	51,393.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,385	1,066,367.22
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	215,000	92,880.00
	SEGRO PLC	763,335	6,842,534.94
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,088,715	1,513,313.85	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	668,157	491,095.39	
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	347,000	263,026.00	

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	120,345.31
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,271,334	1,952,769.02
	UNITE GROUP PLC	228,857	2,111,205.82
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	261,651	309,271.48
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	194,582.56
	WORKSPACE GROUP PLC	83,057	450,168.94
	イギリスポンド 小計	16,390,370	30,301,977.39 (6,046,153,548)
オーストラ リアドル	ABACUS GROUP	224,474	259,267.47
	ABACUS STORAGE KING	347,779	413,857.01
	ARENA REIT	192,648	728,209.44
	BWP TRUST	309,156	1,140,785.64
	CENTURIA CAPITAL GROUP	491,955	863,381.02
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	1,016,995.41
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	248,793.38
	CHARTER HALL GROUP	263,653	3,385,304.52
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	376,694	1,322,195.94
	CHARTER HALL RETAIL REIT	307,930	1,046,962.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	531,639.02
	CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	314,636.80
	DEXUS	623,457	4,351,729.86
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	345,780.00
	GDI PROPERTY GROUP	315,597	190,936.18
	GOODMAN GROUP	986,584	33,711,575.28
	GPT GROUP	1,097,901	4,742,932.32
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	334,532.10
	HEALTHCO REIT	300,321	346,870.75
	HMC CAPITAL LTD	128,494	889,178.48
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	985,745	1,227,252.52
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	102,706	336,875.68
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	207,805	1,001,620.10
	MIRVAC GROUP	2,269,400	4,606,882.00
	NATIONAL STORAGE REIT	750,136	1,635,296.48
	REGION RE GROUP	676,974	1,448,724.36
RURAL FUNDS GROUP	222,079	448,599.58	
SCENTRE GROUP	2,955,904	9,340,656.64	
STOCKLAND	1,360,265	6,121,192.50	
VICINITY CENTERS	2,179,714	4,239,543.73	
WAYPOINT REIT LTD	398,821	965,146.82	
	オーストラリアドル 小計	19,728,326	87,557,353.03 (9,084,950,950)
ニュージ ランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	507,278	545,323.85
	GOODMAN PROPERTY TRUST	585,524	1,282,297.56

	KIWI PROPERTY GROUP LTD	923,753	771,333.75	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	877,392	1,009,000.80	
ニュージーランドドル 小計		2,893,947	3,607,955.96	(345,497,862)
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	2,065,590.00	
	FORTUNE REIT	875,000	3,605,000.00	
	LINK REIT	1,458,800	48,869,800.00	
	PROSPERITY REIT	752,000	1,060,320.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,026,630.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,358,926.40	
香港ドル 小計		6,120,460	57,986,266.40	(1,166,683,679)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	482,473.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,039,418	5,424,851.88	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,358,877	1,229,783.68	
	CAPITALAND CHINA TRUST	643,221	437,390.28	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,899,144	5,769,296.56	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	389,942.00	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-LOGOS REIT	3,505,364	999,028.74	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	334,800.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	628,862	1,370,919.16	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,611,896	1,603,836.52	
	KEPPEL DC REIT	799,503	1,447,100.43	
	KEPPEL REIT	1,231,400	1,071,318.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL TRUST	909,950	505,022.25	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,223,263	2,703,411.23	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,875,485	2,588,169.30	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	1,283,473	1,578,671.79	
	PARAGON REIT	761,500	651,082.50	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE TRUST	233,000	838,800.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	295,800	199,665.00	
STARHILL GLOBAL REIT	863,000	409,925.00		
SUNTEC REIT	1,320,500	1,439,345.00		
シンガポールドル 小計		24,981,456	31,521,536.92	(3,664,378,666)
韓国ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	100,816,800.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	86,720	412,353,600.00	
	JR REIT XXVII	95,683	394,213,960.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	124,240,205.00	
	LOTTE REIT CO LTD	72,480	240,633,600.00	

	NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	54,190,125.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	46,380	295,440,600.00	
	SK REITS CO LTD	75,914	326,050,630.00	
	韓国ウォン 小計	445,799	1,947,939,520.00 (223,818,250)	
イスラエル シェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	598,680.00	
	REIT 1 LTD	103,500	1,429,335.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	155,000	1,069,500.00	
	イスラエルシェケル 小計	618,500	3,097,515.00 (132,214,020)	
	合計	88,429,366	117,425,833,582 (117,425,833,582)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 138銘柄	100.0%	77.0%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	4.0%
イギリスポンド	投資証券 36銘柄	100.0%	5.1%
オーストラリアドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.7%
ニュージーランドドル	投資証券 4銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.0%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.1%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(2024年5月25日から2024年11月24日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

【10 資産分散投資ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2024年 5月24日現在)	第3期中間計算期間 (2024年11月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,276,778	25,967,382
親投資信託受益証券	2,519,820,556	2,575,066,665
未収入金	4,092,460	357,916
未収利息	48	460
流動資産合計	2,550,189,842	2,601,392,423
資産合計	2,550,189,842	2,601,392,423
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,935,360	359,722
未払受託者報酬	349,464	427,168
未払委託者報酬	1,514,305	1,851,011
その他未払費用	58,188	71,136
流動負債合計	4,857,317	2,709,037
負債合計	4,857,317	2,709,037
純資産の部		
元本等		
元本	2,268,369,129	2,286,590,265
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	276,963,396	312,093,121
（分配準備積立金）	216,478,131	208,980,882
元本等合計	2,545,332,525	2,598,683,386
純資産合計	2,545,332,525	2,598,683,386
負債純資産合計	2,550,189,842	2,601,392,423

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2023年 5月25日 至 2023年11月24日	第3期中間計算期間 自 2024年 5月25日 至 2024年11月24日
営業収益		
受取利息	43	21,189
有価証券売買等損益	64,812,930	35,303,692
営業収益合計	64,812,973	35,324,881
営業費用		
支払利息	4,946	-
受託者報酬	283,646	427,168
委託者報酬	1,229,095	1,851,011
その他費用	47,211	71,136
営業費用合計	1,564,898	2,349,315
営業利益又は営業損失（ ）	63,248,075	32,975,566
経常利益又は経常損失（ ）	63,248,075	32,975,566
中間純利益又は中間純損失（ ）	63,248,075	32,975,566
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	676,747	813,583
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	32,595,039	276,963,396
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,900,679	12,763,600
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,900,679	12,763,600
剰余金減少額又は欠損金増加額	928,026	9,795,858
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	928,026	9,795,858
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	98,139,020	312,093,121

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第2期 (2024年 5月24日現在)	第3期中間計算期間 (2024年11月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,268,369,129口	2,286,590,265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) 1,1221円 (11,221円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,1365円 (11,365円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第3期中間計算期間 (2024年11月24日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第2期 自 2023年 5月25日 至 2024年 5月24日	第3期中間計算期間 自 2024年 5月25日 至 2024年11月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,607,741,633円	2,268,369,129円
期中追加設定元本額	790,951,104円	98,374,883円
期中一部解約元本額	130,323,608円	80,153,747円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年11月24日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,688,214,199
株式	677,245,438,330
派生商品評価勘定	299,724,700
未収入金	38,982,000
未収配当金	6,567,280,820
未収利息	27,742
差入委託証拠金	709,481,902
流動資産合計	689,549,149,693
資産合計	689,549,149,693
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,675,450
前受金	277,285,200
未払解約金	94,741,088
流動負債合計	394,701,738
負債合計	394,701,738
純資産の部	
元本等	
元本	243,406,021,052
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	445,748,426,903
元本等合計	689,154,447,955
純資産合計	689,154,447,955
負債純資産合計	689,549,149,693

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,406,021,052口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.8313円 (1万口当たり純資産額) (28,313円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

2024年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	233,105,572,904円
期中追加設定元本額	22,037,499,026円
期中一部解約元本額	11,737,050,878円
期末元本額	243,406,021,052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）	261,278,548円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,245,280,726円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,073,425円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,435,907,184円
世界経済インデックスファンド	6,800,175,544円
日本株式インデックス・オープン	2,715,838,838円
DCマイセレクション25	4,738,261,395円
DCマイセレクション50	16,221,262,894円
DCマイセレクション75	18,528,461,607円
DC日本株式インデックス・オープン	5,948,928,196円
DCマイセレクションS25	3,023,557,158円
DCマイセレクションS50	9,704,501,968円
DCマイセレクションS75	9,202,969,760円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,622,278,684円
DCターゲット・イヤーフンド2025	36,378,128円
DCターゲット・イヤーフンド2035	545,085,158円
DCターゲット・イヤーフンド2045	451,638,366円
DC世界経済インデックスファンド	3,684,204,071円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	343,354,794円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,597,858円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,946,444円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,727,486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）	94,677,357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）	10,788,877円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	43,176,241円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,119,749円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,336,284円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	312,310,241円

区分	2024年11月24日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	276,300,900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)	25,690,546円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	8,295,524円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	279,076,956円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	149,810,795円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	208,949,859円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	15,711,647円
F O F s用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	357,712,416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	1,860,203,133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
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	701,591,955円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	423,467,158円
コア投資戦略ファンド(切替型)	553,090,106円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	188,646,594円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,691,509円
S M T インデックスバランス・オープン	46,151,420円
国内株式S M T Bセクション(S M A専用)	17,217,067,833円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	188,949,882円
S M T 世界経済インデックス・オープン	59,887,214円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	274,375,026円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	44,210,733円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	13,098,151円
グローバル経済コア	303,237,408円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	36,040,648円
M y S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	3,202,583,097円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	29,422,136円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	503,973,750円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	131,503,154円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	67,783,215円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	70,954,568円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	32,704,603円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	42,485,680円
10資産分散投資ファンド	113,799,444円
グローバル10資産バランスファンド	50,698,857円
D C世界経済インデックスファンド(株式特化型)	2,358,473円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	344,650円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	41,045円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	256,962円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	61,505円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	96,976円
D C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
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	61,143円
D CマイセクションS50(2024-2026リスク抑制型)	4,411,242円
F O F s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)	43,833,404,919円
F O F s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)	227,577,644円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	305,604,479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)	21,881,614円
S M T A M日本株式インデックスファンドV L - P(適格機関投資家専用)	51,552,339,803円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,282,458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)	228,964,727円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年11月24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	11,299,279,800	-	11,576,565,000	277,285,200
合計		11,299,279,800	-	11,576,565,000	277,285,200

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年11月24日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,746,598,297
コール・ローン	439,890,140
株式	813,076,091,614
投資信託受益証券	118,987,737
投資証券	15,571,191,187
派生商品評価勘定	324,534,162
未収入金	3,041,432
未収配当金	846,426,123
未収利息	2,603
差入委託証拠金	8,489,774,847
流動資産合計	843,616,538,142
資産合計	843,616,538,142
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	84,807,882
前受金	240,310,506
未払解約金	206,443,216
流動負債合計	531,561,604
負債合計	531,561,604
純資産の部	
元本等	
元本	117,275,298,332
剰余金	
剰余金又は欠損金()	725,809,678,206
元本等合計	843,084,976,538
純資産合計	843,084,976,538
負債純資産合計	843,616,538,142

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2024年11月24日現在	
	<p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,275,298,332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 7.1889円 (1万口当たり純資産額) (71,889円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券

2024年11月24日現在	
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、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>

(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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	115,374,339,720円
期中追加設定元本額	8,017,212,517円
期中一部解約元本額	6,116,253,905円
期末元本額	117,275,298,332円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,340,539,612円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,066,077円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,321,644,668円
世界経済インデックスファンド	15,174,311,883円
外国株式インデックス・オープン	858,188,604円
DCマイセクション25	509,969,335円
DCマイセクション50	2,894,530,356円
DCマイセクション75	3,853,882,106円
DC外国株式インデックス・オープン	13,512,988,139円
DCマイセクションS25	322,562,463円
DCマイセクションS50	1,762,637,720円
DCマイセクションS75	1,929,277,983円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,834,819円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	116,638,389円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	96,651,552円
DC世界経済インデックスファンド	8,634,688,598円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	811,251,933円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,453,662円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,500,900円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	12,048,489円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	4,201,171円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	17,195,492円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	5,276,097円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	16,223,197円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	86,326,552円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	97,313,455円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	777,473,771円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	52,016,097円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	10,070,336円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	84,701,564円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	26,632,633円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	627,958,922円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	631,685,398円

区分	2024年11月24日現在
外国株式ファンド・シリーズ1	1,144,762,684円
コア投資戦略ファンド（安定型）	125,404,541円
コア投資戦略ファンド（成長型）	310,144,127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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,556,201,233円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	951,248,541円
コア投資戦略ファンド（切替型）	130,381,994円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	416,179,397円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,558,071円
SMT インデックスバランス・オープン	96,821,058円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	69,496,181円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	6,205,772,915円
SMT 世界経済インデックス・オープン	257,421,617円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,307,378,867円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	213,004,526円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,629,862円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	3,133,768,195円
グローバル経済コア	701,495,917円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,280,189円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,296,129円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	126,983,021円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,310,017円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	174,542,523円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	182,836,307円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	83,752,634円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	109,860,655円
10資産分散投資ファンド	58,429,941円
グローバル10資産バランスファンド	20,495,668円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	5,394,140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	213,369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	26,626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	164,448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	40,072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	61,397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	38,035円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	456,112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）	50,710,788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）	486,207,914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）	684,029,046円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,476,923,423円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,294,238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）	54,550,137円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,234,574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）	92,561,996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）	144,262,347円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	143,733,691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）	43,648,234円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	91,446,102円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年11月24日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建	14,111,821,150	-	14,352,131,656	240,310,506
合計		14,111,821,150	-	14,352,131,656	240,310,506

(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11月24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	385,165,600	-	384,581,374	584,226
	アメリカドル	385,165,600	-	384,581,374	584,226
	合計	385,165,600	-	384,581,374	584,226

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,041,397,886
コール・ローン	209,175,556
株式	212,000,672,116
投資信託受益証券	452,570,335
投資証券	202,835,170
派生商品評価勘定	349,434
未収配当金	229,308,169
未収利息	1,237
前払金	368,318,508
差入委託証拠金	1,648,974,522
流動資産合計	225,153,602,933
資産合計	225,153,602,933
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	369,446,953
未払金	53,417,105
未払解約金	8,841,285
流動負債合計	431,705,343
負債合計	431,705,343

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	48,167,693,720
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	176,554,203,870
元本等合計	224,721,897,590
純資産合計	224,721,897,590
負債純資産合計	225,153,602,933

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		2024年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		48,167,693,720口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.6654円 (46,654円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2024年11月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	45,060,646,602円
期中追加設定元本額	4,575,673,091円
期中一部解約元本額	1,468,625,973円
期末元本額	48,167,693,720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	6,952,186,113円
世界経済インデックスファンド	13,646,367,800円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,401,120,448円
DC 世界経済インデックスファンド	7,855,421,266円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	87,177,796円
コア投資戦略ファンド（安定型）	60,606,383円
コア投資戦略ファンド（成長型）	149,892,084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）	1,400,809,569円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	818,891,799円
コア投資戦略ファンド（切替型）	64,027,692円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	369,184,367円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,634,196円
SMT インデックスバランス・オープン	87,249,021円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	34,032,360円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	3,027,627,488円
SMT 世界経済インデックス・オープン	293,688,439円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,456,963,963円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	235,089,319円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,005,196円

区分	2024年11月24日現在
グローバル経済コア	647,979,985円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	603,282,263円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	64,535,900円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	17,064,297円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	127,008,709円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	132,985,652円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	60,906,120円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	79,886,596円
10資産分散投資ファンド	18,029,761円
グローバル10資産バランスファンド	29,427,085円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	5,008,027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
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,631,681,363円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	117,181,748円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,001,235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）	14,925,624円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	22,236,563円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年11月24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	12,444,684,631	-	12,076,366,123	368,318,508
合計		12,444,684,631	-	12,076,366,123	368,318,508

（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11月24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	212,851,032	-	211,838,477	1,012,555
	アメリカドル	212,851,032	-	211,838,477	1,012,555
	売建	20,589,032	-	20,355,488	233,544
	ブラジルリアル	20,589,032	-	20,355,488	233,544
合計		233,440,064	-	232,193,965	779,011

（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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年11月24日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	550,003,266
国債証券	565,000,633,740
地方債証券	34,865,253,730
特殊債券	36,513,437,614
社債券	31,931,836,000
未収入金	4,141,614,500
未収利息	1,442,034,901
前払費用	67,789,941
流動資産合計	674,512,603,692
資産合計	674,512,603,692
負債の部	
流動負債	
未払金	2,180,686,900
未払解約金	3,379,214,634
流動負債合計	5,559,901,534
負債合計	5,559,901,534
純資産の部	
元本等	
元本	514,134,148,076
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,818,554,082
元本等合計	668,952,702,158
純資産合計	668,952,702,158
負債純資産合計	674,512,603,692

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	514,134,148,076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 98,263,000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 1.3011円 (1万口当たり純資産額) (13,011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）
金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動	区分	2024年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2024年 5月25日
期首元本額		504,887,869,424円
期中追加設定元本額		48,161,118,545円
期中一部解約元本額		38,914,839,893円
期末元本額		514,134,148,076円
期末元本額の内訳		
エマージング株式オープン		2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）		5,127,578,496円
S B I 資産設計オープン（分配型）		19,706,465円
S M T 国内債券インデックス・オープン		17,202,179,602円
世界経済インデックスファンド		9,416,213,328円
D C マイセレクション 2 5		29,665,926,763円
D C マイセレクション 5 0		37,874,704,359円
D C マイセレクション 7 5		12,895,486,029円
D C 日本債券インデックス・オープン		399,640,168円
D C 日本債券インデックス・オープン S		86,145,403,459円
D C 日本債券インデックス・オープン P		59,818,836,308円
D C マイセレクション S 2 5		18,832,976,159円
D C マイセレクション S 5 0		23,094,514,703円
D C マイセレクション S 7 5		6,402,509,015円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5		231,440,992円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5		3,193,734,267円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5		1,332,861,962円
D C 世界経済インデックスファンド		6,860,376,918円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）		1,745,889円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）		19,831,239円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）		9,434,268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）		48,777,128円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）		79,894,559円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）		27,252,803円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）		24,442,859円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）		1,544,059,035円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）		736,599,411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）		66,704,696円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）		39,425,625円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）		879,410,435円

区分	2024年11月24日現在
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	952,009,460円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,318,460,445円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	91,358,108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	15,029,347,456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
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	358,861,400円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,270,385,522円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,406,364円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,450,464円
SMT インデックスバランス・オープン	65,748,229円
SMT 世界経済インデックス・オープン	79,123,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	174,706,693円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	259,747,779円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	23,727,753円
グローバル経済コア	452,178,797円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	59,526,086円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	42,879,356円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	222,570,499円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	133,659,083円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	40,941,717円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	33,624,450円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,441,283,842円
10資産分散投資ファンド	480,144,943円
グローバル10資産バランスファンド	727,120,242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	1,788,758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	180,733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	930,670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	230,045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	412,549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	785,129円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	85,207,833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）	111,557,646,218円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	55,750,797円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,567,484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）	664,055,442円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,046,881,398
コール・ローン	1,838,664,790
国債証券	364,433,753,427
派生商品評価勘定	424,008
未収利息	2,558,215,229
前払金	5,873,213
前払費用	284,204,536
差入委託証拠金	213,189,400
流動資産合計	370,381,206,001
資産合計	370,381,206,001

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,997,099
未払金	4,346,309
未払解約金	46,845,050
流動負債合計	68,188,458
負債合計	68,188,458
純資産の部	
元本等	
元本	101,672,882,744
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	268,640,134,799
元本等合計	370,313,017,543
純資産合計	370,313,017,543
負債純資産合計	370,381,206,001

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,672,882,744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 3.6422円 (1万口当たり純資産額) (36,422円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2024年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	95,258,832,835円
期中追加設定元本額	10,146,764,574円
期中一部解約元本額	3,732,714,665円
期末元本額	101,672,882,744円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,059,773,797円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	449,944,985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）	2,365,858,115円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,900,755円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,381,959,192円
世界経済インデックスファンド	25,958,376,301円
DCマイセレクション25	1,795,742,531円
DCマイセレクション50	1,709,851,998円
DCマイセレクション75	1,366,501,160円
DC外国債券インデックス・オープン	2,213,171,401円
DCマイセレクションS25	1,136,452,014円
DCマイセレクションS50	1,022,644,525円
DCマイセレクションS75	678,736,521円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,133,286円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,265,764円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,842,107円
DC世界経済インデックスファンド	16,195,219,372円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	794,512,396円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	906,751円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	986,557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）	7,648,924円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	19,381,956円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	33,967,294円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	48,676,880円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	49,895,171円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	542,940,026円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	338,198,539円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,422,854,853円

区分	2024年11月24日現在
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,643,903円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,409,359円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	309,923,077円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	111,956,348円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	157,312,901円
F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	600,405,629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）	1,099,223,297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	757,317,693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）	842,727,962円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,604,354,267円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,493,919円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,268,734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）	1,283,378,470円
SMT インデックスバランス・オープン	162,156,577円
SMT 世界経済インデックス・オープン	508,492,781円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	720,133,170円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,072,206,051円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,673,314円
グローバル経済コア	1,279,009,414円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,747,464円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,794,318円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	68,322,776円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	111,235,611円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	58,024,614円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	83,547,125円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	994,656,632円
10資産分散投資ファンド	35,950,814円
グローバル10資産バランスファンド	35,410,845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	236,243円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	25,995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	151,290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	36,630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	60,153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	71,808円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	5,128,343円
F O F s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）	14,346,508,989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）	233,658,938円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	476,006,407円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	141,535,618円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,413,372,835	-	1,407,499,622	5,873,213
合計		1,413,372,835	-	1,407,499,622	5,873,213

（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11月24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	1,595,187,859	-	1,584,487,981	10,699,878
	アメリカドル	769,238,312	-	767,485,230	1,753,082
	カナダドル	63,136,946	-	62,912,724	224,222
	ユーロ	465,435,188	-	458,798,308	6,636,880
	イギリスポンド	92,257,787	-	91,191,656	1,066,131
	オフショア人民元	205,119,626	-	204,100,063	1,019,563
合計		1,595,187,859	-	1,584,487,981	10,699,878

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	671,024,663
コール・ローン	487,778,755
国債証券	78,426,620,357
派生商品評価勘定	543,539,068
未収入金	6,290
未収利息	540,543,003
前払金	2,117,208
前払費用	68,277,965
差入委託証拠金	50,347,274
流動資産合計	80,790,254,583
資産合計	80,790,254,583
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	670,360,518
未払金	429,198,413
未払解約金	451,442
流動負債合計	1,100,010,373
負債合計	1,100,010,373
純資産の部	
元本等	
元本	97,207,534,972
剰余金	
剰余金又は欠損金()	17,517,290,762
元本等合計	79,690,244,210

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
純資産合計	79,690,244,210
負債純資産合計	80,790,254,583

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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>(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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,207,534,972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 17,517,290,762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 0.8198円 (1万口当たり純資産額) (8,198円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月24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</p>

2024年11月24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> <p>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>

（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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	98,796,580,345円
期中追加設定元本額	9,368,269,883円
期中一部解約元本額	10,957,315,256円
期末元本額	97,207,534,972円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,662,961,673円
分散投資コア戦略ファンドS	29,234,845,970円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2,060,478,966円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	947,291,059円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	225,699,203円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	76,248,495円
10資産分散投資ファンド	765,061,733円
グローバル10資産バランスファンド	148,853,129円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	14,181,597,829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）	2,682,909,515円
私募外国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,077,748,581円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,729,193,270円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,795,810,962円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,781,901,194円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,653,822,636円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,622,777,686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）	2,154,220,944円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,406,112,127円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	369,218,840	-	367,101,632	2,117,208
合計		369,218,840	-	367,101,632	2,117,208

(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11月24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	79,234,425,328	-	79,359,129,570	124,704,242
	アメリカドル	36,870,329,900	-	37,499,779,770	629,449,870
	カナダドル	1,540,306,685	-	1,559,560,399	19,253,714
	メキシコペソ	578,634,720	-	582,382,655	3,747,935
	ユーロ	24,133,138,139	-	23,678,377,462	454,760,677
	イギリスポンド	4,115,529,814	-	4,063,409,355	52,120,459
	スウェーデンクローナ	130,781,404	-	128,219,677	2,561,727
	ノルウェークローネ	120,026,514	-	120,820,093	793,579
	デンマーククローネ	208,156,594	-	204,231,251	3,925,343
	ポーランドズロチ	399,399,576	-	392,705,078	6,694,498
	オーストラリアドル	1,013,492,819	-	1,021,594,095	8,101,276
	ニュージーランドドル	219,221,925	-	218,447,681	774,244
	シンガポールドル	325,455,323	-	324,734,041	721,282
	マレーシアリングット	395,718,399	-	391,228,581	4,489,818
	イスラエルシェケル	241,883,152	-	247,190,552	5,307,400
	オフショア人民元	8,942,350,364	-	8,926,448,880	15,901,484
合計		79,234,425,328	-	79,359,129,570	124,704,242

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	746,857,940
コール・ローン	816,720,271
国債証券	151,941,588,830
未収入金	3,165,528
未収利息	2,328,256,856
前払費用	278,524,895

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	156,115,114,320
資産合計	156,115,114,320
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,992,879
未払金	1,855,172
未払解約金	26,672,838
流動負債合計	34,520,889
負債合計	34,520,889
純資産の部	
元本等	
元本	66,879,430,185
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,201,163,246
元本等合計	156,080,593,431
純資産合計	156,080,593,431
負債純資産合計	156,115,114,320

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,879,430,185口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.3338円 (1万口当たり純資産額) (23,338円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月24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11月24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った場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	62,732,887,478円
期中追加設定元本額	6,411,236,295円
期中一部解約元本額	2,264,693,588円
期末元本額	66,879,430,185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	3,599,854,365円
世界経済インデックスファンド	26,504,532,745円
DC新興国債券インデックス・オープン	6,035,734,930円
DC世界経済インデックスファンド	16,145,902,802円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	4,538,846円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	864,126,621円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,749,974,220円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	233,325,335円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	109,012,863円
SMT インデックスバランス・オープン	168,471,650円
SMT 世界経済インデックス・オープン	604,085,670円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	850,163,630円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,265,600,839円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,389,723円
グローバル経済コア	1,267,338,934円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	137,072,449円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	126,142,516円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	54,777,361円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	68,673,202円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	366,450,140円
10資産分散投資ファンド	57,962,432円
グローバル10資産バランスファンド	55,222,449円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	273,243,979円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	168,149,263円
SMTAM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
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	222,722,981円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	221,906,721円
SMTAM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
SMTAM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
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	141,180,831円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

（2024年11月24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	702,702,630	-	696,709,751	5,992,879
	メキシコペソ	112,103,465	-	110,822,650	1,280,815
	チェココルナ	60,003,546	-	59,128,992	874,554
	ハンガリーフォリント	29,128,238	-	28,505,431	622,807
	ポーランドズロチ	80,559,677	-	79,421,606	1,138,071
	マレーシアリンギット	109,822,172	-	109,450,830	371,342
	タイバーツ	105,805,195	-	105,022,508	782,687
	南アフリカランド	94,823,024	-	94,343,340	479,684
	オフショア人民元	110,457,313	-	110,014,394	442,919
	合計	702,702,630	-	696,709,751	5,992,879

(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。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,887,558
コール・ローン	7,790,047
国債証券	2,430,231,984
派生商品評価勘定	25,299,907
未収入金	60,835
未収利息	6,066,880
前払費用	1,147,198
流動資産合計	2,475,484,409
資産合計	2,475,484,409
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,141,113
未払解約金	22,535
流動負債合計	12,163,648
負債合計	12,163,648
純資産の部	
元本等	
元本	2,821,888,959
剰余金	
剰余金又は欠損金()	358,568,198

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
元本等合計	2,463,320,761
純資産合計	2,463,320,761
負債純資産合計	2,475,484,409

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 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。 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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,821,888,959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 358,568,198円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.8729円 (8,729円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月24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	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	2,801,623,400円
期中追加設定元本額	712,325,834円
期中一部解約元本額	692,060,275円
期末元本額	2,821,888,959円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	119,271,766円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	2,180,910,815円
私募世界物価連動債パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	521,706,378円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年11月24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	2,465,506,043	-	2,452,347,249	13,158,794
	アメリカドル	1,304,504,300	-	1,316,382,655	11,878,355
	カナダドル	41,799,075	-	41,977,117	178,042
	ユーロ	519,238,632	-	505,229,687	14,008,945
	イギリスポンド	547,856,199	-	537,307,117	10,549,082
	スウェーデンクローナ	15,670,013	-	15,241,338	428,675
	デンマーククローネ	4,523,660	-	4,401,161	122,499
	オーストラリアドル	22,315,795	-	22,322,233	6,438
	ニュージーランドドル	9,598,369	-	9,485,941	112,428
合計		2,465,506,043	-	2,452,347,249	13,158,794

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	

2024年11月24日現在	
項目	金額（円）
流動資産	
コール・ローン	2,524,300,174
投資証券	92,471,998,000
未収配当金	667,457,814
未収利息	14,937
前払金	138,224,320
差入委託証拠金	199,691,763
流動資産合計	96,001,687,008
資産合計	
96,001,687,008	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,660,140
未払解約金	40,941,498
流動負債合計	179,601,638
負債合計	
179,601,638	
純資産の部	
元本等	
元本	47,278,363,173
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	48,543,722,197
元本等合計	95,822,085,370
純資産合計	
95,822,085,370	
負債純資産合計	
96,001,687,008	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2024年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,278,363,173口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0268円 (1万口当たり純資産額) (20,268円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

2024年11月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	60,321,849,248円
期中追加設定元本額	5,593,858,021円
期中一部解約元本額	18,637,344,096円
期末元本額	47,278,363,173円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,835,996,739円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,938,281円
SMT J-REITインデックス・オープン	15,846,934,005円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	20,371,502,013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	21,730,059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	16,506,347円
グローバル経済コア	572,759,384円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	20,487,959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)	1,202,192,998円
10資産分散投資ファンド	33,356,900円
グローバル10資産バランスファンド	60,037,941円
FOS用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	212,404,617円
FOS用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	12,564,136円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	846,874,774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)	63,477,032円
J-REIT バッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	486,594,922円

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2024年11月24日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,459,370,820	-	3,321,146,500	138,224,320
合計		3,459,370,820	-	3,321,146,500	138,224,320

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年11月24日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	239,880,764
コール・ローン	40,372,023
投資証券	140,393,160,672
派生商品評価勘定	442
未収入金	77,280,032
未収配当金	190,830,240
未収利息	238
流動資産合計	140,941,524,411
資産合計	
140,941,524,411	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	117,620
未払金	58,391,616
未払解約金	4,334,522
流動負債合計	62,843,758
負債合計	
62,843,758	
純資産の部	
元本等	
元本	42,318,639,236
剰余金	
剰余金又は欠損金()	98,560,041,417
元本等合計	140,878,680,653
純資産合計	
140,878,680,653	
負債純資産合計	
140,941,524,411	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2024年11月24日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,318,639,236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) 3.3290円 (33,290円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2024年11月24日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	40,273,482,755円
期中追加設定元本額	5,592,573,888円
期中一部解約元本額	3,547,417,407円
期末元本額	42,318,639,236円
期末元本額の内訳	

区分	2024年11月24日現在
グローバル3資産バランスオープン	45,207,252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）	1,511,894,890円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,634,021円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,929,685,463円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,282,809,820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）	473,875,605円
SMT インデックスバランス・オープン	102,699,249円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	140,109,442円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,763,836円
グローバル経済コア	387,031,800円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,778,567円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	375,695,734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）	365,445,675円
10資産分散投資ファンド	17,679,842円
グローバル10資産バランスファンド	43,438,115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）	1,354,176,820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）	183,048,800円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	98,343,111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）	49,167,129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）	48,569,505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）	78,752,244円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	78,463,899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）	39,317,488円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	49,920,162円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年11月24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	57,264,800	-	57,147,622	117,178
	アメリカドル	57,264,800	-	57,147,622	117,178
合計		57,264,800	-	57,147,622	117,178

(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。

2【ファンドの現況】

【10資産分散投資ファンド】

【純資産額計算書】

(2024年12月30日現在)

資産総額	2,627,938,038円
負債総額	479,543円
純資産総額(-)	2,627,458,495円
発行済口数	2,294,418,967口
1口当たり純資産額(/)	1.1452円
(1万口当たり純資産額)	(11,452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12月30日現在)

資産総額	730,841,539,611円
負債総額	421,230,891円
純資産総額(-)	730,420,308,720円
発行済口数	249,458,929,129口
1口当たり純資産額(/)	2.9280円
(1万口当たり純資産額)	(29,280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12月30日現在)

資産総額	865,641,218,356円
負債総額	385,662,133円
純資産総額(-)	865,255,556,223円
発行済口数	117,490,737,801口
1口当たり純資産額(/)	7.3645円
(1万口当たり純資産額)	(73,645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12月30日現在)

資産総額	231,804,868,338円
負債総額	162,939,885円
純資産総額(-)	231,641,928,453円
発行済口数	48,536,649,921口

1口当たり純資産額（ / ）	4.7725円
（1万口当たり純資産額）	（47,725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12月30日現在）

資産総額	720,633,985,132円
負債総額	8,459,733,126円
純資産総額（ - ）	712,174,252,006円
発行済口数	546,661,074,835口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3028円
（1万口当たり純資産額）	（13,028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12月30日現在）

資産総額	385,887,514,174円
負債総額	83,156,766円
純資産総額（ - ）	385,804,357,408円
発行済口数	103,879,422,061口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7140円
（1万口当たり純資産額）	（37,140円）

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2024年12月30日現在）

資産総額	84,280,675,406円
負債総額	4,253,576,270円
純資産総額（ - ）	80,027,099,136円
発行済口数	98,224,188,447口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8147円
（1万口当たり純資産額）	（8,147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12月30日現在）

資産総額	160,187,291,964円
負債総額	19,230,460円
純資産総額（ - ）	160,168,061,504円
発行済口数	67,638,784,519口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3680円

（1万口当たり純資産額）	（23,680円）
--------------	-----------

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

純資産額計算書

（2024年12月30日現在）

資産総額	2,554,359,316円
負債総額	126,395,960円
純資産総額（ - ）	2,427,963,356円
発行済口数	2,832,488,462口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8572円
（1万口当たり純資産額）	（8,572円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2024年12月30日現在）

資産総額	96,514,878,306円
負債総額	169,055,838円
純資産総額（ - ）	96,345,822,468円
発行済口数	47,929,888,714口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0101円
（1万口当たり純資産額）	（20,101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12月30日現在）

資産総額	136,791,561,089円
負債総額	272,971,098円
純資産総額（ - ）	136,518,589,991円
発行済口数	42,345,313,186口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2239円
（1万口当たり純資産額）	（32,239円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り

消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

委託会社の機構は2025年 2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12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	525	15,838,205
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	57	202,229
単体型公社債投資信託	52	171,026
合計	634	16,211,460

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)
負債の部		
流動負債		
預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

前事業年度	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にあり、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あります。）

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)				
其他有価証券	-	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	(281)	(230)	-	(511)
通貨関連取引	-	(286)	-	(286)
デリバティブ取引計	(281)	(517)	-	(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)

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4. 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)

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. 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 2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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2024年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することが

あります。

独立監査人の監査報告書

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている10資産分散投資ファンドの2023年5月25日から2024年5月24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、10資産分散投資ファンドの2024年5月24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. 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。

独立監査人の中間監査報告書

2025年2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

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている10資産分散投資ファンドの2024年5月25日から2024年11月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、10資産分散投資ファンドの2024年11月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年5月25日から2024年11月24日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。