# 【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3月10日提出 |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 菱田　賀夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝公園一丁目１番１号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 北添　道生 |
| 【電話番号】 | 03-6453-3610 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 | 10兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

**第一部【証券情報】**

**（1）【ファンドの名称】**

**ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）**

**（2）【内国投資信託受益証券の形態等】**

**①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。**

**②三井住友トラスト・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。**

**③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。**

**（3）【発行（売出）価額の総額】**

**10兆円を上限とします。**

**（4）【発行（売出）価格】**

**取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。**

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

**（5）【申込手数料】**

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

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

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

**（6）【申込単位】**

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

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

**（7）【申込期間】**

2025年 3月11日から2025年 9月10日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞
当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。
＜受益権の取得申込みの方法＞
販売会社所定の方法でお申込みください。
取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
＜申込みコース＞
「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

**販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。**

**＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞**

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

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨーク証券取引所の休業日**

**ロンドン証券取引所の休業日**

**ニューヨークの銀行休業日**

**ロンドンの銀行休業日**

# 第二部【ファンド情報】

## 第１【ファンドの状況】

### １【ファンドの性格】

#### （１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）並びに債券に分散投資することでリスクの低減をはかり、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

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。

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

（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**

**①一般…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。**

**②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。**

**③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**

**①一般…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。**

**②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。**

**③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。**

**④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。**

**⑤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①から④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①から④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。**

**①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。**

**②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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

**［特殊型］**

**(1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。**

**(2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。**

**(3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。**

**(4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。**

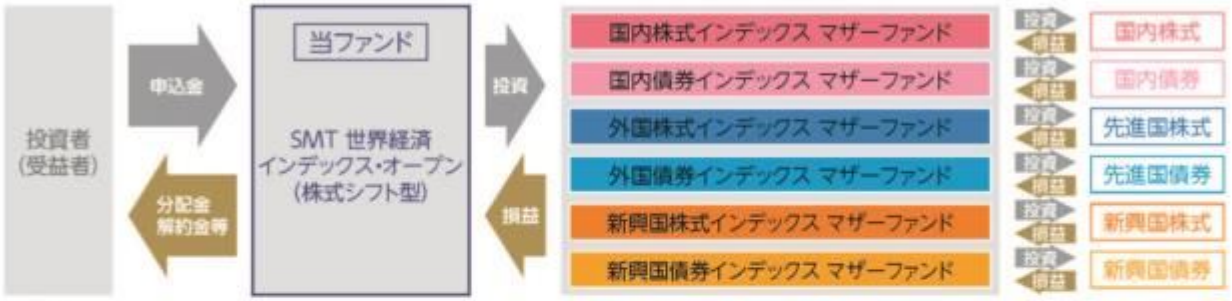
**◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。**

**＜ファンドの特色＞**

## 特色1 世界の株式及び債券に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

ファンドのしくみ




**？ ファミリーファンド方式とは**

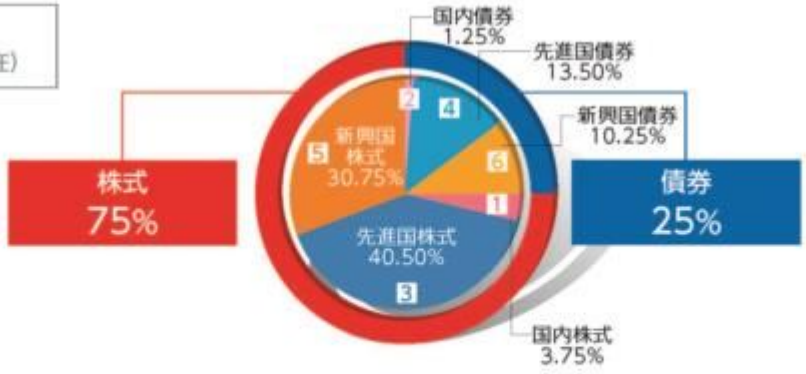
投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

## 特色2 世界経済全体の発展を享受します。

●基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率に基づき決定します。
※年1回地域別構成比の見直しを行います。

（出所）IMF「世界経済見通し2024年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
※上記のファンドの地域別構成比は、2025年1月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
（2025年1月末現在）




●組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
●基本組入比率は年1回見直しを行います。

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

**※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に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

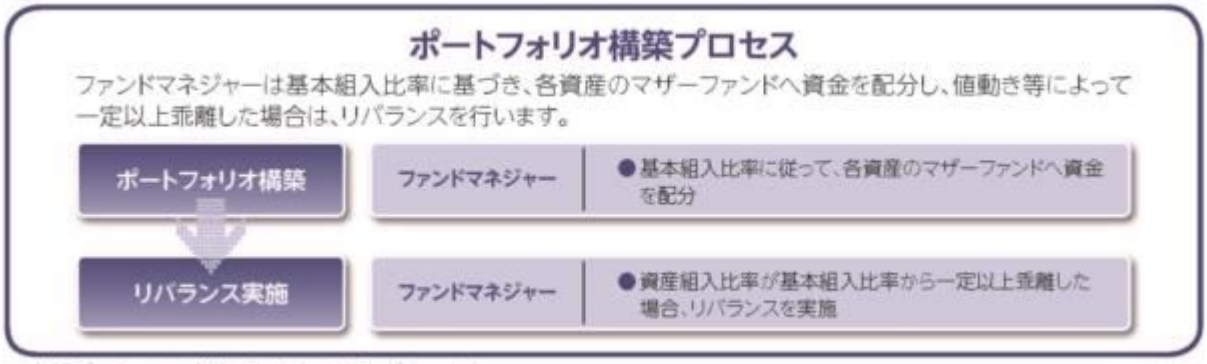
※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

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

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

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

※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」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。




※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

分配方針

●年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。
●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。
●外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

〈ご参考情報〉

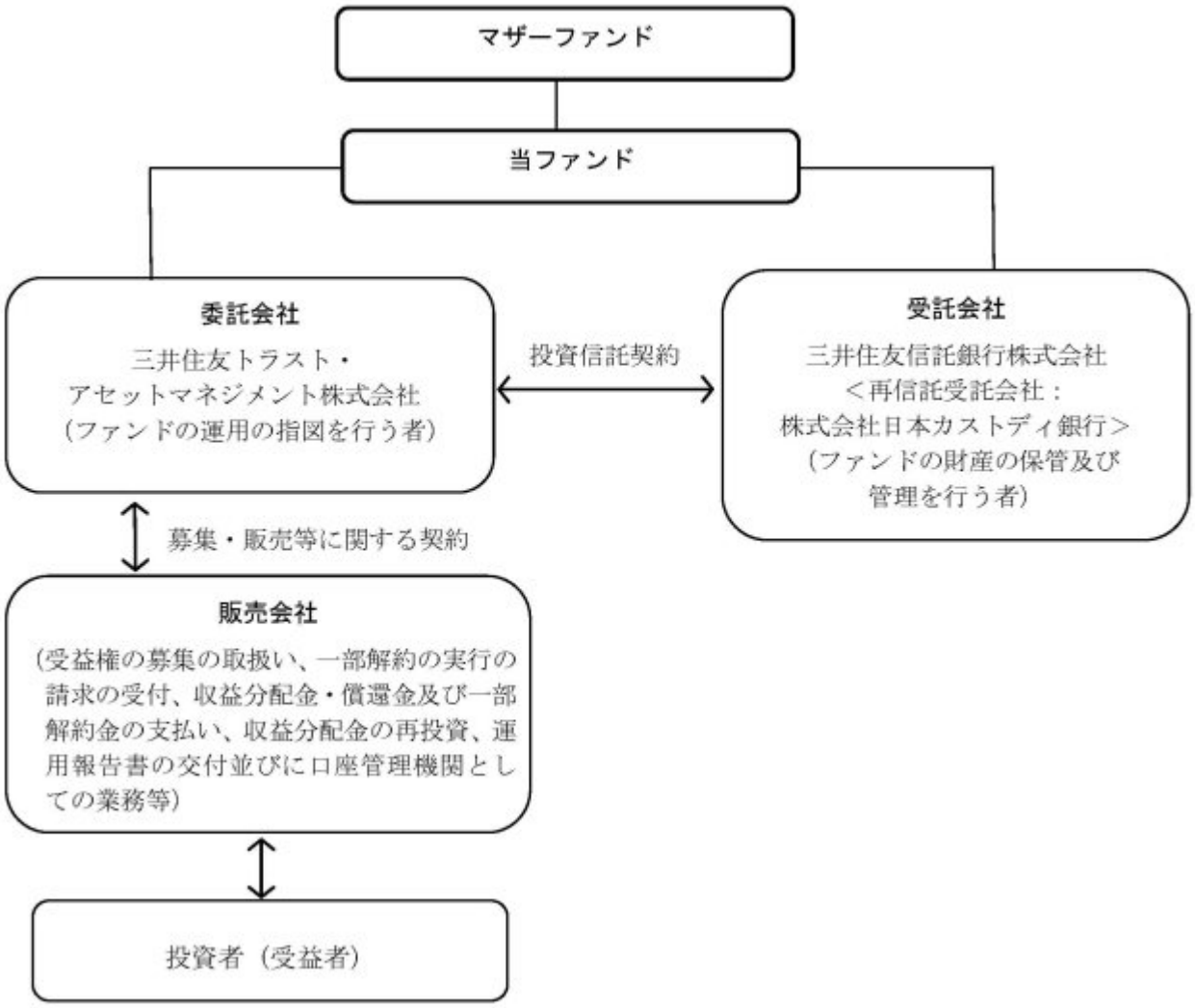
(出所)国連「World Population Prospects 2024」及びIMF「世界経済見通し2024年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

**（2）【ファンドの沿革】**

**2017年 8月25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】**

**①当ファンドの仕組み及び関係法人**




**②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】**

**①基本方針**

**当ファンドは、主として、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国債券インデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。**

**②投資対象**

**各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。**

**③投資態度**

**イ．主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。**

**ロ．株式と債券の基本資産配分比率は、株式75%、債券25%とします。**

**ハ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。**

**ニ．各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年1回見直しを行います。**

**ホ．各マザーファンドは、インデック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。**

| マザーファンド | インデックス |
|---|---|
| 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） |
| 国内債券インデックス マザーファンド | NOMURA-BPI総合 |
| 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） |
| 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） |
| 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） |
| 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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） |

**ヘ．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。**

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

**（2）【投資対象】**

**①投資の対象とする資産の種類**

**当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。**

**イ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定め**

**るものをいいます。以下同じ。）**

**1.有価証券**

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

**3.金銭債権**

**4.約束手形**

**ロ．次に掲げる特定資産以外の資産**

**1.為替手形**

**②有価証券の指図範囲**

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

**1.株券又は新株引受権証書**

**2.国債証券**

**3.地方債証券**

**4.特別の法律により法人の発行する債券**

**5.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）**

**6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）**

**7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）**

**8.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）**

**9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）**

**10.コマーシャル・ペーパー**

**11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券**

**12.外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの**

**13.投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）**

**14.投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）**

**15.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）**

**16.オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）**

**17.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）**

**18.外国法人が発行する譲渡性預金証書**

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

**20.抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）**

**21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの**

**22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの**

**なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、及び第14号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第13号及び第14号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。**

**③金融商品の指図範囲**

**イ．委託会社は、信託金を、上記②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②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、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。**

**２．運用方法**

**(1)投資対象**

**わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。**

**(2)投資態度**

**①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、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。**

**②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。**

**③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。**

④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。

⑤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**

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資は、行いません。

③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。

④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧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。

⑨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**

①NOMURA-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。

②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。

③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。

④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。

⑤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

①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。

②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。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一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。

⑤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。

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)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

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧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

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧一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。

⑨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

①FTSE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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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

①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。

②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。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一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。

⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

「新興国株式インデックス 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

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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

①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。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③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。

④一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。

⑤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・マーケッツ・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**

**①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・マーケッツ・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。**

**②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。**

**③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。**

**④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**

**①株式への投資は行いません。**

**②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。**

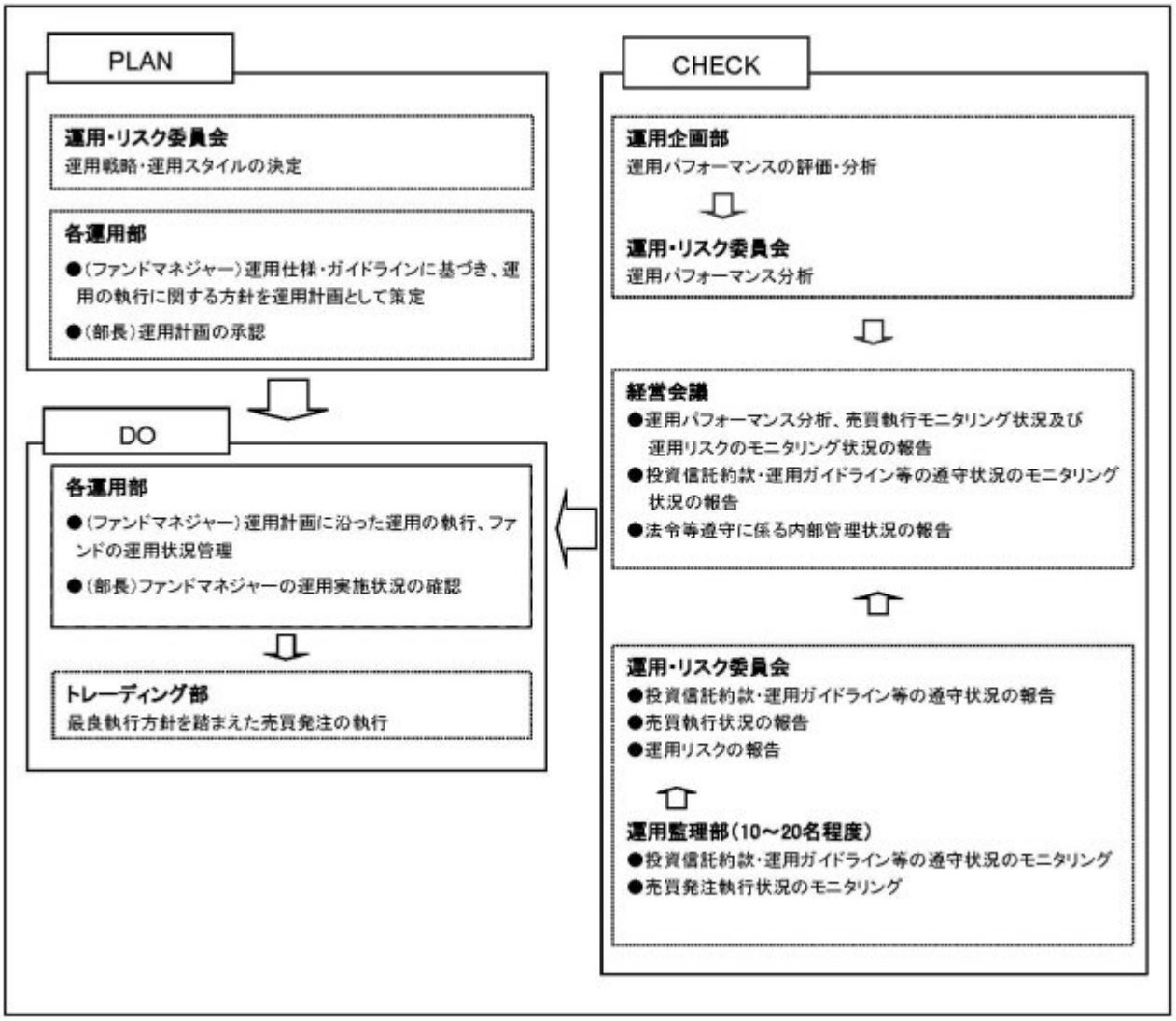
**③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。**

**④一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。**

**⑤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。**

**（３）【運用体制】**

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




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

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

（4）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

**（５）【投資制限】**

**＜約款に定める投資制限＞**

**イ．株式等への投資割合**

**株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の85%以下とします。**

**ロ．投資信託証券への投資割合**

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

**ハ．外貨建資産への投資割合**

**外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。**

**ニ．投資する株式等の範囲**

**（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。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書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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価**

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

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

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

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

**（イ）委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。**

**（ロ）金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。**

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

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

**リ．有価証券の貸付の指図、目的及び範囲**

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

**a.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する**

株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

（ハ）委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ヌ．公社債の空売りの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル．の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）上記（イ）の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ル．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

（イ）委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

（ロ）上記（イ）の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）投資信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヲ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ワ．外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

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

カ．資金の借入れ

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

借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

タ．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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。

＜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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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＞

①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。

②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。

③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。

④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が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。**

**(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。**

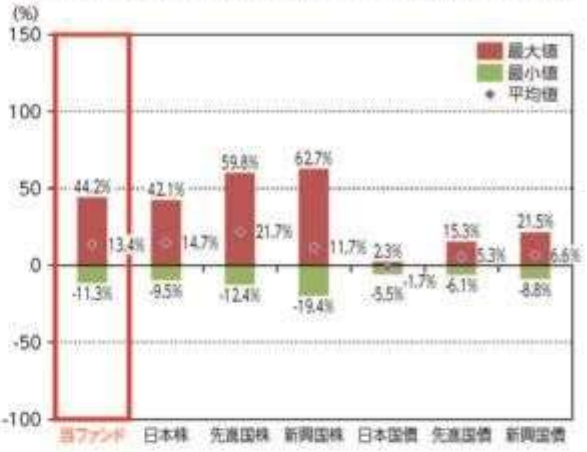
〔参考情報〕

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




*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、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

| | |
|---|---|
| 日本株<br>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株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。 |
| 先進国株<br>MSCIコクサイ・インデックス<br>(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23カ国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 新興国株<br>MSCIエマージング・マーケット・<br>インデックス(配当込み、円ベース) | MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 日本国債<br>NOMURA-BPI国債 | NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。 |
| 先進国債<br>FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース) | FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債<br>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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース) | 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. |

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

## 4【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

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

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

じ。）。

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

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

③上記①及び②の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

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

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

| | | |
|---|---|---|
| 委託会社 | 年率　0.242%　（税抜　0.22%） | 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　0.308%　（税抜　0.28%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率　0.055%　（税抜　0.05%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

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

※2025年3月10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。）

②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。

③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】

①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を含みます。）。

②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。

③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を含みます。）。

④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。

⑤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。

（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。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

**受益者が収益分配金を受け取る際、**

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

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

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

**※上記は、2024年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。**

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

| 総経費率(①+②) | 運用管理費用の比率① | その他費用の比率② |
|---|---|---|
| 0.70% | 0.61% | 0.09% |

※対象期間は2023年6月13日～2024年6月10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。**

**【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】**

**（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 | 22,712,496,495 | 99.38 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | ― | 141,114,219 | 0.62 |
| 合計(純資産総額) | | 22,853,610,714 | 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】**

**①【投資有価証券の主要銘柄】**

**イ.評価額上位銘柄明細**

| 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 日本 | 親投資信託受益証券 | 外国株式インデックス　マザーファンド | 1,316,129,588 | 6.7003 | 8,818,539,108 | 7.3645 | 9,692,636,350 | 42.41 |
| 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 | 1,495,392,313 | 4.6274 | 6,919,890,239 | 4.7725 | 7,136,759,813 | 31.23 |
| 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 | 740,791,678 | 3.6423 | 2,698,198,200 | 3.7140 | 2,751,300,292 | 12.04 |
| 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 | 874,835,845 | 2.3146 | 2,024,959,940 | 2.3680 | 2,071,611,280 | 9.06 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 281,977,309 | 2.8806 | 812,272,837 | 2.9280 | 825,629,560 | 3.61 |
| 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 | 180,042,371 | 1.3035 | 234,686,105 | 1.3028 | 234,559,200 | 1.03 |

(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 | 99.38 |
| 合計 | 99.38 |

(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。

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

| | 純資産総額（円） | | 1万口当たりの純資産額（円） | |
|---|---|---|---|---|
| | （分配落） | （分配付） | （分配落） | （分配付） |
| 第1期計算期間末　(2018年 6月11日) | 1,504,217,648 | 1,504,217,648 | 10,637 | 10,637 |
| 第2期計算期間末　(2019年 6月10日) | 1,826,908,363 | 1,826,908,363 | 10,374 | 10,374 |
| 第3期計算期間末　(2020年 6月10日) | 2,626,130,073 | 2,626,130,073 | 10,932 | 10,932 |
| 第4期計算期間末　(2021年 6月10日) | 4,732,160,740 | 4,732,160,740 | 14,107 | 14,107 |
| 第5期計算期間末　(2022年 6月10日) | 7,741,315,348 | 7,741,315,348 | 14,763 | 14,763 |
| 第6期計算期間末　(2023年 6月12日) | 11,066,909,445 | 11,066,909,445 | 15,698 | 15,698 |
| 第7期計算期間末　(2024年 6月10日) | 19,106,828,239 | 19,106,828,239 | 19,835 | 19,835 |
| 2023年12月末日 | 13,646,033,512 | — | 17,035 | — |
| 2024年 1月末日 | 14,685,251,400 | — | 17,569 | — |
| 2月末日 | 15,910,225,245 | — | 18,329 | — |
| 3月末日 | 17,003,498,913 | — | 18,874 | — |
| 4月末日 | 17,911,966,911 | — | 19,324 | — |
| 5月末日 | 18,723,429,553 | — | 19,590 | — |
| 6月末日 | 20,130,282,108 | — | 20,522 | — |
| 7月末日 | 19,641,628,615 | — | 19,503 | — |
| 8月末日 | 19,648,867,606 | — | 19,080 | — |
| 9月末日 | 20,511,822,202 | — | 19,549 | — |
| 10月末日 | 21,887,710,365 | — | 20,502 | — |
| 11月末日 | 21,622,702,893 | — | 20,046 | — |
| 12月末日 | 22,853,610,714 | — | 20,884 | — |

②【分配の推移】

| | 期　間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2017年 8月25日～2018年 6月11日 | 0 |
| 第2期計算期間 | 2018年 6月12日～2019年 6月10日 | 0 |
| 第3期計算期間 | 2019年 6月11日～2020年 6月10日 | 0 |
| 第4期計算期間 | 2020年 6月11日～2021年 6月10日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 2021年 6月11日～2022年 6月10日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 2022年 6月11日～2023年 6月12日 | 0 |
| 第7期計算期間 | 2023年 6月13日～2024年 6月10日 | 0 |

③【収益率の推移】

| | 期　間 | 収益率（%） |
|---|---|---|
| 第1期計算期間 | 2017年 8月25日～2018年 6月11日 | 6.4 |
| 第2期計算期間 | 2018年 6月12日～2019年 6月10日 | △2.5 |
| 第3期計算期間 | 2019年 6月11日～2020年 6月10日 | 5.4 |
| 第4期計算期間 | 2020年 6月11日～2021年 6月10日 | 29.0 |
| 第5期計算期間 | 2021年 6月11日～2022年 6月10日 | 4.7 |
| 第6期計算期間 | 2022年 6月11日～2023年 6月12日 | 6.3 |
| 第7期計算期間 | 2023年 6月13日～2024年 6月10日 | 26.4 |
| 第8期中間計算期間 | 2024年 6月11日～2024年12月10日 | 3.3 |

(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 | 2017年 8月25日～2018年 6月11日 | 1,988,223,866 | 574,034,195 | 1,414,189,671 |
| 第2期計算期間 | 2018年 6月12日～2019年 6月10日 | 972,552,858 | 625,653,753 | 1,761,088,776 |
| 第3期計算期間 | 2019年 6月11日～2020年 6月10日 | 1,216,187,702 | 575,000,129 | 2,402,276,349 |
| 第4期計算期間 | 2020年 6月11日～2021年 6月10日 | 1,540,288,799 | 588,062,814 | 3,354,502,334 |
| 第5期計算期間 | 2021年 6月11日～2022年 6月10日 | 2,416,929,271 | 527,584,273 | 5,243,847,332 |
| 第6期計算期間 | 2022年 6月11日～2023年 6月12日 | 2,441,482,388 | 635,240,279 | 7,050,089,441 |
| 第7期計算期間 | 2023年 6月13日～2024年 6月10日 | 3,762,050,547 | 1,179,443,539 | 9,632,696,449 |
| 第8期中間計算期間 | 2024年 6月11日～2024年12月10日 | 1,696,922,063 | 485,667,624 | 10,843,950,888 |

(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 | キヤノン | 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。

## 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-CL 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 STOX | 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。

## 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。

## 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 |
| | ブラジルレアル | 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。

**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 |
| | マレーシアリンギット | 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。

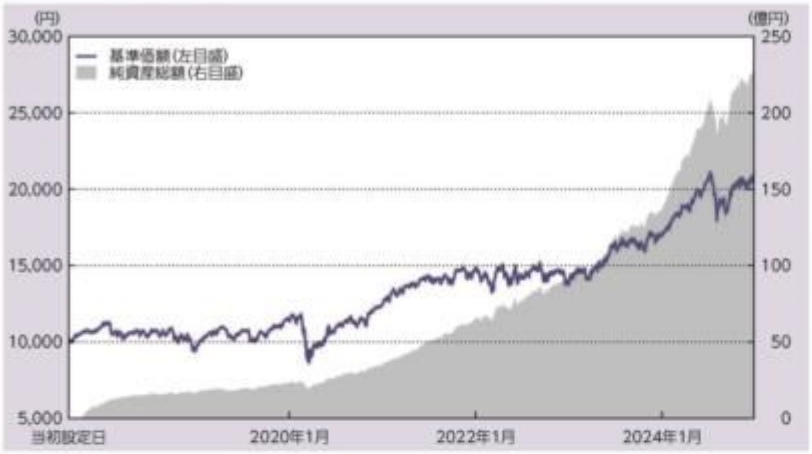
≪参考情報≫

## 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2017年 8 月25日
作成基準日：2024年12月30日

### 基準価額・純資産の推移




※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 20,884円 |
| 純資産総額 | 228.54億円 |

### 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 分配金 |
|---|---|
| 2020年 6 月 | 0円 |
| 2021年 6 月 | 0円 |
| 2022年 6 月 | 0円 |
| 2023年 6 月 | 0円 |
| 2024年 6 月 | 0円 |
| 設定来分配金合計額 | 0円 |

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

### 主要な資産の状況

| マザーファンド | 投資比率 | 上位組入銘柄 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 利率 | 償還期限 | 実質投資比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 外国株式インデックスマザーファンド | 42.4% | APPLE INC | アメリカ | 株式 | テクノロジーハードウェアおよび機器 | - | - | 2.4% |
| | | NVIDIA CORP | アメリカ | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | - | - | 2.1% |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | 31.2% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | - | - | 3.2% |
| | | TENCENT HOLDINGS LTD | ケイマン島 | 株式 | メディア・娯楽 | - | - | 1.4% |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 12.0% | T 1.5% 08/15/26 | アメリカ | 国債 | - | 1.500% | 2026/08/15 | 0.1% |
| | | T 0.375% 07/31/27 | アメリカ | 国債 | - | 0.375% | 2027/07/31 | 0.1% |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 9.1% | BLTN 0% 01/01/26 | ブラジル | 国債 | - | 0.000% | 2026/01/01 | 0.1% |
| | | MGS 4.893% 06/08/38 | マレーシア | 国債 | - | 4.893% | 2038/06/08 | 0.1% |
| 国内株式インデックスマザーファンド | 3.6% | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | - | - | 0.2% |
| | | ソニーグループ | 日本 | 株式 | 電気機器 | - | - | 0.1% |
| 国内債券インデックスマザーファンド | 1.0% | 第376回利付国債(10年) | 日本 | 国債 | - | 0.900% | 2034/09/20 | 0.0% |
| | | 第350回利付国債(10年) | 日本 | 国債 | - | 0.100% | 2028/03/20 | 0.0% |

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)

※2017年は当初設定日から年末までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第２【管理及び運営】

### １【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

**＜申込コース＞**

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

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

**＜申込みの受付＞**

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

**＜申込単位＞**

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

**＜申込価額＞**

**取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。**

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

**＜申込手数料＞**

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

**＜申込代金の支払い＞**

**販売会社が定める期日までにお支払いください。**

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨーク証券取引所の休業日**
**ロンドン証券取引所の休業日**
**ニューヨークの銀行休業日**
**ロンドンの銀行休業日**

**＜申込受付の中止等＞**

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

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

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

**＜一部解約代金の支払い＞**

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

**＜受付不可日＞**

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

**ニューヨーク証券取引所の休業日**

**ロンドン証券取引所の休業日**

**ニューヨークの銀行休業日**

**ロンドンの銀行休業日**

**＜一部解約受付の中止等＞**

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

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

**＜一部解約の制限＞**

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

**＜その他＞**

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

**＜問い合わせ先＞**

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

**（照会先）**

**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**

**ホームページ：https://www.smtam.jp/**

**フリーダイヤル：0120-668001**

**（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）**

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

①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。

②マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

（ハ）公社債等

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

③外貨建資産等の円換算

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

＜基準価額の照会方法＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

**フリーダイヤル：0120-668001**
**（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）**

**（２）【保管】**
**該当事項はありません。**

**（３）【信託期間】**
**無期限とします。（2017年 8月25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6月11日から翌年6月10日までとします。**
**ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2018年6月11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）**
**①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**
**②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。**
**③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。**
**④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）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。**
**①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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。**
**②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、知れ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。**

**③上記①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。**

**④上記①から③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①から③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。**

**①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れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。**

**②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、知れ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。**

**③上記①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。**

**④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。**

**⑤上記①から④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。**

**⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。**

**＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞**

**①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。**

**②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。**

**＜運用報告書＞**

**委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れ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＞**

**①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。**

**②上記①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。**

**③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。**

**④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**

**①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。**

**②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。**

**③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。**

**④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。**

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

**(2)償還金に対する請求権**

**①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。**

**②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。**

**③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。**

**④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。**

**(3)換金（解約）請求権**

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

**詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。**

**(4)帳簿閲覧・謄写請求権**

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

**第３【ファンドの経理状況】**

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

**(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2023年6月13日から2024年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。**

**１【財務諸表】**

## 【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

### （１）【貸借対照表】

（単位：円）

| | 第6期<br>（2023年 6月12日現在） | 第7期<br>（2024年 6月10日現在） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 132,905,207 | 192,009,458 |
| 親投資信託受益証券 | 10,958,894,668 | 18,920,247,812 |
| 未収入金 | 26,435,040 | 54,642,144 |
| 未収利息 | - | 354 |
| 流動資産合計 | 11,118,234,915 | 19,166,899,768 |
| 資産合計 | 11,118,234,915 | 19,166,899,768 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 21,599,204 | 11,390,944 |
| 未払受託者報酬 | 2,678,030 | 4,385,647 |
| 未払委託者報酬 | 26,780,219 | 43,856,432 |
| 未払利息 | 270 | - |
| その他未払費用 | 267,747 | 438,506 |
| 流動負債合計 | 51,325,470 | 60,071,529 |
| 負債合計 | 51,325,470 | 60,071,529 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 7,050,089,441 | 9,632,696,449 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 4,016,820,004 | 9,474,131,790 |
| （分配準備積立金） | 1,705,354,657 | 4,773,082,315 |
| 元本等合計 | 11,066,909,445 | 19,106,828,239 |
| 純資産合計 | 11,066,909,445 | 19,106,828,239 |
| 負債純資産合計 | 11,118,234,915 | 19,166,899,768 |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第6期<br>自　2022年 6月11日<br>至　2023年 6月12日 | 第7期<br>自　2023年 6月13日<br>至　2024年 6月10日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 398 | 30,448 |
| 有価証券売買等損益 | 764,889,804 | 3,551,768,362 |
| 営業収益合計 | 764,890,202 | 3,551,798,810 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 46,283 | 44,891 |
| 受託者報酬 | 4,945,736 | 7,802,413 |
| 委託者報酬 | 49,457,191 | 78,024,050 |
| その他費用 | 494,460 | 780,126 |
| 営業費用合計 | 54,943,670 | 86,651,480 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 709,946,532 | 3,465,147,330 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 709,946,532 | 3,465,147,330 |
| 当期純利益又は当期純損失（△） | 709,946,532 | 3,465,147,330 |
| 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（△） | 923,921 | 165,036,331 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 2,497,468,016 | 4,016,820,004 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,108,170,260 | 2,852,054,037 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,108,170,260 | 2,852,054,037 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 297,840,883 | 694,853,250 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 297,840,883 | 694,853,250 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 4,016,820,004 | 9,474,131,790 |

## （３）【注記表】

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|---|---|
| １.有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 |
| ２.その他 | ファンドの計算期間<br>当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期計算期間は2023年 6月13日から2024年 6月10日までとなっております。 |

### （貸借対照表に関する注記）

| | 第6期<br>(2023年 6月12日現在) | 第7期<br>(2024年 6月10日現在) |
|---|---|---|
| １．計算期間の末日における受益権の総数 | 7,050,089,441口 | 9,632,696,449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 1.5698円<br>(1万口当たり純資産額) (15,698円) | 1口当たり純資産額 1.9835円<br>(1万口当たり純資産額) (19,835円) |

### （損益及び剰余金計算書に関する注記）

第6期
自 2022年 6月11日
至 2023年 6月12日

分配金の計算過程

| 項目 | | |
|---|---|---|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 218,020,608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 | 491,002,003円 |
| 収益調整金額 | C | 2,311,465,347円 |
| 分配準備積立金額 | D | 996,332,046円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 4,016,820,004円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 7,050,089,441口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 5,697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 |

第7期
自 2023年 6月13日
至 2024年 6月10日

分配金の計算過程

| 項目 | | |
|---|---|---|
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 356,979,933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 | 2,943,131,066円 |
| 収益調整金額 | C | 4,701,049,475円 |
| 分配準備積立金額 | D | 1,472,971,316円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 9,474,131,790円 |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 9,632,696,449口 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 9,835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 |

### （金融商品に関する注記）

#### １．金融商品の状況に関する事項

| | 第7期<br>自 2023年 6月13日<br>至 2024年 6月10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。<br>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 |
| ３.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

#### ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 第7期<br>(2024年 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |

| | 第7期<br>(2024年 6月10日現在) |
|---|---|
| 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第6期<br>自 2022年 6月11日<br>至 2023年 6月12日 | 第7期<br>自 2023年 6月13日<br>至 2024年 6月10日 |
|---|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 5,243,847,332円 | 7,050,089,441円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,441,482,388円 | 3,762,050,547円 |
| 期中一部解約元本額 | 635,240,279円 | 1,179,443,539円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 第6期<br>(2023年 6月12日現在) | 第7期<br>(2024年 6月10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 | 761,899,735 | 3,491,702,502 |
| 合計 | 761,899,735 | 3,491,702,502 |

（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 | 新興国株式インデックス　マザーファンド | 1,304,580,306 | 6,035,249,411 | |
| | 国内株式インデックス　マザーファンド | 243,850,907 | 704,436,500 | |
| | 外国株式インデックス　マザーファンド | 1,182,023,932 | 7,913,295,617 | |
| | 国内債券インデックス　マザーファンド | 153,640,943 | 200,194,148 | |
| | 外国債券インデックス　マザーファンド | 637,963,357 | 2,325,185,047 | |
| | 新興国債券インデックス　マザーファンド | 752,435,028 | 1,741,887,089 | |
| 合計 | | 4,274,494,473 | 18,920,247,812 | |

(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 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 5,545,257,610 |
| 株式 | 664,691,246,410 |
| 派生商品評価勘定 | 169,531,050 |
| 未収入金 | 1,680,000 |
| 未収配当金 | 4,615,677,832 |
| 未収利息 | 10,224 |
| 差入委託証拠金 | 454,278,084 |
| 流動資産合計 | 675,477,681,210 |
| 資産合計 | 675,477,681,210 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,825,750 |
| 前受金 | 167,900,000 |
| 未払解約金 | 2,208,544,482 |
| 流動負債合計 | 2,378,270,232 |
| 負債合計 | 2,378,270,232 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 233,002,663,406 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 440,096,747,572 |
| 元本等合計 | 673,099,410,978 |
| 純資産合計 | 673,099,410,978 |
| 負債純資産合計 | 675,477,681,210 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| | (2)派生商品取引等損益<br>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 6月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 233,002,663,406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 2.8888円<br>(1万口当たり純資産額) (28,888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 6月10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。<br>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。<br>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 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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 6月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況<br>期首 | 2023年 6月13日 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 期首元本額 | 253,755,785,513円 |
| 期中追加設定元本額 | 24,862,273,690円 |
| 期中一部解約元本額 | 45,615,395,797円 |
| 期末元本額 | 233,002,663,406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） | 267,258,205円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 3,258,336,958円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 12,592,165円 |
| ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン | 10,463,212,300円 |
| 世界経済インデックスファンド | 6,087,304,873円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 2,801,124,544円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 4,625,819,713円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 15,514,713,834円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 17,887,811,451円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープン | 6,005,048,260円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 2,886,105,644円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 9,171,893,045円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 8,621,934,947円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ | 9,568,566,242円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 56,919,544円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 555,038,443円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 453,356,132円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 3,988,896,648円 |
| 日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 671,244,658円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,269,905円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 9,300,182円 |
| マイセレクション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） | 104,648,814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） | 59,426,463円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 13,994,838円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 40,851,120円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 399,711,459円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 287,247,671円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,952,428,645円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 25,917,567円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 9,548,767円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 286,655,700円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 160,275,282円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 203,723,852円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 15,798,344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） | 359,051,553円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 2,364,121,693円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ２ | 1,895,498,019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） | 664,897,652円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 415,678,113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） | 186,558,730円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 9,614,727円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 49,984,858円 |
| 国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 15,689,876,717円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 194,507,065円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 53,079,437円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 243,850,907円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 39,821,868円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 12,196,868円 |
| グローバル経済コア | 281,243,117円 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 33,592,954円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード） | 2,229,851,388円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 30,735,468円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 492,281,238円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 125,410,997円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 64,509,012円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 63,741,258円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 27,948,092円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 35,062,618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 | 34,813,184円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 46,127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 | 31,734円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４０ | 34,978円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４５ | 37,585円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５０ | 37,585円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５ | 34,970円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６０ | 22,495円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６５ | 17,859円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 14,076円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 41,500,004,778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） | 239,556,684円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 290,330,176円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 25,022,624円 |
| ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 109,278,589円 |
| ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用） | 48,327,828,016円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 15,977,520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） | 205,056,989円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 9,772,544,248 |
| 合計 | 9,772,544,248 |

(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 6月10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<br>買建 | 9,675,070,000 | － | 9,842,970,000 | 167,900,000 |
| 合計 | | 9,675,070,000 | － | 9,842,970,000 | 167,900,000 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

## 第１　有価証券明細表
### (1)株式

| 銘　柄 | 株式数（株） | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|
| | | 単価(円) | 金額(円) | |
| 極洋 | 9,800 | 3,845.00 | 37,681,000 | |
| ニッスイ | 237,700 | 886.40 | 210,697,280 | |
| マルハニチロ | 35,300 | 3,215.00 | 113,489,500 | |
| 雪国まいたけ | 20,200 | 980.00 | 19,796,000 | |
| カネコ種苗 | 6,700 | 1,418.00 | 9,500,600 | |
| サカタのタネ | 27,100 | 3,375.00 | 91,462,500 | |
| ホクト | 19,000 | 1,856.00 | 35,264,000 | |
| ホクリヨウ | 1,300 | 1,003.00 | 1,303,900 | |
| 住石ホールディングス | 30,200 | 1,397.00 | 42,189,400 | |
| 日鉄鉱業 | 9,500 | 5,240.00 | 49,780,000 | |
| 三井松島ホールディングス | 14,100 | 4,580.00 | 64,578,000 | |
| ＩＮＰＥＸ | 798,300 | 2,346.00 | 1,872,811,800 | |
| 石油資源開発 | 27,500 | 6,410.00 | 176,275,000 | |
| Ｋ＆Ｏエナジーグループ | 10,800 | 3,800.00 | 41,040,000 | |
| ショーボンドホールディングス | 32,400 | 5,818.00 | 188,503,200 | |
| ミライト・ワン | 71,800 | 1,972.50 | 141,625,500 | |
| タマホーム | 14,900 | 3,875.00 | 57,737,500 | |
| サンヨーホームズ | 900 | 735.00 | 661,500 | |
| 日本アクア | 3,300 | 920.00 | 3,036,000 | |
| ファーストコーポレーション | 2,300 | 762.00 | 1,752,600 | |
| ベステラ | 1,900 | 1,033.00 | 1,962,700 | |
| キャンディル | 1,400 | 615.00 | 861,000 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 1,600 | 978.00 | 1,564,800 | |
| 第一カッター興業 | 6,800 | 1,569.00 | 10,669,200 | |
| 安藤・間 | 137,700 | 1,119.00 | 154,086,300 | |
| 東急建設 | 74,500 | 762.00 | 56,769,000 | |
| コムシスホールディングス | 75,900 | 3,072.00 | 233,164,800 | |
| ビーアールホールディングス | 34,800 | 357.00 | 12,423,600 | |
| 高松コンストラクショングループ | 17,700 | 2,961.00 | 52,409,700 | |
| 東建コーポレーション | 6,000 | 10,980.00 | 65,880,000 | |
| ソネック | 800 | 937.00 | 749,600 | |
| ヤマウラ | 12,000 | 1,316.00 | 15,792,000 | |
| オリエンタル白石 | 88,000 | 346.00 | 30,448,000 | |
| 大成建設 | 152,300 | 5,968.00 | 908,926,400 | |
| 大林組 | 594,600 | 1,845.00 | 1,097,037,000 | |
| 清水建設 | 471,500 | 844.00 | 397,946,000 | |
| 飛島建設 | 17,100 | 1,452.00 | 24,829,200 | |
| 長谷工コーポレーション | 152,600 | 1,790.00 | 273,154,000 | |
| 松井建設 | 15,500 | 818.00 | 12,679,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 錢高組 | 800 | 4,340.00 | 3,472,000 | |
| 鹿島建設 | 368,700 | 2,706.00 | 997,702,200 | |
| 不動テトラ | 11,500 | 2,462.00 | 28,313,000 | |
| 大末建設 | 2,200 | 1,738.00 | 3,823,600 | |
| 鉄建建設 | 11,900 | 2,561.00 | 30,475,900 | |
| 西松建設 | 31,700 | 4,380.00 | 138,846,000 | |
| 三井住友建設 | 123,800 | 395.00 | 48,901,000 | |
| 大豊建設 | 5,700 | 3,315.00 | 18,895,500 | |
| 佐田建設 | 3,500 | 747.00 | 2,614,500 | |
| ナカノフドー建設 | 3,900 | 528.00 | 2,059,200 | |
| 奥村組 | 27,000 | 4,895.00 | 132,165,000 | |
| 東鉄工業 | 20,600 | 3,100.00 | 63,860,000 | |
| イチケン | 1,400 | 2,562.00 | 3,586,800 | |
| 富士ピー・エス | 2,400 | 448.00 | 1,075,200 | |
| 淺沼組 | 12,300 | 3,675.00 | 45,202,500 | |
| 戸田建設 | 225,000 | 1,074.50 | 241,762,500 | |
| 熊谷組 | 27,400 | 3,645.00 | 99,873,000 | |
| 北野建設 | 1,000 | 3,585.00 | 3,585,000 | |
| 植木組 | 1,600 | 1,633.00 | 2,612,800 | |
| 矢作建設工業 | 22,600 | 1,572.00 | 35,527,200 | |
| ピーエス三菱 | 21,100 | 1,013.00 | 21,374,300 | |
| 日本ハウスホールディングス | 35,500 | 325.00 | 11,537,500 | |
| 新日本建設 | 23,300 | 1,581.00 | 36,837,300 | |
| 東亜道路工業 | 32,600 | 1,170.00 | 38,142,000 | |
| 日本道路 | 19,500 | 1,758.00 | 34,281,000 | |
| 東亜建設工業 | 50,200 | 1,009.00 | 50,651,800 | |
| 日本国土開発 | 47,300 | 463.00 | 21,899,900 | |
| 若築建設 | 5,800 | 3,425.00 | 19,865,000 | |
| 東洋建設 | 41,900 | 1,370.00 | 57,403,000 | |
| 五洋建設 | 235,700 | 656.80 | 154,807,760 | |
| 世紀東急工業 | 21,400 | 1,698.00 | 36,337,200 | |
| 福田組 | 6,300 | 5,590.00 | 35,217,000 | |
| 住友林業 | 143,700 | 5,400.00 | 775,980,000 | |
| 日本基礎技術 | 3,300 | 701.00 | 2,313,300 | |
| 巴コーポレーション | 6,900 | 850.00 | 5,865,000 | |
| 大和ハウス工業 | 459,800 | 4,171.00 | 1,917,825,800 | |
| ライト工業 | 33,100 | 2,056.00 | 68,053,600 | |
| 積水ハウス | 504,300 | 3,555.00 | 1,792,786,500 | |
| 日特建設 | 15,900 | 1,097.00 | 17,442,300 | |
| 北陸電気工事 | 11,400 | 1,125.00 | 12,825,000 | |
| ユアテック | 36,600 | 1,583.00 | 57,937,800 | |
| 日本リーテック | 13,000 | 1,185.00 | 15,405,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 四電工 | 7,000 | 3,625.00 | 25,375,000 | |
| 中電工 | 25,800 | 3,225.00 | 83,205,000 | |
| 関電工 | 104,100 | 1,763.00 | 183,528,300 | |
| きんでん | 115,600 | 3,307.00 | 382,289,200 | |
| 東京エネシス | 15,500 | 1,421.00 | 22,025,500 | |
| トーエネック | 5,500 | 5,700.00 | 31,350,000 | |
| 住友電設 | 15,800 | 3,495.00 | 55,221,000 | |
| 日本電設工業 | 31,200 | 1,953.00 | 60,933,600 | |
| エクシオグループ | 162,500 | 1,578.50 | 256,506,250 | |
| 新日本空調 | 10,800 | 4,160.00 | 44,928,000 | |
| 九電工 | 35,900 | 6,152.00 | 220,856,800 | |
| 三機工業 | 35,900 | 2,231.00 | 80,092,900 | |
| 日揮ホールディングス | 164,500 | 1,228.50 | 202,088,250 | |
| 中外炉工業 | 5,400 | 3,020.00 | 16,308,000 | |
| ヤマト | 4,600 | 1,047.00 | 4,816,200 | |
| 太平電業 | 10,400 | 5,630.00 | 58,552,000 | |
| 高砂熱学工業 | 44,500 | 6,090.00 | 271,005,000 | |
| 三晃金属工業 | 700 | 4,510.00 | 3,157,000 | |
| 朝日工業社 | 15,500 | 1,423.00 | 22,056,500 | |
| 明星工業 | 32,200 | 1,253.00 | 40,346,600 | |
| 大氣社 | 19,200 | 5,260.00 | 100,992,000 | |
| ダイダン | 21,900 | 3,095.00 | 67,780,500 | |
| 日比谷総合設備 | 12,000 | 3,490.00 | 41,880,000 | |
| フィル・カンパニー | 2,600 | 640.00 | 1,664,000 | |
| テスホールディングス | 35,800 | 419.00 | 15,000,200 | |
| インフロニア・ホールディングス | 191,700 | 1,340.00 | 256,878,000 | |
| 東洋エンジニアリング | 24,400 | 893.00 | 21,789,200 | |
| レイズネクスト | 24,000 | 1,831.00 | 43,944,000 | |
| ニップン | 50,000 | 2,287.00 | 114,350,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 154,400 | 1,801.00 | 278,074,400 | |
| 日東富士製粉 | 3,000 | 7,000.00 | 21,000,000 | |
| 昭和産業 | 16,200 | 3,155.00 | 51,111,000 | |
| 鳥越製粉 | 4,900 | 698.00 | 3,420,200 | |
| 中部飼料 | 23,100 | 1,541.00 | 35,597,100 | |
| フィード・ワン | 24,400 | 902.00 | 22,008,800 | |
| 東洋精糖 | 1,000 | 1,650.00 | 1,650,000 | |
| 日本甜菜製糖 | 9,700 | 2,022.00 | 19,613,400 | |
| DM三井製糖ホールディングス | 16,600 | 3,305.00 | 54,863,000 | |
| 塩水港精糖 | 7,200 | 277.00 | 1,994,400 | |
| ウェルネオシュガー | 8,300 | 2,376.00 | 19,720,800 | |
| 森永製菓 | 70,500 | 2,554.00 | 180,057,000 | |
| 中村屋 | 4,200 | 3,265.00 | 13,713,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 江崎グリコ | 47,700 | 4,149.00 | 197,907,300 | |
| 名糖産業 | 6,600 | 1,851.00 | 12,216,600 | |
| 井村屋グループ | 10,000 | 2,489.00 | 24,890,000 | |
| 不二家 | 11,400 | 2,533.00 | 28,876,200 | |
| 山崎製パン | 111,700 | 3,568.00 | 398,545,600 | |
| 第一屋製パン | 1,000 | 649.00 | 649,000 | |
| モロゾフ | 5,400 | 4,400.00 | 23,760,000 | |
| 亀田製菓 | 9,600 | 4,115.00 | 39,504,000 | |
| 寿スピリッツ | 78,900 | 1,784.00 | 140,757,600 | |
| カルビー | 76,400 | 3,195.00 | 244,098,000 | |
| 森永乳業 | 58,300 | 3,304.00 | 192,623,200 | |
| 六甲バター | 12,200 | 1,467.00 | 17,897,400 | |
| ヤクルト本社 | 238,600 | 2,832.00 | 675,715,200 | |
| 明治ホールディングス | 204,600 | 3,543.00 | 724,897,800 | |
| 雪印メグミルク | 40,400 | 2,544.00 | 102,777,600 | |
| プリマハム | 22,400 | 2,408.00 | 53,939,200 | |
| 日本ハム | 71,800 | 4,876.00 | 350,096,800 | |
| 林兼産業 | 1,800 | 516.00 | 928,800 | |
| 丸大食品 | 16,800 | 1,710.00 | 28,728,000 | |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 18,400 | 2,916.00 | 53,654,400 | |
| 柿安本店 | 6,500 | 2,657.00 | 17,270,500 | |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 25,500 | 4,190.00 | 106,845,000 | |
| サッポロホールディングス | 54,900 | 5,596.00 | 307,220,400 | |
| アサヒグループホールディングス | 385,700 | 5,880.00 | 2,267,916,000 | |
| キリンホールディングス | 695,300 | 2,219.00 | 1,542,870,700 | |
| 宝ホールディングス | 112,500 | 1,060.50 | 119,306,250 | |
| オエノンホールディングス | 49,900 | 374.00 | 18,662,600 | |
| 養命酒製造 | 5,500 | 2,237.00 | 12,303,500 | |
| コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 130,800 | 1,925.50 | 251,855,400 | |
| ライフドリンク　カンパニー | 3,300 | 5,990.00 | 19,767,000 | |
| サントリー食品インターナショナル | 117,500 | 5,645.00 | 663,287,500 | |
| ダイドーグループホールディングス | 18,900 | 2,658.00 | 50,236,200 | |
| 伊藤園 | 56,600 | 3,671.00 | 207,778,600 | |
| キーコーヒー | 18,700 | 2,050.00 | 38,335,000 | |
| ユニカフェ | 1,800 | 917.00 | 1,650,600 | |
| ジャパンフーズ | 900 | 1,994.00 | 1,794,600 | |
| 日清オイリオグループ | 23,500 | 4,940.00 | 116,090,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 38,900 | 2,540.50 | 98,825,450 | |
| かどや製油 | 700 | 3,645.00 | 2,551,500 | |
| Ｊ－オイルミルズ | 19,100 | 1,955.00 | 37,340,500 | |
| キッコーマン | 553,100 | 1,839.50 | 1,017,427,450 | |
| 味の素 | 396,700 | 5,898.00 | 2,339,736,600 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ブルドックソース | 8,800 | 1,959.00 | 17,239,200 | |
| キユーピー | 89,700 | 3,101.00 | 278,159,700 | |
| ハウス食品グループ本社 | 57,500 | 2,917.00 | 167,727,500 | |
| カゴメ | 71,800 | 3,634.00 | 260,921,200 | |
| アリアケジャパン | 16,600 | 5,090.00 | 84,494,000 | |
| ピエトロ | 800 | 1,802.00 | 1,441,600 | |
| エバラ食品工業 | 4,000 | 2,900.00 | 11,600,000 | |
| やまみ | 800 | 3,100.00 | 2,480,000 | |
| ニチレイ | 76,500 | 3,700.00 | 283,050,000 | |
| 東洋水産 | 84,400 | 9,844.00 | 830,833,600 | |
| イートアンドホールディングス | 7,900 | 2,105.00 | 16,629,500 | |
| 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 | 1,692.00 | 12,859,200 | |
| 日清食品ホールディングス | 176,100 | 4,102.00 | 722,362,200 | |
| 永谷園ホールディングス | 8,200 | 3,095.00 | 25,379,000 | |
| 一正蒲鉾 | 2,400 | 774.00 | 1,857,600 | |
| フジッコ | 17,100 | 1,860.00 | 31,806,000 | |
| ロック・フィールド | 20,400 | 1,511.00 | 30,824,400 | |
| 日本たばこ産業 | 1,014,300 | 4,571.00 | 4,636,365,300 | |
| ケンコーマヨネーズ | 11,500 | 1,913.00 | 21,999,500 | |
| わらべや日洋ホールディングス | 11,200 | 2,338.00 | 26,185,600 | |
| なとり | 10,500 | 2,135.00 | 22,417,500 | |
| イフジ産業 | 1,100 | 1,354.00 | 1,489,400 | |
| ファーマフーズ | 22,100 | 862.00 | 19,050,200 | |
| ユーグレナ | 103,900 | 551.00 | 57,248,900 | |
| 紀文食品 | 14,500 | 1,231.00 | 17,849,500 | |
| ピックルスホールディングス | 9,800 | 1,178.00 | 11,544,400 | |
| ミヨシ油脂 | 2,100 | 1,391.00 | 2,921,100 | |
| 理研ビタミン | 14,400 | 2,650.00 | 38,160,000 | |
| 片倉工業 | 15,800 | 2,140.00 | 33,812,000 | |
| グンゼ | 12,100 | 5,570.00 | 67,397,000 | |
| 東洋紡 | 73,800 | 1,045.00 | 77,121,000 | |
| ユニチカ | 56,700 | 255.00 | 14,458,500 | |
| 富士紡ホールディングス | 7,500 | 4,950.00 | 37,125,000 | |
| 倉敷紡績 | 12,100 | 4,635.00 | 56,083,500 | |
| シキボウ | 11,000 | 1,099.00 | 12,089,000 | |
| 日本毛織 | 43,800 | 1,337.00 | 58,560,600 | |
| トーア紡コーポレーション | 2,200 | 431.00 | 948,200 | |
| 帝国繊維 | 19,400 | 2,328.00 | 45,163,200 | |
| 帝人 | 163,400 | 1,476.00 | 241,178,400 | |
| 東レ | 1,138,200 | 782.80 | 890,982,960 | |
| 住江織物 | 1,200 | 2,515.00 | 3,018,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本フエルト | 4,000 | 467.00 | 1,868,000 | |
| イチカワ | 900 | 1,745.00 | 1,570,500 | |
| 日東製網 | 600 | 1,480.00 | 888,000 | |
| アツギ | 4,000 | 636.00 | 2,544,000 | |
| ダイニック | 1,800 | 828.00 | 1,490,400 | |
| セーレン | 32,900 | 2,520.00 | 82,908,000 | |
| ソトー | 1,900 | 719.00 | 1,366,100 | |
| 東海染工 | 600 | 836.00 | 501,600 | |
| 小松マテーレ | 24,700 | 733.00 | 18,105,100 | |
| ワコールホールディングス | 34,800 | 3,973.00 | 138,260,400 | |
| ホギメディカル | 22,400 | 3,900.00 | 87,360,000 | |
| ＴＳＩホールディングス | 51,000 | 957.00 | 48,807,000 | |
| マツオカコーポレーション | 1,800 | 1,594.00 | 2,869,200 | |
| ワールド | 24,000 | 2,050.00 | 49,200,000 | |
| 三陽商会 | 7,200 | 2,523.00 | 18,165,600 | |
| ナイガイ | 2,100 | 263.00 | 552,300 | |
| オンワードホールディングス | 100,200 | 632.00 | 63,326,400 | |
| ルックホールディングス | 5,300 | 2,761.00 | 14,633,300 | |
| ゴールドウイン | 30,100 | 8,531.00 | 256,783,100 | |
| デサント | 29,300 | 3,390.00 | 99,327,000 | |
| キング | 2,200 | 688.00 | 1,513,600 | |
| ヤマトインターナショナル | 4,600 | 352.00 | 1,619,200 | |
| 特種東海製紙 | 9,300 | 3,625.00 | 33,712,500 | |
| 王子ホールディングス | 707,400 | 645.60 | 456,697,440 | |
| 日本製紙 | 95,800 | 977.00 | 93,596,600 | |
| 三菱製紙 | 7,600 | 837.00 | 6,361,200 | |
| 北越コーポレーション | 83,500 | 1,172.00 | 97,862,000 | |
| 中越パルプ工業 | 2,300 | 1,576.00 | 3,624,800 | |
| 大王製紙 | 75,000 | 848.10 | 63,607,500 | |
| 阿波製紙 | 1,500 | 536.00 | 804,000 | |
| レンゴー | 154,700 | 1,036.50 | 160,346,550 | |
| トーモク | 9,800 | 2,694.00 | 26,401,200 | |
| ザ・パック | 12,600 | 3,660.00 | 46,116,000 | |
| 北の達人コーポレーション | 71,500 | 175.00 | 12,512,500 | |
| クラレ | 247,500 | 1,863.00 | 461,092,500 | |
| 旭化成 | 1,148,800 | 1,025.00 | 1,177,520,000 | |
| 共和レザー | 3,200 | 783.00 | 2,505,600 | |
| 巴川コーポレーション | 1,600 | 996.00 | 1,593,600 | |
| レゾナック・ホールディングス | 164,100 | 3,449.00 | 565,980,900 | |
| 住友化学 | 1,260,200 | 323.50 | 407,674,700 | |
| 住友精化 | 8,000 | 5,080.00 | 40,640,000 | |
| 日産化学 | 79,200 | 4,621.00 | 365,983,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ラサ工業 | 6,500 | 3,040.00 | 19,760,000 | |
| クレハ | 37,100 | 2,816.00 | 104,473,600 | |
| 多木化学 | 6,600 | 4,050.00 | 26,730,000 | |
| テイカ | 13,900 | 1,660.00 | 23,074,000 | |
| 石原産業 | 28,200 | 1,636.00 | 46,135,200 | |
| 片倉コープアグリ | 1,300 | 1,167.00 | 1,517,100 | |
| 日本曹達 | 20,000 | 5,150.00 | 103,000,000 | |
| 東ソー | 226,700 | 2,100.00 | 476,070,000 | |
| トクヤマ | 54,800 | 3,015.00 | 165,222,000 | |
| セントラル硝子 | 18,100 | 3,620.00 | 65,522,000 | |
| 東亞合成 | 81,700 | 1,514.50 | 123,734,650 | |
| 大阪ソーダ | 11,900 | 10,020.00 | 119,238,000 | |
| 関東電化工業 | 32,800 | 905.00 | 29,684,000 | |
| デンカ | 61,800 | 2,165.00 | 133,797,000 | |
| 信越化学工業 | 1,522,800 | 6,206.00 | 9,450,496,800 | |
| 日本カーバイド工業 | 8,100 | 1,897.00 | 15,365,700 | |
| 堺化学工業 | 12,900 | 2,770.00 | 35,733,000 | |
| 第一稀元素化学工業 | 18,600 | 830.00 | 15,438,000 | |
| エア・ウォーター | 160,200 | 2,222.00 | 355,964,400 | |
| 日本酸素ホールディングス | 164,700 | 4,730.00 | 779,031,000 | |
| 日本化学工業 | 6,200 | 2,403.00 | 14,898,600 | |
| 東邦アセチレン | 5,900 | 370.00 | 2,183,000 | |
| 日本パーカライジング | 75,700 | 1,273.00 | 96,366,100 | |
| 高圧ガス工業 | 24,700 | 958.00 | 23,662,600 | |
| チタン工業 | 700 | 1,010.00 | 707,000 | |
| 四国化成ホールディングス | 19,200 | 2,037.00 | 39,110,400 | |
| 戸田工業 | 3,900 | 1,949.00 | 7,601,100 | |
| ステラ　ケミファ | 9,200 | 4,140.00 | 38,088,000 | |
| 保土谷化学工業 | 5,300 | 5,240.00 | 27,772,000 | |
| 日本触媒 | 98,900 | 1,565.50 | 154,827,950 | |
| 大日精化工業 | 11,800 | 3,275.00 | 38,645,000 | |
| カネカ | 41,800 | 4,225.00 | 176,605,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 124,000 | 2,932.00 | 363,568,000 | |
| 三井化学 | 140,100 | 4,683.00 | 656,088,300 | |
| 東京応化工業 | 81,000 | 4,217.00 | 341,577,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 14,200 | 3,440.00 | 48,848,000 | |
| 三菱ケミカルグループ | 1,241,400 | 837.10 | 1,039,175,940 | |
| ＫＨネオケム | 25,900 | 2,249.00 | 58,249,100 | |
| ダイセル | 218,300 | 1,585.50 | 346,114,650 | |
| 住友ベークライト | 47,600 | 4,570.00 | 217,532,000 | |
| 積水化学工業 | 341,200 | 2,239.50 | 764,117,400 | |
| 日本ゼオン | 116,400 | 1,422.50 | 165,579,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| アイカ工業 | 42,900 | 3,421.00 | 146,760,900 | |
| ＵＢＥ | 80,800 | 2,791.50 | 225,553,200 | |
| 積水樹脂 | 25,300 | 2,450.00 | 61,985,000 | |
| タキロンシーアイ | 43,300 | 700.00 | 30,310,000 | |
| 旭有機材 | 11,300 | 4,885.00 | 55,200,500 | |
| ニチバン | 9,200 | 1,825.00 | 16,790,000 | |
| リケンテクノス | 31,800 | 1,012.00 | 32,181,600 | |
| 大倉工業 | 7,900 | 2,950.00 | 23,305,000 | |
| 積水化成品工業 | 23,800 | 455.00 | 10,829,000 | |
| 群栄化学工業 | 4,000 | 3,220.00 | 12,880,000 | |
| タイガースポリマー | 2,600 | 845.00 | 2,197,000 | |
| ミライアル | 1,900 | 1,510.00 | 2,869,000 | |
| ダイキアクシス | 2,300 | 727.00 | 1,672,100 | |
| ダイキョーニシカワ | 37,500 | 695.00 | 26,062,500 | |
| 竹本容器 | 2,100 | 874.00 | 1,835,400 | |
| 森六ホールディングス | 8,800 | 2,795.00 | 24,596,000 | |
| 恵和 | 12,200 | 1,682.00 | 20,520,400 | |
| 日本化薬 | 129,700 | 1,229.50 | 159,466,150 | |
| カーリットホールディングス | 18,300 | 1,290.00 | 23,607,000 | |
| 日本精化 | 11,300 | 2,659.00 | 30,046,700 | |
| 扶桑化学工業 | 18,000 | 3,865.00 | 69,570,000 | |
| トリケミカル研究所 | 20,600 | 4,065.00 | 83,739,000 | |
| ＡＤＥＫＡ | 59,200 | 3,279.00 | 194,116,800 | |
| 日油 | 153,800 | 2,063.00 | 317,289,400 | |
| 新日本理化 | 7,700 | 185.00 | 1,424,500 | |
| ハリマ化成グループ | 11,900 | 886.00 | 10,543,400 | |
| 花王 | 384,000 | 6,740.00 | 2,588,160,000 | |
| 第一工業製薬 | 6,800 | 3,975.00 | 27,030,000 | |
| 石原ケミカル | 7,600 | 2,027.00 | 15,405,200 | |
| 日華化学 | 2,200 | 1,129.00 | 2,483,800 | |
| ニイタカ | 1,100 | 1,885.00 | 2,073,500 | |
| 三洋化成工業 | 10,400 | 3,955.00 | 41,132,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 4,500 | 305.00 | 1,372,500 | |
| 大日本塗料 | 18,800 | 1,223.00 | 22,992,400 | |
| 日本ペイントホールディングス | 901,700 | 1,082.50 | 976,090,250 | |
| 関西ペイント | 146,700 | 2,736.00 | 401,371,200 | |
| 神東塗料 | 4,700 | 128.00 | 601,600 | |
| 中国塗料 | 34,900 | 2,067.00 | 72,138,300 | |
| 日本特殊塗料 | 4,000 | 1,285.00 | 5,140,000 | |
| 藤倉化成 | 19,600 | 561.00 | 10,995,600 | |
| 太陽ホールディングス | 29,600 | 3,145.00 | 93,092,000 | |
| ＤＩＣ | 66,400 | 3,212.00 | 213,276,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| サカタインクス | 37,800 | 1,821.00 | 68,833,800 | |
| ａｒｔｉｅｎｃｅ | 37,000 | 3,425.00 | 126,725,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 946,300 | 3,728.00 | 3,527,806,400 | |
| 資生堂 | 355,000 | 5,072.00 | 1,800,560,000 | |
| ライオン | 216,400 | 1,276.50 | 276,234,600 | |
| 高砂香料工業 | 12,800 | 3,665.00 | 46,912,000 | |
| マンダム | 36,700 | 1,217.00 | 44,663,900 | |
| ミルボン | 23,100 | 3,280.00 | 75,768,000 | |
| ファンケル | 74,400 | 1,959.50 | 145,786,800 | |
| コーセー | 34,600 | 10,510.00 | 363,646,000 | |
| コタ | 17,200 | 1,473.00 | 25,335,600 | |
| シーボン | 800 | 1,398.00 | 1,118,400 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 87,200 | 1,342.50 | 117,066,000 | |
| ノエビアホールディングス | 15,200 | 5,480.00 | 83,296,000 | |
| アジュバンホールディングス | 1,400 | 869.00 | 1,216,600 | |
| 新日本製薬 | 9,700 | 1,656.00 | 16,063,200 | |
| Ｉ－ｎｅ | 4,500 | 1,676.00 | 7,542,000 | |
| アクシージア | 11,200 | 970.00 | 10,864,000 | |
| エステー | 13,100 | 1,557.00 | 20,396,700 | |
| アグロ　カネショウ | 6,800 | 1,200.00 | 8,160,000 | |
| コニシ | 49,100 | 1,235.00 | 60,638,500 | |
| 長谷川香料 | 32,500 | 3,030.00 | 98,475,000 | |
| 小林製薬 | 49,500 | 5,581.00 | 276,259,500 | |
| 荒川化学工業 | 14,400 | 1,136.00 | 16,358,400 | |
| メック | 14,000 | 4,255.00 | 59,570,000 | |
| 日本高純度化学 | 3,800 | 3,255.00 | 12,369,000 | |
| タカラバイオ | 45,800 | 1,008.00 | 46,166,400 | |
| ＪＣＵ | 18,800 | 3,750.00 | 70,500,000 | |
| 新田ゼラチン | 3,800 | 807.00 | 3,066,600 | |
| ＯＡＴアグリオ | 6,300 | 1,554.00 | 9,790,200 | |
| デクセリアルズ | 42,000 | 6,892.00 | 289,464,000 | |
| アース製薬 | 15,400 | 4,745.00 | 73,073,000 | |
| 北興化学工業 | 17,100 | 1,562.00 | 26,710,200 | |
| 大成ラミック | 4,900 | 2,810.00 | 13,769,000 | |
| クミアイ化学工業 | 67,500 | 788.00 | 53,190,000 | |
| 日本農薬 | 31,200 | 746.00 | 23,275,200 | |
| アキレス | 10,700 | 1,615.00 | 17,280,500 | |
| 有沢製作所 | 29,800 | 1,560.00 | 46,488,000 | |
| 日東電工 | 109,200 | 12,250.00 | 1,337,700,000 | |
| レック | 21,800 | 1,307.00 | 28,492,600 | |
| 三光合成 | 21,400 | 682.00 | 14,594,800 | |
| きもと | 9,300 | 213.00 | 1,980,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 藤森工業 | 13,400 | 4,480.00 | 60,032,000 | |
| 前澤化成工業 | 11,000 | 1,835.00 | 20,185,000 | |
| 未来工業 | 6,100 | 4,135.00 | 25,223,500 | |
| ウェーブロックホールディングス | 2,100 | 640.00 | 1,344,000 | |
| ＪＳＰ | 11,900 | 2,222.00 | 26,441,800 | |
| エフピコ | 32,200 | 2,418.00 | 77,859,600 | |
| 天馬 | 12,300 | 2,740.00 | 33,702,000 | |
| 信越ポリマー | 36,700 | 1,460.00 | 53,582,000 | |
| 東リ | 12,400 | 397.00 | 4,922,800 | |
| ニフコ | 50,800 | 3,818.00 | 193,954,400 | |
| バルカー | 14,200 | 3,600.00 | 51,120,000 | |
| ユニ・チャーム | 354,200 | 5,236.00 | 1,854,591,200 | |
| 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 | 205,400 | 2,727.50 | 560,228,500 | |
| 武田薬品工業 | 1,504,800 | 4,241.00 | 6,381,856,800 | |
| アステラス製薬 | 1,491,400 | 1,576.50 | 2,351,192,100 | |
| 住友ファーマ | 126,100 | 351.00 | 44,261,100 | |
| 塩野義製薬 | 206,800 | 6,286.00 | 1,299,944,800 | |
| わかもと製薬 | 5,900 | 254.00 | 1,498,600 | |
| 日本新薬 | 44,500 | 3,148.00 | 140,086,000 | |
| 中外製薬 | 532,200 | 4,811.00 | 2,560,414,200 | |
| 科研製薬 | 29,100 | 3,806.00 | 110,754,600 | |
| エーザイ | 206,800 | 6,872.00 | 1,421,129,600 | |
| ロート製薬 | 164,700 | 2,966.50 | 488,582,550 | |
| 小野薬品工業 | 347,800 | 2,247.00 | 781,506,600 | |
| 久光製薬 | 37,800 | 3,820.00 | 144,396,000 | |
| 持田製薬 | 19,000 | 3,110.00 | 59,090,000 | |
| 参天製薬 | 300,000 | 1,620.00 | 486,000,000 | |
| 扶桑薬品工業 | 6,000 | 2,294.00 | 13,764,000 | |
| 日本ケミファ | 600 | 1,564.00 | 938,400 | |
| ツムラ | 53,500 | 4,042.00 | 216,247,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 28,100 | 3,215.00 | 90,341,500 | |
| 生化学工業 | 28,800 | 813.00 | 23,414,400 | |
| 栄研化学 | 29,300 | 2,039.00 | 59,742,700 | |
| 鳥居薬品 | 9,100 | 3,730.00 | 33,943,000 | |
| ＪＣＲファーマ | 57,600 | 579.00 | 33,350,400 | |
| 東和薬品 | 26,100 | 2,819.00 | 73,575,900 | |
| 富士製薬工業 | 12,600 | 1,488.00 | 18,748,800 | |
| ゼリア新薬工業 | 23,600 | 2,046.00 | 48,285,600 | |
| ネクセラファーマ | 74,400 | 1,517.00 | 112,864,800 | |
| 第一三共 | 1,481,200 | 5,788.00 | 8,573,185,600 | |
| 杏林製薬 | 36,900 | 1,690.00 | 62,361,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大幸薬品 | 35,300 | 388.00 | 13,696,400 | |
| ダイト | 12,900 | 2,292.00 | 29,566,800 | |
| 大塚ホールディングス | 353,700 | 6,541.00 | 2,313,551,700 | |
| ペプチドリーム | 82,400 | 2,100.00 | 173,040,000 | |
| セルソース | 6,300 | 1,220.00 | 7,686,000 | |
| あすか製薬ホールディングス | 17,400 | 2,309.00 | 40,176,600 | |
| サワイグループホールディングス | 38,900 | 5,808.00 | 225,931,200 | |
| 日本コークス工業 | 172,500 | 124.00 | 21,390,000 | |
| ニチレキ | 22,100 | 2,389.00 | 52,796,900 | |
| ユシロ化学工業 | 8,800 | 1,800.00 | 15,840,000 | |
| ビーピー・カストロール | 2,200 | 983.00 | 2,162,600 | |
| 富士石油 | 49,600 | 518.00 | 25,692,800 | |
| ＭＯＲＥＳＣＯ | 2,000 | 1,372.00 | 2,744,000 | |
| 出光興産 | 882,900 | 1,074.50 | 948,676,050 | |
| ＥＮＥＯＳホールディングス | 2,691,800 | 799.70 | 2,152,632,460 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 50,400 | 7,792.00 | 392,716,800 | |
| 横浜ゴム | 86,000 | 3,769.00 | 324,134,000 | |
| ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ | 97,700 | 2,775.00 | 271,117,500 | |
| ブリヂストン | 497,700 | 6,712.00 | 3,340,562,400 | |
| 住友ゴム工業 | 166,800 | 1,716.00 | 286,228,800 | |
| 藤倉コンポジット | 14,700 | 1,415.00 | 20,800,500 | |
| オカモト | 8,000 | 4,850.00 | 38,800,000 | |
| フコク | 8,900 | 2,394.00 | 21,306,600 | |
| ニッタ | 17,300 | 3,970.00 | 68,681,000 | |
| 住友理工 | 26,400 | 1,339.00 | 35,349,600 | |
| 三ツ星ベルト | 19,700 | 4,380.00 | 86,286,000 | |
| バンドー化学 | 25,200 | 1,883.00 | 47,451,600 | |
| 日東紡績 | 21,500 | 6,670.00 | 143,405,000 | |
| ＡＧＣ | 151,700 | 5,371.00 | 814,780,700 | |
| 日本板硝子 | 81,100 | 451.00 | 36,576,100 | |
| 石塚硝子 | 1,000 | 2,908.00 | 2,908,000 | |
| 日本山村硝子 | 2,200 | 1,704.00 | 3,748,800 | |
| 日本電気硝子 | 69,400 | 3,722.00 | 258,306,800 | |
| オハラ | 8,100 | 1,376.00 | 11,145,600 | |
| 住友大阪セメント | 28,300 | 3,855.00 | 109,096,500 | |
| 太平洋セメント | 100,600 | 3,944.00 | 396,766,400 | |
| 日本ヒューム | 15,000 | 1,120.00 | 16,800,000 | |
| 日本コンクリート工業 | 33,300 | 357.00 | 11,888,100 | |
| 三谷セキサン | 7,100 | 5,760.00 | 40,896,000 | |
| アジアパイルホールディングス | 24,300 | 984.00 | 23,911,200 | |
| 東海カーボン | 157,000 | 955.60 | 150,029,200 | |
| 日本カーボン | 9,000 | 5,440.00 | 48,960,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東洋炭素 | 12,000 | 6,970.00 | 83,640,000 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 18,800 | 3,935.00 | 73,978,000 | |
| ＴＯＴＯ | 112,200 | 3,831.00 | 429,838,200 | |
| 日本碍子 | 197,800 | 2,088.50 | 413,105,300 | |
| 日本特殊陶業 | 142,400 | 4,901.00 | 697,902,400 | |
| ＭＡＲＵＷＡ | 6,300 | 36,600.00 | 230,580,000 | |
| 品川リフラクトリーズ | 21,000 | 2,020.00 | 42,420,000 | |
| 黒崎播磨 | 13,900 | 2,995.00 | 41,630,500 | |
| ヨータイ | 10,000 | 1,794.00 | 17,940,000 | |
| 東京窯業 | 6,200 | 432.00 | 2,678,400 | |
| ニッカトー | 2,700 | 565.00 | 1,525,500 | |
| フジミインコーポレーテッド | 45,700 | 2,941.00 | 134,403,700 | |
| クニミネ工業 | 1,700 | 1,154.00 | 1,961,800 | |
| エーアンドエーマテリアル | 1,200 | 1,379.00 | 1,654,800 | |
| ニチアス | 43,000 | 4,595.00 | 197,585,000 | |
| ニチハ | 21,300 | 3,565.00 | 75,934,500 | |
| 日本製鉄 | 784,200 | 3,405.00 | 2,670,201,000 | |
| 神戸製鋼所 | 351,800 | 2,003.50 | 704,831,300 | |
| 中山製鋼所 | 40,000 | 941.00 | 37,640,000 | |
| 合同製鐵 | 9,800 | 5,210.00 | 51,058,000 | |
| ＪＦＥホールディングス | 486,500 | 2,335.00 | 1,135,977,500 | |
| 東京製鐵 | 49,200 | 1,691.00 | 83,197,200 | |
| 共英製鋼 | 19,900 | 2,121.00 | 42,207,900 | |
| 大和工業 | 33,000 | 8,178.00 | 269,874,000 | |
| 東京鐵鋼 | 7,700 | 5,390.00 | 41,503,000 | |
| 大阪製鐵 | 8,100 | 2,387.00 | 19,334,700 | |
| 淀川製鋼所 | 19,900 | 5,380.00 | 107,062,000 | |
| 中部鋼鈑 | 11,500 | 2,794.00 | 32,131,000 | |
| 丸一鋼管 | 53,300 | 3,787.00 | 201,847,100 | |
| モリ工業 | 4,000 | 5,210.00 | 20,840,000 | |
| 大同特殊鋼 | 110,200 | 1,540.00 | 169,708,000 | |
| 日本高周波鋼業 | 2,300 | 460.00 | 1,058,000 | |
| 日本冶金工業 | 12,800 | 4,705.00 | 60,224,000 | |
| 山陽特殊製鋼 | 17,300 | 2,152.00 | 37,229,600 | |
| 愛知製鋼 | 10,100 | 3,690.00 | 37,269,000 | |
| 日本金属 | 1,500 | 727.00 | 1,090,500 | |
| 大平洋金属 | 14,900 | 1,287.00 | 19,176,300 | |
| 新日本電工 | 87,100 | 286.00 | 24,910,600 | |
| 栗本鐵工所 | 8,100 | 4,750.00 | 38,475,000 | |
| 虹技 | 800 | 1,198.00 | 958,400 | |
| 三菱製鋼 | 13,000 | 1,503.00 | 19,539,000 | |
| 日亜鋼業 | 5,900 | 318.00 | 1,876,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本精線 | 13,900 | 1,245.00 | 17,305,500 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 15,600 | 520.00 | 8,112,000 | |
| シンニッタン | 7,300 | 233.00 | 1,700,900 | |
| 新家工業 | 1,300 | 5,250.00 | 6,825,000 | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 22,500 | 1,297.00 | 29,182,500 | |
| 日本軽金属ホールディングス | 51,300 | 1,818.00 | 93,263,400 | |
| 三井金属鉱業 | 51,000 | 4,968.00 | 253,368,000 | |
| 三菱マテリアル | 125,200 | 2,976.50 | 372,657,800 | |
| 住友金属鉱山 | 202,900 | 4,850.00 | 984,065,000 | |
| ＤＯＷＡホールディングス | 43,300 | 5,721.00 | 247,719,300 | |
| 古河機械金属 | 23,300 | 1,874.00 | 43,664,200 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 30,500 | 2,930.00 | 89,365,000 | |
| 東邦チタニウム | 36,500 | 1,286.00 | 46,939,000 | |
| ＵＡＣＪ | 24,600 | 4,120.00 | 101,352,000 | |
| ＣＫサンエツ | 4,300 | 3,820.00 | 16,426,000 | |
| 古河電気工業 | 58,400 | 4,163.00 | 243,119,200 | |
| 住友電気工業 | 654,500 | 2,659.50 | 1,740,642,750 | |
| フジクラ | 206,500 | 3,259.00 | 672,983,500 | |
| ＳＷＣＣ | 19,600 | 4,730.00 | 92,708,000 | |
| タツタ電線 | 31,900 | 715.00 | 22,808,500 | |
| カナレ電気 | 1,000 | 1,556.00 | 1,556,000 | |
| 平河ヒューテック | 11,500 | 1,463.00 | 16,824,500 | |
| リョービ | 18,800 | 2,418.00 | 45,458,400 | |
| アーレスティ | 6,300 | 704.00 | 4,435,200 | |
| ＡＲＥホールディングス | 65,900 | 2,042.00 | 134,567,800 | |
| 稲葉製作所 | 9,700 | 2,026.00 | 19,652,200 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 8,800 | 4,520.00 | 39,776,000 | |
| トーカロ | 50,400 | 1,919.00 | 96,717,600 | |
| アルファＣｏ | 2,100 | 1,389.00 | 2,916,900 | |
| ＳＵＭＣＯ | 310,800 | 2,393.00 | 743,744,400 | |
| 川田テクノロジーズ | 12,400 | 2,739.00 | 33,963,600 | |
| ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ | 11,700 | 3,630.00 | 42,471,000 | |
| ジェイテックコーポレーション | 1,000 | 1,835.00 | 1,835,000 | |
| 信和 | 3,700 | 739.00 | 2,734,300 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 100,300 | 2,482.50 | 248,994,750 | |
| ホッカンホールディングス | 8,500 | 1,710.00 | 14,535,000 | |
| コロナ | 9,800 | 934.00 | 9,153,200 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 27,400 | 2,718.00 | 74,473,200 | |
| 駒井ハルテック | 1,000 | 1,813.00 | 1,813,000 | |
| 高田機工 | 400 | 3,685.00 | 1,474,000 | |
| 三和ホールディングス | 174,200 | 2,969.50 | 517,286,900 | |
| 文化シヤッター | 45,800 | 1,761.00 | 80,653,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三協立山 | 22,000 | 800.00 | 17,600,000 | |
| アルインコ | 13,300 | 1,085.00 | 14,430,500 | |
| 東洋シヤッター | 1,300 | 976.00 | 1,268,800 | |
| ＬＩＸＩＬ | 273,100 | 1,695.50 | 463,041,050 | |
| 日本フイルコン | 3,800 | 525.00 | 1,995,000 | |
| ノーリツ | 27,700 | 1,767.00 | 48,945,900 | |
| 長府製作所 | 17,400 | 2,185.00 | 38,019,000 | |
| リンナイ | 83,700 | 3,703.00 | 309,941,100 | |
| ダイニチ工業 | 2,900 | 678.00 | 1,966,200 | |
| 日東精工 | 25,300 | 580.00 | 14,674,000 | |
| 三洋工業 | 700 | 3,315.00 | 2,320,500 | |
| 岡部 | 31,200 | 779.00 | 24,304,800 | |
| ジーテクト | 22,300 | 1,882.00 | 41,968,600 | |
| 東プレ | 30,800 | 2,178.00 | 67,082,400 | |
| 高周波熱錬 | 25,900 | 1,100.00 | 28,490,000 | |
| 東京製綱 | 11,300 | 1,306.00 | 14,757,800 | |
| サンコール | 17,500 | 443.00 | 7,752,500 | |
| モリテック　スチール | 5,100 | 230.00 | 1,173,000 | |
| パイオラックス | 21,700 | 2,265.00 | 49,150,500 | |
| エイチワン | 18,000 | 885.00 | 15,930,000 | |
| 日本発條 | 154,700 | 1,636.00 | 253,089,200 | |
| 中央発條 | 13,000 | 1,175.00 | 15,275,000 | |
| アドバネクス | 700 | 1,068.00 | 747,600 | |
| 立川ブラインド工業 | 7,900 | 1,370.00 | 10,823,000 | |
| 三益半導体工業 | 15,800 | 3,690.00 | 58,302,000 | |
| 日本ドライケミカル | 1,400 | 2,549.00 | 3,568,600 | |
| 日本製鋼所 | 47,200 | 4,577.00 | 216,034,400 | |
| 三浦工業 | 71,500 | 3,232.00 | 231,088,000 | |
| タクマ | 57,900 | 1,667.00 | 96,519,300 | |
| ツガミ | 38,100 | 1,442.00 | 54,940,200 | |
| オークマ | 15,000 | 6,593.00 | 98,895,000 | |
| 芝浦機械 | 17,100 | 3,595.00 | 61,474,500 | |
| アマダ | 259,500 | 1,751.00 | 454,384,500 | |
| アイダエンジニアリング | 39,700 | 871.00 | 34,578,700 | |
| ＦＵＪＩ | 80,600 | 2,483.00 | 200,129,800 | |
| 牧野フライス製作所 | 18,900 | 6,600.00 | 124,740,000 | |
| オーエスジー | 75,500 | 1,910.50 | 144,242,750 | |
| ダイジェット工業 | 600 | 841.00 | 504,600 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 39,600 | 898.00 | 35,560,800 | |
| ＤＭＧ森精機 | 117,000 | 4,420.00 | 517,140,000 | |
| ソディック | 41,700 | 714.00 | 29,773,800 | |
| ディスコ | 82,400 | 59,400.00 | 4,894,560,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日東工器 | 8,300 | 2,248.00 | 18,658,400 | |
| 日進工具 | 15,900 | 972.00 | 15,454,800 | |
| パンチ工業 | 5,600 | 462.00 | 2,587,200 | |
| 冨士ダイス | 11,500 | 794.00 | 9,131,000 | |
| 豊和工業 | 3,100 | 816.00 | 2,529,600 | |
| リケンＮＰＲ | 18,600 | 2,683.00 | 49,903,800 | |
| 東洋機械金属 | 4,700 | 712.00 | 3,346,400 | |
| エンシュウ | 1,400 | 713.00 | 998,200 | |
| 島精機製作所 | 27,300 | 1,550.00 | 42,315,000 | |
| オプトラン | 28,100 | 2,033.00 | 57,127,300 | |
| ＮＣホールディングス | 1,300 | 2,204.00 | 2,865,200 | |
| イワキポンプ | 11,400 | 2,485.00 | 28,329,000 | |
| フリュー | 16,200 | 1,071.00 | 17,350,200 | |
| ヤマシンフィルタ | 40,800 | 367.00 | 14,973,600 | |
| 日阪製作所 | 18,700 | 1,045.00 | 19,541,500 | |
| やまびこ | 28,000 | 2,115.00 | 59,220,000 | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 23,200 | 4,515.00 | 104,748,000 | |
| 平田機工 | 8,200 | 6,650.00 | 54,530,000 | |
| ＰＥＧＡＳＵＳ | 19,000 | 530.00 | 10,070,000 | |
| マルマエ | 7,500 | 2,135.00 | 16,012,500 | |
| タツモ | 10,400 | 3,665.00 | 38,116,000 | |
| ナブテスコ | 107,500 | 2,609.00 | 280,467,500 | |
| 三井海洋開発 | 21,700 | 2,682.00 | 58,199,400 | |
| レオン自動機 | 19,800 | 1,563.00 | 30,947,400 | |
| ＳＭＣ | 51,200 | 77,990.00 | 3,993,088,000 | |
| ホソカワミクロン | 12,000 | 4,170.00 | 50,040,000 | |
| ユニオンツール | 7,500 | 5,780.00 | 43,350,000 | |
| 瑞光 | 12,400 | 1,070.00 | 13,268,000 | |
| オイレス工業 | 23,200 | 2,294.00 | 53,220,800 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 6,000 | 4,955.00 | 29,730,000 | |
| サトーホールディングス | 24,400 | 2,164.00 | 52,801,600 | |
| 技研製作所 | 16,100 | 1,885.00 | 30,348,500 | |
| 日本エアーテック | 8,000 | 1,183.00 | 9,464,000 | |
| カワタ | 1,800 | 905.00 | 1,629,000 | |
| 日精樹脂工業 | 12,800 | 1,022.00 | 13,081,600 | |
| オカダアイヨン | 1,900 | 2,410.00 | 4,579,000 | |
| ワイエイシイホールディングス | 7,300 | 2,383.00 | 17,395,900 | |
| 小松製作所 | 802,600 | 4,602.00 | 3,693,565,200 | |
| 住友重機械工業 | 101,300 | 4,126.00 | 417,963,800 | |
| 日立建機 | 68,200 | 4,190.00 | 285,758,000 | |
| 日工 | 25,500 | 740.00 | 18,870,000 | |
| 巴工業 | 6,700 | 4,340.00 | 29,078,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 井関農機 | 16,100 | 1,023.00 | 16,470,300 | |
| ＴＯＷＡ | 19,100 | 11,340.00 | 216,594,000 | |
| 丸山製作所 | 1,000 | 2,351.00 | 2,351,000 | |
| 北川鉄工所 | 6,800 | 1,411.00 | 9,594,800 | |
| ローツェ | 8,900 | 29,700.00 | 264,330,000 | |
| タカキタ | 1,900 | 470.00 | 893,000 | |
| クボタ | 895,200 | 2,215.00 | 1,982,868,000 | |
| 荏原実業 | 9,000 | 3,460.00 | 31,140,000 | |
| 三菱化工機 | 6,000 | 4,060.00 | 24,360,000 | |
| 月島ホールディングス | 23,200 | 1,384.00 | 32,108,800 | |
| 帝国電機製作所 | 11,700 | 2,401.00 | 28,091,700 | |
| 新東工業 | 34,700 | 1,066.00 | 36,990,200 | |
| 澁谷工業 | 16,100 | 3,775.00 | 60,777,500 | |
| アイチ　コーポレーション | 23,700 | 1,200.00 | 28,440,000 | |
| 小森コーポレーション | 42,200 | 1,286.00 | 54,269,200 | |
| 鶴見製作所 | 13,100 | 4,400.00 | 57,640,000 | |
| 日本ギア工業 | 2,200 | 545.00 | 1,199,000 | |
| 酒井重工業 | 3,000 | 5,990.00 | 17,970,000 | |
| 荏原製作所 | 70,300 | 11,760.00 | 826,728,000 | |
| 石井鐵工所 | 700 | 2,825.00 | 1,977,500 | |
| 酉島製作所 | 14,800 | 3,285.00 | 48,618,000 | |
| 北越工業 | 17,200 | 2,389.00 | 41,090,800 | |
| ダイキン工業 | 204,400 | 22,900.00 | 4,680,760,000 | |
| オルガノ | 20,600 | 8,300.00 | 170,980,000 | |
| トーヨーカネツ | 5,800 | 3,835.00 | 22,243,000 | |
| 栗田工業 | 95,800 | 6,681.00 | 640,039,800 | |
| 椿本チエイン | 23,500 | 5,910.00 | 138,885,000 | |
| 大同工業 | 2,500 | 848.00 | 2,120,000 | |
| 木村化工機 | 13,200 | 694.00 | 9,160,800 | |
| アネスト岩田 | 26,500 | 1,522.00 | 40,333,000 | |
| ダイフク | 289,000 | 2,885.00 | 833,765,000 | |
| サムコ | 4,100 | 4,090.00 | 16,769,000 | |
| 加藤製作所 | 2,900 | 1,312.00 | 3,804,800 | |
| 油研工業 | 1,000 | 2,381.00 | 2,381,000 | |
| タダノ | 98,600 | 1,107.50 | 109,199,500 | |
| フジテック | 40,000 | 4,103.00 | 164,120,000 | |
| ＣＫＤ | 47,400 | 3,135.00 | 148,599,000 | |
| 平和 | 50,600 | 2,022.00 | 102,313,200 | |
| 理想科学工業 | 13,700 | 3,190.00 | 43,703,000 | |
| ＳＡＮＫＹＯ | 164,900 | 1,614.50 | 266,231,050 | |
| 日本金銭機械 | 20,700 | 1,297.00 | 26,847,900 | |
| マースグループホールディングス | 8,700 | 3,780.00 | 32,886,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| フクシマガリレイ | 11,200 | 6,530.00 | 73,136,000 | |
| オーイズミ | 2,200 | 372.00 | 818,400 | |
| ダイコク電機 | 8,400 | 3,930.00 | 33,012,000 | |
| 竹内製作所 | 31,100 | 5,810.00 | 180,691,000 | |
| アマノ | 48,600 | 3,955.00 | 192,213,000 | |
| ＪＵＫＩ | 26,600 | 489.00 | 13,007,400 | |
| ジャノメ | 17,400 | 677.00 | 11,779,800 | |
| マックス | 24,100 | 3,805.00 | 91,700,500 | |
| グローリー | 41,100 | 2,759.50 | 113,415,450 | |
| 新晃工業 | 17,300 | 3,845.00 | 66,518,500 | |
| 大和冷機工業 | 26,300 | 1,503.00 | 39,528,900 | |
| セガサミーホールディングス | 152,900 | 2,321.00 | 354,880,900 | |
| ＴＰＲ | 21,800 | 2,404.00 | 52,407,200 | |
| ツバキ・ナカシマ | 34,300 | 781.00 | 26,788,300 | |
| ホシザキ | 101,000 | 5,589.00 | 564,489,000 | |
| 大豊工業 | 14,800 | 803.00 | 11,884,400 | |
| 日本精工 | 317,000 | 751.90 | 238,352,300 | |
| ＮＴＮ | 371,400 | 317.40 | 117,882,360 | |
| ジェイテクト | 152,400 | 1,110.00 | 169,164,000 | |
| 不二越 | 12,600 | 3,430.00 | 43,218,000 | |
| 日本トムソン | 46,700 | 602.00 | 28,113,400 | |
| ＴＨＫ | 98,800 | 3,010.00 | 297,388,000 | |
| ユーシン精機 | 13,600 | 721.00 | 9,805,600 | |
| 前澤給装工業 | 12,300 | 1,330.00 | 16,359,000 | |
| イーグル工業 | 18,900 | 1,849.00 | 34,946,100 | |
| 前澤工業 | 3,600 | 1,385.00 | 4,986,000 | |
| 日本ピラー工業 | 15,900 | 5,260.00 | 83,634,000 | |
| キッツ | 57,300 | 1,149.00 | 65,837,700 | |
| マキタ | 195,300 | 4,487.00 | 876,311,100 | |
| 三井Ｅ＆Ｓ | 85,000 | 1,485.00 | 126,225,000 | |
| 日立造船 | 151,100 | 1,090.00 | 164,699,000 | |
| 三菱重工業 | 2,994,400 | 1,405.00 | 4,207,132,000 | |
| ＩＨＩ | 127,500 | 3,870.00 | 493,425,000 | |
| スター精密 | 31,500 | 2,142.00 | 67,473,000 | |
| 日清紡ホールディングス | 128,700 | 1,079.00 | 138,867,300 | |
| イビデン | 89,300 | 6,383.00 | 570,001,900 | |
| コニカミノルタ | 382,800 | 485.10 | 185,696,280 | |
| ブラザー工業 | 228,800 | 3,008.00 | 688,230,400 | |
| ミネベアミツミ | 297,900 | 3,315.00 | 987,538,500 | |
| 日立製作所 | 822,500 | 17,150.00 | 14,105,875,000 | |
| 三菱電機 | 1,905,800 | 2,686.50 | 5,119,931,700 | |
| 富士電機 | 104,100 | 9,283.00 | 966,360,300 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東洋電機製造 | 2,000 | 1,082.00 | 2,164,000 | |
| 安川電機 | 186,000 | 5,990.00 | 1,114,140,000 | |
| シンフォニアテクノロジー | 18,900 | 3,345.00 | 63,220,500 | |
| 明電舎 | 31,700 | 4,115.00 | 130,445,500 | |
| オリジン | 1,300 | 1,331.00 | 1,730,300 | |
| 山洋電気 | 7,400 | 7,030.00 | 52,022,000 | |
| デンヨー | 13,000 | 2,753.00 | 35,789,000 | |
| ＰＨＣホールディングス | 32,200 | 1,184.00 | 38,124,800 | |
| ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ | 88,900 | 4,570.00 | 406,273,000 | |
| ソシオネクスト | 124,800 | 4,257.00 | 531,273,600 | |
| 東芝テック | 21,900 | 3,115.00 | 68,218,500 | |
| 芝浦メカトロニクス | 9,800 | 7,500.00 | 73,500,000 | |
| マブチモーター | 84,300 | 2,416.00 | 203,668,800 | |
| ニデック | 378,000 | 7,052.00 | 2,665,656,000 | |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 11,200 | 389.00 | 4,356,800 | |
| トレックス・セミコンダクター | 8,900 | 1,853.00 | 16,491,700 | |
| 東光高岳 | 10,400 | 2,060.00 | 21,424,000 | |
| ダブル・スコープ | 49,000 | 485.00 | 23,765,000 | |
| ダイヘン | 16,200 | 8,740.00 | 141,588,000 | |
| ヤーマン | 33,500 | 959.00 | 32,126,500 | |
| ＪＶＣケンウッド | 135,400 | 939.00 | 127,140,600 | |
| ミマキエンジニアリング | 16,400 | 1,997.00 | 32,750,800 | |
| Ｉ－ＰＥＸ | 12,000 | 2,029.00 | 24,348,000 | |
| 大崎電気工業 | 37,500 | 662.00 | 24,825,000 | |
| オムロン | 130,800 | 5,122.00 | 669,957,600 | |
| 日東工業 | 23,100 | 3,375.00 | 77,962,500 | |
| ＩＤＥＣ | 25,300 | 2,910.00 | 73,623,000 | |
| 正興電機製作所 | 2,000 | 1,551.00 | 3,102,000 | |
| 不二電機工業 | 1,300 | 1,126.00 | 1,463,800 | |
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 66,900 | 3,237.00 | 216,555,300 | |
| サクサホールディングス | 1,300 | 2,679.00 | 3,482,700 | |
| メルコホールディングス | 5,400 | 3,485.00 | 18,819,000 | |
| テクノメディカ | 4,300 | 1,782.00 | 7,662,600 | |
| 日本電気 | 224,900 | 12,305.00 | 2,767,394,500 | |
| 富士通 | 1,575,600 | 2,480.50 | 3,908,275,800 | |
| 沖電気工業 | 77,400 | 1,038.00 | 80,341,200 | |
| 岩崎通信機 | 2,700 | 1,321.00 | 3,566,700 | |
| 電気興業 | 6,900 | 2,119.00 | 14,621,100 | |
| サンケン電気 | 15,900 | 6,399.00 | 101,744,100 | |
| ナカヨ | 900 | 1,194.00 | 1,074,600 | |
| アイホン | 9,200 | 3,020.00 | 27,784,000 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 1,067,400 | 2,980.00 | 3,180,852,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| セイコーエプソン | 219,700 | 2,500.50 | 549,359,850 | |
| ワコム | 125,500 | 712.00 | 89,356,000 | |
| アルバック | 37,500 | 11,180.00 | 419,250,000 | |
| アクセル | 7,800 | 1,420.00 | 11,076,000 | |
| ＥＩＺＯ | 12,500 | 4,825.00 | 60,312,500 | |
| 日本信号 | 39,000 | 1,020.00 | 39,780,000 | |
| 京三製作所 | 35,900 | 639.00 | 22,940,100 | |
| 能美防災 | 23,200 | 2,292.00 | 53,174,400 | |
| ホーチキ | 12,900 | 2,170.00 | 27,993,000 | |
| 星和電機 | 2,800 | 562.00 | 1,573,600 | |
| エレコム | 41,000 | 1,573.00 | 64,493,000 | |
| パナソニック　ホールディングス | 2,022,700 | 1,357.50 | 2,745,815,250 | |
| シャープ | 288,600 | 979.10 | 282,568,260 | |
| アンリツ | 120,600 | 1,142.50 | 137,785,500 | |
| 富士通ゼネラル | 48,500 | 2,078.00 | 100,783,000 | |
| ソニーグループ | 1,186,600 | 13,360.00 | 15,852,976,000 | |
| ＴＤＫ | 271,100 | 8,455.00 | 2,292,150,500 | |
| 帝国通信工業 | 7,600 | 1,968.00 | 14,956,800 | |
| タムラ製作所 | 68,200 | 702.00 | 47,876,400 | |
| アルプスアルパイン | 153,000 | 1,485.00 | 227,205,000 | |
| 池上通信機 | 1,800 | 784.00 | 1,411,200 | |
| 日本電波工業 | 20,700 | 1,112.00 | 23,018,400 | |
| 鈴木 | 9,300 | 1,469.00 | 13,661,700 | |
| メイコー | 17,000 | 7,240.00 | 123,080,000 | |
| 日本トリム | 3,900 | 3,275.00 | 12,772,500 | |
| ローランド　ディー．ジー． | 6,600 | 5,340.00 | 35,244,000 | |
| フォスター電機 | 12,700 | 1,708.00 | 21,691,600 | |
| ＳＭＫ | 4,600 | 2,427.00 | 11,164,200 | |
| ヨコオ | 15,200 | 2,090.00 | 31,768,000 | |
| ホシデン | 39,000 | 2,011.00 | 78,429,000 | |
| ヒロセ電機 | 25,300 | 17,545.00 | 443,888,500 | |
| 日本航空電子工業 | 41,000 | 2,425.00 | 99,425,000 | |
| ＴＯＡ | 19,500 | 1,087.00 | 21,196,500 | |
| マクセル | 37,900 | 1,837.00 | 69,622,300 | |
| 古野電気 | 22,300 | 2,124.00 | 47,365,200 | |
| スミダコーポレーション | 23,100 | 1,179.00 | 27,234,900 | |
| アイコム | 6,600 | 3,035.00 | 20,031,000 | |
| リオン | 7,100 | 2,984.00 | 21,186,400 | |
| 横河電機 | 187,300 | 3,966.00 | 742,831,800 | |
| 新電元工業 | 6,600 | 3,005.00 | 19,833,000 | |
| アズビル | 116,600 | 4,221.00 | 492,168,600 | |
| 東亜ディーケーケー | 2,900 | 855.00 | 2,479,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 日本光電工業 | 72,800 | 4,716.00 | 343,324,800 | |
| チノー | 7,000 | 2,558.00 | 17,906,000 | |
| 共和電業 | 5,200 | 450.00 | 2,340,000 | |
| 日本電子材料 | 10,400 | 3,315.00 | 34,476,000 | |
| 堀場製作所 | 32,400 | 12,455.00 | 403,542,000 | |
| アドバンテスト | 485,700 | 5,348.00 | 2,597,523,600 | |
| 小野測器 | 2,600 | 707.00 | 1,838,200 | |
| エスペック | 13,600 | 3,185.00 | 43,316,000 | |
| キーエンス | 169,500 | 70,620.00 | 11,970,090,000 | |
| 日置電機 | 8,000 | 6,800.00 | 54,400,000 | |
| シスメックス | 439,000 | 2,600.00 | 1,141,400,000 | |
| 日本マイクロニクス | 30,500 | 5,760.00 | 175,680,000 | |
| メガチップス | 13,400 | 4,195.00 | 56,213,000 | |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 10,600 | 4,145.00 | 43,937,000 | |
| 澤藤電機 | 800 | 1,235.00 | 988,000 | |
| 原田工業 | 2,800 | 575.00 | 1,610,000 | |
| コーセル | 18,200 | 1,340.00 | 24,388,000 | |
| イリソ電子工業 | 15,600 | 3,040.00 | 47,424,000 | |
| オプテックスグループ | 31,200 | 1,687.00 | 52,634,400 | |
| 千代田インテグレ | 6,700 | 3,080.00 | 20,636,000 | |
| レーザーテック | 77,700 | 37,400.00 | 2,905,980,000 | |
| スタンレー電気 | 108,600 | 2,866.50 | 311,301,900 | |
| ウシオ電機 | 75,100 | 2,079.50 | 156,170,450 | |
| 岡谷電機産業 | 5,100 | 248.00 | 1,264,800 | |
| ヘリオス　テクノ　ホールディング | 6,000 | 883.00 | 5,298,000 | |
| エノモト | 1,700 | 1,485.00 | 2,524,500 | |
| 日本セラミック | 13,900 | 2,583.00 | 35,903,700 | |
| 遠藤照明 | 2,600 | 1,582.00 | 4,113,200 | |
| 古河電池 | 12,600 | 1,180.00 | 14,868,000 | |
| 山一電機 | 15,300 | 3,365.00 | 51,484,500 | |
| 図研 | 14,200 | 3,970.00 | 56,374,000 | |
| 日本電子 | 42,500 | 6,996.00 | 297,330,000 | |
| カシオ計算機 | 122,500 | 1,175.50 | 143,998,750 | |
| ファナック | 826,700 | 4,364.00 | 3,607,718,800 | |
| 日本シイエムケイ | 40,100 | 594.00 | 23,819,400 | |
| エンプラス | 5,000 | 7,820.00 | 39,100,000 | |
| 大真空 | 25,500 | 696.00 | 17,748,000 | |
| ローム | 313,500 | 2,052.50 | 643,458,750 | |
| 浜松ホトニクス | 136,100 | 4,677.00 | 636,539,700 | |
| 三井ハイテック | 15,000 | 6,976.00 | 104,640,000 | |
| 新光電気工業 | 60,000 | 5,657.00 | 339,420,000 | |
| 京セラ | 1,053,500 | 1,821.00 | 1,918,423,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 太陽誘電 | 82,600 | 3,460.00 | 285,796,000 | |
| 村田製作所 | 1,542,500 | 3,083.00 | 4,755,527,500 | |
| 双葉電子工業 | 32,600 | 567.00 | 18,484,200 | |
| 北陸電気工業 | 2,200 | 1,390.00 | 3,058,000 | |
| ニチコン | 44,700 | 1,143.00 | 51,092,100 | |
| 日本ケミコン | 18,200 | 1,603.00 | 29,174,600 | |
| ＫＯＡ | 25,800 | 1,493.00 | 38,519,400 | |
| 市光工業 | 30,900 | 541.00 | 16,716,900 | |
| 小糸製作所 | 175,700 | 2,177.50 | 382,586,750 | |
| ミツバ | 31,800 | 1,097.00 | 34,884,600 | |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 58,000 | 15,140.00 | 878,120,000 | |
| キヤノン電子 | 18,800 | 2,291.00 | 43,070,800 | |
| キヤノン | 845,600 | 4,571.00 | 3,865,237,600 | |
| リコー | 425,100 | 1,471.50 | 625,534,650 | |
| 象印マホービン | 46,200 | 1,512.00 | 69,854,400 | |
| ＭＵＴＯＨホールディングス | 800 | 2,555.00 | 2,044,000 | |
| 東京エレクトロン | 358,600 | 34,780.00 | 12,472,108,000 | |
| イノテック | 11,400 | 1,723.00 | 19,642,200 | |
| トヨタ紡織 | 71,400 | 2,182.50 | 155,830,500 | |
| 芦森工業 | 1,200 | 2,456.00 | 2,947,200 | |
| ユニプレス | 30,500 | 1,352.00 | 41,236,000 | |
| 豊田自動織機 | 144,600 | 14,060.00 | 2,033,076,000 | |
| モリタホールディングス | 29,800 | 1,835.00 | 54,683,000 | |
| 三櫻工業 | 25,900 | 975.00 | 25,252,500 | |
| デンソー | 1,398,700 | 2,475.00 | 3,461,782,500 | |
| 東海理化電機製作所 | 47,800 | 2,165.00 | 103,487,000 | |
| 川崎重工業 | 138,400 | 5,736.00 | 793,862,400 | |
| 名村造船所 | 47,500 | 2,439.00 | 115,852,500 | |
| 日本車輌製造 | 5,600 | 2,358.00 | 13,204,800 | |
| 三菱ロジスネクスト | 27,100 | 1,413.00 | 38,292,300 | |
| 近畿車輛 | 800 | 1,922.00 | 1,537,600 | |
| 日産自動車 | 2,230,600 | 545.10 | 1,215,900,060 | |
| いすゞ自動車 | 476,000 | 2,015.00 | 959,140,000 | |
| トヨタ自動車 | 9,304,300 | 3,272.00 | 30,443,669,600 | |
| 日野自動車 | 255,000 | 434.80 | 110,874,000 | |
| 三菱自動車工業 | 661,400 | 440.20 | 291,148,280 | |
| エフテック | 4,000 | 654.00 | 2,616,000 | |
| レシップホールディングス | 2,400 | 612.00 | 1,468,800 | |
| ＧＭＢ | 1,100 | 1,338.00 | 1,471,800 | |
| ファルテック | 1,200 | 556.00 | 667,200 | |
| 武蔵精密工業 | 41,500 | 1,688.00 | 70,052,000 | |
| 日産車体 | 17,200 | 996.00 | 17,131,200 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 新明和工業 | 48,800 | 1,402.00 | 68,417,600 | |
| 極東開発工業 | 28,000 | 2,468.00 | 69,104,000 | |
| トピー工業 | 13,800 | 2,449.00 | 33,796,200 | |
| ティラド | 3,800 | 3,575.00 | 13,585,000 | |
| 曙ブレーキ工業 | 103,500 | 135.00 | 13,972,500 | |
| タチエス | 31,300 | 1,923.00 | 60,189,900 | |
| ＮＯＫ | 65,900 | 2,111.50 | 139,147,850 | |
| フタバ産業 | 45,500 | 860.00 | 39,130,000 | |
| カヤバ | 16,000 | 5,390.00 | 86,240,000 | |
| 大同メタル工業 | 33,200 | 598.00 | 19,853,600 | |
| プレス工業 | 67,800 | 647.00 | 43,866,600 | |
| ミクニ | 7,200 | 408.00 | 2,937,600 | |
| 太平洋工業 | 38,900 | 1,539.00 | 59,867,100 | |
| アイシン | 130,800 | 5,795.00 | 757,986,000 | |
| マツダ | 560,800 | 1,567.50 | 879,054,000 | |
| 今仙電機製作所 | 3,600 | 622.00 | 2,239,200 | |
| 本田技研工業 | 4,016,800 | 1,708.00 | 6,860,694,400 | |
| スズキ | 1,245,500 | 1,881.00 | 2,342,785,500 | |
| ＳＵＢＡＲＵ | 525,700 | 3,426.00 | 1,801,048,200 | |
| 安永 | 2,500 | 603.00 | 1,507,500 | |
| ヤマハ発動機 | 732,700 | 1,506.50 | 1,103,812,550 | |
| ＴＢＫ | 6,200 | 305.00 | 1,891,000 | |
| エクセディ | 27,700 | 2,618.00 | 72,518,600 | |
| 豊田合成 | 48,600 | 2,914.50 | 141,644,700 | |
| 愛三工業 | 28,100 | 1,356.00 | 38,103,600 | |
| 盟和産業 | 800 | 1,008.00 | 806,400 | |
| 日本プラスト | 4,900 | 427.00 | 2,092,300 | |
| ヨロズ | 15,900 | 1,096.00 | 17,426,400 | |
| エフ・シー・シー | 30,100 | 2,289.00 | 68,898,900 | |
| シマノ | 68,300 | 26,175.00 | 1,787,752,500 | |
| テイ・エス　テック | 60,400 | 1,869.50 | 112,917,800 | |
| ジャムコ | 9,200 | 1,434.00 | 13,192,800 | |
| テルモ | 945,100 | 2,720.00 | 2,570,672,000 | |
| クリエートメディック | 1,800 | 988.00 | 1,778,400 | |
| 日機装 | 39,500 | 1,201.00 | 47,439,500 | |
| 日本エム・ディ・エム | 13,400 | 631.00 | 8,455,400 | |
| 島津製作所 | 225,200 | 4,083.00 | 919,491,600 | |
| ＪＭＳ | 15,700 | 531.00 | 8,336,700 | |
| 長野計器 | 12,300 | 2,988.00 | 36,752,400 | |
| ブイ・テクノロジー | 8,900 | 3,055.00 | 27,189,500 | |
| 東京計器 | 13,000 | 2,999.00 | 38,987,000 | |
| 愛知時計電機 | 7,300 | 2,135.00 | 15,585,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| インターアクション | 10,200 | 1,508.00 | 15,381,600 | |
| オーバル | 4,900 | 456.00 | 2,234,400 | |
| 東京精密 | 34,700 | 11,325.00 | 392,977,500 | |
| マニー | 67,800 | 1,941.50 | 131,633,700 | |
| ニコン | 245,100 | 1,604.50 | 393,262,950 | |
| トプコン | 82,400 | 1,719.50 | 141,686,800 | |
| オリンパス | 970,600 | 2,666.50 | 2,588,104,900 | |
| 理研計器 | 24,000 | 3,815.00 | 91,560,000 | |
| タムロン | 10,400 | 8,670.00 | 90,168,000 | |
| ＨＯＹＡ | 333,700 | 19,030.00 | 6,350,311,000 | |
| シード | 3,400 | 578.00 | 1,965,200 | |
| ノーリツ鋼機 | 16,100 | 4,380.00 | 70,518,000 | |
| Ａ＆Ｄホロンホールディングス | 24,700 | 2,844.00 | 70,246,800 | |
| 朝日インテック | 206,700 | 2,271.00 | 469,415,700 | |
| シチズン時計 | 156,000 | 1,052.00 | 164,112,000 | |
| リズム | 1,300 | 3,780.00 | 4,914,000 | |
| 大研医器 | 4,800 | 539.00 | 2,587,200 | |
| メニコン | 58,300 | 1,289.00 | 75,148,700 | |
| シンシア | 700 | 458.00 | 320,600 | |
| 松風 | 7,700 | 4,050.00 | 31,185,000 | |
| セイコーグループ | 23,600 | 4,725.00 | 111,510,000 | |
| ニプロ | 141,300 | 1,247.50 | 176,271,750 | |
| ＫＹＯＲＩＴＳＵ | 8,300 | 164.00 | 1,361,200 | |
| 中本パックス | 1,800 | 1,618.00 | 2,912,400 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 35,200 | 2,921.00 | 102,819,200 | |
| トランザクション | 11,200 | 1,918.00 | 21,481,600 | |
| 粧美堂 | 1,500 | 566.00 | 849,000 | |
| ニホンフラッシュ | 15,900 | 906.00 | 14,405,400 | |
| 前田工繊 | 15,100 | 3,195.00 | 48,244,500 | |
| 永大産業 | 6,600 | 242.00 | 1,597,200 | |
| アートネイチャー | 15,300 | 820.00 | 12,546,000 | |
| フルヤ金属 | 5,400 | 13,000.00 | 70,200,000 | |
| バンダイナムコホールディングス | 464,400 | 3,072.00 | 1,426,636,800 | |
| アイフィスジャパン | 1,500 | 591.00 | 886,500 | |
| ＳＨＯＥＩ | 47,700 | 2,049.00 | 97,737,300 | |
| フランスベッドホールディングス | 21,900 | 1,191.00 | 26,082,900 | |
| パイロットコーポレーション | 23,900 | 4,383.00 | 104,753,700 | |
| 萩原工業 | 11,300 | 1,557.00 | 17,594,100 | |
| フジシールインターナショナル | 34,300 | 2,354.00 | 80,742,200 | |
| タカラトミー | 77,200 | 3,000.00 | 231,600,000 | |
| 広済堂ホールディングス | 49,300 | 634.00 | 31,256,200 | |
| エステールホールディングス | 1,300 | 648.00 | 842,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| タカノ | 2,100 | 925.00 | 1,942,500 | |
| プロネクサス | 17,600 | 1,253.00 | 22,052,800 | |
| ホクシン | 4,300 | 119.00 | 511,700 | |
| ウッドワン | 2,000 | 923.00 | 1,846,000 | |
| ＴＯＰＰＡＮホールディングス | 208,400 | 4,200.00 | 875,280,000 | |
| 大日本印刷 | 175,800 | 4,979.00 | 875,308,200 | |
| 共同印刷 | 4,800 | 3,660.00 | 17,568,000 | |
| ＮＩＳＳＨＡ | 29,000 | 1,956.00 | 56,724,000 | |
| 光村印刷 | 500 | 1,563.00 | 781,500 | |
| ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ | 10,000 | 2,819.00 | 28,190,000 | |
| アシックス | 144,400 | 9,373.00 | 1,353,461,200 | |
| ツツミ | 4,000 | 2,073.00 | 8,292,000 | |
| ローランド | 12,500 | 4,090.00 | 51,125,000 | |
| 小松ウオール工業 | 6,900 | 3,210.00 | 22,149,000 | |
| ヤマハ | 106,900 | 3,646.00 | 389,757,400 | |
| 河合楽器製作所 | 5,100 | 3,310.00 | 16,881,000 | |
| クリナップ | 16,600 | 725.00 | 12,035,000 | |
| ピジョン | 108,000 | 1,514.50 | 163,566,000 | |
| キングジム | 15,000 | 900.00 | 13,500,000 | |
| リンテック | 34,000 | 3,230.00 | 109,820,000 | |
| イトーキ | 32,300 | 1,544.00 | 49,871,200 | |
| 任天堂 | 1,070,300 | 8,739.00 | 9,353,351,700 | |
| 三菱鉛筆 | 24,100 | 2,430.00 | 58,563,000 | |
| タカラスタンダード | 34,700 | 1,686.00 | 58,504,200 | |
| コクヨ | 69,300 | 2,683.00 | 185,931,900 | |
| ナカバヤシ | 18,300 | 540.00 | 9,882,000 | |
| グローブライド | 15,200 | 2,186.00 | 33,227,200 | |
| オカムラ | 51,000 | 2,209.00 | 112,659,000 | |
| 美津濃 | 16,800 | 8,440.00 | 141,792,000 | |
| 東京電力ホールディングス | 1,528,200 | 922.50 | 1,409,764,500 | |
| 中部電力 | 624,700 | 2,024.50 | 1,264,705,150 | |
| 関西電力 | 654,600 | 2,829.00 | 1,851,863,400 | |
| 中国電力 | 294,500 | 1,117.00 | 328,956,500 | |
| 北陸電力 | 173,300 | 1,072.00 | 185,777,600 | |
| 東北電力 | 446,300 | 1,545.00 | 689,533,500 | |
| 四国電力 | 157,900 | 1,495.50 | 236,139,450 | |
| 九州電力 | 390,800 | 1,782.50 | 696,601,000 | |
| 北海道電力 | 163,800 | 1,435.50 | 235,134,900 | |
| 沖縄電力 | 43,300 | 1,131.00 | 48,972,300 | |
| 電源開発 | 139,300 | 2,543.00 | 354,239,900 | |
| エフオン | 12,300 | 406.00 | 4,993,800 | |
| イーレックス | 30,200 | 657.00 | 19,841,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| レノバ | 45,200 | 1,028.00 | 46,465,600 | |
| 東京瓦斯 | 330,000 | 3,582.00 | 1,182,060,000 | |
| 大阪瓦斯 | 337,800 | 3,581.00 | 1,209,661,800 | |
| 東邦瓦斯 | 73,400 | 4,002.00 | 293,746,800 | |
| 北海道瓦斯 | 10,100 | 3,525.00 | 35,602,500 | |
| 広島ガス | 35,800 | 383.00 | 13,711,400 | |
| 西部ガスホールディングス | 17,700 | 2,002.00 | 35,435,400 | |
| 静岡ガス | 33,800 | 948.00 | 32,042,400 | |
| メタウォーター | 20,300 | 1,938.00 | 39,341,400 | |
| ＳＢＳホールディングス | 15,100 | 2,685.00 | 40,543,500 | |
| 東武鉄道 | 186,200 | 2,758.50 | 513,632,700 | |
| 相鉄ホールディングス | 60,700 | 2,435.50 | 147,834,850 | |
| 東急 | 475,400 | 1,848.00 | 878,539,200 | |
| 京浜急行電鉄 | 209,800 | 1,167.00 | 244,836,600 | |
| 小田急電鉄 | 280,300 | 1,573.50 | 441,052,050 | |
| 京王電鉄 | 81,500 | 3,758.00 | 306,277,000 | |
| 京成電鉄 | 109,300 | 5,475.00 | 598,417,500 | |
| 富士急行 | 20,900 | 2,965.00 | 61,968,500 | |
| 東日本旅客鉄道 | 934,400 | 2,736.00 | 2,556,518,400 | |
| 西日本旅客鉄道 | 402,200 | 3,156.00 | 1,269,343,200 | |
| 東海旅客鉄道 | 653,000 | 3,517.00 | 2,296,601,000 | |
| 西武ホールディングス | 205,100 | 2,366.50 | 485,369,150 | |
| 鴻池運輸 | 28,900 | 2,346.00 | 67,799,400 | |
| 西日本鉄道 | 45,300 | 2,541.00 | 115,107,300 | |
| ハマキョウレックス | 14,500 | 4,075.00 | 59,087,500 | |
| サカイ引越センター | 18,800 | 2,392.00 | 44,969,600 | |
| 近鉄グループホールディングス | 169,200 | 3,402.00 | 575,618,400 | |
| 阪急阪神ホールディングス | 225,700 | 4,181.00 | 943,651,700 | |
| 南海電気鉄道 | 75,500 | 2,662.50 | 201,018,750 | |
| 京阪ホールディングス | 93,300 | 2,931.00 | 273,462,300 | |
| 神戸電鉄 | 4,600 | 2,740.00 | 12,604,000 | |
| 名古屋鉄道 | 174,600 | 1,774.00 | 309,740,400 | |
| 山陽電気鉄道 | 12,700 | 2,078.00 | 26,390,600 | |
| アルプス物流 | 13,500 | 5,680.00 | 76,680,000 | |
| ヤマトホールディングス | 205,700 | 1,744.00 | 358,740,800 | |
| 山九 | 40,800 | 5,668.00 | 231,254,400 | |
| 丸運 | 3,300 | 403.00 | 1,329,900 | |
| 丸全昭和運輸 | 10,500 | 5,120.00 | 53,760,000 | |
| センコーグループホールディングス | 89,600 | 1,132.00 | 101,427,200 | |
| トナミホールディングス | 3,700 | 5,560.00 | 20,572,000 | |
| ニッコンホールディングス | 52,100 | 2,955.00 | 153,955,500 | |
| 日本石油輸送 | 600 | 3,030.00 | 1,818,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 福山通運 | 19,300 | 3,765.00 | 72,664,500 | |
| セイノーホールディングス | 95,200 | 2,071.50 | 197,206,800 | |
| エスライングループ本社 | 1,600 | 1,473.00 | 2,356,800 | |
| 神奈川中央交通 | 4,800 | 3,020.00 | 14,496,000 | |
| ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス | 43,300 | 1,200.00 | 51,960,000 | |
| Ｃ＆Ｆロジホールディングス | 16,300 | 5,730.00 | 93,399,000 | |
| 九州旅客鉄道 | 119,700 | 3,558.00 | 425,892,600 | |
| ＳＧホールディングス | 284,200 | 1,492.50 | 424,168,500 | |
| ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス | 57,400 | 7,645.00 | 438,823,000 | |
| 日本郵船 | 438,500 | 4,950.00 | 2,170,575,000 | |
| 商船三井 | 367,700 | 5,116.00 | 1,881,153,200 | |
| 川崎汽船 | 408,100 | 2,423.00 | 988,826,300 | |
| ＮＳユナイテッド海運 | 9,200 | 5,030.00 | 46,276,000 | |
| 飯野海運 | 62,600 | 1,276.00 | 79,877,600 | |
| 共栄タンカー | 1,600 | 1,228.00 | 1,964,800 | |
| 乾汽船 | 20,400 | 1,114.00 | 22,725,600 | |
| 日本航空 | 415,700 | 2,625.00 | 1,091,212,500 | |
| ＡＮＡホールディングス | 460,500 | 2,989.00 | 1,376,434,500 | |
| パスコ | 1,100 | 1,810.00 | 1,991,000 | |
| トランコム | 4,900 | 6,300.00 | 30,870,000 | |
| 日新 | 12,900 | 4,480.00 | 57,792,000 | |
| 三菱倉庫 | 40,400 | 5,410.00 | 218,564,000 | |
| 三井倉庫ホールディングス | 15,800 | 4,470.00 | 70,626,000 | |
| 住友倉庫 | 45,200 | 2,621.00 | 118,469,200 | |
| 澁澤倉庫 | 7,700 | 3,110.00 | 23,947,000 | |
| 東陽倉庫 | 1,500 | 1,499.00 | 2,248,500 | |
| 日本トランスシティ | 34,100 | 998.00 | 34,031,800 | |
| ケイヒン | 1,000 | 2,249.00 | 2,249,000 | |
| 中央倉庫 | 9,100 | 1,246.00 | 11,338,600 | |
| 川西倉庫 | 1,000 | 1,208.00 | 1,208,000 | |
| 安田倉庫 | 11,500 | 1,783.00 | 20,504,500 | |
| ファイズホールディングス | 800 | 1,052.00 | 841,600 | |
| 東洋埠頭 | 1,600 | 1,383.00 | 2,212,800 | |
| 上組 | 78,200 | 3,315.00 | 259,233,000 | |
| サンリツ | 1,400 | 911.00 | 1,275,400 | |
| キムラユニティー | 2,700 | 1,724.00 | 4,654,800 | |
| キユーソー流通システム | 8,700 | 1,618.00 | 14,076,600 | |
| 東海運 | 3,300 | 294.00 | 970,200 | |
| エーアイテイー | 10,600 | 1,831.00 | 19,408,600 | |
| 内外トランスライン | 6,800 | 2,692.00 | 18,305,600 | |
| 日本コンセプト | 6,200 | 1,927.00 | 11,947,400 | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 66,300 | 2,206.00 | 146,257,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| クロスキャット | 10,800 | 1,330.00 | 14,364,000 | |
| システナ | 257,300 | 291.00 | 74,874,300 | |
| デジタルアーツ | 10,800 | 3,605.00 | 38,934,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 29,000 | 5,090.00 | 147,610,000 | |
| キューブシステム | 9,000 | 1,118.00 | 10,062,000 | |
| コア | 7,500 | 1,892.00 | 14,190,000 | |
| 手間いらず | 2,900 | 2,986.00 | 8,659,400 | |
| ラクーンホールディングス | 12,700 | 632.00 | 8,026,400 | |
| ソリトンシステムズ | 8,800 | 1,164.00 | 10,243,200 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 14,000 | 2,040.00 | 28,560,000 | |
| ＴＩＳ | 179,700 | 2,970.00 | 533,709,000 | |
| テクミラホールディングス | 2,600 | 395.00 | 1,027,000 | |
| グリー | 57,000 | 521.00 | 29,697,000 | |
| GMOペパボ | 2,100 | 1,428.00 | 2,998,800 | |
| コーエーテクモホールディングス | 106,600 | 1,398.50 | 149,080,100 | |
| 三菱総合研究所 | 8,300 | 4,725.00 | 39,217,500 | |
| 電算 | 700 | 1,486.00 | 1,040,200 | |
| ＡＧＳ | 2,300 | 1,026.00 | 2,359,800 | |
| ファインデックス | 13,500 | 1,044.00 | 14,094,000 | |
| ブレインパッド | 14,200 | 1,076.00 | 15,279,200 | |
| ＫＬａｂ | 31,300 | 223.00 | 6,979,900 | |
| ポールトゥウィンホールディングス | 29,100 | 483.00 | 14,055,300 | |
| ネクソン | 373,000 | 2,757.50 | 1,028,547,500 | |
| アイスタイル | 56,800 | 465.00 | 26,412,000 | |
| エムアップホールディングス | 20,800 | 1,300.00 | 27,040,000 | |
| エイチーム | 11,300 | 710.00 | 8,023,000 | |
| エニグモ | 21,700 | 342.00 | 7,421,400 | |
| テクノスジャパン | 5,000 | 645.00 | 3,225,000 | |
| コロプラ | 57,800 | 618.00 | 35,720,400 | |
| ブロードリーフ | 80,700 | 536.00 | 43,255,200 | |
| クロス・マーケティンググループ | 2,700 | 596.00 | 1,609,200 | |
| デジタルハーツホールディングス | 10,600 | 1,095.00 | 11,607,000 | |
| メディアドゥ | 7,700 | 1,452.00 | 11,180,400 | |
| じげん | 49,600 | 642.00 | 31,843,200 | |
| ブイキューブ | 20,500 | 247.00 | 5,063,500 | |
| エンカレッジ・テクノロジ | 1,300 | 611.00 | 794,300 | |
| サイバーリンクス | 2,200 | 737.00 | 1,621,400 | |
| フィックスターズ | 17,100 | 1,849.00 | 31,617,900 | |
| ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 8,000 | 1,608.00 | 12,864,000 | |
| オプティム | 17,500 | 670.00 | 11,725,000 | |
| セレス | 6,900 | 1,888.00 | 13,027,200 | |
| ＳＨＩＦＴ | 11,300 | 14,775.00 | 166,957,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ティーガイア | 17,800 | 1,940.00 | 34,532,000 | |
| セック | 2,300 | 4,335.00 | 9,970,500 | |
| テクマトリックス | 31,100 | 1,956.00 | 60,831,600 | |
| プロシップ | 8,200 | 1,401.00 | 11,488,200 | |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 44,300 | 2,747.00 | 121,692,100 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 38,800 | 7,166.00 | 278,040,800 | |
| ザッパラス | 1,300 | 439.00 | 570,700 | |
| システムリサーチ | 11,700 | 1,551.00 | 18,146,700 | |
| インターネットイニシアティブ | 81,300 | 2,205.50 | 179,307,150 | |
| さくらインターネット | 19,100 | 5,220.00 | 99,702,000 | |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 5,200 | 2,981.00 | 15,501,200 | |
| ＳＲＡホールディングス | 8,700 | 4,075.00 | 35,452,500 | |
| システムインテグレータ | 1,700 | 373.00 | 634,100 | |
| 朝日ネット | 18,300 | 655.00 | 11,986,500 | |
| ｅＢＡＳＥ | 23,900 | 688.00 | 16,443,200 | |
| アバントグループ | 21,500 | 1,296.00 | 27,864,000 | |
| アドソル日進 | 7,200 | 1,718.00 | 12,369,600 | |
| ＯＤＫソリューションズ | 1,100 | 598.00 | 657,800 | |
| フリービット | 7,400 | 1,402.00 | 10,374,800 | |
| コムチュア | 24,500 | 1,825.00 | 44,712,500 | |
| アステリア | 13,300 | 542.00 | 7,208,600 | |
| アイル | 9,500 | 2,319.00 | 22,030,500 | |
| マークラインズ | 9,200 | 2,920.00 | 26,864,000 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 20,300 | 515.00 | 10,454,500 | |
| ｇｕｍｉ | 27,600 | 341.00 | 9,411,600 | |
| ショーケース | 1,300 | 305.00 | 396,500 | |
| モバイルファクトリー | 1,200 | 679.00 | 814,800 | |
| テラスカイ | 7,400 | 1,920.00 | 14,208,000 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 8,900 | 1,790.00 | 15,931,000 | |
| ＰＣＩホールディングス | 2,300 | 973.00 | 2,237,900 | |
| アイビーシー | 900 | 461.00 | 414,900 | |
| ネオジャパン | 5,700 | 1,440.00 | 8,208,000 | |
| ＰＲ　ＴＩＭＥＳ | 3,400 | 1,795.00 | 6,103,000 | |
| ラクス | 80,400 | 1,755.00 | 141,102,000 | |
| ランドコンピュータ | 2,700 | 816.00 | 2,203,200 | |
| ダブルスタンダード | 5,200 | 1,756.00 | 9,131,200 | |
| オープンドア | 9,900 | 589.00 | 5,831,100 | |
| アカツキ | 8,300 | 2,144.00 | 17,795,200 | |
| ベネフィットジャパン | 400 | 1,191.00 | 476,400 | |
| Ｕｂｉｃｏｍホールディングス | 5,300 | 1,258.00 | 6,667,400 | |
| カナミックネットワーク | 21,400 | 545.00 | 11,663,000 | |
| ノムラシステムコーポレーション | 6,200 | 130.00 | 806,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| チェンジホールディングス | 37,000 | 1,254.00 | 46,398,000 | |
| シンクロ・フード | 3,600 | 529.00 | 1,904,400 | |
| オークネット | 6,300 | 2,458.00 | 15,485,400 | |
| キャピタル・アセット・プランニング | 1,100 | 851.00 | 936,100 | |
| セグエグループ | 5,200 | 614.00 | 3,192,800 | |
| エイトレッド | 900 | 1,530.00 | 1,377,000 | |
| マクロミル | 33,400 | 854.00 | 28,523,600 | |
| ビーグリー | 1,200 | 1,087.00 | 1,304,400 | |
| オロ | 6,200 | 2,582.00 | 16,008,400 | |
| ユーザーローカル | 7,200 | 2,050.00 | 14,760,000 | |
| テモナ | 1,400 | 215.00 | 301,000 | |
| ニーズウェル | 6,200 | 395.00 | 2,449,000 | |
| マネーフォワード | 38,000 | 5,042.00 | 191,596,000 | |
| サインポスト | 2,200 | 664.00 | 1,460,800 | |
| Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ | 12,100 | 877.00 | 10,611,700 | |
| プラスアルファ・コンサルティング | 21,400 | 1,822.00 | 38,990,800 | |
| 電算システムホールディングス | 7,500 | 2,577.00 | 19,327,500 | |
| Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ | 58,200 | 1,242.00 | 72,284,400 | |
| ビジョナル | 19,900 | 7,910.00 | 157,409,000 | |
| ソルクシーズ | 4,600 | 316.00 | 1,453,600 | |
| フェイス | 1,600 | 431.00 | 689,600 | |
| プロトコーポレーション | 18,600 | 1,353.00 | 25,165,800 | |
| ハイマックス | 5,300 | 1,358.00 | 7,197,400 | |
| 野村総合研究所 | 368,200 | 4,225.00 | 1,555,645,000 | |
| ＣＥホールディングス | 2,700 | 580.00 | 1,566,000 | |
| 日本システム技術 | 14,200 | 1,573.00 | 22,336,600 | |
| インテージホールディングス | 19,200 | 1,449.00 | 27,820,800 | |
| 東邦システムサイエンス | 7,100 | 1,463.00 | 10,387,300 | |
| ソースネクスト | 77,900 | 201.00 | 15,657,900 | |
| インフォコム | 21,900 | 5,510.00 | 120,669,000 | |
| シンプレクス・ホールディングス | 25,800 | 2,919.00 | 75,310,200 | |
| ＨＥＲＯＺ | 6,700 | 1,364.00 | 9,138,800 | |
| ラクスル | 41,100 | 924.00 | 37,976,400 | |
| メルカリ | 82,900 | 2,123.00 | 175,996,700 | |
| ＩＰＳ | 4,900 | 2,165.00 | 10,608,500 | |
| ＦＩＧ | 6,500 | 334.00 | 2,171,000 | |
| システムサポート | 6,600 | 1,864.00 | 12,302,400 | |
| イーソル | 12,300 | 848.00 | 10,430,400 | |
| 東海ソフト | 900 | 1,280.00 | 1,152,000 | |
| ウイングアーク１ｓｔ | 17,700 | 2,702.00 | 47,825,400 | |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 5,700 | 929.00 | 5,295,300 | |
| サーバーワークス | 3,500 | 3,105.00 | 10,867,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 東名 | 600 | 2,352.00 | 1,411,200 | |
| ヴィッツ | 600 | 789.00 | 473,400 | |
| トビラシステムズ | 1,600 | 775.00 | 1,240,000 | |
| Ｓａｎｓａｎ | 55,800 | 1,603.00 | 89,447,400 | |
| Ｌｉｎｋ－Ｕグループ | 1,100 | 657.00 | 722,700 | |
| ギフティ | 14,900 | 1,077.00 | 16,047,300 | |
| メドレー | 22,800 | 3,540.00 | 80,712,000 | |
| ベース | 6,000 | 2,815.00 | 16,890,000 | |
| ＪＭＤＣ | 29,000 | 3,180.00 | 92,220,000 | |
| フォーカスシステムズ | 11,400 | 1,116.00 | 12,722,400 | |
| クレスコ | 14,000 | 2,283.00 | 31,962,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 163,300 | 1,823.50 | 297,777,550 | |
| オービック | 56,800 | 20,265.00 | 1,151,052,000 | |
| ジャストシステム | 24,400 | 2,773.00 | 67,661,200 | |
| ＴＤＣソフト | 31,900 | 1,038.00 | 33,112,200 | |
| ＬＩＮＥヤフー | 2,420,900 | 377.80 | 914,616,020 | |
| トレンドマイクロ | 80,400 | 7,118.00 | 572,287,200 | |
| ＩＤホールディングス | 11,500 | 1,462.00 | 16,813,000 | |
| 日本オラクル | 32,500 | 11,405.00 | 370,662,500 | |
| アルファシステムズ | 4,500 | 2,947.00 | 13,261,500 | |
| フューチャー | 36,300 | 1,495.00 | 54,268,500 | |
| ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 9,100 | 1,952.00 | 17,763,200 | |
| ＳＢテクノロジー | 7,100 | 2,938.00 | 20,859,800 | |
| トーセ | 1,600 | 690.00 | 1,104,000 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 23,900 | 6,292.00 | 150,378,800 | |
| アイティフォー | 21,800 | 1,405.00 | 30,629,000 | |
| 東計電算 | 4,700 | 3,735.00 | 17,554,500 | |
| エックスネット | 800 | 1,504.00 | 1,203,200 | |
| 大塚商会 | 168,600 | 2,903.00 | 489,445,800 | |
| サイボウズ | 23,400 | 1,844.00 | 43,149,600 | |
| 電通総研 | 20,700 | 5,250.00 | 108,675,000 | |
| ＡＣＣＥＳＳ | 17,700 | 1,384.00 | 24,496,800 | |
| デジタルガレージ | 27,200 | 2,370.00 | 64,464,000 | |
| ＥＭシステムズ | 28,400 | 629.00 | 17,863,600 | |
| ウェザーニューズ | 5,300 | 4,465.00 | 23,664,500 | |
| ＣＩＪ | 42,400 | 456.00 | 19,334,400 | |
| ビジネスエンジニアリング | 3,600 | 3,555.00 | 12,798,000 | |
| 日本エンタープライズ | 5,900 | 133.00 | 784,700 | |
| ＷＯＷＯＷ | 12,800 | 1,098.00 | 14,054,400 | |
| スカラ | 15,800 | 719.00 | 11,360,200 | |
| インテリジェント　ウェイブ | 3,000 | 1,053.00 | 3,159,000 | |
| ＡＮＹＣＯＬＯＲ | 24,100 | 2,361.00 | 56,900,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ | 17,100 | 530.00 | 9,063,000 | |
| ネットワンシステムズ | 66,200 | 2,773.00 | 183,572,600 | |
| システムソフト | 59,400 | 61.00 | 3,623,400 | |
| アルゴグラフィックス | 15,600 | 4,455.00 | 69,498,000 | |
| マーベラス | 27,600 | 642.00 | 17,719,200 | |
| エイベックス | 29,000 | 1,217.00 | 35,293,000 | |
| ＢＩＰＲＯＧＹ | 55,600 | 4,249.00 | 236,244,400 | |
| 都築電気 | 9,000 | 2,324.00 | 20,916,000 | |
| ＴＢＳホールディングス | 85,500 | 3,865.00 | 330,457,500 | |
| 日本テレビホールディングス | 150,500 | 2,183.50 | 328,616,750 | |
| 朝日放送グループホールディングス | 15,900 | 669.00 | 10,637,100 | |
| テレビ朝日ホールディングス | 41,300 | 2,059.00 | 85,036,700 | |
| スカパーＪＳＡＴホールディングス | 132,100 | 898.00 | 118,625,800 | |
| テレビ東京ホールディングス | 12,200 | 3,170.00 | 38,674,000 | |
| 日本ＢＳ放送 | 2,000 | 903.00 | 1,806,000 | |
| ビジョン | 25,400 | 1,197.00 | 30,403,800 | |
| スマートバリュー | 1,600 | 391.00 | 625,600 | |
| Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ | 19,100 | 4,775.00 | 91,202,500 | |
| ワイヤレスゲート | 2,500 | 234.00 | 585,000 | |
| 日本通信 | 167,500 | 184.00 | 30,820,000 | |
| クロップス | 700 | 1,149.00 | 804,300 | |
| 日本電信電話 | 50,576,200 | 151.20 | 7,647,121,440 | |
| ＫＤＤＩ | 1,313,900 | 4,299.00 | 5,648,456,100 | |
| ソフトバンク | 2,714,800 | 1,959.50 | 5,319,650,600 | |
| 光通信 | 17,100 | 27,765.00 | 474,781,500 | |
| エムティーアイ | 11,700 | 847.00 | 9,909,900 | |
| ＧＭＯインターネットグループ | 62,300 | 2,422.00 | 150,890,600 | |
| ファイバーゲート | 9,200 | 1,174.00 | 10,800,800 | |
| アイドママーケティングコミュニケーション | 1,600 | 229.00 | 366,400 | |
| ＫＡＤＯＫＡＷＡ | 89,900 | 3,233.00 | 290,646,700 | |
| 学研ホールディングス | 31,100 | 989.00 | 30,757,900 | |
| ゼンリン | 29,100 | 912.00 | 26,539,200 | |
| 昭文社ホールディングス | 2,400 | 364.00 | 873,600 | |
| インプレスホールディングス | 5,700 | 160.00 | 912,000 | |
| アイネット | 10,300 | 2,212.00 | 22,783,600 | |
| 松竹 | 8,800 | 9,730.00 | 85,624,000 | |
| 東宝 | 94,600 | 5,133.00 | 485,581,800 | |
| 東映 | 28,100 | 3,850.00 | 108,185,000 | |
| ＮＴＴデータグループ | 444,600 | 2,374.50 | 1,055,702,700 | |
| ピー・シー・エー | 9,800 | 2,225.00 | 21,805,000 | |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 6,700 | 2,137.00 | 14,317,900 | |
| ＤＴＳ | 35,600 | 4,255.00 | 151,478,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 77,700 | 4,693.00 | 364,646,100 | |
| シーイーシー | 21,500 | 2,055.00 | 44,182,500 | |
| カプコン | 304,100 | 2,976.50 | 905,153,650 | |
| アイ・エス・ビー | 8,700 | 1,409.00 | 12,258,300 | |
| ＳＣＳＫ | 119,000 | 3,076.00 | 366,044,000 | |
| ＮＳＷ | 7,600 | 3,160.00 | 24,016,000 | |
| アイネス | 13,300 | 1,681.00 | 22,357,300 | |
| ＴＫＣ | 30,300 | 3,265.00 | 98,929,500 | |
| 富士ソフト | 34,200 | 6,650.00 | 227,430,000 | |
| ＮＳＤ | 60,000 | 3,035.00 | 182,100,000 | |
| コナミグループ | 63,700 | 11,280.00 | 718,536,000 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 10,500 | 2,453.00 | 25,756,500 | |
| ＪＢＣＣホールディングス | 11,300 | 3,150.00 | 35,595,000 | |
| ミロク情報サービス | 15,500 | 1,819.00 | 28,194,500 | |
| ソフトバンクグループ | 838,700 | 9,724.00 | 8,155,518,800 | |
| リョーサン菱洋ホールディングス | 33,700 | 2,949.00 | 99,381,300 | |
| 高千穂交易 | 6,400 | 3,765.00 | 24,096,000 | |
| オルバヘルスケアホールディングス | 1,000 | 2,145.00 | 2,145,000 | |
| 伊藤忠食品 | 4,000 | 7,190.00 | 28,760,000 | |
| エレマテック | 16,100 | 1,985.00 | 31,958,500 | |
| あらた | 27,400 | 3,260.00 | 89,324,000 | |
| トーメンデバイス | 2,600 | 7,120.00 | 18,512,000 | |
| 東京エレクトロン　デバイス | 17,900 | 4,370.00 | 78,223,000 | |
| 円谷フィールズホールディングス | 30,800 | 1,586.00 | 48,848,800 | |
| 双日 | 199,700 | 3,964.00 | 791,610,800 | |
| アルフレッサ　ホールディングス | 180,000 | 2,191.00 | 394,380,000 | |
| 横浜冷凍 | 45,400 | 1,031.00 | 46,807,400 | |
| ラサ商事 | 8,200 | 1,763.00 | 14,456,600 | |
| アルコニックス | 23,600 | 1,463.00 | 34,526,800 | |
| 神戸物産 | 138,800 | 3,452.00 | 479,137,600 | |
| ハイパー | 1,400 | 300.00 | 420,000 | |
| あい　ホールディングス | 28,700 | 2,328.00 | 66,813,600 | |
| ディーブイエックス | 1,600 | 1,002.00 | 1,603,200 | |
| ダイワボウホールディングス | 79,400 | 2,760.00 | 219,144,000 | |
| マクニカホールディングス | 42,400 | 6,661.00 | 282,426,400 | |
| ラクト・ジャパン | 7,000 | 2,898.00 | 20,286,000 | |
| グリムス | 7,600 | 2,483.00 | 18,870,800 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 27,200 | 1,294.00 | 35,196,800 | |
| 八洲電機 | 14,500 | 1,554.00 | 22,533,000 | |
| メディアスホールディングス | 10,400 | 966.00 | 10,046,400 | |
| レスター | 15,300 | 3,055.00 | 46,741,500 | |
| ジオリーブグループ | 1,400 | 1,191.00 | 1,667,400 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大光 | 3,100 | 609.00 | 1,887,900 | |
| ＯＣＨＩホールディングス | 1,400 | 1,445.00 | 2,023,000 | |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 97,400 | 968.00 | 94,283,200 | |
| 黒谷 | 1,600 | 684.00 | 1,094,400 | |
| Ｃｏｍｉｎｉｘ | 1,200 | 870.00 | 1,044,000 | |
| 三洋貿易 | 18,400 | 1,532.00 | 28,188,800 | |
| ビューティガレージ | 5,700 | 2,069.00 | 11,793,300 | |
| ウイン・パートナーズ | 11,600 | 1,207.00 | 14,001,200 | |
| ミタチ産業 | 1,700 | 1,105.00 | 1,878,500 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 64,500 | 2,451.50 | 158,121,750 | |
| 明治電機工業 | 6,700 | 1,650.00 | 11,055,000 | |
| デリカフーズホールディングス | 2,600 | 571.00 | 1,484,600 | |
| スターティアホールディングス | 1,600 | 2,057.00 | 3,291,200 | |
| コメダホールディングス | 44,000 | 2,691.00 | 118,404,000 | |
| ピーバンドットコム | 800 | 372.00 | 297,600 | |
| アセンテック | 6,900 | 601.00 | 4,146,900 | |
| 富士興産 | 1,700 | 1,722.00 | 2,927,400 | |
| 協栄産業 | 600 | 2,895.00 | 1,737,000 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 16,000 | 2,153.00 | 34,448,000 | |
| ヤマエグループホールディングス | 15,800 | 2,425.00 | 38,315,000 | |
| 小野建 | 17,900 | 1,600.00 | 28,640,000 | |
| 南陽 | 2,400 | 1,128.00 | 2,707,200 | |
| 佐鳥電機 | 11,300 | 2,032.00 | 22,961,600 | |
| エコートレーディング | 1,200 | 1,323.00 | 1,587,600 | |
| 伯東 | 10,300 | 5,120.00 | 52,736,000 | |
| コンドーテック | 13,800 | 1,379.00 | 19,030,200 | |
| 中山福 | 3,200 | 375.00 | 1,200,000 | |
| ナガイレーベン | 22,700 | 2,501.00 | 56,772,700 | |
| 三菱食品 | 16,600 | 5,150.00 | 85,490,000 | |
| 松田産業 | 13,700 | 2,768.00 | 37,921,600 | |
| 第一興商 | 69,400 | 1,650.00 | 114,510,000 | |
| メディパルホールディングス | 182,400 | 2,343.50 | 427,454,400 | |
| ＳＰＫ | 8,000 | 2,230.00 | 17,840,000 | |
| 萩原電気ホールディングス | 7,700 | 4,035.00 | 31,069,500 | |
| アズワン | 55,600 | 2,743.50 | 152,538,600 | |
| スズデン | 6,300 | 1,925.00 | 12,127,500 | |
| 尾家産業 | 1,400 | 1,952.00 | 2,732,800 | |
| シモジマ | 12,000 | 1,295.00 | 15,540,000 | |
| ドウシシャ | 16,600 | 2,223.00 | 36,901,800 | |
| 小津産業 | 1,300 | 1,630.00 | 2,119,000 | |
| 高速 | 10,700 | 2,277.00 | 24,363,900 | |
| たけびし | 6,900 | 2,142.00 | 14,779,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| リックス | 4,100 | 2,992.00 | 12,267,200 | |
| 丸文 | 16,000 | 1,254.00 | 20,064,000 | |
| ハピネット | 15,300 | 3,650.00 | 55,845,000 | |
| 橋本総業ホールディングス | 7,100 | 1,397.00 | 9,918,700 | |
| 日本ライフライン | 48,000 | 1,105.00 | 53,040,000 | |
| タカショー | 15,700 | 506.00 | 7,944,200 | |
| ＩＤＯＭ | 47,500 | 1,355.00 | 64,362,500 | |
| 進和 | 11,000 | 2,733.00 | 30,063,000 | |
| エスケイジャパン | 1,500 | 820.00 | 1,230,000 | |
| ダイトロン | 7,100 | 3,095.00 | 21,974,500 | |
| シークス | 25,600 | 1,325.00 | 33,920,000 | |
| 田中商事 | 1,700 | 815.00 | 1,385,500 | |
| オーハシテクニカ | 9,400 | 1,682.00 | 15,810,800 | |
| 白銅 | 5,000 | 2,864.00 | 14,320,000 | |
| ダイコー通産 | 600 | 1,198.00 | 718,800 | |
| 伊藤忠商事 | 1,205,700 | 7,373.00 | 8,889,626,100 | |
| 丸紅 | 1,487,800 | 3,001.00 | 4,464,887,800 | |
| 高島 | 4,000 | 1,051.00 | 4,204,000 | |
| 長瀬産業 | 82,200 | 2,967.50 | 243,928,500 | |
| 蝶理 | 11,200 | 3,545.00 | 39,704,000 | |
| 豊田通商 | 157,100 | 9,320.00 | 1,464,172,000 | |
| 三共生興 | 24,900 | 729.00 | 18,152,100 | |
| 兼松 | 75,000 | 2,721.00 | 204,075,000 | |
| ツカモトコーポレーション | 800 | 1,210.00 | 968,000 | |
| 三井物産 | 1,342,800 | 7,712.00 | 10,355,673,600 | |
| 日本紙パルプ商事 | 8,600 | 6,300.00 | 54,180,000 | |
| カメイ | 19,100 | 2,107.00 | 40,243,700 | |
| 東都水産 | 500 | 6,410.00 | 3,205,000 | |
| ＯＵＧホールディングス | 900 | 2,692.00 | 2,422,800 | |
| スターゼン | 12,400 | 2,831.00 | 35,104,400 | |
| 山善 | 54,400 | 1,402.00 | 76,268,800 | |
| 椿本興業 | 11,100 | 2,220.00 | 24,642,000 | |
| 住友商事 | 1,085,600 | 4,059.00 | 4,406,450,400 | |
| 内田洋行 | 7,300 | 7,370.00 | 53,801,000 | |
| 三菱商事 | 3,442,500 | 3,260.00 | 11,222,550,000 | |
| 第一実業 | 16,900 | 2,286.00 | 38,633,400 | |
| キヤノンマーケティングジャパン | 41,600 | 4,415.00 | 183,664,000 | |
| 西華産業 | 7,000 | 4,220.00 | 29,540,000 | |
| 佐藤商事 | 12,500 | 1,644.00 | 20,550,000 | |
| 東京産業 | 16,400 | 655.00 | 10,742,000 | |
| ユアサ商事 | 14,000 | 5,520.00 | 77,280,000 | |
| 神鋼商事 | 4,500 | 7,010.00 | 31,545,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| トルク | 4,300 | 238.00 | 1,023,400 | |
| 阪和興業 | 32,200 | 6,240.00 | 200,928,000 | |
| 正栄食品工業 | 11,900 | 4,475.00 | 53,252,500 | |
| カナデン | 13,500 | 1,597.00 | 21,559,500 | |
| ＲＹＯＤＥＮ | 14,500 | 2,631.00 | 38,149,500 | |
| 岩谷産業 | 40,800 | 9,418.00 | 384,254,400 | |
| ナイス | 1,800 | 1,822.00 | 3,279,600 | |
| ニチモウ | 1,900 | 2,094.00 | 3,978,600 | |
| 極東貿易 | 10,700 | 1,712.00 | 18,318,400 | |
| アステナホールディングス | 33,700 | 487.00 | 16,411,900 | |
| 三愛オブリ | 41,900 | 2,127.00 | 89,121,300 | |
| 稲畑産業 | 35,500 | 3,355.00 | 119,102,500 | |
| ＧＳＩクレオス | 9,600 | 2,179.00 | 20,918,400 | |
| 明和産業 | 21,200 | 719.00 | 15,242,800 | |
| クワザワホールディングス | 2,100 | 894.00 | 1,877,400 | |
| ワキタ | 29,700 | 1,713.00 | 50,876,100 | |
| 東邦ホールディングス | 48,500 | 3,876.00 | 187,986,000 | |
| サンゲツ | 41,300 | 3,045.00 | 125,758,500 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 22,900 | 1,513.00 | 34,647,700 | |
| シナネンホールディングス | 5,000 | 4,735.00 | 23,675,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 44,500 | 1,533.00 | 68,218,500 | |
| サンリオ | 145,700 | 2,681.00 | 390,621,700 | |
| サンワテクノス | 9,200 | 2,252.00 | 20,718,400 | |
| 新光商事 | 24,100 | 947.00 | 22,822,700 | |
| トーホー | 7,000 | 3,130.00 | 21,910,000 | |
| 三信電気 | 7,200 | 2,125.00 | 15,300,000 | |
| 東陽テクニカ | 16,600 | 1,613.00 | 26,775,800 | |
| モスフードサービス | 26,400 | 3,525.00 | 93,060,000 | |
| 加賀電子 | 16,400 | 5,730.00 | 93,972,000 | |
| ソーダニッカ | 17,100 | 1,092.00 | 18,673,200 | |
| 立花エレテック | 11,900 | 3,045.00 | 36,235,500 | |
| フォーバル | 7,000 | 1,400.00 | 9,800,000 | |
| ＰＡＬＴＡＣ | 24,200 | 4,202.00 | 101,688,400 | |
| 三谷産業 | 31,400 | 356.00 | 11,178,400 | |
| 西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス | 4,600 | 4,210.00 | 19,366,000 | |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 500 | 2,630.00 | 1,315,000 | |
| コーア商事ホールディングス | 12,600 | 689.00 | 8,681,400 | |
| ＫＰＰグループホールディングス | 46,500 | 822.00 | 38,223,000 | |
| ヤマタネ | 7,900 | 2,776.00 | 21,930,400 | |
| 丸紅建材リース | 500 | 3,115.00 | 1,557,500 | |
| 泉州電業 | 11,100 | 5,130.00 | 56,943,000 | |
| トラスコ中山 | 37,700 | 2,367.00 | 89,235,900 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| オートバックスセブン | 62,400 | 1,541.00 | 96,158,400 | |
| モリト | 12,900 | 1,445.00 | 18,640,500 | |
| 加藤産業 | 22,200 | 4,190.00 | 93,018,000 | |
| 北恵 | 1,500 | 861.00 | 1,291,500 | |
| イエローハット | 28,500 | 2,150.00 | 61,275,000 | |
| ＪＫホールディングス | 13,800 | 1,017.00 | 14,034,600 | |
| 日伝 | 11,800 | 3,465.00 | 40,887,000 | |
| 北沢産業 | 3,600 | 371.00 | 1,335,600 | |
| 杉本商事 | 8,700 | 2,435.00 | 21,184,500 | |
| 因幡電機産業 | 46,500 | 3,900.00 | 181,350,000 | |
| 東テク | 18,000 | 2,513.00 | 45,234,000 | |
| ミスミグループ本社 | 270,900 | 2,565.50 | 694,993,950 | |
| アルテック | 3,200 | 277.00 | 886,400 | |
| タキヒヨー | 1,400 | 1,150.00 | 1,610,000 | |
| 蔵王産業 | 1,100 | 2,573.00 | 2,830,300 | |
| スズケン | 64,100 | 4,663.00 | 298,898,300 | |
| ジェコス | 10,700 | 998.00 | 10,678,600 | |
| サンエー | 13,800 | 4,900.00 | 67,620,000 | |
| カワチ薬品 | 14,200 | 2,864.00 | 40,668,800 | |
| エービーシー・マート | 78,600 | 3,010.00 | 236,586,000 | |
| ハードオフコーポレーション | 7,300 | 2,145.00 | 15,658,500 | |
| アスクル | 43,500 | 2,175.00 | 94,612,500 | |
| ゲオホールディングス | 20,300 | 1,627.00 | 33,028,100 | |
| アダストリア | 21,800 | 3,670.00 | 80,006,000 | |
| くら寿司 | 21,100 | 4,440.00 | 93,684,000 | |
| キャンドゥ | 6,500 | 3,140.00 | 20,410,000 | |
| ＩＫホールディングス | 2,900 | 385.00 | 1,116,500 | |
| パルグループホールディングス | 35,400 | 1,843.00 | 65,242,200 | |
| エディオン | 71,200 | 1,582.00 | 112,638,400 | |
| サーラコーポレーション | 38,100 | 816.00 | 31,089,600 | |
| ワッツ | 3,000 | 688.00 | 2,064,000 | |
| ハローズ | 8,200 | 4,255.00 | 34,891,000 | |
| あみやき亭 | 4,400 | 6,130.00 | 26,972,000 | |
| 大黒天物産 | 5,600 | 8,370.00 | 46,872,000 | |
| ハニーズホールディングス | 16,100 | 1,575.00 | 25,357,500 | |
| ファーマライズホールディングス | 1,900 | 640.00 | 1,216,000 | |
| アルペン | 15,000 | 2,041.00 | 30,615,000 | |
| ハブ | 2,400 | 870.00 | 2,088,000 | |
| クオールホールディングス | 24,900 | 1,451.00 | 36,129,900 | |
| ジンズホールディングス | 13,800 | 3,845.00 | 53,061,000 | |
| ビックカメラ | 107,600 | 1,609.00 | 173,128,400 | |
| ＤＣＭホールディングス | 93,100 | 1,561.00 | 145,329,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 254,500 | 1,641.50 | 417,761,750 | |
| 東京一番フーズ | 2,400 | 512.00 | 1,228,800 | |
| きちりホールディングス | 1,700 | 923.00 | 1,569,100 | |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 206,100 | 1,664.00 | 342,950,400 | |
| ドトール・日レスホールディングス | 32,000 | 2,185.00 | 69,920,000 | |
| マツキヨココカラ＆カンパニー | 326,500 | 2,144.50 | 700,179,250 | |
| ブロンコビリー | 10,600 | 4,060.00 | 43,036,000 | |
| ＺＯＺＯ | 114,400 | 3,757.00 | 429,800,800 | |
| トレジャー・ファクトリー | 11,300 | 1,756.00 | 19,842,800 | |
| 物語コーポレーション | 30,100 | 3,405.00 | 102,490,500 | |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 297,000 | 3,264.00 | 969,408,000 | |
| Ｈａｍｅｅ | 7,500 | 1,356.00 | 10,170,000 | |
| マーケットエンタープライズ | 1,000 | 861.00 | 861,000 | |
| ウエルシアホールディングス | 93,200 | 2,151.00 | 200,473,200 | |
| クリエイトＳＤホールディングス | 25,500 | 3,420.00 | 87,210,000 | |
| 丸善ＣＨＩホールディングス | 8,000 | 338.00 | 2,704,000 | |
| ミサワ | 1,800 | 629.00 | 1,132,200 | |
| ティーライフ | 1,100 | 1,409.00 | 1,549,900 | |
| チムニー | 1,800 | 1,308.00 | 2,354,400 | |
| シュッピン | 16,500 | 1,319.00 | 21,763,500 | |
| オイシックス・ラ・大地 | 24,400 | 1,265.00 | 30,866,000 | |
| ネクステージ | 41,100 | 2,534.00 | 104,147,400 | |
| ジョイフル本田 | 52,300 | 2,110.00 | 110,353,000 | |
| エターナルホスピタリティグループ | 6,700 | 3,645.00 | 24,421,500 | |
| ホットランド | 13,900 | 2,555.00 | 35,514,500 | |
| すかいらーくホールディングス | 245,400 | 2,260.00 | 554,604,000 | |
| ＳＦＰホールディングス | 8,700 | 2,094.00 | 18,217,800 | |
| 綿半ホールディングス | 14,100 | 1,646.00 | 23,208,600 | |
| ヨシックスホールディングス | 4,300 | 2,830.00 | 12,169,000 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 50,500 | 888.00 | 44,844,000 | |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 8,800 | 541.00 | 4,760,800 | |
| ＢＥＥＮＯＳ | 10,800 | 2,231.00 | 24,094,800 | |
| あさひ | 16,900 | 1,446.00 | 24,437,400 | |
| 日本調剤 | 12,100 | 1,414.00 | 17,109,400 | |
| コスモス薬品 | 15,200 | 13,045.00 | 198,284,000 | |
| トーエル | 3,100 | 820.00 | 2,542,000 | |
| セブン＆アイ・ホールディングス | 1,836,400 | 2,048.00 | 3,760,947,200 | |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 121,400 | 1,123.00 | 136,332,200 | |
| ツルハホールディングス | 37,700 | 9,300.00 | 350,610,000 | |
| サンマルクホールディングス | 14,600 | 2,162.00 | 31,565,200 | |
| フェリシモ | 1,700 | 923.00 | 1,569,100 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| トリドールホールディングス | 50,400 | 3,650.00 | 183,960,000 | |
| ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ | 20,300 | 310.00 | 6,293,000 | |
| ウイルプラスホールディングス | 1,500 | 1,063.00 | 1,594,500 | |
| ＪＭホールディングス | 13,700 | 2,822.00 | 38,661,400 | |
| サツドラホールディングス | 2,800 | 873.00 | 2,444,400 | |
| アレンザホールディングス | 13,700 | 1,127.00 | 15,439,900 | |
| 串カツ田中ホールディングス | 5,000 | 1,701.00 | 8,505,000 | |
| バロックジャパンリミテッド | 14,400 | 793.00 | 11,419,200 | |
| クスリのアオキホールディングス | 54,100 | 3,191.00 | 172,633,100 | |
| 力の源ホールディングス | 10,400 | 1,441.00 | 14,986,400 | |
| ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ | 95,800 | 2,717.00 | 260,288,600 | |
| メディカルシステムネットワーク | 20,000 | 600.00 | 12,000,000 | |
| はるやまホールディングス | 3,400 | 590.00 | 2,006,000 | |
| ノジマ | 52,200 | 1,705.00 | 89,001,000 | |
| カッパ・クリエイト | 28,200 | 1,696.00 | 47,827,200 | |
| ライトオン | 4,500 | 394.00 | 1,773,000 | |
| 良品計画 | 213,700 | 2,613.00 | 558,398,100 | |
| パリミキホールディングス | 8,300 | 390.00 | 3,237,000 | |
| アドヴァングループ | 15,800 | 994.00 | 15,705,200 | |
| アルビス | 6,000 | 2,635.00 | 15,810,000 | |
| コナカ | 7,000 | 286.00 | 2,002,000 | |
| ハウス　オブ　ローゼ | 1,000 | 1,588.00 | 1,588,000 | |
| Ｇ－７ホールディングス | 19,800 | 1,569.00 | 31,066,200 | |
| イオン北海道 | 53,100 | 932.00 | 49,489,200 | |
| コジマ | 35,000 | 889.00 | 31,115,000 | |
| ヒマラヤ | 2,500 | 913.00 | 2,282,500 | |
| コーナン商事 | 22,100 | 4,200.00 | 92,820,000 | |
| エコス | 6,800 | 2,288.00 | 15,558,400 | |
| ワタミ | 18,900 | 903.00 | 17,066,700 | |
| 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 | 362,300 | 3,912.00 | 1,417,317,600 | |
| 西松屋チェーン | 35,500 | 2,290.00 | 81,295,000 | |
| ゼンショーホールディングス | 91,400 | 6,179.00 | 564,760,600 | |
| 幸楽苑ホールディングス | 13,300 | 1,330.00 | 17,689,000 | |
| ハークスレイ | 2,200 | 817.00 | 1,797,400 | |
| サイゼリヤ | 26,600 | 5,430.00 | 144,438,000 | |
| ＶＴホールディングス | 70,700 | 495.00 | 34,996,500 | |
| 魚力 | 6,400 | 2,404.00 | 15,385,600 | |
| フジ・コーポレーション | 8,700 | 1,902.00 | 16,547,400 | |
| ユナイテッドアローズ | 21,300 | 1,853.00 | 39,468,900 | |
| ハイデイ日高 | 26,700 | 3,055.00 | 81,568,500 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| YU−WA Creation Holdings | 5,700 | 134.00 | 763,800 | |
| コロワイド | 77,100 | 2,041.50 | 157,399,650 | |
| 壱番屋 | 71,200 | 1,150.00 | 81,880,000 | |
| ＰＬＡＮＴ | 1,500 | 1,544.00 | 2,316,000 | |
| スギホールディングス | 108,600 | 2,431.00 | 264,006,600 | |
| 薬王堂ホールディングス | 8,900 | 2,800.00 | 24,920,000 | |
| スクロール | 27,000 | 1,074.00 | 28,998,000 | |
| ヨンドシーホールディングス | 17,200 | 1,913.00 | 32,903,600 | |
| 木曽路 | 27,300 | 2,548.00 | 69,560,400 | |
| ＳＲＳホールディングス | 29,900 | 1,243.00 | 37,165,700 | |
| 千趣会 | 33,000 | 334.00 | 11,022,000 | |
| リテールパートナーズ | 26,800 | 1,670.00 | 44,756,000 | |
| 上新電機 | 17,900 | 2,576.00 | 46,110,400 | |
| 日本瓦斯 | 95,200 | 2,402.00 | 228,670,400 | |
| ロイヤルホールディングス | 31,600 | 2,628.00 | 83,044,800 | |
| いなげや | 17,500 | 1,255.00 | 21,962,500 | |
| チヨダ | 17,500 | 904.00 | 15,820,000 | |
| ライフコーポレーション | 18,800 | 4,150.00 | 78,020,000 | |
| リンガーハット | 23,100 | 2,355.00 | 54,400,500 | |
| ＭｒＭａｘＨＤ | 23,100 | 666.00 | 15,384,600 | |
| ＡＯＫＩホールディングス | 38,700 | 1,261.00 | 48,800,700 | |
| オークワ | 25,900 | 950.00 | 24,605,000 | |
| コメリ | 27,700 | 3,670.00 | 101,659,000 | |
| 青山商事 | 38,600 | 1,532.00 | 59,135,200 | |
| しまむら | 42,200 | 7,472.00 | 315,318,400 | |
| はせがわ | 3,800 | 345.00 | 1,311,000 | |
| 高島屋 | 114,300 | 2,733.00 | 312,381,900 | |
| 松屋 | 30,500 | 1,037.00 | 31,628,500 | |
| エイチ・ツー・オー　リテイリング | 79,400 | 2,468.00 | 195,959,200 | |
| 近鉄百貨店 | 7,900 | 2,305.00 | 18,209,500 | |
| 丸井グループ | 119,100 | 2,315.00 | 275,716,500 | |
| アクシアル　リテイリング | 49,300 | 1,006.00 | 49,595,800 | |
| イオン | 608,100 | 3,535.00 | 2,149,633,500 | |
| イズミ | 31,800 | 3,317.00 | 105,480,600 | |
| 平和堂 | 30,000 | 2,316.00 | 69,480,000 | |
| フジ | 27,600 | 1,997.00 | 55,117,200 | |
| ヤオコー | 21,300 | 9,210.00 | 196,173,000 | |
| ゼビオホールディングス | 24,600 | 1,147.00 | 28,216,200 | |
| ケーズホールディングス | 120,700 | 1,426.50 | 172,178,550 | |
| Ｏｌｙｍｐｉｃグループ | 3,300 | 544.00 | 1,795,200 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 9,400 | 527.00 | 4,953,800 | |
| シルバーライフ | 5,200 | 934.00 | 4,856,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ | 7,900 | 5,970.00 | 47,163,000 | |
| ナルミヤ・インターナショナル | 1,200 | 1,320.00 | 1,584,000 | |
| ブックオフグループホールディングス | 12,000 | 1,594.00 | 19,128,000 | |
| ギフトホールディングス | 7,700 | 3,060.00 | 23,562,000 | |
| アインホールディングス | 24,800 | 6,087.00 | 150,957,600 | |
| 元気寿司 | 10,300 | 3,280.00 | 33,784,000 | |
| ヤマダホールディングス | 552,500 | 434.70 | 240,171,750 | |
| アークランズ | 53,500 | 1,958.00 | 104,753,000 | |
| ニトリホールディングス | 65,300 | 17,105.00 | 1,116,956,500 | |
| グルメ杵屋 | 14,900 | 1,109.00 | 16,524,100 | |
| 愛眼 | 4,400 | 179.00 | 787,600 | |
| ケーユーホールディングス | 8,700 | 1,267.00 | 11,022,900 | |
| 吉野家ホールディングス | 66,200 | 2,985.00 | 197,607,000 | |
| 松屋フーズホールディングス | 8,500 | 5,620.00 | 47,770,000 | |
| サガミホールディングス | 27,100 | 1,571.00 | 42,574,100 | |
| 関西フードマーケット | 12,300 | 2,567.00 | 31,574,100 | |
| 王将フードサービス | 13,300 | 8,570.00 | 113,981,000 | |
| ミニストップ | 13,100 | 1,641.00 | 21,497,100 | |
| アークス | 33,000 | 2,937.00 | 96,921,000 | |
| バローホールディングス | 34,400 | 2,366.00 | 81,390,400 | |
| ベルク | 9,000 | 7,360.00 | 66,240,000 | |
| 大庄 | 10,000 | 1,243.00 | 12,430,000 | |
| ファーストリテイリング | 100,900 | 41,490.00 | 4,186,341,000 | |
| サンドラッグ | 60,600 | 3,941.00 | 238,824,600 | |
| サックスバー　ホールディングス | 15,600 | 796.00 | 12,417,600 | |
| ヤマザワ | 1,500 | 1,265.00 | 1,897,500 | |
| やまや | 1,300 | 3,105.00 | 4,036,500 | |
| ベルーナ | 43,700 | 745.00 | 32,556,500 | |
| いよぎんホールディングス | 198,700 | 1,433.00 | 284,737,100 | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 371,000 | 1,551.00 | 575,421,000 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 140,600 | 1,639.50 | 230,513,700 | |
| 楽天銀行 | 77,400 | 2,866.00 | 221,828,400 | |
| 京都フィナンシャルグループ | 210,200 | 2,681.00 | 563,546,200 | |
| 島根銀行 | 1,600 | 565.00 | 904,000 | |
| じもとホールディングス | 4,900 | 400.00 | 1,960,000 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 773,700 | 606.50 | 469,249,050 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 21,400 | 4,725.00 | 101,115,000 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 323,100 | 984.20 | 317,995,020 | |
| ゆうちょ銀行 | 1,834,800 | 1,536.00 | 2,818,252,800 | |
| 富山第一銀行 | 53,000 | 1,190.00 | 63,070,000 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 888,300 | 919.10 | 816,436,530 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 93,400 | 1,992.00 | 186,052,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 三十三フィナンシャルグループ | 14,900 | 2,169.00 | 32,318,100 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 26,200 | 4,895.00 | 128,249,000 | |
| ひろぎんホールディングス | 237,600 | 1,230.50 | 292,366,800 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 14,200 | 2,538.00 | 36,039,600 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 21,600 | 4,665.00 | 100,764,000 | |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 17,600 | 5,200.00 | 91,520,000 | |
| プロクレアホールディングス | 19,100 | 1,838.00 | 35,105,800 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 34,300 | 2,728.00 | 93,570,400 | |
| あおぞら銀行 | 120,000 | 2,377.50 | 285,300,000 | |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 10,163,300 | 1,649.50 | 16,764,363,350 | |
| りそなホールディングス | 1,931,000 | 1,047.50 | 2,022,722,500 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 599,700 | 3,634.00 | 2,179,309,800 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,168,700 | 10,365.00 | 12,113,575,500 | |
| 千葉銀行 | 465,300 | 1,429.50 | 665,146,350 | |
| 群馬銀行 | 324,000 | 1,010.50 | 327,402,000 | |
| 武蔵野銀行 | 23,300 | 3,205.00 | 74,676,500 | |
| 千葉興業銀行 | 35,500 | 1,007.00 | 35,748,500 | |
| 筑波銀行 | 73,300 | 314.00 | 23,016,200 | |
| 七十七銀行 | 48,600 | 4,310.00 | 209,466,000 | |
| 秋田銀行 | 11,200 | 2,548.00 | 28,537,600 | |
| 山形銀行 | 18,500 | 1,140.00 | 21,090,000 | |
| 岩手銀行 | 10,600 | 2,789.00 | 29,563,400 | |
| 東邦銀行 | 132,100 | 317.00 | 41,875,700 | |
| 東北銀行 | 2,700 | 1,200.00 | 3,240,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 145,400 | 4,346.00 | 631,908,400 | |
| スルガ銀行 | 125,000 | 1,089.00 | 136,125,000 | |
| 八十二銀行 | 358,300 | 1,025.00 | 367,257,500 | |
| 山梨中央銀行 | 18,700 | 1,981.00 | 37,044,700 | |
| 大垣共立銀行 | 31,800 | 2,214.00 | 70,405,200 | |
| 福井銀行 | 14,900 | 2,076.00 | 30,932,400 | |
| 清水銀行 | 6,600 | 1,667.00 | 11,002,200 | |
| 富山銀行 | 900 | 1,773.00 | 1,595,700 | |
| 滋賀銀行 | 27,800 | 4,465.00 | 124,127,000 | |
| 南都銀行 | 25,100 | 3,415.00 | 85,716,500 | |
| 百五銀行 | 157,100 | 677.00 | 106,356,700 | |
| 紀陽銀行 | 59,700 | 1,888.00 | 112,713,600 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 103,300 | 2,093.00 | 216,206,900 | |
| 山陰合同銀行 | 104,500 | 1,418.00 | 148,181,000 | |
| 鳥取銀行 | 1,900 | 1,401.00 | 2,661,900 | |
| 百十四銀行 | 16,400 | 3,280.00 | 53,792,000 | |
| 四国銀行 | 24,500 | 1,141.00 | 27,954,500 | |
| 阿波銀行 | 23,400 | 2,797.00 | 65,449,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 大分銀行 | 10,000 | 3,405.00 | 34,050,000 | |
| 宮崎銀行 | 10,100 | 3,435.00 | 34,693,500 | |
| 佐賀銀行 | 9,800 | 2,615.00 | 25,627,000 | |
| 琉球銀行 | 35,500 | 1,261.00 | 44,765,500 | |
| セブン銀行 | 523,400 | 264.30 | 138,334,620 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 2,253,700 | 3,147.00 | 7,092,393,900 | |
| 高知銀行 | 1,900 | 950.00 | 1,805,000 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 163,700 | 1,787.00 | 292,531,900 | |
| 名古屋銀行 | 10,600 | 7,190.00 | 76,214,000 | |
| 北洋銀行 | 253,000 | 558.00 | 141,174,000 | |
| 大光銀行 | 1,800 | 1,668.00 | 3,002,400 | |
| 愛媛銀行 | 22,500 | 1,279.00 | 28,777,500 | |
| トマト銀行 | 2,000 | 1,235.00 | 2,470,000 | |
| 京葉銀行 | 68,700 | 885.00 | 60,799,500 | |
| 栃木銀行 | 83,400 | 366.00 | 30,524,400 | |
| 北日本銀行 | 5,400 | 2,641.00 | 14,261,400 | |
| 東和銀行 | 30,600 | 703.00 | 21,511,800 | |
| 福島銀行 | 5,800 | 270.00 | 1,566,000 | |
| 大東銀行 | 2,400 | 752.00 | 1,804,800 | |
| トモニホールディングス | 158,000 | 411.00 | 64,938,000 | |
| フィデアホールディングス | 17,300 | 1,614.00 | 27,922,200 | |
| 池田泉州ホールディングス | 231,600 | 407.00 | 94,261,200 | |
| ＦＰＧ | 62,200 | 2,118.00 | 131,739,600 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 27,100 | 1,422.00 | 38,536,200 | |
| マーキュリアホールディングス | 2,900 | 874.00 | 2,534,600 | |
| ＳＢＩホールディングス | 268,000 | 4,150.00 | 1,112,200,000 | |
| ジャフコ　グループ | 49,800 | 1,832.00 | 91,233,600 | |
| 大和証券グループ本社 | 1,293,500 | 1,315.00 | 1,700,952,500 | |
| 野村ホールディングス | 2,807,900 | 962.70 | 2,703,165,330 | |
| 岡三証券グループ | 146,700 | 799.00 | 117,213,300 | |
| 丸三証券 | 55,600 | 1,013.00 | 56,322,800 | |
| 東洋証券 | 44,500 | 402.00 | 17,889,000 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 198,400 | 599.00 | 118,841,600 | |
| 光世証券 | 1,400 | 647.00 | 905,800 | |
| 水戸証券 | 49,400 | 538.00 | 26,577,200 | |
| いちよし証券 | 31,400 | 838.00 | 26,313,200 | |
| 松井証券 | 82,300 | 811.00 | 66,745,300 | |
| マネックスグループ | 163,600 | 746.00 | 122,045,600 | |
| 極東証券 | 22,900 | 1,473.00 | 33,731,700 | |
| 岩井コスモホールディングス | 19,100 | 2,252.00 | 43,013,200 | |
| アイザワ証券グループ | 24,100 | 2,009.00 | 48,416,900 | |
| マネーパートナーズグループ | 6,000 | 253.00 | 1,518,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スパークス・グループ | 18,600 | 1,717.00 | 31,936,200 | |
| かんぽ生命保険 | 170,100 | 2,986.50 | 508,003,650 | |
| ＦＰパートナー | 4,400 | 4,650.00 | 20,460,000 | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 753,500 | 3,433.00 | 2,586,765,500 | |
| アニコム　ホールディングス | 56,700 | 645.00 | 36,571,500 | |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 1,121,500 | 3,174.00 | 3,559,641,000 | |
| 第一生命ホールディングス | 785,000 | 4,164.00 | 3,268,740,000 | |
| 東京海上ホールディングス | 1,630,200 | 5,587.00 | 9,107,927,400 | |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 448,300 | 2,792.50 | 1,251,877,750 | |
| アドバンスクリエイト | 11,700 | 1,044.00 | 12,214,800 | |
| ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ | 2,600 | 607.00 | 1,578,200 | |
| 全国保証 | 43,700 | 5,689.00 | 248,609,300 | |
| あんしん保証 | 4,600 | 223.00 | 1,025,800 | |
| イントラスト | 2,700 | 782.00 | 2,111,400 | |
| 日本モーゲージサービス | 4,100 | 415.00 | 1,701,500 | |
| Ｃａｓａ | 2,700 | 895.00 | 2,416,500 | |
| ＳＢＩアルヒ | 16,600 | 856.00 | 14,209,600 | |
| プレミアグループ | 28,500 | 2,148.00 | 61,218,000 | |
| ネットプロテクションズホールディングス | 58,500 | 169.00 | 9,886,500 | |
| クレディセゾン | 106,000 | 3,430.00 | 363,580,000 | |
| 芙蓉総合リース | 15,400 | 12,515.00 | 192,731,000 | |
| みずほリース | 140,300 | 1,095.00 | 153,628,500 | |
| 東京センチュリー | 125,100 | 1,495.00 | 187,024,500 | |
| 日本証券金融 | 61,700 | 1,668.00 | 102,915,600 | |
| アイフル | 247,000 | 393.00 | 97,071,000 | |
| リコーリース | 15,900 | 5,070.00 | 80,613,000 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 96,200 | 1,313.00 | 126,310,600 | |
| アコム | 299,200 | 385.20 | 115,251,840 | |
| ジャックス | 17,900 | 4,865.00 | 87,083,500 | |
| オリエントコーポレーション | 54,900 | 1,026.00 | 56,327,400 | |
| オリックス | 1,001,500 | 3,468.00 | 3,473,202,000 | |
| 三菱ＨＣキャピタル | 744,500 | 1,039.50 | 773,907,750 | |
| 九州リースサービス | 2,600 | 1,094.00 | 2,844,400 | |
| 日本取引所グループ | 430,600 | 3,747.00 | 1,613,458,200 | |
| イー・ギャランティ | 27,600 | 1,281.00 | 35,355,600 | |
| アサックス | 3,100 | 838.00 | 2,597,800 | |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 8,300 | 3,865.00 | 32,079,500 | |
| ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ | 50,000 | 180.00 | 9,000,000 | |
| 大東建託 | 61,200 | 16,835.00 | 1,030,302,000 | |
| サムティホールディングス | 26,600 | 2,532.00 | 67,351,200 | |
| いちご | 171,100 | 387.00 | 66,215,700 | |
| 日本駐車場開発 | 202,000 | 192.00 | 38,784,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スター・マイカ・ホールディングス | 20,400 | 612.00 | 12,484,800 | |
| ＳＲＥホールディングス | 7,400 | 4,215.00 | 31,191,000 | |
| ＡＤワークスグループ | 14,000 | 229.00 | 3,206,000 | |
| ヒューリック | 389,900 | 1,489.50 | 580,756,050 | |
| 野村不動産ホールディングス | 93,100 | 4,169.00 | 388,133,900 | |
| 三重交通グループホールディングス | 36,800 | 593.00 | 21,822,400 | |
| ディア・ライフ | 29,200 | 882.00 | 25,754,400 | |
| 地主 | 13,000 | 2,377.00 | 30,901,000 | |
| プレサンスコーポレーション | 23,500 | 1,889.00 | 44,391,500 | |
| ハウスコム | 1,500 | 999.00 | 1,498,500 | |
| ＪＰＭＣ | 10,200 | 1,247.00 | 12,719,400 | |
| サンセイランディック | 2,100 | 1,023.00 | 2,148,300 | |
| フージャースホールディングス | 25,700 | 1,151.00 | 29,580,700 | |
| オープンハウスグループ | 61,300 | 4,678.00 | 286,761,400 | |
| 東急不動産ホールディングス | 502,600 | 1,135.50 | 570,702,300 | |
| 飯田グループホールディングス | 160,300 | 2,153.50 | 345,206,050 | |
| イーグランド | 1,200 | 1,559.00 | 1,870,800 | |
| ムゲンエステート | 4,100 | 1,160.00 | 4,756,000 | |
| Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス | 10,100 | 1,170.00 | 11,817,000 | |
| シーアールイー | 8,700 | 1,308.00 | 11,379,600 | |
| ケイアイスター不動産 | 8,200 | 3,435.00 | 28,167,000 | |
| グッドコムアセット | 16,400 | 710.00 | 11,644,000 | |
| ジェイ・エス・ビー | 8,500 | 2,950.00 | 25,075,000 | |
| ロードスターキャピタル | 11,100 | 2,984.00 | 33,122,400 | |
| テンポイノベーション | 2,300 | 868.00 | 1,996,400 | |
| フェイスネットワーク | 1,900 | 1,649.00 | 3,133,100 | |
| 霞ヶ関キャピタル | 6,900 | 15,370.00 | 106,053,000 | |
| パーク２４ | 108,800 | 1,649.50 | 179,465,600 | |
| パラカ | 5,900 | 2,013.00 | 11,876,700 | |
| 三井不動産 | 2,316,800 | 1,515.00 | 3,509,952,000 | |
| 三菱地所 | 1,091,700 | 2,652.00 | 2,895,188,400 | |
| 平和不動産 | 27,300 | 3,795.00 | 103,603,500 | |
| 東京建物 | 146,100 | 2,574.50 | 376,134,450 | |
| 京阪神ビルディング | 31,600 | 1,641.00 | 51,855,600 | |
| 住友不動産 | 241,600 | 4,922.00 | 1,189,155,200 | |
| テーオーシー | 30,600 | 716.00 | 21,909,600 | |
| レオパレス２１ | 167,100 | 511.00 | 85,388,100 | |
| スターツコーポレーション | 24,200 | 3,460.00 | 83,732,000 | |
| フジ住宅 | 21,900 | 747.00 | 16,359,300 | |
| 空港施設 | 24,500 | 599.00 | 14,675,500 | |
| 明和地所 | 11,400 | 915.00 | 10,431,000 | |
| ゴールドクレスト | 13,900 | 2,612.00 | 36,306,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| エスリード | 8,000 | 4,180.00 | 33,440,000 | |
| 日神グループホールディングス | 28,000 | 525.00 | 14,700,000 | |
| 日本エスコン | 31,200 | 1,050.00 | 32,760,000 | |
| ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス | 76,700 | 490.00 | 37,583,000 | |
| ＡＶＡＮＴＩＡ | 3,700 | 841.00 | 3,111,700 | |
| イオンモール | 86,900 | 1,932.00 | 167,890,800 | |
| 毎日コムネット | 2,700 | 754.00 | 2,035,800 | |
| ファースト住建 | 2,700 | 1,076.00 | 2,905,200 | |
| カチタス | 45,300 | 1,624.00 | 73,567,200 | |
| トーセイ | 28,100 | 2,423.00 | 68,086,300 | |
| 穴吹興産 | 1,600 | 2,228.00 | 3,564,800 | |
| サンフロンティア不動産 | 25,000 | 1,996.00 | 49,900,000 | |
| ＦＪネクストホールディングス | 18,100 | 1,243.00 | 22,498,300 | |
| インテリックス | 1,300 | 549.00 | 713,700 | |
| ランドビジネス | 2,000 | 242.00 | 484,000 | |
| サンネクスタグループ | 2,300 | 1,030.00 | 2,369,000 | |
| グランディハウス | 15,100 | 589.00 | 8,893,900 | |
| 日本空港ビルデング | 59,200 | 5,631.00 | 333,355,200 | |
| 明豊ファシリティワークス | 3,200 | 883.00 | 2,825,600 | |
| ＬＩＦＵＬＬ | 44,100 | 167.00 | 7,364,700 | |
| ＭＩＸＩ | 37,500 | 2,859.00 | 107,212,500 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 63,300 | 655.00 | 41,461,500 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 278,000 | 737.20 | 204,941,600 | |
| メンバーズ | 6,300 | 840.00 | 5,292,000 | |
| 中広 | 1,400 | 495.00 | 693,000 | |
| ＵＴグループ | 22,700 | 2,937.00 | 66,669,900 | |
| アイティメディア | 6,800 | 1,886.00 | 12,824,800 | |
| ケアネット | 36,100 | 527.00 | 19,024,700 | |
| Ｅ・Ｊホールディングス | 10,300 | 1,764.00 | 18,169,200 | |
| オープンアップグループ | 52,500 | 1,997.00 | 104,842,500 | |
| コシダカホールディングス | 52,500 | 855.00 | 44,887,500 | |
| アルトナー | 2,500 | 2,105.00 | 5,262,500 | |
| パソナグループ | 21,300 | 2,162.00 | 46,050,600 | |
| ＣＤＳ | 1,600 | 1,832.00 | 2,931,200 | |
| リンクアンドモチベーション | 50,200 | 455.00 | 22,841,000 | |
| エス・エム・エス | 61,200 | 1,940.00 | 118,728,000 | |
| サニーサイドアップグループ | 2,400 | 671.00 | 1,610,400 | |
| パーソルホールディングス | 1,775,200 | 223.30 | 396,402,160 | |
| リニカル | 4,300 | 402.00 | 1,728,600 | |
| クックパッド | 49,000 | 190.00 | 9,310,000 | |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 3,100 | 777.00 | 2,408,700 | |
| 学情 | 9,000 | 1,797.00 | 16,173,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| スタジオアリス | 8,800 | 2,088.00 | 18,374,400 | |
| エプコ | 1,900 | 824.00 | 1,565,600 | |
| ＮＪＳ | 3,900 | 3,685.00 | 14,371,500 | |
| 綜合警備保障 | 291,400 | 976.50 | 284,552,100 | |
| カカクコム | 113,200 | 1,993.00 | 225,607,600 | |
| アイロムグループ | 7,100 | 2,787.00 | 19,787,700 | |
| セントケア・ホールディング | 13,000 | 840.00 | 10,920,000 | |
| サイネックス | 1,300 | 735.00 | 955,500 | |
| ルネサンス | 13,800 | 958.00 | 13,220,400 | |
| ディップ | 26,800 | 2,744.00 | 73,539,200 | |
| デジタルホールディングス | 9,300 | 1,062.00 | 9,876,600 | |
| 新日本科学 | 16,000 | 1,385.00 | 22,160,000 | |
| キャリアデザインセンター | 1,200 | 1,749.00 | 2,098,800 | |
| エムスリー | 344,600 | 1,551.50 | 534,646,900 | |
| ツカダ・グローバルホールディング | 3,700 | 490.00 | 1,813,000 | |
| ウェルネット | 5,500 | 620.00 | 3,410,000 | |
| ワールドホールディングス | 8,000 | 2,114.00 | 16,912,000 | |
| ディー・エヌ・エー | 62,100 | 1,567.00 | 97,310,700 | |
| 博報堂ＤＹホールディングス | 222,500 | 1,108.50 | 246,641,250 | |
| ぐるなび | 33,300 | 318.00 | 10,589,400 | |
| タカミヤ | 24,100 | 480.00 | 11,568,000 | |
| ファンコミュニケーションズ | 25,000 | 412.00 | 10,300,000 | |
| ライク | 6,600 | 1,532.00 | 10,111,200 | |
| Ａｏｂａ－ＢＢＴ | 2,800 | 348.00 | 974,400 | |
| エスプール | 50,800 | 315.00 | 16,002,000 | |
| ＷＤＢホールディングス | 9,000 | 1,790.00 | 16,110,000 | |
| ティア | 4,400 | 460.00 | 2,024,000 | |
| ＣＤＧ | 800 | 1,296.00 | 1,036,800 | |
| アドウェイズ | 24,600 | 396.00 | 9,741,600 | |
| バリューコマース | 15,500 | 1,206.00 | 18,693,000 | |
| インフォマート | 181,700 | 301.00 | 54,691,700 | |
| ＪＰホールディングス | 45,000 | 542.00 | 24,390,000 | |
| エコナックホールディングス | 6,900 | 128.00 | 883,200 | |
| ＣＬホールディングス | 4,300 | 1,328.00 | 5,710,400 | |
| プレステージ・インターナショナル | 81,900 | 661.00 | 54,135,900 | |
| アミューズ | 10,800 | 1,606.00 | 17,344,800 | |
| ドリームインキュベータ | 6,100 | 2,130.00 | 12,993,000 | |
| クイック | 12,200 | 2,128.00 | 25,961,600 | |
| ＴＡＣ | 4,100 | 177.00 | 725,700 | |
| 電通グループ | 171,300 | 4,151.00 | 711,066,300 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 7,700 | 971.00 | 7,476,700 | |
| イオンファンタジー | 6,400 | 2,300.00 | 14,720,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| シーティーエス | 22,300 | 796.00 | 17,750,800 | |
| Ｈ．Ｕ．グループホールディングス | 51,100 | 2,495.50 | 127,520,050 | |
| アルプス技研 | 16,600 | 2,534.00 | 42,064,400 | |
| 日本空調サービス | 19,000 | 1,016.00 | 19,304,000 | |
| オリエンタルランド | 922,300 | 4,412.00 | 4,069,187,600 | |
| ダスキン | 38,100 | 3,711.00 | 141,389,100 | |
| 明光ネットワークジャパン | 21,500 | 732.00 | 15,738,000 | |
| ファルコホールディングス | 7,800 | 2,301.00 | 17,947,800 | |
| ラウンドワン | 164,600 | 774.00 | 127,400,400 | |
| リゾートトラスト | 75,800 | 2,452.00 | 185,861,600 | |
| ビー・エム・エル | 21,500 | 2,839.00 | 61,038,500 | |
| リソー教育 | 89,500 | 243.00 | 21,748,500 | |
| 早稲田アカデミー | 9,800 | 1,598.00 | 15,660,400 | |
| ユー・エス・エス | 391,200 | 1,235.50 | 483,327,600 | |
| 東京個別指導学院 | 21,200 | 411.00 | 8,713,200 | |
| サイバーエージェント | 385,400 | 954.30 | 367,787,220 | |
| 楽天グループ | 1,496,100 | 839.00 | 1,255,227,900 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 8,900 | 1,684.00 | 14,987,600 | |
| ＳＢＩグローバルアセットマネジメント | 34,500 | 673.00 | 23,218,500 | |
| テー・オー・ダブリュー | 34,800 | 362.00 | 12,597,600 | |
| 山田コンサルティンググループ | 7,700 | 1,983.00 | 15,269,100 | |
| セントラルスポーツ | 6,600 | 2,507.00 | 16,546,200 | |
| フルキャストホールディングス | 16,800 | 1,476.00 | 24,796,800 | |
| エン・ジャパン | 28,500 | 2,612.00 | 74,442,000 | |
| リソルホールディングス | 600 | 4,860.00 | 2,916,000 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 102,100 | 2,620.00 | 267,502,000 | |
| 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 | 1,235.00 | 11,362,000 | |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | 10,800 | 3,970.00 | 42,876,000 | |
| ファーストロジック | 2,300 | 504.00 | 1,159,200 | |
| 三機サービス | 1,200 | 1,165.00 | 1,398,000 | |
| Ｇｕｎｏｓｙ | 14,200 | 743.00 | 10,550,600 | |
| デザインワン・ジャパン | 3,400 | 146.00 | 496,400 | |
| イー・ガーディアン | 8,500 | 1,898.00 | 16,133,000 | |
| リブセンス | 3,700 | 222.00 | 821,400 | |
| ジャパンマテリアル | 53,500 | 1,936.00 | 103,576,000 | |
| ベクトル | 21,000 | 1,292.00 | 27,132,000 | |
| ウチヤマホールディングス | 3,200 | 342.00 | 1,094,400 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 14,700 | 1,561.00 | 22,946,700 | |
| キャリアリンク | 6,500 | 2,399.00 | 15,593,500 | |
| ＩＢＪ | 13,700 | 607.00 | 8,315,900 | |
| アサンテ | 8,800 | 1,726.00 | 15,188,800 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| バリューＨＲ | 15,400 | 1,551.00 | 23,885,400 | |
| Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ | 14,200 | 2,068.00 | 29,365,600 | |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 7,100 | 1,054.00 | 7,483,400 | |
| ＥＲＩホールディングス | 1,700 | 2,287.00 | 3,887,900 | |
| アビスト | 1,000 | 3,300.00 | 3,300,000 | |
| シグマクシス・ホールディングス | 23,000 | 1,457.00 | 33,511,000 | |
| ウィルグループ | 14,800 | 975.00 | 14,430,000 | |
| 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 | 14,400 | 600.00 | 8,640,000 | |
| レアジョブ | 1,500 | 432.00 | 648,000 | |
| リクルートホールディングス | 1,254,600 | 7,937.00 | 9,957,760,200 | |
| エラン | 23,300 | 872.00 | 20,317,600 | |
| 土木管理総合試験所 | 3,400 | 325.00 | 1,105,000 | |
| 日本郵政 | 1,821,900 | 1,496.50 | 2,726,473,350 | |
| ベルシステム２４ホールディングス | 18,900 | 1,519.00 | 28,709,100 | |
| 鎌倉新書 | 15,300 | 537.00 | 8,216,100 | |
| ＳＭＮ | 1,800 | 303.00 | 545,400 | |
| グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ | 1,400 | 669.00 | 936,600 | |
| エアトリ | 13,000 | 1,321.00 | 17,173,000 | |
| アトラエ | 13,500 | 719.00 | 9,706,500 | |
| ストライク | 8,600 | 4,200.00 | 36,120,000 | |
| ソラスト | 48,600 | 461.00 | 22,404,600 | |
| セラク | 5,500 | 1,125.00 | 6,187,500 | |
| インソース | 38,100 | 904.00 | 34,442,400 | |
| ベイカレント・コンサルティング | 128,200 | 3,171.00 | 406,522,200 | |
| Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 4,000 | 1,348.00 | 5,392,000 | |
| アイモバイル | 22,600 | 481.00 | 10,870,600 | |
| キャリアインデックス | 3,400 | 171.00 | 581,400 | |
| ＭＳ－Ｊａｐａｎ | 7,400 | 1,047.00 | 7,747,800 | |
| 船場 | 1,400 | 1,239.00 | 1,734,600 | |
| ジャパンエレベーターサービスホールディングス | 56,600 | 2,697.00 | 152,650,200 | |
| フルテック | 1,000 | 1,130.00 | 1,130,000 | |
| ＧａｍｅＷｉｔｈ | 3,300 | 259.00 | 854,700 | |
| ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ | 1,200 | 606.00 | 727,200 | |
| エル・ティー・エス | 2,100 | 2,111.00 | 4,433,100 | |
| ミダックホールディングス | 10,700 | 1,566.00 | 16,756,200 | |
| キュービーネットホールディングス | 10,200 | 1,092.00 | 11,138,400 | |
| オープングループ | 24,700 | 260.00 | 6,422,000 | |
| スプリックス | 2,000 | 781.00 | 1,562,000 | |
| マネジメントソリューションズ | 7,600 | 1,724.00 | 13,102,400 | |
| プロレド・パートナーズ | 4,600 | 639.00 | 2,939,400 | |
| テノ．ホールディングス | 1,300 | 419.00 | 544,700 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| フロンティア・マネジメント | 4,600 | 1,260.00 | 5,796,000 | |
| コプロ・ホールディングス | 2,000 | 1,480.00 | 2,960,000 | |
| ギークス | 1,300 | 477.00 | 620,100 | |
| アンビスホールディングス | 37,400 | 2,223.00 | 83,140,200 | |
| カーブスホールディングス | 47,900 | 745.00 | 35,685,500 | |
| フォーラムエンジニアリング | 24,000 | 851.00 | 20,424,000 | |
| Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ | 6,100 | 1,323.00 | 8,070,300 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 19,000 | 236.00 | 4,484,000 | |
| ポピンズ | 2,800 | 1,246.00 | 3,488,800 | |
| ＬＩＴＡＬＩＣＯ | 13,700 | 1,666.00 | 22,824,200 | |
| コンフィデンス・インターワークス | 600 | 1,844.00 | 1,106,400 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 3,500 | 487.00 | 1,704,500 | |
| リログループ | 87,500 | 1,665.00 | 145,687,500 | |
| 東祥 | 12,500 | 723.00 | 9,037,500 | |
| ＩＤ＆Ｅホールディングス | 10,600 | 4,235.00 | 44,891,000 | |
| ビーウィズ | 3,700 | 1,816.00 | 6,719,200 | |
| ＴＲＥホールディングス | 33,600 | 1,189.00 | 39,950,400 | |
| 人・夢・技術グループ | 7,300 | 1,727.00 | 12,607,100 | |
| ＮＩＳＳＯホールディングス | 15,400 | 840.00 | 12,936,000 | |
| 大栄環境 | 31,800 | 2,486.00 | 79,054,800 | |
| 日本管財ホールディングス | 18,400 | 2,615.00 | 48,116,000 | |
| M&A総研ホールディングス | 18,600 | 3,450.00 | 64,170,000 | |
| エイチ・アイ・エス | 50,800 | 1,766.00 | 89,712,800 | |
| ラックランド | 8,000 | 1,908.00 | 15,264,000 | |
| 共立メンテナンス | 54,800 | 3,151.00 | 172,674,800 | |
| イチネンホールディングス | 18,600 | 1,645.00 | 30,597,000 | |
| 建設技術研究所 | 9,000 | 4,930.00 | 44,370,000 | |
| スペース | 11,600 | 1,089.00 | 12,632,400 | |
| 燦ホールディングス | 16,500 | 1,172.00 | 19,338,000 | |
| スバル興業 | 6,200 | 2,638.00 | 16,355,600 | |
| 東京テアトル | 2,100 | 1,110.00 | 2,331,000 | |
| タナベコンサルティンググループ | 7,000 | 1,044.00 | 7,308,000 | |
| ナガワ | 5,500 | 7,880.00 | 43,340,000 | |
| 東京都競馬 | 14,600 | 4,110.00 | 60,006,000 | |
| カナモト | 27,100 | 2,989.00 | 81,001,900 | |
| ニシオホールディングス | 15,400 | 4,075.00 | 62,755,000 | |
| トランス・コスモス | 21,700 | 3,410.00 | 73,997,000 | |
| 乃村工藝社 | 76,300 | 807.00 | 61,574,100 | |
| 藤田観光 | 7,000 | 6,230.00 | 43,610,000 | |
| ＫＮＴ－ＣＴホールディングス | 10,400 | 1,323.00 | 13,759,200 | |
| トーカイ | 15,500 | 2,168.00 | 33,604,000 | |
| セコム | 177,500 | 9,682.00 | 1,718,555,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| セントラル警備保障 | 9,500 | 2,976.00 | 28,272,000 | |
| 丹青社 | 34,100 | 847.00 | 28,882,700 | |
| メイテックグループホールディングス | 59,400 | 3,046.00 | 180,932,400 | |
| 応用地質 | 16,400 | 2,644.00 | 43,361,600 | |
| 船井総研ホールディングス | 35,000 | 2,210.00 | 77,350,000 | |
| 進学会ホールディングス | 2,500 | 239.00 | 597,500 | |
| オオバ | 4,100 | 1,036.00 | 4,247,600 | |
| いであ | 1,700 | 2,378.00 | 4,042,600 | |
| 学究社 | 7,100 | 2,093.00 | 14,860,300 | |
| イオンディライト | 18,800 | 3,845.00 | 72,286,000 | |
| ナック | 15,200 | 568.00 | 8,633,600 | |
| ダイセキ | 35,600 | 3,245.00 | 115,522,000 | |
| ステップ | 6,500 | 1,909.00 | 12,408,500 | |
| 合　計 | 271,674,800 | | 664,691,246,410 | |

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 国内債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 428,084,976 |
| 国債証券 | 560,696,248,430 |
| 地方債証券 | 33,561,690,538 |
| 特殊債券 | 37,026,451,464 |
| 社債券 | 30,901,479,000 |
| 未収入金 | 700,317,700 |
| 未収利息 | 1,566,249,545 |
| 前払費用 | 80,203,561 |
| 流動資産合計 | 664,960,725,214 |
| 資産合計 | 664,960,725,214 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 700,000,000 |
| 未払解約金 | 315,314,606 |
| 流動負債合計 | 1,015,314,606 |
| 負債合計 | 1,015,314,606 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 509,548,095,906 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 154,397,314,702 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 元本等合計 | 663,945,410,608 |
| 純資産合計 | 663,945,410,608 |
| 負債純資産合計 | 664,960,725,214 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 6月10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<br>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。<br>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<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>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 6月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 509,548,095,906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 98,518,000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 1.3030円<br>(1万口当たり純資産額) (13,030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 6月10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。<br>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。<br>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 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 |

| | 2024年 6月10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 | (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br><br>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 6月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 6月13日 |
| 期首元本額 | 469,662,622,453円 |
| 期中追加設定元本額 | 69,967,874,025円 |
| 期中一部解約元本額 | 30,082,400,572円 |
| 期末元本額 | 509,548,095,906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 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 5,126,174,078円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 19,527,747円 |
| ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン | 16,791,289,104円 |
| 世界経済インデックスファンド | 7,786,020,717円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 29,795,140,394円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 38,418,996,088円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 13,094,005,915円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープン | 396,026,591円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ | 87,081,517,247円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ | 61,163,279,995円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 18,271,558,271円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 22,022,492,864円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 6,167,700,591円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 350,433,406円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 3,063,404,329円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 1,264,899,979円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 4,867,737,461円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,254,689円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 22,629,970円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 8,968,360円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 1,321,333円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 56,406,128円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 102,143,311円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 29,246,553円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 24,904,076円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,002,646,475円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 744,019,332円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,277,069,786円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 67,709,641円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 45,729,424円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 906,784,079円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,019,219,378円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,392,817,881円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（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 | 6,338,195,114円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ１ | 17,616,870,277円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 18,911,262,574円 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 27,057,001,481円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 332,942,968円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 2,219,037,706円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 89,833,481円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 48,535,081円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 73,476,712円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 62,473,233円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 153,640,943円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 231,749,762円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 21,238,948円 |
| グローバル経済コア | 418,226,888円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 51,946,876円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 42,330,961円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 165,872,777円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 96,282,011円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 28,983,044円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 21,703,800円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　国内債券インデックス（ノーロード） | 1,077,997,014円 |
| １０資産分散投資ファンド | 467,198,871円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 520,531,675円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０３５ | 169,809円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４０ | 154,544円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４５ | 142,071円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５０ | 142,071円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５ | 153,103円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６０ | 210,850円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６５ | 234,291円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 279,544円 |
| ＦＯＦｓ用　国内債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 107,413,473,852円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 64,247,928円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 18,710,149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） | 522,342,323円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 1,582,137,310 |
| 地方債証券 | 65,821,776 |
| 特殊債券 | 66,090,270 |
| 社債券 | 52,031,000 |
| 合計 | 1,766,080,356 |

(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４５０回利付国債（２年） | 1,140,000,000 | 1,137,594,600 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第４５１回利付国債（２年） | 1,180,000,000 | 1,177,179,800 | |
| 第４５２回利付国債（２年） | 2,880,000,000 | 2,872,252,800 | |
| 第４５３回利付国債（２年） | 1,650,000,000 | 1,645,050,000 | |
| 第４５４回利付国債（２年） | 2,890,000,000 | 2,883,786,500 | |
| 第４５５回利付国債（２年） | 2,050,000,000 | 2,042,005,000 | |
| 第４５６回利付国債（２年） | 1,100,000,000 | 1,096,755,000 | |
| 第４５７回利付国債（２年） | 2,720,000,000 | 2,710,860,800 | |
| 第４５８回利付国債（２年） | 1,490,000,000 | 1,486,930,600 | |
| 第４５９回利付国債（２年） | 30,000,000 | 29,924,400 | |
| 第４６０回利付国債（２年） | 2,300,000,000 | 2,297,608,000 | |
| 第４６１回利付国債（２年） | 2,680,000,000 | 2,681,286,400 | |
| 第１４５回利付国債（５年） | 5,020,000,000 | 5,011,365,600 | |
| 第１４６回利付国債（５年） | 4,800,000,000 | 4,787,568,000 | |
| 第１４７回利付国債（５年） | 5,040,000,000 | 5,011,574,400 | |
| 第１４８回利付国債（５年） | 5,890,000,000 | 5,847,356,400 | |
| 第１４９回利付国債（５年） | 5,680,000,000 | 5,631,265,600 | |
| 第１５０回利付国債（５年） | 5,310,000,000 | 5,257,537,200 | |
| 第１５１回利付国債（５年） | 3,250,000,000 | 3,213,470,000 | |
| 第１５２回利付国債（５年） | 690,000,000 | 684,038,400 | |
| 第１５３回利付国債（５年） | 5,620,000,000 | 5,548,682,200 | |
| 第１５４回利付国債（５年） | 4,990,000,000 | 4,933,563,100 | |
| 第１５５回利付国債（５年） | 2,670,000,000 | 2,653,793,100 | |
| 第１５６回利付国債（５年） | 3,650,000,000 | 3,615,179,000 | |
| 第１５７回利付国債（５年） | 2,460,000,000 | 2,432,669,400 | |
| 第１５８回利付国債（５年） | 3,770,000,000 | 3,714,128,600 | |
| 第１５９回利付国債（５年） | 950,000,000 | 934,078,000 | |
| 第１６０回利付国債（５年） | 2,950,000,000 | 2,912,210,500 | |
| 第１６１回利付国債（５年） | 2,610,000,000 | 2,586,849,300 | |
| 第１６２回利付国債（５年） | 1,630,000,000 | 1,612,966,500 | |
| 第１６３回利付国債（５年） | 3,480,000,000 | 3,458,180,400 | |
| 第１６４回利付国債（５年） | 1,750,000,000 | 1,721,037,500 | |
| 第１６５回利付国債（５年） | 2,510,000,000 | 2,479,528,600 | |
| 第１６６回利付国債（５年） | 1,540,000,000 | 1,528,434,600 | |
| 第１６７回利付国債（５年） | 1,530,000,000 | 1,516,153,500 | |
| 第１６８回利付国債（５年） | 4,040,000,000 | 4,040,929,200 | |
| 第１回利付国債（４０年） | 740,000,000 | 801,242,400 | |
| 第２回利付国債（４０年） | 1,030,000,000 | 1,070,324,500 | |
| 第３回利付国債（４０年） | 730,000,000 | 754,184,900 | |
| 第４回利付国債（４０年） | 1,150,000,000 | 1,180,831,500 | |
| 第５回利付国債（４０年） | 1,250,000,000 | 1,226,987,500 | |
| 第６回利付国債（４０年） | 1,630,000,000 | 1,558,932,000 | |
| 第７回利付国債（４０年） | 1,460,000,000 | 1,326,278,600 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第８回利付国債（４０年） | 1,310,000,000 | 1,095,579,200 | |
| 第９回利付国債（４０年） | 2,260,000,000 | 1,355,977,400 | |
| 第１０回利付国債（４０年） | 2,040,000,000 | 1,439,056,800 | |
| 第１１回利付国債（４０年） | 1,765,000,000 | 1,186,221,200 | |
| 第１２回利付国債（４０年） | 1,630,000,000 | 960,999,100 | |
| 第１３回利付国債（４０年） | 2,330,000,000 | 1,346,973,000 | |
| 第１４回利付国債（４０年） | 2,310,000,000 | 1,424,646,300 | |
| 第１５回利付国債（４０年） | 2,950,000,000 | 2,012,136,000 | |
| 第１６回利付国債（４０年） | 2,840,000,000 | 2,127,131,600 | |
| 第１７回利付国債（４０年） | 820,000,000 | 797,171,200 | |
| 第３４０回利付国債（１０年） | 4,430,000,000 | 4,439,303,000 | |
| 第３４１回利付国債（１０年） | 5,030,000,000 | 5,032,263,500 | |
| 第３４２回利付国債（１０年） | 4,760,000,000 | 4,741,102,800 | |
| 第３４３回利付国債（１０年） | 3,670,000,000 | 3,650,438,900 | |
| 第３４４回利付国債（１０年） | 5,900,000,000 | 5,862,004,000 | |
| 第３４５回利付国債（１０年） | 4,880,000,000 | 4,843,351,200 | |
| 第３４６回利付国債（１０年） | 5,750,000,000 | 5,700,320,000 | |
| 第３４７回利付国債（１０年） | 3,840,000,000 | 3,802,137,600 | |
| 第３４８回利付国債（１０年） | 4,260,000,000 | 4,211,819,400 | |
| 第３４９回利付国債（１０年） | 5,160,000,000 | 5,092,868,400 | |
| 第３５０回利付国債（１０年） | 6,570,000,000 | 6,472,632,600 | 代用有価証券<br>100,000,000円 |
| 第３５１回利付国債（１０年） | 4,835,000,000 | 4,753,965,400 | |
| 第３５２回利付国債（１０年） | 4,230,000,000 | 4,150,433,700 | |
| 第３５３回利付国債（１０年） | 4,415,000,000 | 4,322,461,600 | |
| 第３５４回利付国債（１０年） | 4,420,000,000 | 4,317,456,000 | |
| 第３５５回利付国債（１０年） | 4,570,000,000 | 4,456,344,100 | |
| 第３５６回利付国債（１０年） | 4,580,000,000 | 4,459,408,600 | |
| 第３５７回利付国債（１０年） | 3,780,000,000 | 3,674,953,800 | |
| 第３５８回利付国債（１０年） | 4,110,000,000 | 3,987,522,000 | |
| 第３５９回利付国債（１０年） | 4,565,000,000 | 4,418,143,950 | |
| 第３６０回利付国債（１０年） | 5,430,000,000 | 5,241,959,100 | |
| 第３６１回利付国債（１０年） | 5,060,000,000 | 4,872,021,000 | |
| 第３６２回利付国債（１０年） | 4,450,000,000 | 4,271,822,000 | |
| 第３６３回利付国債（１０年） | 5,220,000,000 | 4,993,556,400 | |
| 第３６４回利付国債（１０年） | 5,320,000,000 | 5,069,108,800 | |
| 第３６５回利付国債（１０年） | 5,277,000,000 | 5,009,403,330 | |
| 第３６６回利付国債（１０年） | 5,760,000,000 | 5,491,008,000 | |
| 第３６７回利付国債（１０年） | 5,280,000,000 | 5,016,475,200 | |
| 第３６８回利付国債（１０年） | 5,490,000,000 | 5,197,932,000 | |
| 第３６９回利付国債（１０年） | 5,130,000,000 | 4,967,481,600 | |
| 第３７０回利付国債（１０年） | 6,110,000,000 | 5,899,266,100 | |
| 第３７１回利付国債（１０年） | 5,790,000,000 | 5,522,965,200 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第３７２回利付国債（１０年） | 5,160,000,000 | 5,085,334,800 | |
| 第３７３回利付国債（１０年） | 5,240,000,000 | 5,053,298,800 | |
| 第３７４回利付国債（１０年） | 4,250,000,000 | 4,163,172,500 | |
| 第１回利付国債（３０年） | 110,000,000 | 122,502,600 | |
| 第２回利付国債（３０年） | 160,000,000 | 175,860,800 | |
| 第３回利付国債（３０年） | 120,000,000 | 131,586,000 | |
| 第４回利付国債（３０年） | 110,000,000 | 125,423,100 | |
| 第５回利付国債（３０年） | 50,000,000 | 54,981,500 | |
| 第６回利付国債（３０年） | 580,000,000 | 647,465,600 | |
| 第７回利付国債（３０年） | 380,000,000 | 422,552,400 | |
| 第８回利付国債（３０年） | 850,000,000 | 913,291,000 | |
| 第９回利付国債（３０年） | 240,000,000 | 250,094,400 | |
| 第１０回利付国債（３０年） | 160,000,000 | 162,534,400 | |
| 第１１回利付国債（３０年） | 260,000,000 | 277,128,800 | |
| 第１２回利付国債（３０年） | 190,000,000 | 209,161,500 | |
| 第１３回利付国債（３０年） | 400,000,000 | 436,496,000 | |
| 第１４回利付国債（３０年） | 750,000,000 | 846,112,500 | |
| 第１５回利付国債（３０年） | 340,000,000 | 386,994,800 | |
| 第１６回利付国債（３０年） | 400,000,000 | 455,488,000 | |
| 第１７回利付国債（３０年） | 1,130,000,000 | 1,275,792,600 | |
| 第１８回利付国債（３０年） | 315,000,000 | 352,592,100 | |
| 第１９回利付国債（３０年） | 530,000,000 | 593,403,900 | |
| 第２０回利付国債（３０年） | 480,000,000 | 547,416,000 | |
| 第２１回利付国債（３０年） | 750,000,000 | 839,482,500 | |
| 第２２回利付国債（３０年） | 300,000,000 | 342,348,000 | |
| 第２３回利付国債（３０年） | 430,000,000 | 490,544,000 | |
| 第２４回利付国債（３０年） | 680,000,000 | 775,417,600 | |
| 第２５回利付国債（３０年） | 600,000,000 | 670,404,000 | |
| 第２６回利付国債（３０年） | 1,510,000,000 | 1,705,001,400 | |
| 第２７回利付国債（３０年） | 1,670,000,000 | 1,904,434,600 | |
| 第２８回利付国債（３０年） | 1,830,000,000 | 2,084,077,200 | |
| 第２９回利付国債（３０年） | 1,670,000,000 | 1,877,631,100 | |
| 第３０回利付国債（３０年） | 1,970,000,000 | 2,184,355,700 | |
| 第３１回利付国債（３０年） | 1,400,000,000 | 1,529,402,000 | |
| 第３２回利付国債（３０年） | 1,950,000,000 | 2,151,708,000 | |
| 第３３回利付国債（３０年） | 2,290,000,000 | 2,422,362,000 | |
| 第３４回利付国債（３０年） | 2,145,000,000 | 2,322,863,400 | |
| 第３５回利付国債（３０年） | 2,480,000,000 | 2,605,438,400 | |
| 第３６回利付国債（３０年） | 2,420,000,000 | 2,534,635,400 | |
| 第３７回利付国債（３０年） | 2,715,000,000 | 2,790,694,200 | |
| 第３８回利付国債（３０年） | 1,560,000,000 | 1,573,244,400 | |
| 第３９回利付国債（３０年） | 1,800,000,000 | 1,839,834,000 | |
| 第４０回利付国債（３０年） | 1,290,000,000 | 1,293,702,300 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第４１回利付国債（３０年） | 1,310,000,000 | 1,290,140,400 | |
| 第４２回利付国債（３０年） | 1,530,000,000 | 1,502,199,900 | |
| 第４３回利付国債（３０年） | 1,390,000,000 | 1,361,518,900 | |
| 第４４回利付国債（３０年） | 1,290,000,000 | 1,260,536,400 | |
| 第４５回利付国債（３０年） | 1,600,000,000 | 1,505,488,000 | |
| 第４６回利付国債（３０年） | 1,820,000,000 | 1,709,016,400 | |
| 第４７回利付国債（３０年） | 1,820,000,000 | 1,736,662,200 | |
| 第４８回利付国債（３０年） | 1,870,000,000 | 1,715,332,300 | |
| 第４９回利付国債（３０年） | 1,750,000,000 | 1,601,635,000 | |
| 第５０回利付国債（３０年） | 1,860,000,000 | 1,499,829,600 | |
| 第５１回利付国債（３０年） | 1,940,000,000 | 1,383,899,000 | |
| 第５２回利付国債（３０年） | 1,860,000,000 | 1,387,281,000 | |
| 第５３回利付国債（３０年） | 1,630,000,000 | 1,239,044,500 | |
| 第５４回利付国債（３０年） | 2,030,000,000 | 1,611,028,300 | |
| 第５５回利付国債（３０年） | 1,620,000,000 | 1,280,221,200 | |
| 第５６回利付国債（３０年） | 1,760,000,000 | 1,384,961,600 | |
| 第５７回利付国債（３０年） | 1,480,000,000 | 1,159,683,600 | |
| 第５８回利付国債（３０年） | 2,130,000,000 | 1,661,932,500 | |
| 第５９回利付国債（３０年） | 1,430,000,000 | 1,084,340,400 | |
| 第６０回利付国債（３０年） | 1,630,000,000 | 1,292,622,600 | |
| 第６１回利付国債（３０年） | 1,650,000,000 | 1,238,935,500 | |
| 第６２回利付国債（３０年） | 1,285,000,000 | 910,640,950 | |
| 第６３回利付国債（３０年） | 1,380,000,000 | 945,520,800 | |
| 第６４回利付国債（３０年） | 1,520,000,000 | 1,035,211,200 | |
| 第６５回利付国債（３０年） | 1,385,000,000 | 938,365,200 | |
| 第６６回利付国債（３０年） | 1,495,000,000 | 1,006,867,550 | |
| 第６７回利付国債（３０年） | 1,665,000,000 | 1,181,117,700 | |
| 第６８回利付国債（３０年） | 1,560,000,000 | 1,101,297,600 | |
| 第６９回利付国債（３０年） | 1,610,000,000 | 1,164,496,900 | |
| 第７０回利付国債（３０年） | 1,920,000,000 | 1,382,342,400 | |
| 第７１回利付国債（３０年） | 1,470,000,000 | 1,054,298,700 | |
| 第７２回利付国債（３０年） | 1,710,000,000 | 1,221,709,500 | |
| 第７３回利付国債（３０年） | 1,800,000,000 | 1,281,096,000 | |
| 第７４回利付国債（３０年） | 2,280,000,000 | 1,759,772,400 | |
| 第７５回利付国債（３０年） | 1,660,000,000 | 1,383,012,400 | |
| 第７６回利付国債（３０年） | 1,780,000,000 | 1,517,200,800 | |
| 第７７回利付国債（３０年） | 2,010,000,000 | 1,795,472,700 | |
| 第７８回利付国債（３０年） | 1,520,000,000 | 1,290,951,200 | |
| 第７９回利付国債（３０年） | 1,350,000,000 | 1,086,790,500 | |
| 第８０回利付国債（３０年） | 2,070,000,000 | 1,931,144,400 | |
| 第８１回利付国債（３０年） | 1,260,000,000 | 1,118,665,800 | |
| 第８２回利付国債（３０年） | 1,280,000,000 | 1,191,104,000 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第８１回利付国債（２０年） | 390,000,000 | 398,759,400 | |
| 第８２回利付国債（２０年） | 600,000,000 | 614,238,000 | |
| 第８３回利付国債（２０年） | 290,000,000 | 298,085,200 | |
| 第８４回利付国債（２０年） | 470,000,000 | 482,389,200 | |
| 第８５回利付国債（２０年） | 290,000,000 | 299,097,300 | |
| 第８６回利付国債（２０年） | 510,000,000 | 527,793,900 | |
| 第８７回利付国債（２０年） | 1,790,000,000 | 1,849,302,700 | |
| 第８８回利付国債（２０年） | 420,000,000 | 436,375,800 | |
| 第８９回利付国債（２０年） | 350,000,000 | 362,943,000 | |
| 第９０回利付国債（２０年） | 630,000,000 | 655,880,400 | |
| 第９１回利付国債（２０年） | 450,000,000 | 469,498,500 | |
| 第９２回利付国債（２０年） | 880,000,000 | 917,523,200 | |
| 第９３回利付国債（２０年） | 410,000,000 | 427,929,300 | |
| 第９４回利付国債（２０年） | 610,000,000 | 638,346,700 | |
| 第９５回利付国債（２０年） | 830,000,000 | 876,604,500 | |
| 第９６回利付国債（２０年） | 1,590,000,000 | 1,669,770,300 | |
| 第９７回利付国債（２０年） | 900,000,000 | 951,165,000 | |
| 第９８回利付国債（２０年） | 440,000,000 | 463,592,800 | |
| 第９９回利付国債（２０年） | 1,510,000,000 | 1,595,647,200 | |
| 第１００回利付国債（２０年） | 480,000,000 | 510,494,400 | |
| 第１０１回利付国債（２０年） | 715,000,000 | 765,722,100 | |
| 第１０２回利付国債（２０年） | 1,180,000,000 | 1,268,193,200 | |
| 第１０３回利付国債（２０年） | 400,000,000 | 428,320,000 | |
| 第１０４回利付国債（２０年） | 160,000,000 | 170,032,000 | |
| 第１０５回利付国債（２０年） | 1,180,000,000 | 1,257,207,400 | |
| 第１０６回利付国債（２０年） | 680,000,000 | 727,334,800 | |
| 第１０７回利付国債（２０年） | 1,100,000,000 | 1,175,031,000 | |
| 第１０８回利付国債（２０年） | 840,000,000 | 889,879,200 | |
| 第１０９回利付国債（２０年） | 920,000,000 | 976,396,000 | |
| 第１１０回利付国債（２０年） | 1,100,000,000 | 1,177,913,000 | |
| 第１１１回利付国債（２０年） | 970,000,000 | 1,046,465,100 | |
| 第１１２回利付国債（２０年） | 990,000,000 | 1,063,200,600 | |
| 第１１３回利付国債（２０年） | 2,020,000,000 | 2,176,085,400 | |
| 第１１４回利付国債（２０年） | 2,200,000,000 | 2,377,122,000 | |
| 第１１５回利付国債（２０年） | 700,000,000 | 760,305,000 | |
| 第１１６回利付国債（２０年） | 1,660,000,000 | 1,807,673,600 | |
| 第１１７回利付国債（２０年） | 1,980,000,000 | 2,145,092,400 | |
| 第１１８回利付国債（２０年） | 660,000,000 | 712,687,800 | |
| 第１１９回利付国債（２０年） | 530,000,000 | 565,992,300 | |
| 第１２０回利付国債（２０年） | 1,370,000,000 | 1,447,131,000 | |
| 第１２１回利付国債（２０年） | 1,470,000,000 | 1,581,279,000 | |
| 第１２２回利付国債（２０年） | 900,000,000 | 962,703,000 | |
| 第１２３回利付国債（２０年） | 1,800,000,000 | 1,962,162,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１２４回利付国債（２０年） | 760,000,000 | 823,710,800 | |
| 第１２５回利付国債（２０年） | 1,240,000,000 | 1,362,462,400 | |
| 第１２６回利付国債（２０年） | 1,030,000,000 | 1,118,023,800 | |
| 第１２７回利付国債（２０年） | 1,020,000,000 | 1,100,559,600 | |
| 第１２８回利付国債（２０年） | 1,340,000,000 | 1,446,690,800 | |
| 第１２９回利付国債（２０年） | 740,000,000 | 793,968,200 | |
| 第１３０回利付国債（２０年） | 2,055,000,000 | 2,205,405,450 | |
| 第１３１回利付国債（２０年） | 1,290,000,000 | 1,375,023,900 | |
| 第１３２回利付国債（２０年） | 1,230,000,000 | 1,311,364,500 | |
| 第１３３回利付国債（２０年） | 1,810,000,000 | 1,942,618,700 | |
| 第１３４回利付国債（２０年） | 1,640,000,000 | 1,760,638,400 | |
| 第１３５回利付国債（２０年） | 130,000,000 | 138,611,200 | |
| 第１３６回利付国債（２０年） | 1,150,000,000 | 1,217,321,000 | |
| 第１３７回利付国債（２０年） | 1,200,000,000 | 1,279,500,000 | |
| 第１３８回利付国債（２０年） | 1,330,000,000 | 1,397,564,000 | |
| 第１３９回利付国債（２０年） | 480,000,000 | 507,993,600 | |
| 第１４０回利付国債（２０年） | 2,490,000,000 | 2,654,688,600 | |
| 第１４１回利付国債（２０年） | 1,650,000,000 | 1,760,088,000 | |
| 第１４２回利付国債（２０年） | 1,265,000,000 | 1,359,988,850 | |
| 第１４３回利付国債（２０年） | 1,660,000,000 | 1,756,612,000 | |
| 第１４４回利付国債（２０年） | 1,160,000,000 | 1,217,570,800 | |
| 第１４５回利付国債（２０年） | 2,275,000,000 | 2,424,877,000 | |
| 第１４６回利付国債（２０年） | 2,670,000,000 | 2,844,351,000 | |
| 第１４７回利付国債（２０年） | 2,740,000,000 | 2,890,508,200 | |
| 第１４８回利付国債（２０年） | 2,260,000,000 | 2,360,592,600 | |
| 第１４９回利付国債（２０年） | 2,980,000,000 | 3,108,676,400 | |
| 第１５０回利付国債（２０年） | 2,970,000,000 | 3,064,980,600 | |
| 第１５１回利付国債（２０年） | 2,555,000,000 | 2,581,520,900 | |
| 第１５２回利付国債（２０年） | 2,680,000,000 | 2,701,895,600 | |
| 第１５３回利付国債（２０年） | 2,350,000,000 | 2,387,976,000 | |
| 第１５４回利付国債（２０年） | 2,845,000,000 | 2,854,900,600 | |
| 第１５５回利付国債（２０年） | 2,530,000,000 | 2,478,742,200 | |
| 第１５６回利付国債（２０年） | 2,690,000,000 | 2,451,558,400 | |
| 第１５７回利付国債（２０年） | 3,200,000,000 | 2,831,008,000 | |
| 第１５８回利付国債（２０年） | 3,050,000,000 | 2,787,242,500 | |
| 第１５９回利付国債（２０年） | 2,580,000,000 | 2,377,753,800 | |
| 第１６０回利付国債（２０年） | 2,430,000,000 | 2,259,146,700 | |
| 第１６１回利付国債（２０年） | 2,390,000,000 | 2,184,173,200 | |
| 第１６２回利付国債（２０年） | 1,650,000,000 | 1,501,368,000 | |
| 第１６３回利付国債（２０年） | 2,610,000,000 | 2,363,120,100 | |
| 第１６４回利付国債（２０年） | 2,370,000,000 | 2,106,669,300 | |
| 第１６５回利付国債（２０年） | 2,410,000,000 | 2,131,982,400 | |
| | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第１６６回利付国債（２０年） | 2,080,000,000 | 1,884,334,400 | |
| | 第１６７回利付国債（２０年） | 2,430,000,000 | 2,127,465,000 | |
| | 第１６８回利付国債（２０年） | 1,940,000,000 | 1,663,821,600 | |
| | 第１６９回利付国債（２０年） | 2,240,000,000 | 1,880,435,200 | |
| | 第１７０回利付国債（２０年） | 2,550,000,000 | 2,127,363,000 | |
| | 第１７１回利付国債（２０年） | 1,990,000,000 | 1,650,804,500 | |
| | 第１７２回利付国債（２０年） | 1,750,000,000 | 1,467,952,500 | |
| | 第１７３回利付国債（２０年） | 2,400,000,000 | 2,002,008,000 | |
| | 第１７４回利付国債（２０年） | 2,530,000,000 | 2,098,635,000 | |
| | 第１７５回利付国債（２０年） | 2,270,000,000 | 1,905,029,400 | |
| | 第１７６回利付国債（２０年） | 2,350,000,000 | 1,961,474,500 | |
| | 第１７７回利付国債（２０年） | 2,500,000,000 | 2,039,900,000 | |
| | 第１７８回利付国債（２０年） | 2,520,000,000 | 2,082,780,000 | |
| | 第１７９回利付国債（２０年） | 2,825,000,000 | 2,323,308,250 | |
| | 第１８０回利付国債（２０年） | 2,200,000,000 | 1,901,196,000 | |
| | 第１８１回利付国債（２０年） | 2,780,000,000 | 2,434,501,600 | |
| | 第１８２回利付国債（２０年） | 2,320,000,000 | 2,095,215,200 | |
| | 第１８３回利付国債（２０年） | 2,490,000,000 | 2,358,154,500 | |
| | 第１８４回利付国債（２０年） | 2,340,000,000 | 2,098,371,600 | |
| | 第１８５回利付国債（２０年） | 2,540,000,000 | 2,268,728,000 | |
| | 第１８６回利付国債（２０年） | 2,320,000,000 | 2,214,045,600 | |
| | 第１８７回利付国債（２０年） | 1,900,000,000 | 1,746,328,000 | |
| | 第１８８回利付国債（２０年） | 1,680,000,000 | 1,621,536,000 | |
| 国債証券合計 | | 586,547,000,000 | 560,696,248,430 | |
| 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 | 99,039,000 | |
| | 第５回東京都公募公債（東京グリーンボンド（３０年）） | 100,000,000 | 70,526,000 | |
| | 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 | 99,046,000 | |
| | 第９回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 110,366,000 | |
| | 第１１回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 106,991,000 | |
| | 第１３回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 102,174,000 | |
| | 第１５回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 98,295,000 | |
| | 第１６回東京都公募公債（２０年） | 200,000,000 | 212,028,000 | |
| | 第１７回東京都公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,366,000 | |
| | 第１９回東京都公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,110,000 | |
| | 第１９回東京都公募公債（３０年） | 100,000,000 | 71,461,000 | |
| | 第２６回東京都公募公債（２０年） | 200,000,000 | 212,376,000 | |
| | 第２７回東京都公募公債（２０年） | 200,000,000 | 211,394,000 | |
| | 第３３回東京都公募公債（５年） | 200,000,000 | 198,952,000 | |
| | 第７５１回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,022,000 | |
| | 第７６５回東京都公募公債 | 100,000,000 | 99,208,000 | |
| | 第７７０回東京都公募公債 | 100,000,000 | 99,001,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第７８１回東京都公募公債 | 300,000,000 | 294,741,000 | |
| 第８００回東京都公募公債 | 200,000,000 | 193,340,000 | |
| 第８３０回東京都公募公債 | 300,000,000 | 284,898,000 | |
| 平成２７年度第１５回北海道公募公債 | 100,000,000 | 99,671,000 | |
| 平成２８年度第１回北海道公募公債 | 100,000,000 | 99,323,000 | |
| 平成２８年度第１４回北海道公募公債 | 100,000,000 | 99,266,000 | |
| 平成３０年度第１４回北海道公募公債 | 200,000,000 | 195,760,000 | |
| 令和４年度第１０回北海道公募公債 | 200,000,000 | 192,746,000 | |
| 令和５年度第６回北海道公募公債 | 100,000,000 | 97,749,000 | |
| 第３１回１号宮城県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 200,532,000 | |
| 第３９回１号宮城県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 96,329,000 | |
| 第４回神奈川県公募公債（３０年） | 200,000,000 | 227,992,000 | |
| 第１１回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,951,000 | |
| 第１５回神奈川県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 214,616,000 | |
| 第１７回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,831,000 | |
| 第２０回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,933,000 | |
| 第２７回神奈川県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 102,325,000 | |
| 第２１８回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 99,757,000 | |
| 第２２６回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 99,167,000 | |
| 第２２７回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 99,001,000 | |
| 第２４３回神奈川県公募公債 | 200,000,000 | 193,286,000 | |
| 第２６０回神奈川県公募公債 | 208,000,000 | 204,064,640 | |
| 第６回大阪府公募公債（２０年） | 200,000,000 | 214,796,000 | |
| 第７回大阪府公募公債（２０年） | 300,000,000 | 320,475,000 | |
| 第１０回大阪府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,939,000 | |
| 第３９９回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,260,000 | |
| 第４００回大阪府公募公債（１０年） | 300,000,000 | 300,819,000 | |
| 第４０２回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,208,000 | |
| 第４０７回大阪府公募公債（１０年） | 156,000,000 | 154,989,120 | |
| 第４１０回大阪府公募公債（１０年） | 200,000,000 | 198,010,000 | |
| 第４３９回大阪府公募公債（１０年） | 200,000,000 | 195,830,000 | |
| 第４４０回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 97,861,000 | |
| 第４５８回大阪府公募公債（１０年） | 100,000,000 | 96,127,000 | |
| 第４６５回大阪府公募公債（１０年） | 160,000,000 | 152,918,400 | |
| 第４６８回大阪府公募公債（１０年） | 182,000,000 | 173,487,860 | |
| 第４６９回大阪府公募公債（１０年） | 200,000,000 | 190,404,000 | |
| 平成２１年度第３回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,739,000 | |
| 平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,566,000 | |
| 平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 88,735,000 | |
| 平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年） | 100,000,000 | 90,566,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 令和２年度第１２回京都府公募公債 | 140,500,000 | 134,704,375 | |
| 第２回兵庫県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,901,000 | |
| 第６回兵庫県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 102,936,000 | |
| 第７回兵庫県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 102,009,000 | |
| 第８回兵庫県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 101,873,000 | |
| 第９回兵庫県公募公債（２０年） | 400,000,000 | 432,792,000 | |
| 第３５回兵庫県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 88,480,000 | |
| 令和元年度第１７回兵庫県公募公債 | 300,000,000 | 290,727,000 | |
| 第１回静岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 102,371,000 | |
| 第９回静岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 92,672,000 | |
| 第１２回静岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 76,807,000 | |
| 第１５回静岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,871,000 | |
| 第１８回静岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 103,051,000 | |
| 平成２９年度第５回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 99,031,000 | |
| 平成２９年度第８回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 99,091,000 | |
| 平成２９年度第１１回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 98,985,000 | |
| 令和２年度第１１回静岡県公募公債 | 310,000,000 | 298,812,100 | |
| 令和５年度第７回静岡県公募公債 | 165,000,000 | 161,115,900 | |
| 平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,841,000 | |
| 平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,009,000 | |
| 平成２７年度第１８回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,720,000 | |
| 平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,215,000 | |
| 平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 198,148,000 | |
| 平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年） | 300,000,000 | 269,406,000 | |
| 平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 98,461,000 | |
| 平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 75,597,000 | |
| 令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年） | 200,000,000 | 193,162,000 | |
| 令和２年度第７回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 96,446,000 | |
| 令和３年度第６回愛知県公募公債（３０年） | 200,000,000 | 140,798,000 | |
| 令和５年度第６回愛知県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 96,897,000 | |
| 平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,227,000 | |
| 平成２１年度第１回広島県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 214,830,000 | |
| 平成２７年度第４回広島県公募公債 | 125,230,000 | 125,476,703 | |
| 平成２９年度第１回広島県公募公債 | 100,000,000 | 99,024,000 | |
| 令和２年度第７回広島県公募公債 | 390,000,000 | 375,070,800 | |
| 令和４年度第２回広島県公募公債 | 100,000,000 | 95,585,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第２回埼玉県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 97,387,000 | |
| 第３回埼玉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,717,000 | |
| 第６回埼玉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,871,000 | |
| 第６回埼玉県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 80,877,000 | |
| 第７回埼玉県公募公債（１５年） | 600,000,000 | 543,942,000 | |
| 第７回埼玉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 215,796,000 | |
| 第８回埼玉県公募公債（１５年） | 200,000,000 | 179,502,000 | |
| 第１０回埼玉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 214,616,000 | |
| 第１８回埼玉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 178,266,000 | |
| 平成２７年度第７回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 100,173,000 | |
| 平成２８年度第６回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 99,121,000 | |
| 平成２８年度第９回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 99,343,000 | |
| 平成２９年度第４回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 99,028,000 | |
| 令和２年度第７回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 96,119,000 | |
| 令和２年度第８回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 95,873,000 | |
| 令和３年度第８回埼玉県公募公債 | 150,000,000 | 142,102,500 | |
| 平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,880,000 | |
| 平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,213,000 | |
| 平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 101,918,000 | |
| 平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 108,013,000 | |
| 平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 102,476,000 | |
| 平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 104,619,000 | |
| 平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 100,455,000 | |
| 平成２７年度第７回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 100,166,000 | |
| 平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年） | 100,000,000 | 75,597,000 | |
| 平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 88,984,000 | |
| 令和２年度第１回福岡県公募公債 | 300,000,000 | 289,857,000 | |
| 令和３年度第２回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 95,554,000 | |
| 令和３年度第１回福岡県公募公債（１５年） | 100,000,000 | 88,567,000 | |
| 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 | 97,174,000 | |
| 令和５年度第３回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 96,916,000 | |
| 第５回千葉県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 213,742,000 | |
| 第６回千葉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,510,000 | |
| 第１３回千葉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,871,000 | |
| 第２０回千葉県公募公債（２０年） | 100,000,000 | 90,346,000 | |
| 平成２８年度第４回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 99,125,000 | |
| 平成２８年度第６回千葉県公募公債 | 120,000,000 | 119,035,200 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 令和元年度第７回千葉県公募公債 | 300,000,000 | 289,530,000 | |
| 令和２年度第７回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 96,330,000 | |
| 令和４年度第６回千葉県公募公債 | 130,000,000 | 125,535,800 | |
| 令和６年度第１回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 97,680,000 | |
| 平成２７年度第１回新潟県公募公債 | 100,000,000 | 100,169,000 | |
| 令和３年度第１回長野県公募公債（１０年） | 300,000,000 | 287,835,000 | |
| 令和４年度第１回長野県公募公債（１０年） | 300,000,000 | 286,011,000 | |
| 令和６年度第１回長野県公募公債（１０年） | 300,000,000 | 297,759,000 | |
| 令和５年度第１回茨城県公募公債 | 100,000,000 | 97,068,000 | |
| 令和６年度第１回茨城県公募公債 | 100,000,000 | 99,201,000 | |
| 第１回群馬県公募公債（２０年） | 200,000,000 | 213,326,000 | |
| 第２８回群馬県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 96,909,000 | |
| 第３０回群馬県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,587,000 | |
| 平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 98,895,000 | |
| 第１４８回共同発行市場公募地方債 | 125,400,000 | 125,752,374 | |
| 第１４９回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,236,000 | |
| 第１５２回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,226,000 | |
| 第１５６回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,448,000 | |
| 第１５７回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,355,000 | |
| 第１５９回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 198,440,000 | |
| 第１６０回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 198,288,000 | |
| 第１６１回共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 396,468,000 | |
| 第１６４回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 98,953,000 | |
| 第１６６回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,196,000 | |
| 第１６７回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 99,332,000 | |
| 第１７１回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 198,020,000 | |
| 第１７４回共同発行市場公募地方債 | 594,300,000 | 586,883,136 | |
| 第１７５回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 98,932,000 | |
| 第１８１回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 295,332,000 | |
| 第２１９回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 95,414,000 | |
| 第２２８回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 189,376,000 | |
| 第２３３回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 190,106,000 | |
| 第２４３回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 97,113,000 | |
| 第２４４回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 96,207,000 | |
| 第２４５回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 97,716,000 | |
| 第２５５回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 298,764,000 | |
| 令和４年度第３回長崎県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 95,667,000 | |
| 令和４年度第１回熊本市公募公債 | 101,000,000 | 96,725,680 | |
| 平成２７年度第１回静岡市公募公債 | 100,000,000 | 100,197,000 | |
| 平成２９年度第１回静岡市公募公債 | 100,000,000 | 98,902,000 | |
| 平成３０年度第１回浜松市公募公債 | 100,000,000 | 97,664,000 | |
| 令和２年度第１回静岡市公募公債 | 200,000,000 | 192,202,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１３回大阪市公募公債（２０年） | 200,000,000 | 215,768,000 | |
| 第１５回大阪市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 70,116,000 | |
| 第１９回大阪市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 99,203,000 | |
| 第２２回大阪市公募公債（２０年） | 600,000,000 | 536,136,000 | |
| 第２４回大阪市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 91,376,000 | |
| 令和３年度第２回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 191,266,000 | |
| 第１回名古屋市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 113,202,000 | |
| 第５回名古屋市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 111,957,000 | |
| 第９回名古屋市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,301,000 | |
| 第１１回名古屋市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 97,295,000 | |
| 第４９９回名古屋市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,244,000 | |
| 第５１２回名古屋市公募公債（１０年） | 300,000,000 | 289,788,000 | |
| 第５２８回名古屋市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,587,000 | |
| 平成２８年度第６回京都市公募公債 | 200,000,000 | 198,388,000 | |
| 令和２年度第１回京都市公募公債 | 200,000,000 | 192,630,000 | |
| 令和５年度第７回京都市公募公債 | 100,000,000 | 99,107,000 | |
| 平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年） | 120,000,000 | 125,044,800 | |
| 平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年） | 200,000,000 | 213,896,000 | |
| 平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 108,386,000 | |
| 平成２４年度第１２回神戸市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 105,936,000 | |
| 令和２年度第９回神戸市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 70,821,000 | |
| 令和３年度第６回神戸市公募公債（３０年） | 100,000,000 | 70,261,000 | |
| 第２０回横浜市公募公債（２０年） | 300,000,000 | 322,068,000 | |
| 平成２７年度第３回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 100,261,000 | |
| 平成２８年度第４回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 99,185,000 | |
| 平成２９年度第２回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 99,160,000 | |
| 平成３０年度第１回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 98,528,000 | |
| 平成３０年度第４回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 98,549,000 | |
| 第３０回横浜市公募公債（２０年） | 200,000,000 | 204,084,000 | |
| 令和２年度第１回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 289,821,000 | |
| 令和３年度第２回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 95,630,000 | |
| 平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年） | 100,000,000 | 102,652,000 | |
| 平成２６年度第１０回札幌市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 100,582,000 | |
| 平成２７年度第９回札幌市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 99,749,000 | |
| 令和５年度第３回札幌市公募公債（１０年） | 200,000,000 | 192,894,000 | |
| 第１１回川崎市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 106,657,000 | |
| 第１３回川崎市公募公債（３０年） | 200,000,000 | 178,326,000 | |
| 第１７回川崎市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 104,329,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第８９回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 99,189,000 | |
| | 第９３回川崎市公募公債 | 100,000,000 | 96,067,000 | |
| | 平成２７年度第２回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 100,202,000 | |
| | 平成２８年度第１回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 99,374,000 | |
| | 平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 107,476,000 | |
| | 平成２５年度第６回福岡市公募公債（２０年） | 100,000,000 | 103,706,000 | |
| | ２０２３年度第８回福岡市公募公債（１０年） | 100,000,000 | 97,454,000 | |
| | 平成２８年度第４回広島市公募公債 | 105,000,000 | 104,154,750 | |
| | 平成２９年度第６回広島市公募公債 | 170,000,000 | 167,895,400 | |
| | 令和元年度第６回広島市公募公債 | 550,000,000 | 531,861,000 | |
| | 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 | 193,020,000 | |
| | 令和３年度第８回千葉市公募公債 | 300,000,000 | 284,283,000 | |
| | 令和４年度第１回千葉市公募公債 | 100,000,000 | 95,155,000 | |
| | 令和５年度第２回福井県公募公債 | 100,000,000 | 96,383,000 | |
| | 平成２７年度第１回山梨県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 100,228,000 | |
| | 平成３０年度第３回岡山県公募公債（１０年） | 100,000,000 | 97,533,000 | |
| | 第１１３回福岡北九州高速道路債券 | 100,000,000 | 105,767,000 | |
| 地方債証券合計 | | 34,102,430,000 | 33,561,690,538 | |
| 特殊債券 | 第３７回新関西国際空港株式会社社債 | 100,000,000 | 92,074,000 | |
| | 第１回国立大学法人東京大学債券 | 100,000,000 | 63,080,000 | |
| | 第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 99,055,000 | |
| | 第７８回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 | 100,000,000 | 99,036,000 | |
| | 第１２９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債 | 100,000,000 | 53,198,000 | |
| | 第５回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 130,000,000 | 133,528,200 | |
| | 第２０回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 209,720,000 | |
| | 第２１回道路債券 | 100,000,000 | 114,105,000 | |
| | 第２８回道路債券 | 200,000,000 | 229,546,000 | |
| | 第３３回道路債券 | 200,000,000 | 230,858,000 | |
| | 第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,499,000 | |
| | 第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 112,943,000 | |
| | 第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,971,000 | |
| | 第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 107,963,000 | |
| | 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 | 106,194,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 214,782,000 | |
| 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 | 216,240,000 | |
| 第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,845,000 | |
| 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 | 107,782,000 | |
| 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 | 108,513,000 | |
| 第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,677,000 | |
| 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 | 106,757,000 | |
| 第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 93,189,000 | |
| 第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 198,312,000 | |
| 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 | 104,913,000 | |
| 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 | 105,544,000 | |
| 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 | 105,678,000 | |
| 第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 600,000,000 | 535,080,000 | |
| 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 | 106,632,000 | |
| 第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 73,431,000 | |
| 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 | 206,934,000 | |
| 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 | 102,790,000 | |
| 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 | 204,908,000 | |
| 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 | 99,751,000 | |
| 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 | 200,480,000 | |
| 第２４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 162,340,000 | |
| 第２５８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,105,000 | |
| 第２６１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 140,000,000 | 140,113,400 | |
| 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 | 199,870,000 | |
| 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 | 99,602,000 | |
| 第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 72,029,000 | |
| | 247,000,000 | 244,248,420 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | | |
| 第２９６回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 99,305,000 | |
| 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 | 110,925,920 | |
| 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 | 203,103,750 | |
| 第３０１回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 197,822,000 | |
| 第３０２回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 91,988,000 | |
| 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 | 99,074,000 | |
| 第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 198,034,000 | |
| 第３１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 280,341,000 | |
| 第３１４回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 89,743,000 | |
| 第３１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 95,027,000 | |
| 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 | 98,888,000 | |
| 第３３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 98,848,000 | |
| 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 | 118,423,200 | |
| 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 | 196,614,000 | |
| 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 | 266,406,000 | |
| 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 | 210,355,580 | |
| 第３８５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 96,748,000 | |
| 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 | 96,467,000 | |
| 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 | 269,024,000 | |
| 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 | 115,286,400 | |
| 第２回公営企業債券（３０年） | 300,000,000 | 333,357,000 | |
| 第３回地方公共団体金融機構債券（１５年） | 100,000,000 | 102,092,000 | |
| 第５回公営企業債券（３０年） | 300,000,000 | 342,144,000 | |
| 第７回公営企業債券（３０年） | 200,000,000 | 227,154,000 | |
| 第８回公営企業債券（３０年） | 100,000,000 | 111,902,000 | |
| 第８回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 200,000,000 | 214,748,000 | |
| 第１０回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 200,000,000 | 211,482,000 | |
| 第１１回地方公共団体金融機構債券（３０年） | 200,000,000 | 138,756,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１８回公営企業債券（２０年） | 100,000,000 | 104,159,000 | |
| 第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 500,000,000 | 532,365,000 | |
| 第２３回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 100,000,000 | 105,172,000 | |
| 第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 100,000,000 | 105,319,000 | |
| 第３４回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 500,000,000 | 520,645,000 | |
| 第４３回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 100,000,000 | 98,616,000 | |
| 第４５回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 100,000,000 | 99,133,000 | |
| 第７６回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 150,000,000 | 150,253,500 | |
| 第７６回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 200,334,000 | |
| Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 204,638,000 | |
| 第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 500,000,000 | 500,470,000 | |
| 第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,073,000 | |
| 第８１回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,628,000 | |
| 第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 201,000,000 | 199,721,640 | |
| 第８３回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 198,516,000 | |
| 第８６回地方公共団体金融機構債券（２０年） | 300,000,000 | 245,442,000 | |
| 第８８回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 98,964,000 | |
| 第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 99,055,000 | |
| 第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 251,000,000 | 248,567,810 | |
| 第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 359,000,000 | 355,108,440 | |
| 第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 98,961,000 | |
| 第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 98,920,000 | |
| 第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 110,000,000 | 108,587,600 | |
| 第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 156,000,000 | 153,541,440 | |
| 第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 98,337,000 | |
| 第１１６回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 97,445,000 | |
| 第１１９回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 97,069,000 | |
| 第１２０回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 96,705,000 | |
| Ｆ１２９回地方公共団体金融機構債券 | 700,000,000 | 705,593,000 | |
| Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,824,000 | |
| Ｆ１４３回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 102,428,000 | |
| Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 202,060,000 | |
| 第１６９回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 192,778,000 | |
| 第１７０回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 96,129,000 | |
| Ｆ２０２回地方公共団体金融機構債券 | 200,000,000 | 201,692,000 | |
| Ｆ２０６回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,601,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 100,684,000 | |
| Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,079,000 | |
| Ｆ２２６回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,719,000 | |
| Ｆ２４６回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 101,679,000 | |
| Ｆ４４１回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 98,775,000 | |
| 第２９回首都高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,879,000 | |
| 第３３回首都高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 198,012,000 | |
| 第２７回阪神高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,128,000 | |
| 第２８回阪神高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,529,000 | |
| 第３０回阪神高速道路株式会社社債 | 300,000,000 | 297,711,000 | |
| 第４回株式会社日本政策金融公庫社債 | 100,000,000 | 107,488,000 | |
| 第１８回株式会社日本政策金融公庫社債 | 100,000,000 | 108,449,000 | |
| 第４０回政府保証日本政策金融公庫債券 | 126,000,000 | 125,198,640 | |
| 第４４回政府保証日本政策金融公庫債券 | 117,000,000 | 115,929,450 | |
| 第４６回政府保証日本政策金融公庫債券 | 100,000,000 | 98,957,000 | |
| 第４７回政府保証日本政策金融公庫債券 | 210,000,000 | 207,139,800 | |
| 第５３回政府保証日本政策金融公庫債券 | 187,000,000 | 183,959,380 | |
| 第１１７回都市再生債券 | 200,000,000 | 199,442,000 | |
| 第１５９回都市再生債券 | 200,000,000 | 109,542,000 | |
| 第１６１回都市再生債券 | 100,000,000 | 60,854,000 | |
| 第１７１回都市再生債券 | 200,000,000 | 127,526,000 | |
| 第１９１回都市再生債券 | 100,000,000 | 87,342,000 | |
| 第１７回政府保証民間都市開発債券 | 300,000,000 | 298,833,000 | |
| 第６２回独立行政法人福祉医療機構債券 | 100,000,000 | 96,296,000 | |
| 第２３回政府保証中部国際空港債券 | 104,000,000 | 103,338,560 | |
| 第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 84,471,000 | 83,314,592 | |
| 第３回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 104,674,000 | |
| 第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 58,894,000 | 58,186,094 | |
| 第４回一般担保住宅金融公庫債券 | 100,000,000 | 104,656,000 | |
| 第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 102,174,000 | 100,574,976 | |
| 第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 116,349,000 | 113,983,624 | |
| 第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 41,227,000 | 40,486,975 | |
| 第８回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 146,226,000 | 143,206,433 | |
| 第９回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券 | 100,558,000 | 98,577,007 | |
| 第１２回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 105,846,000 | |
| 第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 13,012,000 | 13,347,059 | |
| 第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 12,632,000 | 12,983,548 | |
| 第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 14,134,000 | 14,615,686 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 16,414,000 | 16,962,720 | |
| 第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 17,332,000 | 17,953,525 | |
| 第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 17,674,000 | 18,275,799 | |
| 第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 36,872,000 | 38,085,457 | |
| 第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 16,610,000 | 17,109,628 | |
| 第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 17,038,000 | 17,534,316 | |
| 第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 16,644,000 | 17,146,482 | |
| 第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 15,795,000 | 16,266,006 | |
| 第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 33,476,000 | 34,332,985 | |
| 第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 17,648,000 | 18,100,671 | |
| 第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 23,611,000 | 24,090,539 | |
| 第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,406,000 | 22,868,907 | |
| 第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 22,606,000 | 23,090,672 | |
| 第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,390,000 | 49,234,889 | |
| 第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 60,714,000 | 60,973,248 | |
| 第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 31,474,000 | 31,528,135 | |
| 第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 97,854,000 | 98,776,763 | |
| 第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 32,963,000 | 33,301,200 | |
| 第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 28,534,000 | 28,871,557 | |
| 第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 27,443,000 | 27,559,907 | |
| 第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 32,388,000 | 32,768,882 | |
| 第７５回一般担保住宅金融支援機構債券 | 150,000,000 | 161,832,000 | |
| 第７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,498,000 | 84,860,496 | |
| 第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 114,752,000 | 115,072,158 | |
| 第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 33,478,000 | 33,364,509 | |
| 第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 34,900,000 | 34,762,843 | |
| 第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 35,755,000 | 35,460,021 | |
| 第８８回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 106,515,000 | |
| 第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 112,371,000 | 111,243,918 | |
| 第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 38,581,000 | 38,004,214 | |
| 第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 81,954,000 | 79,880,563 | |
| 第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 46,262,000 | 45,156,338 | |
| 第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 49,362,000 | 47,893,480 | |
| 第９６回一般担保住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 308,430,000 | |
| 第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 48,538,000 | 47,344,450 | |
| 第９８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 152,220,000 | 148,814,838 | |
| 第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 102,532,000 | 99,989,206 | |
| 第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 50,162,000 | 48,805,117 | |
| 第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 54,030,000 | 52,443,138 | |
| 第１０８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 60,169,000 | 56,329,616 | |
| | 65,684,000 | 61,616,846 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | | |
| 第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 64,901,000 | 60,672,699 | |
| 第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 65,547,000 | 61,469,976 | |
| 第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 65,955,000 | 62,185,671 | |
| 第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 66,298,000 | 62,330,064 | |
| 第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 68,394,000 | 64,035,934 | |
| 第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 274,844,000 | 257,449,122 | |
| 第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 68,124,000 | 63,611,466 | |
| 第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 67,940,000 | 63,434,219 | |
| 第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 68,830,000 | 64,246,610 | |
| 第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 140,558,000 | 130,770,946 | |
| 第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 137,540,000 | 128,298,687 | |
| 第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 141,220,000 | 131,866,999 | |
| 第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 70,676,000 | 65,828,333 | |
| 第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 140,414,000 | 130,408,098 | |
| 第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 70,858,000 | 65,897,231 | |
| 第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 143,286,000 | 132,765,941 | |
| 第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 143,386,000 | 132,822,753 | |
| 第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 103,184,000 | |
| 第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 73,001,000 | 67,982,181 | |
| 第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,234,000 | 67,453,553 | |
| 第１４０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,328,000 | 66,814,436 | |
| 第１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 149,766,000 | 137,528,620 | |
| 第１４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 75,328,000 | 69,030,579 | |
| 第１４４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 74,260,000 | 68,182,561 | |
| 第１４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 151,784,000 | 138,949,144 | |
| 第１４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 77,128,000 | 70,008,314 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 232,845,000 | 210,033,175 | |
| 第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 157,140,000 | 141,732,423 | |
| 第１５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,390,000 | 73,497,361 | |
| 第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 81,030,000 | 73,833,725 | |
| 第１５８回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 99,933,000 | |
| 第１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 165,686,000 | 151,539,729 | |
| 第１６２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,022,000 | 76,703,683 | |
| 第１６３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 169,368,000 | 154,460,228 | |
| 第１６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 170,996,000 | 155,551,641 | |
| 第１６５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 84,776,000 | 77,361,491 | |
| 第１６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 170,740,000 | 156,464,428 | |
| 第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 169,988,000 | 155,472,724 | |
| 第１６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 86,588,000 | 79,055,709 | |
| 第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,656,000 | 79,509,251 | |
| 第１７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 261,693,000 | 237,331,998 | |
| 第１７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 87,717,000 | 79,598,791 | |
| 第１７５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,385,000 | 81,356,439 | |
| 第１７８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,019,000 | 81,856,531 | |
| 第１８１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 90,382,000 | 83,169,516 | |
| 第１８３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 91,179,000 | 83,973,123 | |
| 第１８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 184,384,000 | 169,319,827 | |
| 第１８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 93,444,000 | 87,985,001 | |
| 第１８８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 185,762,000 | 178,894,378 | |
| 第１９１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 94,328,000 | 90,871,822 | |
| 第１９２回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 86,155,000 | |
| 第１９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 95,070,000 | 91,563,818 | |
| 第１９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 95,382,000 | 91,704,070 | |
| | 193,760,000 | 187,602,307 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | | | |
| 第１９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 97,119,000 | 94,457,939 | |
| 第１９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 97,382,000 | 95,000,036 | |
| 第２０８回一般担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 197,916,000 | |
| 第３２０回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 70,937,000 | |
| 第３５４回一般担保住宅金融支援機構債券 | 300,000,000 | 275,841,000 | |
| 第３５６回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 94,448,000 | |
| い第８４３号商工債 | 200,000,000 | 199,266,000 | |
| い第８４７号商工債 | 100,000,000 | 99,362,000 | |
| い第８５０号商工債 | 200,000,000 | 198,328,000 | |
| い第８７６号商工債 | 400,000,000 | 393,856,000 | |
| い第８７８号商工債 | 100,000,000 | 98,263,000 | |
| 第３７６回信金中金債（５年） | 100,000,000 | 99,180,000 | |
| 第３７９回信金中金債（５年） | 100,000,000 | 98,957,000 | |
| 第３８４回信金中金債（５年） | 200,000,000 | 197,322,000 | |
| 第３８５回信金中金債（５年） | 400,000,000 | 394,532,000 | |
| 第３９４回信金中金債（５年） | 100,000,000 | 98,445,000 | |
| 第１６号商工債（１０年） | 100,000,000 | 99,901,000 | |
| 第２回信金中金債（１０年） | 100,000,000 | 100,161,000 | |
| 第２０回アンデス開発公社円貨債券（２０２３） | 300,000,000 | 298,272,000 | |
| 第２１回国際協力機構債券 | 100,000,000 | 105,311,000 | |
| 第６４回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 96,562,000 | |
| 第６７回東日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 193,674,000 | |
| 第７３回東日本高速道路株式会社社債 | 500,000,000 | 481,845,000 | |
| 第８６回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,668,000 | |
| 第１０６回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,711,000 | |
| 第１１１回東日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,248,000 | |
| 第８５回中日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 199,062,000 | |
| 第９８回中日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 198,942,000 | |
| 第１００回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,847,000 | |
| 第１０１回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,917,000 | |
| 第１０３回中日本高速道路株式会社社債 | 400,000,000 | 397,580,000 | |
| 第１０４回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,981,000 | |
| 第１０５回中日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 198,440,000 | |
| 第２７回西日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 200,454,000 | |
| 第７１回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,020,000 | |
| 第７４回西日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 199,030,000 | |
| 第７７回西日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 197,720,000 | |
| 第７８回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,670,000 | |
| 第８０回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,093,000 | |
| | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第８２回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 99,334,000 | |
| | 第８５回西日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 98,881,000 | |
| | 第９２回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 100,000,000 | 98,984,000 | |
| | 第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 200,000,000 | 182,454,000 | |
| 特殊債券合計 | | 38,029,642,000 | 37,026,451,464 | |
| 社債券 | 第２７回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債 | 100,000,000 | 99,808,000 | |
| | 第４１回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債 | 200,000,000 | 200,426,000 | |
| | 第１４回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 99,110,000 | |
| | 第３２回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 200,000,000 | 199,214,000 | |
| | 第３３回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 100,000,000 | 98,917,000 | |
| | 第１９回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 | 400,000,000 | 398,656,000 | |
| | 第３回韓国輸出入銀行保証株式會社大韓航空円貨社債（２０２３） | 100,000,000 | 99,409,000 | |
| | 第８回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（２０２３） | 400,000,000 | 398,636,000 | |
| | 第３９回大成建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,908,000 | |
| | 第２４回清水建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,515,000 | |
| | 第３２回清水建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,974,000 | |
| | 第９回五洋建設株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,915,000 | |
| | 第２４回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 296,883,000 | |
| | 第２５回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 94,596,000 | |
| | 第２９回大和ハウス工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,705,000 | |
| | 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 | 99,615,000 | |
| | 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 | 99,555,000 | |
| | 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 | 198,118,000 | |
| | 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 | 95,939,000 | |
| | 第２４回株式会社ニチレイ無担保社債 | 100,000,000 | 99,718,000 | |
| | 第２７回株式会社ニチレイ無担保社債 | 200,000,000 | 198,772,000 | |
| | 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 | 98,719,000 | |
| | 第６回ヒューリック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,875,000 | |
| | 第１１回ヒューリック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,328,000 | |
| | 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 | 98,295,000 | |
| | 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 | 97,191,000 | |
| | 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 | 99,459,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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 | 99,454,000 | |
| 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 | 198,996,000 | |
| 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 | 99,437,000 | |
| 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 | 99,363,000 | |
| 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 | 98,012,000 | |
| 第１３回イビデン株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,392,000 | |
| 第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,957,000 | |
| 第５６回三井化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,510,000 | |
| 第１３回ＪＳＲ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 93,671,000 | |
| 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 | 98,200,000 | |
| 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 | 197,230,000 | |
| 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 | 77,683,000 | |
| 第４回株式会社野村総合研究所無担保社債 | 100,000,000 | 98,110,000 | |
| 第１４回株式会社野村総合研究所無担保社債 | 100,000,000 | 97,967,000 | |
| 第４回株式会社電通グループ無担保社債 | 100,000,000 | 99,715,000 | |
| 第６回株式会社電通無担保社債 | 200,000,000 | 193,986,000 | |
| 第２回株式会社ＡＤＥＫＡ無担保社債 | 100,000,000 | 98,954,000 | |
| 第１６回武田薬品工業株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 281,511,000 | |
| 第１回アステラス製薬株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,644,000 | |
| 第３回アステラス製薬株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 198,694,000 | |
| 第１０回テルモ株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 298,965,000 | |
| 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 | 99,418,000 | |
| 第１３回ヤフー株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 94,855,000 | |
| 第２回サワイグループホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,181,000 | |
| 第４回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,741,000 | |
| 第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 98,804,000 | |
| 第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 99,287,000 | |
| 第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債 | 100,000,000 | 97,426,000 | |
| 第１１回住友理工株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,310,000 | |
| 第２回日本製鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,139,000 | |
| 第３４回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 299,133,000 | |
| 第１５回大同特殊鋼株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,670,000 | |
| 第３４回住友金属鉱山株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,407,000 | |
| 第１４回株式会社ＬＩＸＩＬ無担保社債 | 100,000,000 | 98,724,000 | |
| 第１５回株式会社小松製作所無担保社債 | 100,000,000 | 99,202,000 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１７回株式会社クボタ無担保社債 | 100,000,000 | 96,786,000 | |
| 第８回株式会社タダノ無担保社債 | 100,000,000 | 99,556,000 | |
| 第１７回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 102,223,000 | |
| 第２０回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 96,156,000 | |
| 第２３回株式会社日立製作所無担保社債 | 100,000,000 | 97,531,000 | |
| 第１回株式会社安川電機無担保社債 | 100,000,000 | 98,954,000 | |
| 第２１回セイコーエプソン株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,633,000 | |
| 第２２回セイコーエプソン株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,815,000 | |
| 第２１回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,357,000 | |
| 第２３回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,275,000 | |
| 第２６回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,270,000 | |
| 第３７回ソニーグループ株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,316,000 | |
| 第１８回株式会社デンソー無担保社債 | 100,000,000 | 98,331,000 | |
| 第３５回三菱重工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,571,000 | |
| 第２２回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,764,000 | |
| 第２７回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,112,000 | |
| 第２８回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,389,000 | |
| 第２９回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,948,000 | |
| 第３０回いすゞ自動車株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,225,000 | |
| 第３２回いすゞ自動車株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 197,356,000 | |
| 第２７回トヨタ自動車株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 190,024,000 | |
| 第８回株式会社ＳＵＢＡＲＵ無担保社債 | 100,000,000 | 98,965,000 | |
| 第１回オリックス銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,094,000 | |
| 第４回オリックス銀行株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 198,904,000 | |
| 第６回大日本印刷株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 81,782,000 | |
| 第１０８回丸紅株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,979,000 | |
| 第７０回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,423,000 | |
| 第７３回三井物産株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 193,732,000 | |
| 第５３回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,753,000 | |
| 第５６回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,284,000 | |
| 第６０回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,554,000 | |
| 第３回岩谷産業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,774,000 | |
| 第４３回株式会社丸井グループ無担保社債 | 200,000,000 | 198,050,000 | |
| 第４４回株式会社丸井グループ無担保社債 | 100,000,000 | 98,369,000 | |
| 第９９回株式会社クレディセゾン無担保社債 | 100,000,000 | 98,493,000 | |
| 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 | 95,959,000 | |
| 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 | 98,699,000 | |
| 第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付） | 100,000,000 | 107,984,000 | |
| 第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 104,455,000 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第４１回芙蓉総合リース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,360,000 | |
| 第９回みずほリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,223,000 | |
| 第１６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 198,814,000 | |
| 第１８回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 400,000,000 | 385,660,000 | |
| 第２５回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,251,000 | |
| 第２６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 192,982,000 | |
| 第３０回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 298,308,000 | |
| 第３４回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,639,000 | |
| 第３４回東京センチュリー株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,295,000 | |
| 第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 99,098,000 | |
| 第７６回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 200,000,000 | 199,356,000 | |
| 第７８回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 100,000,000 | 99,619,000 | |
| 第８６回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 300,000,000 | 299,916,000 | |
| 第９４回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,532,000 | |
| 第９８回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,613,000 | |
| 第４１回リコーリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,049,000 | |
| 第４４回リコーリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,790,000 | |
| 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 | 98,831,000 | |
| 第３２回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 98,947,000 | |
| 第３５回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 98,654,000 | |
| 第３８回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 99,600,000 | |
| 第３９回株式会社ジャックス無担保社債 | 100,000,000 | 98,996,000 | |
| 第８０回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,997,000 | |
| 第２１２回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,324,000 | |
| 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 | 198,308,000 | |
| 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 | 199,230,000 | |
| 第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 197,210,000 | |
| 第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,514,000 | |
| 第６４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,916,000 | |
| 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 | 98,228,000 | |
| | 100,000,000 | 99,102,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第３９回株式会社大和証券グループ本社無担保社債 | | | |
| 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 | 98,528,000 | |
| 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 | 299,253,000 | |
| 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 | 197,452,000 | |
| 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 | 198,806,000 | |
| 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 | 197,360,000 | |
| 第６６回三井不動産株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 198,944,000 | |
| 第８４回三井不動産株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 194,670,000 | |
| 第８６回三井不動産株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 185,516,000 | |
| 第１２０回三菱地所株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 197,204,000 | |
| 第１３１回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 82,140,000 | |
| 第１３５回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 94,247,000 | |
| 第１０９回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 94,687,000 | |
| 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 | 85,590,000 | |
| 第１３２回東武鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 95,383,000 | |
| 第１３５回東武鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,728,000 | |
| 第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 76,342,000 | |
| 第４５回京浜急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 82,856,000 | |
| 第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,596,000 | |
| 第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 83,899,000 | |
| 第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 70,157,000 | |
| 第４２回京王電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 83,946,000 | |
| 第５１回京成電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,087,000 | |
| 第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 104,162,000 | |
| 第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 200,000,000 | 213,684,000 | |
| 第１０９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 98,276,000 | |
| 第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 98,858,000 | |
| 第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 80,145,000 | |
| 第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 69,968,000 | |
| 第１４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 96,296,000 | |
| 第１５９回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 70,117,000 | |
| 第１６５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 81,076,000 | |
| | 100,000,000 | 61,682,000 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第１７２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | | | |
| 第１８４回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 300,000,000 | 298,995,000 | |
| 第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,243,000 | |
| 第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 66,593,000 | |
| 第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 78,385,000 | |
| 第７５回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 80,840,000 | |
| 第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 107,161,000 | |
| 第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 96,273,000 | |
| 第７２回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 99,638,000 | |
| 第３１回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 69,679,000 | |
| 第３７回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 58,404,000 | |
| 第４０回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 48,752,000 | |
| 第５４回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 62,678,000 | |
| 第５６回東京地下鉄株式会社社債 | 100,000,000 | 73,302,000 | |
| 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 | 99,245,000 | |
| 第２５回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,659,000 | |
| 第３０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,589,000 | |
| 第２１回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,416,000 | |
| 第３１回株式会社光通信無担保社債 | 200,000,000 | 167,216,000 | |
| 第３３回株式会社光通信無担保社債 | 100,000,000 | 91,257,000 | |
| 第３６回株式会社光通信無担保社債 | 100,000,000 | 90,038,000 | |
| 第５１９回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 90,290,000 | |
| 第５４０回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 81,282,000 | |
| 第５４５回中部電力株式会社社債 | 100,000,000 | 94,464,000 | |
| 第５０８回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,130,000 | |
| 第５１０回関西電力株式会社社債 | 200,000,000 | 198,170,000 | |
| 第５１１回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,754,000 | |
| 第５２４回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,304,000 | |
| 第５３６回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 95,741,000 | |
| 第５３８回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 95,227,000 | |
| 第５５０回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,900,000 | |
| 第５５４回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,815,000 | |
| 第３９８回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,978,000 | |
| 第４００回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,617,000 | |
| 第４１６回中国電力株式会社社債 | 200,000,000 | 194,558,000 | |
| 第４２５回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 96,107,000 | |
| 第４４８回中国電力株式会社社債 | 300,000,000 | 289,554,000 | |
| 第４５７回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,642,000 | |
| | | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 第３２２回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,883,000 | |
| 第３２３回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 89,135,000 | |
| 第３３０回北陸電力株式会社社債 | 200,000,000 | 194,046,000 | |
| 第３３９回北陸電力株式会社社債 | 200,000,000 | 176,932,000 | |
| 第４９６回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,633,000 | |
| 第５０８回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,660,000 | |
| 第５２１回東北電力株式会社社債 | 200,000,000 | 193,160,000 | |
| 第５２７回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 94,851,000 | |
| 第５３５回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,271,000 | |
| 第３０９回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 96,408,000 | |
| 第３１４回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 94,461,000 | |
| 第４４９回九州電力株式会社社債 | 200,000,000 | 198,174,000 | |
| 第４６５回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,949,000 | |
| 第４６８回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,113,000 | |
| 第４７６回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,403,000 | |
| 第４８４回九州電力株式会社社債 | 200,000,000 | 193,378,000 | |
| 第４８９回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 96,470,000 | |
| 第４９４回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 94,407,000 | |
| 第５１６回九州電力株式会社社債 | 200,000,000 | 192,882,000 | |
| 第３３２回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 91,371,000 | |
| 第３４０回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,200,000 | |
| 第３５０回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 86,451,000 | |
| 第３８５回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,204,000 | |
| 第４４回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 88,487,000 | |
| 第５０回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,928,000 | |
| 第５７回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 97,910,000 | |
| 第７７回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 98,944,000 | |
| 第８４回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,781,000 | |
| 第８６回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 96,638,000 | |
| 第３１回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 200,000,000 | 197,652,000 | |
| 第３９回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 98,699,000 | |
| 第４２回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 96,606,000 | |
| 第４５回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 96,128,000 | |
| 第４８回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 300,000,000 | 263,877,000 | |
| 第６４回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 99,372,000 | |
| 第６７回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 93,274,000 | |
| 第６９回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 100,000,000 | 100,343,000 | |
| 第９回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債 | 100,000,000 | 94,046,000 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 第２２回株式会社ＪＥＲＡ無担保社債 | 200,000,000 | 198,510,000 | |
| | 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 | 99,361,000 | |
| | 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 | 97,488,000 | |
| | 第６４回東京瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 69,851,000 | |
| | 第６５回東京瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 191,256,000 | |
| | 第４１回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 189,200,000 | |
| | 第４２回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 80,544,000 | |
| | 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 | 196,898,000 | |
| 社債券合計 | | 32,200,000,000 | 30,901,479,000 | |
| 合計 | | | 662,185,869,432 | |

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

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 16,148,306,139 |
| コール・ローン | 313,291,294 |
| 株式 | 736,311,889,259 |
| 投資信託受益証券 | 129,298,324 |
| 投資証券 | 13,505,761,571 |
| 派生商品評価勘定 | 716,378,323 |
| 未収入金 | 3,065,234 |
| 未収配当金 | 1,081,221,666 |
| 未収利息 | 577 |
| 差入委託証拠金 | 7,010,384,653 |
| 流動資産合計 | 775,219,597,040 |
| 資産合計 | 775,219,597,040 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 9,369,076 |
| 前受金 | 706,524,367 |
| 未払解約金 | 207,680,072 |
| 流動負債合計 | 923,573,515 |
| 負債合計 | 923,573,515 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 115,658,546,387 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 658,637,477,138 |
| 元本等合計 | 774,296,023,525 |
| 純資産合計 | 774,296,023,525 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 負債純資産合計 | 775,219,597,040 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)新株予約権証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。<br><br>(3)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(4)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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 6月10日現在 | |
|---|---|---|
| 1． 計算期間の末日における受益権の総数 | | 115,658,546,387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 | 6.6947円 |
| | (1万口当たり純資産額) | (66,947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 6月10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。<br>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。<br>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 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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 6月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 6月13日 |
| 期首元本額 | 121,623,869,603円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,076,805,461円 |
| 期中一部解約元本額 | 18,042,128,677円 |
| 期末元本額 | 115,658,546,387円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,431,953,557円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 5,530,473円 |
| ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン | 34,314,261,063円 |
| 世界経済インデックスファンド | 14,091,392,667円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 880,267,253円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 531,107,173円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 3,033,305,065円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 4,036,755,919円 |
| ＤＣ外国株式インデックス・オープン | 13,215,032,735円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 325,471,228円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 1,782,870,563円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 1,941,239,736円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 12,881,578円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 125,569,495円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 102,555,788円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 9,181,419,397円 |
| 外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 875,410,757円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,770,669円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（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ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 19,955,173円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 5,360,270円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 27,345,118円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 5,981,360円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 17,462,164円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 121,553,297円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 110,450,369円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 850,230,643円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 55,429,884円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 12,253,945円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 95,057,606円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 31,021,059円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 680,167,753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） | 721,817,468円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ１ | 1,159,273,695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 | 1,450,995,739円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 6,861,869,398円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,533,845,609円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 990,593,797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） | 429,912,966円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 22,350,530円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 113,683,801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ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 4,902,262,860円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 257,311,480円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,182,023,932円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 193,040,725円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 5,490,730円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード） | 2,326,807,020円 |
| グローバル経済コア | 700,501,236円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 14,713,858円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 6,950,499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 | 175,049,969円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 171,814,794円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 76,198,249円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 94,907,476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 | 15,674,060円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 110,756円 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０３５ | 20,814円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４０ | 22,941円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４５ | 24,654円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５０ | 24,654円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５ | 22,738円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６０ | 14,732円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６５ | 11,713円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 1,502円 |
| ＦＯＦｓ用　外国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 47,155,611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） | 215,726,223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） | 572,197,663円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,408,022,798円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 121,425,315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） | 77,450,904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） | 79,405,841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 6月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 3,877,263,687 |
| 投資信託受益証券 | △2,821,829 |
| 投資証券 | 318,239,909 |
| 合計 | 4,192,681,767 |

(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 6月10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<br>買建 | 23,480,746,083 | － | 24,187,270,450 | 706,524,367 |
| 合計 | | 23,480,746,083 | － | 24,187,270,450 | 706,524,367 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年 6月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 59,169,800 | － | 59,654,680 | 484,880 |
| | アメリカドル | 59,169,800 | － | 59,654,680 | 484,880 |
| 合計 | | 59,169,800 | － | 59,654,680 | 484,880 |

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数(株) | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | APA CORP | 33,009 | 28.85 | 952,309.65 | |
| | BAKER HUGHES CO | 77,332 | 31.64 | 2,446,784.48 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 18,099 | 159.59 | 2,888,419.41 | |
| | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 8,482 | 88.29 | 748,875.78 | |
| | CHEVRON CORP | 135,746 | 156.08 | 21,187,235.68 | |
| | CHORD ENERGY CORP | 4,800 | 168.96 | 811,008.00 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 90,345 | 112.00 | 10,118,640.00 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 54,546 | 27.58 | 1,504,378.68 | |
| | DEVON ENERGY CORPORATION | 50,256 | 46.79 | 2,351,478.24 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 13,267 | 190.30 | 2,524,710.10 | |
| | EOG RESOURCES INC | 45,763 | 120.19 | 5,500,254.97 | |
| | EQT CORPORATION | 34,139 | 40.54 | 1,383,995.06 | |
| | EXXON MOBIL | 346,986 | 112.75 | 39,122,671.50 | |
| | HALLIBURTON CO | 70,302 | 34.08 | 2,395,892.16 | |
| | HESS CORP | 21,602 | 147.54 | 3,187,159.08 | |
| | HF SINCLAIR CORP | 13,429 | 53.25 | 715,094.25 | |
| | KINDER MORGAN INC | 160,038 | 19.62 | 3,139,945.56 | |
| | MARATHON OIL CORP | 39,344 | 27.87 | 1,096,517.28 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 27,588 | 175.10 | 4,830,658.80 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 49,406 | 59.48 | 2,938,668.88 | |
| | ONEOK INC | 43,535 | 78.65 | 3,424,027.75 | |
| | OVINTIV INC | 20,398 | 47.63 | 971,556.74 | |
| | PHILLIPS 66 | 32,264 | 138.07 | 4,454,690.48 | |
| | SCHLUMBERGER | 110,287 | 44.55 | 4,913,285.85 | |
| | TARGA RESOURCES CORP | 17,298 | 118.01 | 2,041,336.98 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1,599 | 582.07 | 930,729.93 | |
| VALERO ENERGY CORP | 26,282 | 154.43 | 4,058,729.26 | |
| WILLIAMS COS | 97,655 | 40.70 | 3,974,558.50 | |
| AIR PRODUCTS&CHEMICALS | 17,479 | 279.53 | 4,885,904.87 | |
| ALBEMARLE CORP | 8,403 | 114.94 | 965,840.82 | |
| AMCOR PLC | 110,292 | 10.01 | 1,104,022.92 | |
| AVERY DENNISON CORP | 6,638 | 226.29 | 1,502,113.02 | |
| BALL CORP | 25,896 | 68.47 | 1,773,099.12 | |
| CELANESE CORP-SERIES A | 8,582 | 146.47 | 1,257,005.54 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 12,872 | 77.86 | 1,002,213.92 | |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 43,000 | 15.80 | 679,400.00 | |
| CORTEVA INC | 51,757 | 52.90 | 2,737,945.30 | |
| CROWN HOLDINGS INC | 9,940 | 82.21 | 817,167.40 | |
| DOW INC | 56,967 | 55.73 | 3,174,770.91 | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 34,119 | 80.01 | 2,729,861.19 | |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 8,832 | 103.30 | 912,345.60 | |
| ECOLAB INC | 20,345 | 239.19 | 4,866,320.55 | |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 110,698 | 49.27 | 5,454,090.46 | |
| INT'L PAPER CO | 25,191 | 45.21 | 1,138,885.11 | |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 19,307 | 98.48 | 1,901,353.36 | |
| LINDE PLC | 37,432 | 433.70 | 16,234,258.40 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 19,745 | 96.06 | 1,896,704.70 | |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 5,017 | 550.87 | 2,763,714.79 | |
| MOSAIC CO/THE | 27,732 | 28.28 | 784,260.96 | |
| NEWMONT CORPORATION | 86,194 | 40.36 | 3,478,789.84 | |
| NUCOR CORP | 18,727 | 161.00 | 3,015,047.00 | |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 6,221 | 183.58 | 1,142,051.18 | |
| PPG INDUSTRIES INC | 17,495 | 128.41 | 2,246,532.95 | |
| RELIANCE INC | 4,126 | 286.96 | 1,183,996.96 | |
| RPM INTERNATIONAL INC | 10,456 | 108.14 | 1,130,711.84 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 18,426 | 291.95 | 5,379,470.70 | |
| STEEL DYNAMICS INC | 11,618 | 125.52 | 1,458,291.36 | |
| VULCAN MATERIALS CO | 10,153 | 247.59 | 2,513,781.27 | |
| WESTLAKE CORP | 2,222 | 153.01 | 339,988.22 | |
| WESTROCK CO | 21,356 | 51.86 | 1,107,522.16 | |
| 3 M COMPANY | 43,663 | 100.86 | 4,403,850.18 | |
| AECOM | 10,456 | 85.80 | 897,124.80 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | 14,679 | 90.39 | 1,326,834.81 | |
| ALLEGION PLC | 7,721 | 116.93 | 902,816.53 | |
| AMETEK INC | 17,753 | 170.00 | 3,018,010.00 | |
| AXON ENTERPRISE INC | 5,367 | 280.50 | 1,505,443.50 | |
| BOEING CO | 44,809 | 190.24 | 8,524,464.16 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 9,522 | 146.28 | 1,392,878.16 | |
| CARLISLE COS INC | 3,456 | 408.85 | 1,412,985.60 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 62,063 | 62.71 | 3,891,970.73 | |
| CATERPILLAR | 38,627 | 328.94 | 12,705,965.38 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 54,445 | 10.31 | 561,327.95 | |
| CUMMINS INC | 10,453 | 271.87 | 2,841,857.11 | |
| DEERE&CO | 20,534 | 368.58 | 7,568,421.72 | |
| DOVER CORP | 10,657 | 177.22 | 1,888,633.54 | |
| EATON CORP | 30,932 | 314.83 | 9,738,321.56 | |
| EMCOR GROUP INC | 3,640 | 376.00 | 1,368,640.00 | |
| EMERSON ELECTRIC CO | 44,010 | 107.98 | 4,752,199.80 | |
| FASTENAL CO | 44,011 | 63.89 | 2,811,862.79 | |
| FERGUSON PLC | 16,260 | 198.68 | 3,230,536.80 | |
| FORTIVE CORP | 25,894 | 72.75 | 1,883,788.50 | |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 10,310 | 65.99 | 680,356.90 | |
| GE VERNOVA INC | 20,868 | 162.08 | 3,382,285.44 | |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 18,159 | 299.14 | 5,432,083.26 | |
| GENERAL ELECTRIC CO | 85,192 | 161.92 | 13,794,288.64 | |
| GRACO INC | 13,378 | 78.35 | 1,048,166.30 | |
| GRAINGER (WW) INC | 3,363 | 892.25 | 3,000,636.75 | |
| HEICO CORP | 3,640 | 222.52 | 809,972.80 | |
| HEICO CORP-CLASS A | 5,700 | 176.78 | 1,007,646.00 | |
| HONEYWELL INTL INC | 51,027 | 208.78 | 10,653,417.06 | |
| HOWMET AEROSPACE INC | 31,648 | 83.78 | 2,651,469.44 | |
| HUBBELL INC | 4,458 | 366.68 | 1,634,659.44 | |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 3,433 | 249.21 | 855,537.93 | |
| IDEX CORP | 5,916 | 201.79 | 1,193,789.64 | |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 22,812 | 240.42 | 5,484,461.04 | |
| INGERSOLL-RAND INC | 31,562 | 89.13 | 2,813,121.06 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 12,700 | 37.88 | 481,076.00 | |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 54,141 | 69.95 | 3,787,162.95 | |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 14,682 | 221.90 | 3,257,935.80 | |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,526 | 497.03 | 1,255,497.78 | |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 16,743 | 470.13 | 7,871,386.59 | |
| MASCO CORP | 18,934 | 66.03 | 1,250,212.02 | |
| NORDSON CORP | 4,121 | 226.15 | 931,964.15 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 10,696 | 440.04 | 4,706,667.84 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 30,717 | 98.66 | 3,030,539.22 | |
| OWENS CORNING | 6,460 | 176.89 | 1,142,709.40 | |
| PACCAR INC | 40,380 | 107.67 | 4,347,714.60 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 9,881 | 516.14 | 5,099,979.34 | |
| PENTAIR PLC | 14,383 | 77.55 | 1,115,401.65 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| QUANTA SERVICES INC | 11,573 | 269.32 | 3,116,840.36 | |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 8,466 | 255.91 | 2,166,534.06 | |
| RTX CORP | 102,848 | 108.11 | 11,118,897.28 | |
| SMITH (A.O.) CORP | 9,016 | 81.08 | 731,017.28 | |
| SNAP-ON INC | 4,000 | 268.19 | 1,072,760.00 | |
| STANLEY BLACK&DECKER | 12,598 | 82.46 | 1,038,831.08 | |
| TEXTRON | 13,876 | 85.60 | 1,187,785.60 | |
| TORO CO | 8,812 | 95.98 | 845,775.76 | |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 18,000 | 319.03 | 5,742,540.00 | |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,240 | 1,310.00 | 5,554,400.00 | |
| UNITED RENTALS INC | 5,364 | 643.40 | 3,451,197.60 | |
| VERTIV HOLDINGS CO-A | 29,005 | 87.68 | 2,543,158.40 | |
| WABTEC CORP | 13,304 | 163.17 | 2,170,813.68 | |
| WATSCO INC | 2,656 | 462.63 | 1,228,745.28 | |
| XYLEM INC | 19,668 | 137.32 | 2,700,809.76 | |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 31,919 | 252.32 | 8,053,802.08 | |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 9,240 | 151.74 | 1,402,077.60 | |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC | 9,640 | 198.04 | 1,909,105.60 | |
| CINTAS CORP | 7,043 | 682.17 | 4,804,523.31 | |
| COPART INC | 69,100 | 53.76 | 3,714,816.00 | |
| DAYFORCE INC | 10,668 | 51.53 | 549,722.04 | |
| EQUIFAX INC | 9,160 | 233.28 | 2,136,844.80 | |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 8,836 | 139.06 | 1,228,734.16 | |
| LEIDOS HOLDINGS | 9,314 | 144.85 | 1,349,132.90 | |
| PAYCHEX INC | 24,118 | 122.58 | 2,956,384.44 | |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 4,235 | 145.33 | 615,472.55 | |
| PAYLOCITY HOLDING CORP | 3,423 | 139.51 | 477,542.73 | |
| REPUBLIC SERVICES INC | 16,455 | 186.95 | 3,076,262.25 | |
| ROLLINS INC | 25,466 | 46.57 | 1,185,951.62 | |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 15,402 | 61.64 | 949,379.28 | |
| TRANSUNION | 15,741 | 71.31 | 1,122,490.71 | |
| VERALTO CORP | 17,691 | 99.22 | 1,755,301.02 | |
| VERISK ANALYTICS INC | 10,738 | 264.00 | 2,834,832.00 | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 19,775 | 165.54 | 3,273,553.50 | |
| WASTE MANAGEMENT INC | 30,660 | 200.55 | 6,148,863.00 | |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 8,367 | 86.98 | 727,761.66 | |
| CSX CORP | 152,551 | 32.75 | 4,996,045.25 | |
| DELTA AIR LINES INC | 15,193 | 50.44 | 766,334.92 | |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 12,280 | 125.47 | 1,540,771.60 | |
| FEDEX CORP | 17,725 | 247.73 | 4,391,014.25 | |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A | 190,364 | 3.67 | 698,635.88 | |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 5,748 | 159.96 | 919,450.08 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 13,623 | 48.04 | 654,448.92 | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 17,982 | 224.07 | 4,029,226.74 | |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 14,712 | 168.53 | 2,479,413.36 | |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 13,533 | 27.75 | 375,540.75 | |
| U-HAUL HOLDING CO | 6,606 | 60.39 | 398,936.34 | |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 144,319 | 69.31 | 10,002,749.89 | |
| UNION PACIFIC CORP | 46,736 | 227.97 | 10,654,405.92 | |
| UNITED PARCEL SERVICE B | 55,567 | 137.64 | 7,648,241.88 | |
| APTIV PLC | 21,896 | 81.42 | 1,782,772.32 | |
| FORD MOTOR COMPANY | 290,990 | 12.15 | 3,535,528.50 | |
| GENERAL MOTORS CO | 89,296 | 45.72 | 4,082,613.12 | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 51,336 | 11.52 | 591,390.72 | |
| TESLA INC | 221,215 | 177.48 | 39,261,238.20 | |
| DECKERS OUTDOOR CORP | 2,103 | 1,044.31 | 2,196,183.93 | |
| DR HORTON INC | 22,973 | 140.22 | 3,221,274.06 | |
| GARMIN LTD | 11,170 | 163.26 | 1,823,614.20 | |
| LENNAR CORP-CL A | 18,864 | 154.02 | 2,905,433.28 | |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 8,619 | 317.86 | 2,739,635.34 | |
| NIKE B | 94,445 | 96.55 | 9,118,664.75 | |
| NVR INC | 247 | 7,497.67 | 1,851,924.49 | |
| PULTE GROUP INC | 16,747 | 111.54 | 1,867,960.38 | |
| AIRBNB INC-CLASS A | 34,827 | 146.66 | 5,107,727.82 | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 2,619 | 3,813.09 | 9,986,482.71 | |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 17,560 | 36.06 | 633,213.60 | |
| CARNIVAL CORPORATION | 71,810 | 16.70 | 1,199,227.00 | |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 2,089 | 3,169.02 | 6,620,082.78 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 9,207 | 148.54 | 1,367,607.78 | |
| DOMINO'S PIZZA INC | 2,848 | 513.55 | 1,462,590.40 | |
| DOORDASH INC - A | 21,857 | 113.27 | 2,475,742.39 | |
| DRAFTKINGS INC | 32,654 | 36.89 | 1,204,606.06 | |
| EXPEDIA GROUP INC | 9,628 | 123.06 | 1,184,821.68 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 19,635 | 202.18 | 3,969,804.30 | |
| HYATT HOTELS CORP - CL A | 3,787 | 145.15 | 549,683.05 | |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 30,565 | 45.02 | 1,376,036.30 | |
| MARRIOTT INTL A | 19,516 | 231.10 | 4,510,147.60 | |
| MCDONALD'S CORP | 55,965 | 256.21 | 14,338,792.65 | |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 15,462 | 40.69 | 629,148.78 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 18,429 | 154.57 | 2,848,570.53 | |
| STARBUCKS CORP | 88,273 | 81.43 | 7,188,070.39 | |
| WYNN RESORTS LTD | 6,702 | 93.14 | 624,224.28 | |
| YUM BRANDS INC | 22,162 | 139.97 | 3,102,015.14 | |
| ALPHABET INC-CL A | 455,214 | 174.46 | 79,416,634.44 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ALPHABET INC-CL C | 394,786 | 175.95 | 69,462,596.70 | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 7,192 | 276.83 | 1,990,961.36 | |
| COMCAST CORP-CL A | 309,993 | 38.96 | 12,077,327.28 | |
| ELECTRONIC ARTS INC | 19,733 | 136.82 | 2,699,869.06 | |
| FOX CORP - CLASS A | 21,544 | 34.11 | 734,865.84 | |
| FOX CORP- CLASS B | 10,345 | 31.77 | 328,660.65 | |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS | 28,511 | 30.72 | 875,857.92 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C | 15,379 | 71.89 | 1,105,596.31 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT | 11,613 | 90.53 | 1,051,324.89 | |
| MATCH GROUP INC | 22,730 | 32.02 | 727,814.60 | |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 169,631 | 492.96 | 83,621,297.76 | |
| NETFLIX INC | 33,607 | 641.47 | 21,557,882.29 | |
| NEWS CORP-CLASS A | 33,479 | 27.19 | 910,294.01 | |
| OMNICOM GROUP | 14,048 | 91.09 | 1,279,632.32 | |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B | 32,508 | 12.01 | 390,421.08 | |
| PINTEREST INC- CLASS A | 45,767 | 44.11 | 2,018,782.37 | |
| ROBLOX CORP -CLASS A | 35,113 | 35.63 | 1,251,076.19 | |
| ROKU INC | 9,122 | 57.35 | 523,146.70 | |
| SEA LTD-ADR | 28,338 | 72.47 | 2,053,654.86 | |
| SNAP INC - A | 72,602 | 15.59 | 1,131,865.18 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE | 12,867 | 164.77 | 2,120,095.59 | |
| THE WALT DISNEY CO | 142,615 | 101.54 | 14,481,127.10 | |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 33,583 | 94.17 | 3,162,511.11 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 177,413 | 8.27 | 1,467,205.51 | |
| AMAZON.COM | 724,185 | 184.30 | 133,467,295.50 | |
| AUTOZONE INC | 1,368 | 2,800.70 | 3,831,357.60 | |
| BATH & BODY WORKS INC | 13,452 | 45.84 | 616,639.68 | |
| BEST BUY COMPANY INC | 15,285 | 87.92 | 1,343,857.20 | |
| BURLINGTON STORES INC | 5,108 | 229.21 | 1,170,804.68 | |
| CARMAX INC | 10,695 | 69.17 | 739,773.15 | |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 4,950 | 219.05 | 1,084,297.50 | |
| EBAY | 41,952 | 53.08 | 2,226,812.16 | |
| ETSY INC | 10,294 | 65.28 | 671,992.32 | |
| GENUINE PARTS CO | 9,903 | 145.19 | 1,437,816.57 | |
| GLOBAL-E ONLINE LTD | 7,000 | 30.00 | 210,000.00 | |
| HOME DEPOT | 77,067 | 327.03 | 25,203,221.01 | |
| LKQ CORP | 19,286 | 42.21 | 814,062.06 | |
| LOWES COMPANIES | 44,328 | 216.67 | 9,604,547.76 | |
| MERCADOLIBRE INC | 3,573 | 1,600.16 | 5,717,371.68 | |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 4,577 | 978.70 | 4,479,509.90 | |
| POOL CORP | 2,664 | 340.86 | 908,051.04 | |
| ROSS STORES INC | 25,425 | 144.27 | 3,668,191.87 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TJX COMPANIES INC | 88,680 | 107.44 | 9,527,779.20 | |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 7,846 | 270.93 | 2,125,716.78 | |
| ULTA BEAUTY INC | 3,920 | 382.61 | 1,499,831.20 | |
| WILLIAMS-SONOMA INC | 4,460 | 292.52 | 1,304,639.20 | |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A | 25,000 | 20.07 | 501,750.00 | |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 34,237 | 845.58 | 28,950,122.46 | |
| DOLLAR GENERAL CORP | 16,287 | 126.61 | 2,062,097.07 | |
| DOLLAR TREE INC | 16,318 | 111.29 | 1,816,030.22 | |
| KROGER CO | 50,664 | 51.98 | 2,633,514.72 | |
| SYSCO CORP | 40,090 | 72.66 | 2,912,939.40 | |
| TARGET (DAYTON HUDSON) | 35,264 | 146.00 | 5,148,544.00 | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 51,567 | 15.84 | 816,821.28 | |
| WALMART INC | 342,809 | 65.88 | 22,584,256.92 | |
| ALTRIA GROUP INC | 132,873 | 46.70 | 6,205,169.10 | |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 40,618 | 61.27 | 2,488,664.86 | |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 14,082 | 43.89 | 618,058.98 | |
| BUNGE GLOBAL SA | 11,604 | 104.13 | 1,208,324.52 | |
| CAMPBELL SOUP CO (US) | 15,869 | 42.86 | 680,145.34 | |
| CELSIUS HOLDINGS INC | 13,069 | 73.20 | 956,650.80 | |
| COCA-COLA CO | 316,878 | 63.91 | 20,251,672.98 | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 15,394 | 74.43 | 1,145,775.42 | |
| CONAGRA BRANDS INC | 33,324 | 29.72 | 990,389.28 | |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 13,126 | 250.93 | 3,293,707.18 | |
| GENERAL MILLS INC | 43,531 | 67.46 | 2,936,601.26 | |
| HERSHEY FOODS CORPORATION | 10,942 | 196.06 | 2,145,288.52 | |
| HORMEL FOODS CORP | 23,338 | 30.64 | 715,076.32 | |
| JM SMUCKER CO | 7,850 | 114.98 | 902,593.00 | |
| KELLANOVA | 23,448 | 59.63 | 1,398,204.24 | |
| KEURIG DR PEPPER INC | 81,153 | 34.63 | 2,810,328.39 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 68,964 | 34.39 | 2,371,671.96 | |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 11,876 | 85.84 | 1,019,435.84 | |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 18,092 | 68.58 | 1,240,749.36 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B | 14,669 | 51.94 | 761,907.86 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 105,431 | 67.81 | 7,149,276.11 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 58,348 | 52.69 | 3,074,356.12 | |
| PEPSICO INC | 107,105 | 171.04 | 18,319,239.20 | |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 118,983 | 103.61 | 12,327,828.63 | |
| TYSON FOODS INC | 23,306 | 55.86 | 1,301,873.16 | |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 19,346 | 107.38 | 2,077,373.48 | |
| CLOROX COMPANY | 9,570 | 132.97 | 1,272,522.90 | |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 61,938 | 93.89 | 5,815,358.82 | |
| ESTEE LAUDER CO-CL A | 18,800 | 120.47 | 2,264,836.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KENVUE INC | 148,093 | 18.39 | 2,723,430.27 | |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 26,877 | 134.48 | 3,614,418.96 | |
| PROCTER & GAMBLE CO | 181,466 | 167.06 | 30,315,709.96 | |
| ABBOTT LABORATORIES | 133,298 | 107.58 | 14,340,198.84 | |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 5,253 | 255.54 | 1,342,351.62 | |
| BAXTER INTERNATIONAL | 41,576 | 33.16 | 1,378,660.16 | |
| BECTON DICKINSON & CO | 22,142 | 240.63 | 5,328,029.46 | |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 112,121 | 77.11 | 8,645,650.31 | |
| CARDINAL HEALTH | 19,151 | 98.51 | 1,886,565.01 | |
| CENCORA INC | 14,462 | 235.47 | 3,405,367.14 | |
| CENTENE CORP | 40,934 | 69.81 | 2,857,602.54 | |
| COOPER COS INC/THE | 12,923 | 94.38 | 1,219,672.74 | |
| CVS HEALTH CORP | 99,034 | 61.78 | 6,118,320.52 | |
| DAVITA INC | 4,627 | 143.18 | 662,493.86 | |
| DEXCOM INC | 28,772 | 115.79 | 3,331,509.88 | |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 44,930 | 88.14 | 3,960,130.20 | |
| ELEVANCE HEALTH INC | 18,232 | 538.94 | 9,825,954.08 | |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY | 32,998 | 76.34 | 2,519,067.32 | |
| HCA HEALTHCARE INC | 15,457 | 337.44 | 5,215,810.08 | |
| HENRY SCHEIN INC | 8,755 | 68.51 | 599,805.05 | |
| HOLOGIC INC | 18,875 | 74.51 | 1,406,376.25 | |
| HUMANA INC | 9,013 | 351.80 | 3,170,773.40 | |
| IDEXX LABORATORIES INC | 6,644 | 497.51 | 3,305,456.44 | |
| INSULET CORP | 5,246 | 191.42 | 1,004,189.32 | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 27,718 | 417.61 | 11,575,313.98 | |
| LABCORP HOLDINGS INC | 6,548 | 196.60 | 1,287,336.80 | |
| MCKESSON CORP | 10,179 | 586.90 | 5,974,055.10 | |
| MEDTRONIC PLC | 102,632 | 84.07 | 8,628,272.24 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 4,545 | 309.56 | 1,406,950.20 | |
| QUEST DIAGNOSTICS | 8,679 | 142.34 | 1,235,368.86 | |
| RESMED INC | 10,920 | 210.91 | 2,303,137.20 | |
| SOLVENTUM CORP | 10,915 | 56.41 | 615,715.15 | |
| STERIS PLC | 8,172 | 226.85 | 1,853,818.20 | |
| STRYKER CORP | 26,379 | 349.33 | 9,214,976.07 | |
| TELEFLEX INC | 3,934 | 212.57 | 836,250.38 | |
| THE CIGNA GROUP | 21,946 | 338.10 | 7,419,942.60 | |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 71,401 | 490.69 | 35,035,756.69 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 4,672 | 187.53 | 876,140.16 | |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 12,491 | 183.14 | 2,287,601.74 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 15,254 | 113.34 | 1,728,888.36 | |
| ABBVIE INC | 136,294 | 169.42 | 23,090,929.48 | |
| AGILENT TECHNOLOGIES | 21,791 | 132.98 | 2,897,767.18 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 9,643 | 152.78 | 1,473,257.54 | |
| AMGEN | 41,885 | 305.02 | 12,775,762.70 | |
| AVANTOR INC | 49,647 | 24.01 | 1,192,024.47 | |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 1,853 | 287.02 | 531,848.06 | |
| BIO-TECHNE CORP | 12,980 | 77.63 | 1,007,637.40 | |
| BIOGEN INC | 10,740 | 225.43 | 2,421,118.20 | |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 14,783 | 80.69 | 1,192,840.27 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 155,274 | 41.48 | 6,440,765.52 | |
| CATALENT INC | 13,739 | 56.39 | 774,742.21 | |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 4,204 | 214.79 | 902,977.16 | |
| DANAHER CORP | 54,787 | 263.08 | 14,413,363.96 | |
| ELI LILLY & CO | 62,575 | 849.99 | 53,188,124.25 | |
| EXACT SCIENCES CORP | 12,208 | 42.93 | 524,089.44 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 96,270 | 64.70 | 6,228,669.00 | |
| ILLUMINA INC | 11,423 | 113.70 | 1,298,795.10 | |
| INCYTE CORP | 15,212 | 59.16 | 899,941.92 | |
| IQVIA HOLDINGS INC | 13,836 | 219.23 | 3,033,266.28 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 187,239 | 147.08 | 27,539,112.12 | |
| MERCK & CO | 195,618 | 130.67 | 25,561,404.06 | |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,627 | 1,438.58 | 2,340,569.66 | |
| MODERNA INC | 25,884 | 151.01 | 3,908,742.84 | |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 6,742 | 134.97 | 909,967.74 | |
| PFIZER | 432,739 | 28.58 | 12,367,680.62 | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 8,327 | 1,002.95 | 8,351,564.65 | |
| REPLIGEN CORP | 4,353 | 145.78 | 634,580.34 | |
| REVVITY INC | 8,524 | 110.92 | 945,482.08 | |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 30,083 | 27.46 | 826,079.18 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 92,141 | 16.82 | 1,549,811.62 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 29,526 | 581.09 | 17,157,263.34 | |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 3,618 | 275.00 | 994,950.00 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 19,876 | 483.04 | 9,600,903.04 | |
| VIATRIS INC | 89,720 | 10.47 | 939,368.40 | |
| WATERS CORP | 4,749 | 302.09 | 1,434,625.41 | |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 5,767 | 314.68 | 1,814,759.56 | |
| ZOETIS INC | 35,994 | 176.92 | 6,368,058.48 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 549,785 | 39.78 | 21,870,447.30 | |
| CITIGROUP | 146,698 | 61.78 | 9,063,002.44 | |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 39,522 | 34.15 | 1,349,676.30 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 54,420 | 36.13 | 1,966,194.60 | |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 766 | 1,688.80 | 1,293,620.80 | |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 114,112 | 13.40 | 1,529,100.80 | |
| JPMORGAN CHASE & CO | 222,518 | 199.95 | 44,492,474.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KEY CORP | 71,223 | 13.93 | 992,136.39 | |
| M & T BANK CORP | 13,791 | 146.82 | 2,024,794.62 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 31,533 | 155.88 | 4,915,364.04 | |
| REGIONS FINL CORP | 70,810 | 18.60 | 1,317,066.00 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 106,342 | 36.17 | 3,846,390.14 | |
| US BANCORP | 117,317 | 39.02 | 4,577,709.34 | |
| WELLS FARGO & CO | 273,850 | 58.36 | 15,981,886.00 | |
| ALLY FINANCIAL INC | 21,529 | 38.64 | 831,880.56 | |
| AMERICAN EXPRESS | 45,006 | 232.67 | 10,471,546.02 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 7,816 | 426.63 | 3,334,540.08 | |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 29,517 | 112.36 | 3,316,530.12 | |
| ARES MANAGEMENT CORP - A | 14,741 | 132.93 | 1,959,521.13 | |
| BANK NEW YORK CO | 56,329 | 60.31 | 3,397,201.99 | |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 101,297 | 413.72 | 41,908,594.84 | |
| BLACKROCK INC | 11,583 | 768.69 | 8,903,736.27 | |
| BLACKSTONE INC | 55,334 | 117.62 | 6,508,385.08 | |
| BLOCK INC | 42,352 | 65.10 | 2,757,115.20 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 30,097 | 139.80 | 4,207,560.60 | |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 15,669 | 40.68 | 637,414.92 | |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 8,803 | 172.68 | 1,520,102.04 | |
| CME GROUP INC | 27,997 | 199.36 | 5,581,481.92 | |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 14,368 | 244.16 | 3,508,090.88 | |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC | 19,249 | 28.90 | 556,296.10 | |
| CORPAY INC | 4,988 | 259.01 | 1,291,941.88 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 18,987 | 124.90 | 2,371,476.30 | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 27,983 | 40.16 | 1,123,797.28 | |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 3,148 | 409.93 | 1,290,459.64 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 45,470 | 77.51 | 3,524,379.70 | |
| FISERV INC | 46,319 | 151.42 | 7,013,622.98 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 26,070 | 22.89 | 596,742.30 | |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 4,316 | 74.90 | 323,268.40 | |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 20,749 | 97.71 | 2,027,384.79 | |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 25,012 | 454.91 | 11,378,208.92 | |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 44,122 | 133.79 | 5,903,082.38 | |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 5,213 | 164.78 | 858,998.14 | |
| KKR & CO INC | 47,919 | 97.99 | 4,695,582.81 | |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 5,490 | 280.06 | 1,537,529.40 | |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 3,207 | 198.76 | 637,423.32 | |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 64,241 | 449.79 | 28,894,959.39 | |
| MOODY'S CORP | 12,577 | 403.70 | 5,077,334.90 | |
| MORGAN STANLEY | 93,827 | 97.14 | 9,114,354.78 | |
| MSCI INC | 5,952 | 491.69 | 2,926,538.88 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| NASDAQ INC | 29,020 | 58.78 | 1,705,795.60 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 15,902 | 82.29 | 1,308,575.58 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 79,286 | 67.30 | 5,335,947.80 | |
| PRICE T ROWE GROUP INC | 18,275 | 115.55 | 2,111,676.25 | |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 15,486 | 120.03 | 1,858,784.58 | |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A | 46,668 | 22.18 | 1,035,096.24 | |
| S&P GLOBAL INC | 24,501 | 428.74 | 10,504,558.74 | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 117,095 | 73.93 | 8,656,833.35 | |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 9,550 | 65.26 | 623,233.00 | |
| STATE STREET CORP | 22,335 | 74.76 | 1,669,764.60 | |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 29,196 | 43.70 | 1,275,865.20 | |
| TOAST INC-CLASS A | 31,526 | 22.02 | 694,202.52 | |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 9,061 | 105.31 | 954,213.91 | |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 122,188 | 278.67 | 34,050,129.96 | |
| AFLAC | 43,196 | 88.79 | 3,835,372.84 | |
| ALLSTATE CORP | 20,722 | 165.06 | 3,420,373.32 | |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 6,319 | 128.15 | 809,779.85 | |
| AMERICAN INT'L GROUP | 50,875 | 76.02 | 3,867,517.50 | |
| AON PLC | 15,249 | 283.12 | 4,317,296.88 | |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 29,737 | 100.57 | 2,990,650.09 | |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 16,294 | 253.53 | 4,131,017.82 | |
| ASSURANT INC | 4,726 | 173.34 | 819,204.84 | |
| BROWN & BROWN INC | 20,155 | 90.28 | 1,819,593.40 | |
| CHUBB LTD | 30,987 | 267.22 | 8,280,346.14 | |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 11,110 | 115.97 | 1,288,426.70 | |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 2,166 | 357.48 | 774,301.68 | |
| EVEREST GROUP LTD | 3,288 | 382.81 | 1,258,679.28 | |
| FNF GROUP | 20,461 | 49.23 | 1,007,295.03 | |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS | 21,873 | 100.85 | 2,205,892.05 | |
| LOEWS CORP | 16,402 | 75.25 | 1,234,250.50 | |
| MARKEL GROUP INC | 1,007 | 1,601.43 | 1,612,640.01 | |
| MARSH & MCLENNAN COS | 38,224 | 209.99 | 8,026,657.76 | |
| METLIFE INC | 48,925 | 70.05 | 3,427,196.25 | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 18,536 | 79.27 | 1,469,348.72 | |
| PROGRESSIVE CORP | 45,236 | 212.53 | 9,614,007.08 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 26,649 | 117.84 | 3,140,318.16 | |
| TRAVELERS COS INC/THE | 17,147 | 212.95 | 3,651,453.65 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 7,737 | 255.49 | 1,976,726.13 | |
| WR BERKLEY CORP | 14,360 | 80.20 | 1,151,672.00 | |
| WEYERHAEUSER CO | 52,615 | 29.36 | 1,544,776.40 | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 48,353 | 288.40 | 13,945,005.20 | |
| ADOBE INC | 34,893 | 465.43 | 16,240,248.99 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AKAMAI TECHNOLOGIES,INC | 11,484 | 89.18 | 1,024,143.12 | |
| ANSYS INC | 6,794 | 324.30 | 2,203,294.20 | |
| APPLOVIN CORP-CLASS A | 12,260 | 81.91 | 1,004,216.60 | |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 2,394 | 202.56 | 484,928.64 | |
| ATLASSIAN CORP-CL A | 11,436 | 163.36 | 1,868,184.96 | |
| AUTODESK INC | 17,030 | 216.05 | 3,679,331.50 | |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 14,813 | 50.82 | 752,796.66 | |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS | 21,140 | 294.42 | 6,224,038.80 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 7,058 | 156.41 | 1,103,941.78 | |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 23,067 | 70.73 | 1,631,528.91 | |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 37,006 | 65.94 | 2,440,175.64 | |
| CONFLUENT INC-CLASS A | 12,300 | 25.78 | 317,094.00 | |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 17,478 | 349.12 | 6,101,919.36 | |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 3,100 | 239.97 | 743,907.00 | |
| DATADOG INC - CLASS A | 20,780 | 109.47 | 2,274,786.60 | |
| DOCUSIGN INC | 14,969 | 52.05 | 779,136.45 | |
| DYNATRACE INC | 22,028 | 46.18 | 1,017,253.04 | |
| EPAM SYSTEMS INC | 4,768 | 176.98 | 843,840.64 | |
| FAIR ISAAC CORP | 2,026 | 1,310.32 | 2,654,708.32 | |
| FORTINET INC | 49,270 | 59.72 | 2,942,404.40 | |
| GARTNER INC | 5,859 | 434.44 | 2,545,383.96 | |
| GEN DIGITAL INC | 43,555 | 24.72 | 1,076,679.60 | |
| GODADDY INC - CLASS A | 11,388 | 139.36 | 1,587,031.68 | |
| HUBSPOT INC | 3,646 | 596.65 | 2,175,385.90 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 71,082 | 170.01 | 12,084,650.82 | |
| INTUIT INC | 21,468 | 573.90 | 12,320,485.20 | |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC | 4,694 | 220.55 | 1,035,261.70 | |
| MICROSOFT CORP | 546,006 | 423.85 | 231,424,643.10 | |
| MICROSTRATEGY INC-CL A | 1,219 | 1,596.20 | 1,945,767.80 | |
| MONDAY.COM LTD | 2,838 | 223.24 | 633,555.12 | |
| MONGODB INC | 5,325 | 227.02 | 1,208,881.50 | |
| OKTA INC | 11,505 | 87.42 | 1,005,767.10 | |
| ORACLE CORP | 126,564 | 125.92 | 15,936,938.88 | |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 146,919 | 23.31 | 3,424,681.89 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 25,444 | 301.90 | 7,681,543.60 | |
| PTC INC | 9,741 | 174.48 | 1,699,609.68 | |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 8,456 | 554.03 | 4,684,877.68 | |
| SALESFORCE INC | 74,662 | 241.85 | 18,057,004.70 | |
| SAMSARA INC-CL A | 13,283 | 30.56 | 405,928.48 | |
| SERVICENOW INC | 15,986 | 698.81 | 11,171,176.66 | |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 23,538 | 131.21 | 3,088,420.98 | |
| SYNOPSYS INC | 11,896 | 571.45 | 6,797,969.20 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TWILIO INC - A | 12,842 | 57.03 | 732,379.26 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 3,339 | 481.84 | 1,608,863.76 | |
| UIPATH INC - CLASS A | 28,419 | 12.00 | 341,028.00 | |
| UNITY SOFTWARE INC | 16,437 | 17.27 | 283,866.99 | |
| VERISIGN INC | 6,723 | 180.46 | 1,213,232.58 | |
| WIX.COM LTD | 5,010 | 169.60 | 849,696.00 | |
| WORKDAY INC-CLASS A | 16,432 | 215.56 | 3,542,081.92 | |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 20,869 | 62.84 | 1,311,407.96 | |
| ZSCALER INC | 7,204 | 180.99 | 1,303,851.96 | |
| AMPHENOL CORPORATION | 45,860 | 130.64 | 5,991,150.40 | |
| APPLE INC | 1,134,924 | 196.89 | 223,455,186.36 | |
| ARISTA NETWORKS INC | 20,702 | 296.79 | 6,144,146.58 | |
| CDW CORP/DE | 9,823 | 224.24 | 2,202,709.52 | |
| CISCO SYSTEMS | 312,372 | 45.84 | 14,319,132.48 | |
| CORNING | 66,604 | 36.93 | 2,459,685.72 | |
| DELL TECHNOLOGIES -C | 20,331 | 129.97 | 2,642,420.07 | |
| F5 INC | 4,851 | 165.57 | 803,180.07 | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS | 97,432 | 20.03 | 1,951,562.96 | |
| HP INC | 77,024 | 36.45 | 2,807,524.80 | |
| JABIL INC | 9,340 | 113.88 | 1,063,639.20 | |
| JUNIPER NETWORKS INC | 25,321 | 35.55 | 900,161.55 | |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 13,838 | 135.81 | 1,879,338.78 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 13,159 | 371.06 | 4,882,778.54 | |
| NETAPP INC | 15,191 | 120.98 | 1,837,807.18 | |
| PURE STORAGE INC - CLASS A | 23,875 | 64.94 | 1,550,442.50 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 14,548 | 96.11 | 1,398,208.28 | |
| SUPER MICRO COMPUTER INC | 4,216 | 769.11 | 3,242,567.76 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 23,161 | 149.17 | 3,454,926.37 | |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 3,320 | 389.06 | 1,291,679.20 | |
| TRIMBLE IMS HOLDINGS | 17,718 | 54.99 | 974,312.82 | |
| WESTERN DIGITAL CORP | 25,790 | 74.98 | 1,933,734.20 | |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 4,162 | 300.83 | 1,252,054.46 | |
| AT&T INC | 548,004 | 18.10 | 9,918,872.40 | |
| T-MOBILE US INC | 41,896 | 179.82 | 7,533,738.72 | |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 322,255 | 40.94 | 13,193,119.70 | |
| AES CORP | 54,375 | 19.87 | 1,080,431.25 | |
| ALLIANT ENERGY CORPORATION | 20,778 | 50.13 | 1,041,601.14 | |
| AMEREN CORPORATION | 20,898 | 71.07 | 1,485,220.86 | |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 40,720 | 88.30 | 3,595,576.00 | |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 14,468 | 128.25 | 1,855,521.00 | |
| ATMOS ENERGY CORP | 11,302 | 114.78 | 1,297,243.56 | |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 47,466 | 30.17 | 1,432,049.22 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CMS ENERGY CORP | 23,697 | 60.63 | 1,436,749.11 | |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 27,675 | 91.61 | 2,535,306.75 | |
| CONSTELLATION ENERGY | 23,831 | 198.00 | 4,718,538.00 | |
| DOMINION ENERGY INC | 62,863 | 51.44 | 3,233,672.72 | |
| DTE ENERGY COMPANY | 15,851 | 112.33 | 1,780,542.83 | |
| DUKE ENERGY CORP | 60,351 | 102.62 | 6,193,219.62 | |
| EDISON INTL | 30,900 | 73.98 | 2,285,982.00 | |
| ENTERGY CORP | 16,181 | 108.47 | 1,755,153.07 | |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 20,399 | 36.97 | 754,151.03 | |
| EVERGY INC | 18,475 | 52.96 | 978,436.00 | |
| EVERSOURCE ENERGY | 27,450 | 58.58 | 1,608,021.00 | |
| EXELON CORP | 81,573 | 36.17 | 2,950,495.41 | |
| FIRSTENERGY CORP | 39,425 | 38.82 | 1,530,478.50 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 160,662 | 75.39 | 12,112,308.18 | |
| NISOURCE INC | 32,351 | 28.28 | 914,886.28 | |
| NRG ENERGY INC | 13,109 | 77.89 | 1,021,060.01 | |
| PG&E CORP | 164,187 | 18.05 | 2,963,575.35 | |
| PPL CORPORATION | 58,459 | 28.41 | 1,660,820.19 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE | 40,266 | 72.88 | 2,934,586.08 | |
| SEMPRA | 49,744 | 75.33 | 3,747,215.52 | |
| SOUTHERN CO | 86,109 | 77.94 | 6,711,335.46 | |
| VISTRA CORP | 24,594 | 85.07 | 2,092,211.58 | |
| WEC ENERGY GROUP INC | 23,447 | 79.85 | 1,872,242.95 | |
| XCEL ENERGY INC | 41,562 | 54.74 | 2,275,103.88 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 124,711 | 167.87 | 20,935,235.57 | |
| ANALOG DEVICES | 37,792 | 234.77 | 8,872,427.84 | |
| APPLIED MATERIALS | 64,814 | 221.73 | 14,371,208.22 | |
| BROADCOM INC | 34,017 | 1,406.64 | 47,849,672.88 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 9,617 | 122.75 | 1,180,486.75 | |
| ENTEGRIS INC | 12,389 | 130.08 | 1,611,561.12 | |
| FIRST SOLAR INC | 7,921 | 267.34 | 2,117,600.14 | |
| INTEL CORP | 328,277 | 30.74 | 10,091,234.98 | |
| KLA CORP | 10,294 | 768.97 | 7,915,777.18 | |
| LAM RESEARCH CORP | 10,237 | 962.72 | 9,855,364.64 | |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | 10,978 | 60.77 | 667,133.06 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 67,749 | 67.99 | 4,606,254.51 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 40,718 | 92.85 | 3,780,666.30 | |
| MICRON TECHNOLOGY | 85,302 | 130.94 | 11,169,443.88 | |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 3,911 | 751.64 | 2,939,664.04 | |
| NVIDIA CORP | 193,375 | 1,208.88 | 233,767,170.00 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 19,310 | 271.89 | 5,250,195.90 | |
| ON SEMICONDUCTOR CORP | 32,011 | 72.31 | 2,314,715.41 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | QORVO INC | 8,678 | 99.49 | 863,374.22 | |
| | QUALCOMM | 85,755 | 206.62 | 17,718,698.10 | |
| | SKYWORKS SOLUTIONS INC | 11,242 | 90.81 | 1,020,886.02 | |
| | TERADYNE INC | 12,318 | 140.90 | 1,735,606.20 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS | 71,015 | 195.61 | 13,891,244.15 | |
| | CBRE GROUP INC-A | 22,995 | 85.63 | 1,969,061.85 | |
| | COSTAR GROUP INC | 33,027 | 76.21 | 2,516,987.67 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 98,700 | 3.42 | 337,554.00 | |
| | ZILLOW GROUP INC-C | 11,809 | 42.63 | 503,417.67 | |
| アメリカドル 小計 | | 26,237,810 | | 3,545,558,801.29<br>(556,688,187,390) | |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD | 38,058 | 25.04 | 952,972.32 | |
| | CAMECO CORP | 31,793 | 73.49 | 2,336,467.57 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 82,602 | 96.74 | 7,990,917.48 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 111,293 | 26.02 | 2,895,843.86 | |
| | ENBRIDGE | 166,986 | 49.21 | 8,217,381.06 | |
| | IMPERIAL OIL | 16,202 | 88.89 | 1,440,195.78 | |
| | KEYERA CORP | 18,607 | 36.61 | 681,202.27 | |
| | MEG ENERGY CORP | 13,934 | 28.31 | 394,471.54 | |
| | PARKLAND CORP | 7,149 | 39.11 | 279,597.39 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 45,941 | 50.97 | 2,341,612.77 | |
| | SUNCOR ENERGY | 98,973 | 52.25 | 5,171,339.25 | |
| | TC ENERGY CORP | 82,559 | 54.18 | 4,473,046.62 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 25,009 | 66.61 | 1,665,849.49 | |
| | AGNICO EAGLE MINES | 40,306 | 87.76 | 3,537,254.56 | |
| | BARRICK GOLD CORP | 133,727 | 22.23 | 2,972,751.21 | |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 9,322 | 72.06 | 671,743.32 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 65,267 | 16.92 | 1,104,317.64 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 15,641 | 161.83 | 2,531,183.03 | |
| | IVANHOE MINES LTD-CL A | 51,847 | 18.01 | 933,764.47 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 108,451 | 10.18 | 1,104,031.18 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 38,990 | 15.18 | 591,868.20 | |
| | NUTRIEN LTD | 37,152 | 76.24 | 2,832,468.48 | |
| | PAN AMERICAN SILVER CORP | 22,416 | 27.37 | 613,525.92 | |
| | TECK RESOURCES LTD-CL B | 35,386 | 67.68 | 2,394,924.48 | |
| | WEST FRASER TIMBER CO LTD | 3,505 | 107.34 | 376,226.70 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 36,991 | 72.35 | 2,676,298.85 | |
| | CAE INC | 25,999 | 25.44 | 661,414.56 | |
| | STANTEC INC | 9,001 | 112.99 | 1,017,022.99 | |
| | TOROMONT INDUSTRIES LTD | 5,213 | 120.22 | 626,706.86 | |
| | WSP GLOBAL INC | 9,951 | 207.96 | 2,069,409.96 | |
| | ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION | 32,579 | 24.90 | 811,217.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 12,609 | 50.14 | 632,215.26 | |
| RB GLOBAL INC | 14,445 | 100.00 | 1,444,500.00 | |
| THOMSON REUTERS CORP | 11,495 | 235.05 | 2,701,899.75 | |
| AIR CANADA | 13,805 | 17.79 | 245,590.95 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 42,237 | 170.91 | 7,218,725.67 | |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 73,125 | 106.29 | 7,772,456.25 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 5,837 | 193.75 | 1,130,918.75 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 20,254 | 60.19 | 1,219,088.26 | |
| BRP INC/CA- SUB VOTING | 3,070 | 86.17 | 264,541.90 | |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 9,820 | 52.77 | 518,201.40 | |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 23,073 | 94.61 | 2,182,936.53 | |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 4,513 | 138.69 | 625,907.97 | |
| DOLLARAMA INC | 22,000 | 127.12 | 2,796,640.00 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 57,865 | 80.14 | 4,637,301.10 | |
| EMPIRE CO LTD 'A' | 6,930 | 32.92 | 228,135.60 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 12,913 | 160.93 | 2,078,089.09 | |
| METRO INC | 18,840 | 75.19 | 1,416,579.60 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 5,226 | 195.26 | 1,020,428.76 | |
| SAPUTO INC | 20,898 | 29.84 | 623,596.32 | |
| BANK MONTREAL | 56,278 | 116.89 | 6,578,335.42 | |
| BANK NOVA SCOTIA | 97,216 | 64.60 | 6,280,153.60 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK | 71,075 | 67.39 | 4,789,744.25 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 27,646 | 117.74 | 3,255,040.04 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 109,143 | 146.35 | 15,973,078.05 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 136,393 | 76.45 | 10,427,244.85 | |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A | 29,001 | 52.20 | 1,513,852.20 | |
| BROOKFIELD CORP | 104,769 | 57.14 | 5,986,500.66 | |
| IGM FINANCIAL INC | 7,685 | 37.21 | 285,958.85 | |
| ONEX CORP | 6,603 | 96.75 | 638,840.25 | |
| TMX GROUP LTD | 23,425 | 37.00 | 866,725.00 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1,493 | 1,561.81 | 2,331,782.33 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 23,788 | 39.92 | 949,616.96 | |
| IA FINANCIAL CORP INC | 6,977 | 87.15 | 608,045.55 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 13,255 | 228.54 | 3,029,297.70 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 135,007 | 35.59 | 4,804,899.13 | |
| POWER CORP OF CANADA | 43,577 | 39.99 | 1,742,644.23 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 43,614 | 67.52 | 2,944,817.28 | |
| CGI INC - CL A | 16,084 | 139.38 | 2,241,787.92 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,553 | 3,841.84 | 5,966,377.52 | |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE | 6,984 | 125.42 | 875,933.28 | |
| OPEN TEXT CORP | 20,463 | 38.11 | 779,844.93 | |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 94,130 | 84.74 | 7,976,576.20 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BCE INC | 6,203 | 47.09 | 292,099.27 | |
| | QUEBECOR INC -CL B | 15,200 | 28.92 | 439,584.00 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 27,881 | 53.86 | 1,501,670.66 | |
| | TELUS CORP | 32,908 | 22.76 | 748,986.08 | |
| | ALTAGAS INCOME LTD | 24,395 | 31.11 | 758,928.45 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 11,295 | 41.77 | 471,792.15 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 10,324 | 31.31 | 323,244.44 | |
| | EMERA INC | 25,484 | 47.58 | 1,212,528.72 | |
| | FORTIS INC | 35,547 | 55.07 | 1,957,573.29 | |
| | HYDRO ONE LTD | 29,579 | 40.86 | 1,208,597.94 | |
| | NORTHLAND POWER INC | 17,854 | 24.05 | 429,388.70 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 2,690 | 205.96 | 554,032.40 | |
| カナダドル 小計 | | 3,115,324 | | 205,870,302.37<br>(23,481,566,688) | |
| ユーロ | ENI | 151,339 | 13.99 | 2,117,535.28 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 39,662 | 19.08 | 756,750.96 | |
| | NESTE OIL OYJ | 32,766 | 18.94 | 620,751.87 | |
| | OMV AG | 12,549 | 41.20 | 517,018.80 | |
| | REPSOL SA | 89,536 | 14.59 | 1,306,777.92 | |
| | TENARIS SA | 40,648 | 14.90 | 605,858.44 | |
| | TOTALENERGIES SE | 167,596 | 64.94 | 10,883,684.24 | |
| | AIR LIQUIDE | 40,571 | 187.28 | 7,598,136.88 | |
| | AKZO NOBEL | 12,357 | 62.10 | 767,369.70 | |
| | ARCELORMITTAL | 29,208 | 23.40 | 683,467.20 | |
| | ARKEMA | 4,369 | 89.55 | 391,243.95 | |
| | BASF SE | 70,406 | 46.80 | 3,295,000.80 | |
| | COVESTRO AG | 14,454 | 48.40 | 699,573.60 | |
| | DSM-FIRMENICH AG | 13,707 | 99.78 | 1,367,684.46 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 16,037 | 18.42 | 295,401.54 | |
| | HEIDELBERG MATERIALS AG | 10,765 | 95.52 | 1,028,272.80 | |
| | OCI NV | 7,248 | 24.80 | 179,750.40 | |
| | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 19,504 | 43.62 | 850,764.48 | |
| | STORA ENSO OYJ R | 42,169 | 12.78 | 538,919.82 | |
| | SYENSQO SA | 5,356 | 92.85 | 497,304.60 | |
| | SYMRISE AG | 10,018 | 110.15 | 1,103,482.70 | |
| | UMICORE | 17,605 | 16.43 | 289,250.15 | |
| | UPM KYMMENE OYJ | 42,324 | 34.02 | 1,439,862.48 | |
| | VOESTALPINE AG | 7,152 | 26.12 | 186,810.24 | |
| | ACS ACTIV. CONST. Y SVCS | 16,593 | 41.26 | 684,627.18 | |
| | AIRBUS SE | 46,092 | 150.00 | 6,913,800.00 | |
| | ALSTOM | 24,388 | 17.70 | 431,667.60 | |
| | BOUYGUES ORD | 16,606 | 34.64 | 575,231.84 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BRENNTAG SE | 9,500 | 65.18 | 619,210.00 | |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 39,278 | 38.38 | 1,507,489.64 | |
| DASSAULT AVIATION SA | 2,130 | 193.10 | 411,303.00 | |
| EIFFAGE | 5,924 | 99.60 | 590,030.40 | |
| FERROVIAL SE | 37,026 | 36.14 | 1,338,119.64 | |
| GEA GROUP AG | 13,382 | 37.96 | 507,980.72 | |
| IMCD NV | 4,641 | 140.75 | 653,220.75 | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 12,398 | 86.80 | 1,076,146.40 | |
| KNORR-BREMSE AG | 5,022 | 71.55 | 359,324.10 | |
| KONE OYJ-B | 26,369 | 47.20 | 1,244,616.80 | |
| LEGRAND SA | 19,340 | 98.50 | 1,904,990.00 | |
| LEONARDO SPA | 31,340 | 24.17 | 757,487.80 | |
| METSO CORPORATION | 51,970 | 10.88 | 565,433.60 | |
| MTU AERO ENGINES AG | 3,962 | 228.70 | 906,109.40 | |
| PRYSMIAN SPA | 21,155 | 58.52 | 1,237,990.60 | |
| RATIONAL AG | 483 | 799.50 | 386,158.50 | |
| REXEL SA | 17,411 | 27.05 | 470,967.55 | |
| RHEINMETALL AG | 3,203 | 532.80 | 1,706,558.40 | |
| SAFRAN SA | 26,619 | 208.60 | 5,552,723.40 | |
| SAINT-GOBAIN | 36,177 | 79.68 | 2,882,583.36 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 42,150 | 226.85 | 9,561,727.50 | |
| SIEMENS | 58,485 | 174.44 | 10,202,123.40 | |
| SIEMENS ENERGY AG | 47,513 | 23.02 | 1,093,749.26 | |
| THALES SA | 6,657 | 172.85 | 1,150,662.45 | |
| VINCI S.A. | 39,327 | 110.75 | 4,355,465.25 | |
| WARTSILA OYJ | 41,917 | 19.27 | 807,740.59 | |
| BUREAU VERITAS SA | 25,073 | 28.20 | 707,058.60 | |
| RANDSTAD NV | 10,680 | 47.48 | 507,086.40 | |
| TELEPERFORMANCE | 4,734 | 104.60 | 495,176.40 | |
| WOLTERS KLUWER | 19,155 | 149.55 | 2,864,630.25 | |
| ADP | 2,382 | 131.70 | 313,709.40 | |
| AENA SME SA | 5,508 | 184.70 | 1,017,327.60 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 45,343 | 6.29 | 285,479.52 | |
| DHL GROUP | 74,810 | 39.50 | 2,954,995.00 | |
| GETLINK | 21,115 | 16.48 | 348,080.77 | |
| INPOST SA | 15,470 | 16.91 | 261,597.70 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 24,617 | 91.18 | 2,244,578.06 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 4,991 | 86.35 | 430,972.85 | |
| CONTINENTAL AG | 8,168 | 61.04 | 498,574.72 | |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 10,254 | 75.38 | 772,946.52 | |
| FERRARI NV | 10,026 | 382.80 | 3,837,952.80 | |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 63,436 | 65.11 | 4,130,317.96 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MICHELIN | 49,034 | 37.64 | 1,845,639.76 | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 11,745 | 49.44 | 580,672.80 | |
| RENAULT SA | 17,081 | 51.22 | 874,888.82 | |
| STELLANTIS NV | 166,407 | 20.19 | 3,359,757.33 | |
| VOLKSWAGEN AG-PFD | 15,328 | 112.60 | 1,725,932.80 | |
| VOLKSWAGEN STAMM | 2,486 | 124.70 | 310,004.20 | |
| ADIDAS AG | 12,783 | 231.00 | 2,952,873.00 | |
| HERMES INTERNATIONAL | 2,420 | 2,201.00 | 5,326,420.00 | |
| KERING | 5,534 | 328.10 | 1,815,705.40 | |
| LVMH | 21,429 | 762.50 | 16,339,612.50 | |
| MONCLER SPA | 18,908 | 61.46 | 1,162,085.68 | |
| PUMA SE | 9,220 | 47.47 | 437,673.40 | |
| SEB SA | 2,282 | 110.40 | 251,932.80 | |
| ACCOR | 14,436 | 38.96 | 562,426.56 | |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS | 36,772 | 67.64 | 2,487,258.08 | |
| DELIVERY HERO SE | 13,414 | 28.38 | 380,689.32 | |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 8,108 | 33.18 | 269,023.44 | |
| SODEXO | 6,173 | 87.75 | 541,680.75 | |
| BOLLORE SE | 31,761 | 6.17 | 195,965.37 | |
| CTS EVENTIM AG & CO KGAA | 4,827 | 82.80 | 399,675.60 | |
| PUBLICIS GROUPE | 17,217 | 103.35 | 1,779,376.95 | |
| SCOUT24 SE | 7,536 | 71.95 | 542,215.20 | |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 65,826 | 28.23 | 1,858,267.98 | |
| VIVENDI SE | 61,243 | 9.93 | 608,387.96 | |
| D'IETEREN GROUP | 2,217 | 201.40 | 446,503.80 | |
| INDITEX | 87,257 | 45.67 | 3,985,027.19 | |
| PROSUS | 112,590 | 33.91 | 3,818,489.85 | |
| ZALANDO SE | 17,664 | 23.42 | 413,690.88 | |
| CARREFOUR | 39,746 | 14.86 | 590,625.56 | |
| JERONIMO MARTINS | 21,861 | 19.96 | 436,345.56 | |
| KESKO OYJ-B SHS | 20,083 | 16.23 | 325,947.09 | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 70,900 | 28.08 | 1,990,872.00 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 68,097 | 57.80 | 3,936,006.60 | |
| DANONE (GROUPE) | 51,810 | 60.02 | 3,109,636.20 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 33,863 | 9.75 | 330,299.70 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 9,512 | 76.55 | 728,143.60 | |
| HEINEKEN NV | 23,160 | 94.50 | 2,188,620.00 | |
| JDE PEET'S BV | 7,000 | 20.62 | 144,340.00 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 10,913 | 77.30 | 843,574.90 | |
| LOTUS BAKERIES | 38 | 9,840.00 | 373,920.00 | |
| PERNOD-RICARD | 15,339 | 137.45 | 2,108,345.55 | |
| REMY COINTREAU | 1,032 | 83.70 | 86,378.40 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| BEIERSDORF AG | 7,430 | 145.05 | 1,077,721.50 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 8,780 | 74.75 | 656,305.00 | |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD | 11,880 | 84.54 | 1,004,335.20 | |
| LOREAL | 18,546 | 455.35 | 8,444,921.10 | |
| AMPLIFON SPA | 11,650 | 34.00 | 396,100.00 | |
| BIOMERIEUX | 3,044 | 93.80 | 285,527.20 | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR | 3,430 | 85.15 | 292,064.50 | |
| DIASORIN ITALIA SPA | 2,070 | 101.55 | 210,208.50 | |
| ESSILORLUXOTTICA | 22,901 | 208.80 | 4,781,728.80 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG | 16,985 | 39.75 | 675,153.75 | |
| FRESENIUS SE&CO KGAA | 33,689 | 30.30 | 1,020,776.70 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS | 66,646 | 24.38 | 1,624,829.48 | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 21,567 | 55.10 | 1,188,341.70 | |
| ARGENX SE | 4,935 | 354.60 | 1,749,951.00 | |
| BAYER | 78,462 | 28.09 | 2,203,997.58 | |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 10,220 | 54.92 | 561,282.40 | |
| GRIFOLS SA | 27,685 | 9.34 | 258,799.38 | |
| IPSEN | 3,532 | 122.90 | 434,082.80 | |
| MERCK KGAA | 10,703 | 171.30 | 1,833,423.90 | |
| ORION OYJ-CLASS B | 10,139 | 38.94 | 394,812.66 | |
| QIAGEN N.V. | 16,526 | 41.32 | 682,936.95 | |
| RECORDATI SPA | 6,099 | 49.70 | 303,120.30 | |
| SANOFI | 87,091 | 91.13 | 7,936,602.83 | |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 1,824 | 244.00 | 445,056.00 | |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 2,582 | 184.65 | 476,766.30 | |
| UCB (GROUPE) | 9,389 | 130.00 | 1,220,570.00 | |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 26,474 | 15.98 | 423,186.89 | |
| AIB GROUP PLC | 145,826 | 5.12 | 747,358.25 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA | 448,899 | 9.89 | 4,441,406.70 | |
| BANCO BPM SPA | 118,197 | 6.50 | 768,989.68 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 420,800 | 1.92 | 808,356.80 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,223,031 | 4.73 | 5,789,828.75 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 88,378 | 10.21 | 902,339.38 | |
| BNP PARIBAS | 81,615 | 66.37 | 5,416,787.55 | |
| CAIXABANK | 275,085 | 5.26 | 1,446,947.10 | |
| COMMERZBANK AG | 81,889 | 15.57 | 1,275,421.17 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 87,162 | 14.64 | 1,276,051.68 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 25,376 | 44.93 | 1,140,143.68 | |
| FINECOBANK SPA | 41,585 | 14.78 | 614,834.22 | |
| ING GROEP NV-CVA | 256,546 | 16.38 | 4,203,762.75 | |
| INTESA SANPAOLO | 1,145,097 | 3.58 | 4,107,462.93 | |
| KBC GROEP NV | 18,057 | 66.42 | 1,199,345.94 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| MEDIOBANCA | 33,860 | 14.34 | 485,721.70 | |
| NORDEA BANK ABP | 236,636 | 11.28 | 2,670,437.26 | |
| SOCIETE GENERALE | 53,019 | 26.02 | 1,379,554.38 | |
| UNICREDIT SPA | 116,219 | 36.57 | 4,250,128.83 | |
| ADYEN NV | 1,609 | 1,231.80 | 1,981,966.20 | |
| AMUNDI SA | 4,626 | 65.95 | 305,084.70 | |
| DEUTSCHE BANK NAMEN | 140,740 | 15.29 | 2,152,759.04 | |
| DEUTSCHE BOERSE | 14,123 | 187.95 | 2,654,417.85 | |
| EDENRED | 20,131 | 46.30 | 932,065.30 | |
| EURAZEO SA | 3,357 | 75.60 | 253,789.20 | |
| EURONEXT NV | 6,480 | 93.90 | 608,472.00 | |
| EXOR NV | 7,825 | 99.80 | 780,935.00 | |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 8,515 | 69.35 | 590,515.25 | |
| NEXI SPA | 48,458 | 6.18 | 299,761.18 | |
| SOFINA | 1,238 | 218.00 | 269,884.00 | |
| AEGON LTD | 101,846 | 5.94 | 605,576.31 | |
| AGEAS | 11,086 | 43.80 | 485,566.80 | |
| ALLIANZ SE-REG | 30,116 | 261.50 | 7,875,334.00 | |
| ASR NEDERLAND NV | 11,959 | 45.69 | 546,406.71 | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 84,111 | 23.79 | 2,001,000.69 | |
| AXA SA | 136,349 | 33.18 | 4,524,059.82 | |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 4,455 | 234.50 | 1,044,697.50 | |
| MUENCHENER RUECKVERSICH. | 10,414 | 462.00 | 4,811,268.00 | |
| NN GROUP NV | 22,941 | 42.57 | 976,598.37 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 24,923 | 12.79 | 318,889.78 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 33,132 | 40.40 | 1,338,532.80 | |
| TALANX AG | 5,053 | 75.00 | 378,975.00 | |
| BECHTLE AG | 7,659 | 46.74 | 357,981.66 | |
| CAPGEMINI SA | 12,235 | 195.25 | 2,388,883.75 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 49,547 | 37.14 | 1,840,175.58 | |
| NEMETSCHEK SE | 5,455 | 93.95 | 512,497.25 | |
| SAP SE | 81,129 | 177.36 | 14,389,039.44 | |
| NOKIA OYJ | 396,129 | 3.62 | 1,434,977.30 | |
| CELLNEX TELECOM SA | 34,475 | 33.63 | 1,159,394.25 | |
| DEUTSCHE TELEKOM | 253,485 | 22.59 | 5,726,226.15 | |
| ELISA A | 10,227 | 43.72 | 447,124.44 | |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 30,375 | 9.85 | 299,193.75 | |
| KPN (KON.) | 290,883 | 3.51 | 1,020,999.33 | |
| ORANGE | 153,281 | 10.06 | 1,542,006.86 | |
| TELECOM ITALIA ORD | 852,552 | 0.23 | 201,799.05 | |
| TELEFONICA | 373,259 | 4.37 | 1,634,127.90 | |
| ACCIONA SA | 2,181 | 118.60 | 258,666.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | E.ON SE | 166,881 | 12.33 | 2,057,642.73 | |
| | EDP RENOVAVEIS SA | 21,752 | 14.38 | 312,793.76 | |
| | ELIA GROUP SA/NV | 987 | 93.50 | 92,284.50 | |
| | ENDESA | 25,972 | 18.43 | 478,793.82 | |
| | ENEL | 640,374 | 6.71 | 4,296,909.54 | |
| | ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 235,657 | 3.70 | 873,580.49 | |
| | ENGIE | 146,393 | 15.00 | 2,195,895.00 | |
| | FORTUM OYJ | 32,550 | 13.88 | 451,794.00 | |
| | IBERDROLA SA | 447,152 | 12.17 | 5,444,075.60 | |
| | REDEIA CORP SA | 30,678 | 16.98 | 520,912.44 | |
| | RWE STAMM | 52,507 | 34.18 | 1,794,689.26 | |
| | SNAM SPA | 147,559 | 4.38 | 646,751.09 | |
| | TERNA SPA | 95,819 | 7.73 | 741,064.14 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 49,781 | 30.94 | 1,540,224.14 | |
| | VERBUND AG | 6,430 | 75.70 | 486,751.00 | |
| | ASM INTERNATIONAL NV | 3,856 | 687.40 | 2,650,614.40 | |
| | ASML HOLDING NV | 30,793 | 958.90 | 29,527,407.70 | |
| | BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES | 6,357 | 147.75 | 939,246.75 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES | 96,562 | 38.01 | 3,670,321.62 | |
| | STMICROELECTRONICS NV | 50,286 | 41.40 | 2,082,091.83 | |
| | LEG IMMOBILIEN SE | 5,275 | 76.50 | 403,537.50 | |
| | VONOVIA SE | 61,810 | 26.68 | 1,649,090.80 | |
| ユーロ 小計 | | 14,208,564 | | 407,924,931.66<br>(69,033,136,184) | |
| イギリスポンド | BP PLC | 1,315,261 | 4.62 | 6,085,712.64 | |
| | SHELL PLC-NEW | 491,663 | 27.32 | 13,434,691.47 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 101,769 | 23.82 | 2,424,646.42 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 29,856 | 21.45 | 640,411.20 | |
| | CRH PLC | 52,103 | 60.80 | 3,167,862.40 | |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 10,924 | 43.19 | 471,807.56 | |
| | ENDEAVOUR MINING PLC | 17,604 | 16.52 | 290,818.08 | |
| | GLENCORE PLC | 793,369 | 4.69 | 3,726,850.87 | |
| | MONDI PLC | 37,918 | 15.04 | 570,476.31 | |
| | RIO TINTO PLC REG | 88,047 | 53.52 | 4,712,275.44 | |
| | ASHTEAD GROUP PLC | 33,317 | 55.58 | 1,851,758.86 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 240,047 | 13.95 | 3,348,655.65 | |
| | BUNZL PLC | 29,337 | 29.46 | 864,268.02 | |
| | DCC PLC | 6,622 | 56.35 | 373,149.70 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 101,116 | 6.20 | 626,919.20 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 635,909 | 4.56 | 2,905,468.22 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 26,476 | 17.32 | 458,564.32 | |
| | SPIRAX GROUP PLC | 5,514 | 88.15 | 486,059.10 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EXPERIAN PLC | 68,159 | 36.63 | 2,496,664.17 | |
| INTERTEK GROUP PLC | 13,890 | 48.40 | 672,276.00 | |
| RELX PLC | 145,542 | 35.31 | 5,139,088.02 | |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 181,834 | 4.21 | 766,248.47 | |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 73,202 | 5.01 | 366,742.02 | |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE | 6,952 | 51.95 | 361,156.40 | |
| BURBERRY GROUP PLC | 29,776 | 10.32 | 307,288.32 | |
| PERSIMMON PLC | 25,686 | 14.41 | 370,263.69 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 264,104 | 1.49 | 395,231.63 | |
| COMPASS GROUP PLC | 129,701 | 22.40 | 2,905,302.40 | |
| ENTAIN PLC | 49,630 | 7.16 | 355,549.32 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 13,042 | 148.10 | 1,931,520.20 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 13,833 | 79.38 | 1,098,063.54 | |
| PEARSON | 55,305 | 9.61 | 531,923.49 | |
| WHITBREAD PLC | 17,434 | 30.24 | 527,204.16 | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 72,462 | 8.19 | 593,463.78 | |
| INFORMA PLC | 110,598 | 8.32 | 921,060.14 | |
| WPP PLC | 85,821 | 7.72 | 662,709.76 | |
| JD SPORTS FASHION PLC | 206,825 | 1.25 | 259,565.37 | |
| KINGFISHER PLC | 153,717 | 2.61 | 402,584.82 | |
| NEXT PLC | 8,464 | 92.46 | 782,581.44 | |
| SAINSBURY (J) PLC | 148,335 | 2.63 | 391,307.73 | |
| TESCO PLC | 525,585 | 3.07 | 1,616,699.46 | |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 25,740 | 25.60 | 658,944.00 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO | 157,980 | 24.37 | 3,849,972.60 | |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 17,960 | 27.04 | 485,638.40 | |
| DIAGEO | 174,682 | 26.70 | 4,664,009.40 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 68,478 | 19.87 | 1,360,657.86 | |
| HALEON PLC | 530,525 | 3.30 | 1,752,324.07 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 56,621 | 45.06 | 2,551,342.26 | |
| UNILEVER PLC | 193,307 | 43.96 | 8,497,775.72 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 68,595 | 10.38 | 712,016.10 | |
| ASTRAZENECA | 120,005 | 125.56 | 15,067,827.80 | |
| GSK PLC | 319,416 | 16.29 | 5,203,286.64 | |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 17,910 | 19.49 | 349,065.90 | |
| BARCLAYS | 1,129,529 | 2.17 | 2,453,901.75 | |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB) | 1,446,594 | 6.94 | 10,048,041.92 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,828,476 | 0.54 | 2,646,004.84 | |
| NATWEST GROUP PLC | 506,122 | 3.16 | 1,603,900.61 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 161,358 | 7.46 | 1,203,730.68 | |
| 3I GROUP PLC | 74,757 | 29.26 | 2,187,389.82 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 33,079 | 10.58 | 350,141.21 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 35,214 | 94.32 | 3,321,384.48 | |
| | M&G PLC | 131,539 | 1.98 | 260,841.83 | |
| | SCHRODERS PLC | 39,932 | 3.84 | 153,658.33 | |
| | WISE PLC - A | 49,048 | 8.54 | 418,869.92 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 16,255 | 27.30 | 443,761.50 | |
| | AVIVA PLC | 193,334 | 4.77 | 923,943.18 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP | 498,200 | 2.49 | 1,241,016.20 | |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 51,001 | 4.91 | 250,618.91 | |
| | PRUDENTIAL | 212,226 | 7.31 | 1,552,645.41 | |
| | SAGE GROUP PLC | 76,660 | 10.60 | 812,596.00 | |
| | HALMA PLC | 31,069 | 22.96 | 713,344.24 | |
| | BT GROUP PLC | 464,863 | 1.32 | 613,851.59 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,645,717 | 0.71 | 1,177,016.79 | |
| | CENTRICA PLC | 453,631 | 1.33 | 605,370.56 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 371,439 | 8.69 | 3,228,547.78 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 17,468 | 24.10 | 420,978.80 | |
| | SSE PLC | 81,692 | 17.87 | 1,459,836.04 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 50,580 | 10.10 | 511,110.90 | |
| イギリスポンド 小計 | | 20,767,751 | | 154,050,253.83<br>(30,766,916,694) | |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 17,398 | 13.92 | 242,180.16 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 574 | 732.50 | 420,455.00 | |
| | GIVAUDAN-REG | 742 | 4,314.00 | 3,200,988.00 | |
| | HOLCIM LTD | 38,804 | 79.98 | 3,103,543.92 | |
| | SIG GROUP AG | 26,203 | 17.45 | 457,242.35 | |
| | SIKA AG-BR | 12,257 | 270.90 | 3,320,421.30 | |
| | ABB LTD | 124,889 | 50.44 | 6,299,401.16 | |
| | GEBERIT AG-REG | 2,530 | 550.80 | 1,393,524.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 2,048 | 230.50 | 472,064.00 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 3,092 | 235.00 | 726,620.00 | |
| | VAT GROUP AG | 1,956 | 489.70 | 957,853.20 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 14,856 | 33.28 | 494,407.68 | |
| | SGS SA | 12,959 | 83.90 | 1,087,260.10 | |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 3,781 | 268.60 | 1,015,576.60 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD) | 40,975 | 150.10 | 6,150,347.50 | |
| | SWATCH GROUP AG(BEARER) | 2,483 | 188.85 | 468,914.55 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-REG | 3,938 | 37.00 | 145,706.00 | |
| | AVOLTA AG | 7,820 | 36.62 | 286,368.40 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 280 | 1,565.00 | 438,200.00 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 8 | 108,800.00 | 870,400.00 | |
| | LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 82 | 10,740.00 | 880,680.00 | |
| | NESTLE SA - REGISTERED | 205,438 | 98.02 | 20,137,032.76 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ALCON INC | 38,399 | 82.16 | 3,154,861.84 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 3,887 | 288.40 | 1,121,010.80 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 8,540 | 116.75 | 997,045.00 | |
| | BACHEM HOLDING AG-REG B | 1,850 | 78.45 | 145,132.50 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 5,536 | 500.20 | 2,769,107.20 | |
| | NOVARTIS | 152,401 | 94.95 | 14,470,474.95 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BR | 2,215 | 268.80 | 595,392.00 | |
| | ROCHE HOLDING GENUSS | 54,075 | 242.60 | 13,118,595.00 | |
| | SANDOZ GROUP AG | 30,458 | 32.18 | 980,138.44 | |
| | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 2,487 | 96.20 | 239,249.40 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 15,289 | 51.32 | 784,631.48 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,825 | 1,165.00 | 2,126,125.00 | |
| | UBS GROUP AG | 249,657 | 28.42 | 7,095,251.94 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 4,264 | 155.70 | 663,904.80 | |
| | HELVETIA HOLDING AG-REG | 2,955 | 121.20 | 358,146.00 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 2,119 | 637.40 | 1,350,650.60 | |
| | SWISS RE LTD | 24,330 | 113.65 | 2,765,104.50 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 11,440 | 479.60 | 5,486,624.00 | |
| | TEMENOS AG - REG | 5,150 | 61.40 | 316,210.00 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 12,006 | 90.94 | 1,091,825.64 | |
| | SWISSCOM | 1,856 | 503.50 | 934,496.00 | |
| | BKW AG | 1,744 | 143.40 | 250,089.60 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 5,679 | 84.00 | 477,036.00 | |
| スイスフラン 小計 | | 1,161,275 | | 113,860,289.37<br>(19,932,382,257) | |
| スウェーデンクローナ | BOLIDEN AB | 22,252 | 352.00 | 7,832,704.00 | |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 5,383 | 429.00 | 2,309,307.00 | |
| | SCA SV CELLULOSA B | 34,763 | 157.10 | 5,461,267.30 | |
| | ALFA LAVAL AB | 25,134 | 480.80 | 12,084,427.20 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 75,977 | 309.50 | 23,514,881.50 | |
| | ATLAS COPCO A | 207,097 | 204.40 | 42,330,626.80 | |
| | ATLAS COPCO B | 114,624 | 176.50 | 20,231,136.00 | |
| | BEIJER REF AB | 26,868 | 170.20 | 4,572,933.60 | |
| | EPIROC AB-A | 53,479 | 218.10 | 11,663,769.90 | |
| | EPIROC AB-B | 28,804 | 199.00 | 5,731,996.00 | |
| | HUSQVARNA AB-B SHS | 38,712 | 85.68 | 3,316,844.16 | |
| | INDUTRADE AB | 22,644 | 275.40 | 6,236,157.60 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 14,002 | 297.40 | 4,164,194.80 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 17,970 | 283.60 | 5,096,292.00 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 122,848 | 50.72 | 6,230,850.56 | |
| | SAAB AB-B | 25,552 | 272.20 | 6,955,254.40 | |
| | SANDVIK AB | 87,594 | 224.80 | 19,691,131.20 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SKANSKA B | 25,507 | 184.10 | 4,695,838.70 | |
| | SKF AB-B | 21,050 | 225.60 | 4,748,880.00 | |
| | TRELLEBORG AB-B SHS | 16,653 | 417.80 | 6,957,623.40 | |
| | VOLVO AB-A SHS | 13,514 | 281.80 | 3,808,245.20 | |
| | VOLVO B | 124,872 | 275.20 | 34,364,774.40 | |
| | SECURITAS B | 28,375 | 108.65 | 3,082,943.75 | |
| | VOLVO CAR AB-B | 49,839 | 35.71 | 1,779,999.88 | |
| | EVOLUTION AB | 13,186 | 1,130.00 | 14,900,180.00 | |
| | HENNES & MAURITZ B | 40,961 | 187.20 | 7,667,899.20 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 49,474 | 283.60 | 14,030,826.40 | |
| | GETINGE AB-B SHS | 17,796 | 188.70 | 3,358,105.20 | |
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 14,335 | 281.00 | 4,028,135.00 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A | 114,218 | 152.45 | 17,412,534.10 | |
| | SVENSKA HANDELSBK A | 120,736 | 100.20 | 12,097,747.20 | |
| | SWEDBANK AB-A | 71,421 | 220.20 | 15,726,904.20 | |
| | EQT AB | 31,471 | 314.80 | 9,907,070.80 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 11,818 | 367.60 | 4,344,296.80 | |
| | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 11,168 | 366.20 | 4,089,721.60 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 128,538 | 288.80 | 37,121,774.40 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 7,280 | 533.50 | 3,883,880.00 | |
| | ERICSSON (LM) B | 214,689 | 66.20 | 14,212,411.80 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 172,099 | 117.80 | 20,273,262.20 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 46,762 | 103.60 | 4,844,543.20 | |
| | TELIA CO AB | 123,760 | 27.26 | 3,373,697.60 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 56,700 | 69.50 | 3,940,650.00 | |
| | SAGAX AB-B | 17,402 | 272.00 | 4,733,344.00 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 2,467,327 | | 446,809,063.05<br>(6,644,050,767) | |
| ノルウェークローネ | AKER BP ASA | 29,320 | 258.80 | 7,588,016.00 | |
| | EQUINOR ASA | 66,436 | 298.15 | 19,807,893.40 | |
| | NORSK HYDRO | 100,517 | 67.70 | 6,805,000.90 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 12,498 | 316.30 | 3,953,117.40 | |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 5,304 | 932.00 | 4,943,328.00 | |
| | MOWI ASA | 31,968 | 187.50 | 5,994,000.00 | |
| | ORKLA | 39,191 | 88.15 | 3,454,686.65 | |
| | SALMAR ASA | 5,423 | 601.00 | 3,259,223.00 | |
| | DNB BANK ASA | 71,795 | 202.50 | 14,538,487.50 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 18,574 | 185.20 | 3,439,904.80 | |
| | TELENOR ASA | 51,193 | 125.90 | 6,445,198.70 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 432,219 | | 80,228,856.35<br>(1,173,748,168) | |
| | NOVONESIS (NOVOZYMES) B | 30,112 | 422.00 | 12,707,264.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| デンマーククローネ | ROCKWOOL A/S-B SHS | 755 | 2,832.00 | 2,138,160.00 | |
| | VESTAS WIND SYSYEMS A/S | 83,415 | 188.40 | 15,715,386.00 | |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 219 | 11,850.00 | 2,595,150.00 | |
| | A P MOLLER-MAERSK A/S-B | 306 | 12,175.00 | 3,725,550.00 | |
| | DSV A/S | 12,386 | 1,109.50 | 13,742,267.00 | |
| | PANDORA A/S | 6,512 | 1,118.50 | 7,283,672.00 | |
| | CARLSBERG AS-B | 6,810 | 969.40 | 6,601,614.00 | |
| | COLOPLAST-B | 9,737 | 840.80 | 8,186,869.60 | |
| | DEMANT A/S | 8,512 | 334.00 | 2,843,008.00 | |
| | GENMAB A/S | 4,878 | 1,930.00 | 9,414,540.00 | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 253,029 | 984.00 | 248,980,536.00 | |
| | DANSKE BANK A/S | 53,617 | 210.70 | 11,297,101.90 | |
| | TRYG A/S | 29,772 | 144.30 | 4,296,099.60 | |
| | ORSTED A/S | 12,910 | 397.40 | 5,130,434.00 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 512,970 | | 354,657,652.10<br>(8,043,635,549) | |
| オーストラリアドル | AMPOL LTD | 20,629 | 34.46 | 710,875.34 | |
| | SANTOS | 224,634 | 7.55 | 1,695,986.70 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 141,135 | 27.21 | 3,840,283.35 | |
| | BHP GROUP LTD | 388,318 | 44.53 | 17,291,800.54 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 34,770 | 21.14 | 735,037.80 | |
| | FORTESCUE LTD | 137,312 | 24.37 | 3,346,293.44 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 30,758 | 46.44 | 1,428,401.52 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 14,409 | 68.63 | 988,889.67 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 88,682 | 14.56 | 1,291,209.92 | |
| | ORICA LTD | 38,288 | 18.27 | 699,521.76 | |
| | PILBARA MINERALS LTD | 209,485 | 3.65 | 764,620.25 | |
| | RIO TINTO LTD | 28,272 | 125.31 | 3,542,764.32 | |
| | SOUTH32 LTD | 346,773 | 3.87 | 1,342,011.51 | |
| | REECE LTD | 16,814 | 25.98 | 436,827.72 | |
| | SEVEN GROUP HOLDINGS LTD | 12,630 | 40.17 | 507,347.10 | |
| | BRAMBLES LTD | 108,007 | 14.65 | 1,582,302.55 | |
| | COMPUTERSHARE LIMITED | 44,376 | 27.15 | 1,204,808.40 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 119,591 | 3.77 | 450,858.07 | |
| | QANTAS AIRWAYS LIMITED | 85,000 | 6.20 | 527,000.00 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 224,973 | 12.80 | 2,879,654.40 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 46,210 | 47.18 | 2,180,187.80 | |
| | LOTTERY CORP LTD/THE | 182,013 | 5.17 | 941,007.21 | |
| | CAR GROUP LTD | 29,334 | 36.63 | 1,074,504.42 | |
| | REA GROUP LTD | 3,586 | 188.41 | 675,638.26 | |
| | SEEK LTD | 28,001 | 23.19 | 649,343.19 | |
| | WESFARMERS LTD | 82,500 | 67.14 | 5,539,050.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | COLES GROUP LTD | 108,486 | 16.98 | 1,842,092.28 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 109,901 | 5.12 | 562,693.12 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 92,071 | 32.44 | 2,986,783.24 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 63,960 | 12.07 | 771,997.20 | |
| | COCHLEAR LIMITED | 4,783 | 332.07 | 1,588,290.81 | |
| | PRO MEDICUS LTD | 3,708 | 125.87 | 466,725.96 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 12,107 | 49.30 | 596,875.10 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 41,829 | 24.98 | 1,044,888.42 | |
| | CSL LIMITED | 37,640 | 289.00 | 10,877,960.00 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 238,423 | 29.18 | 6,957,183.14 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUST | 130,513 | 125.55 | 16,385,907.15 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 240,813 | 35.23 | 8,483,841.99 | |
| | WESTPAC BANKING | 276,117 | 26.97 | 7,446,875.49 | |
| | ASX LTD | 14,549 | 64.32 | 935,791.68 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 28,241 | 196.27 | 5,542,861.07 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 13,812 | 32.00 | 441,984.00 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GRP. | 166,662 | 6.56 | 1,093,302.72 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 232,183 | 3.79 | 879,973.57 | |
| | QBE INSURANCE GROUP | 127,819 | 18.58 | 2,374,877.02 | |
| | SUNCORP GROUP LIMITED | 94,864 | 16.53 | 1,568,101.92 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 13,801 | 100.08 | 1,381,204.08 | |
| | XERO LTD | 11,340 | 129.29 | 1,466,148.60 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 308,467 | 3.56 | 1,098,142.52 | |
| | ORIGIN ENERGY LIMITED | 155,535 | 10.35 | 1,609,787.25 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 5,214,124 | | 134,730,513.57<br>(13,908,230,915) | |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 82,461 | 7.67 | 632,475.87 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 39,980 | 30.00 | 1,199,400.00 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 132,957 | 4.07 | 541,134.99 | |
| | MERCURY NZ LTD | 64,613 | 6.65 | 429,676.45 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 110,544 | 6.30 | 696,427.20 | |
| ニュージーランドドル 小計 | | 430,555 | | 3,499,114.51<br>(335,180,178) | |
| 香港ドル | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 175,996 | 38.65 | 6,802,245.40 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 107,000 | 97.05 | 10,384,350.00 | |
| | MTR CORP | 125,000 | 25.90 | 3,237,500.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 120,000 | 21.55 | 2,586,000.00 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 174,000 | 40.00 | 6,960,000.00 | |
| | SANDS CHINA LTD | 198,000 | 18.58 | 3,678,840.00 | |
| | WH GROUP LTD | 658,301 | 5.32 | 3,502,161.32 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS -R | 281,500 | 24.95 | 7,023,425.00 | |
| | HANG SENG BANK | 59,400 | 108.20 | 6,427,080.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 96,300 | 270.80 | 26,078,040.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 864,200 | 58.35 | 50,426,070.00 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 37,500 | 45.60 | 1,710,000.00 | |
| | CLP HOLDINGS | 136,500 | 65.60 | 8,954,400.00 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 904,657 | 5.91 | 5,346,522.87 | |
| | POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 112,000 | 44.05 | 4,933,600.00 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 121,996 | 30.45 | 3,714,778.20 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMEN | 125,228 | 22.75 | 2,848,937.00 | |
| | SINO LAND CO | 315,400 | 8.48 | 2,674,592.00 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 105,000 | 73.60 | 7,728,000.00 | |
| | SWIRE PACIFIC A | 44,500 | 68.35 | 3,041,575.00 | |
| | SWIRE PROPERTIES LTD | 96,200 | 13.98 | 1,344,876.00 | |
| | WHARF HOLDINGS | 84,000 | 23.05 | 1,936,200.00 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 123,000 | 22.10 | 2,718,300.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 5,065,678 | | 174,057,492.79<br>(3,498,555,605) | |
| シンガポールドル | KEPPEL LTD | 112,800 | 6.63 | 747,864.00 | |
| | SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING | 147,400 | 4.09 | 602,866.00 | |
| | SINGAPORE AIRLINES | 108,332 | 6.80 | 736,657.60 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 292,800 | 0.89 | 260,592.00 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 178,600 | 3.10 | 553,660.00 | |
| | DBS GROUP | 155,760 | 35.52 | 5,532,595.20 | |
| | OCBC BANK | 257,100 | 14.27 | 3,668,817.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 94,000 | 30.76 | 2,891,440.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 66,000 | 9.67 | 638,220.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 622,143 | 2.52 | 1,567,800.36 | |
| | SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 84,100 | 5.06 | 425,546.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 260,100 | 2.64 | 686,664.00 | |
| シンガポールドル 小計 | | 2,379,135 | | 18,312,722.16<br>(2,125,374,533) | |
| イスラエルシェケル | ICL LTD | 59,427 | 17.27 | 1,026,304.29 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2,146 | 690.00 | 1,480,740.00 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 98,310 | 33.15 | 3,258,976.50 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 112,512 | 30.90 | 3,476,620.80 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 99,500 | 18.76 | 1,866,620.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 12,503 | 131.50 | 1,644,144.50 | |
| | NICE LTD | 4,991 | 644.50 | 3,216,699.50 | |
| | AZRIELI GROUP | 1,537 | 218.80 | 336,295.60 | |
| イスラエルシェケル 小計 | | 390,926 | | 16,306,401.19<br>(680,924,331) | |
| 合　計 | | 82,383,658 | | 736,311,889,259<br>(736,311,889,259) | |

**(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 | －<br>(－) | |
| 新株予約権証券合計 | | | | －<br>(－) | |
| 投資信託受益証券 | オーストラリアドル | APA GROUP | 83,290 | 714,628.20 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 83,290 | 714,628.20<br>(73,771,069) | |
| | 香港ドル | HKT TRUST AND HKT LTD | 315,000 | 2,762,550.00 | |
| | 香港ドル 小計 | | 315,000 | 2,762,550.00<br>(55,527,255) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 398,290 | 129,298,324<br>(129,298,324) | |
| 投資証券 | アメリカドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 12,503 | 1,431,468.47 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 24,974 | 890,323.10 | |
| | | AMERICAN TOWER CORPORATION | 36,290 | 7,049,695.40 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 37,402 | 738,315.48 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,673 | 2,302,032.33 | |
| | | BOSTON PROPERTIES | 11,259 | 667,208.34 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,749 | 826,740.81 | |
| | | CROWN CASTLE INC | 33,735 | 3,394,415.70 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 23,348 | 3,416,979.80 | |
| | | EQUINIX INC | 7,333 | 5,524,608.87 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 14,090 | 877,384.30 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 25,885 | 1,684,336.95 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST | 5,205 | 1,395,304.35 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 15,693 | 2,324,133.30 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 18,095 | 790,570.55 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 54,765 | 1,056,416.85 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 56,773 | 1,011,127.13 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 45,008 | 1,575,730.08 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 23,326 | 1,993,673.22 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 47,897 | 899,984.63 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 9,195 | 1,256,588.70 | |
| | | PROLOGIS INC | 71,288 | 7,855,937.60 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 11,847 | 3,243,945.54 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 64,068 | 3,416,105.76 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 12,511 | 766,173.64 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 8,933 | 1,727,552.87 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SIMON PROPERTY GROUP | 25,979 | 3,943,352.41 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 10,890 | 1,257,903.90 | |
| | | UDR INC | 23,815 | 944,741.05 | |
| | | VENTAS INC | 31,565 | 1,569,096.15 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 83,762 | 2,376,327.94 | |
| | | WELLTOWER INC | 43,994 | 4,567,017.14 | |
| | | WP CAREY INC | 16,024 | 900,709.04 | |
| | アメリカドル 小計 | | 926,874 | 73,675,901.40<br>(11,567,853,278) | |
| | カナダドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 4,887 | 215,663.31 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 15,490 | 264,104.50 | |
| | カナダドル 小計 | | 20,377 | 479,767.81<br>(54,722,316) | |
| | ユーロ | COVIVIO(FP) | 4,962 | 240,557.76 | |
| | | GECINA SA | 3,139 | 312,958.30 | |
| | | KLEPIERRE | 17,225 | 459,563.00 | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 10,455 | 829,917.90 | |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 12,914 | 335,764.00 | |
| | ユーロ 小計 | | 48,695 | 2,178,760.96<br>(368,711,717) | |
| | イギリスポンド | LAND SECURITIES GROUP PLC | 56,289 | 364,189.83 | |
| | | SEGRO PLC | 103,047 | 932,575.35 | |
| | イギリスポンド 小計 | | 159,336 | 1,296,765.18<br>(258,989,941) | |
| | オーストラリアドル | DEXUS | 94,090 | 654,866.40 | |
| | | GOODMAN GROUP | 135,303 | 4,777,548.93 | |
| | | GPT GROUP | 167,884 | 720,222.36 | |
| | | MIRVAC GROUP | 266,683 | 532,032.58 | |
| | | SCENTRE GROUP | 381,283 | 1,223,918.43 | |
| | | STOCKLAND | 207,412 | 952,021.08 | |
| | | VICINITY CENTERS | 305,149 | 591,989.06 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | 1,557,804 | 9,452,598.84<br>(975,791,778) | |
| | 香港ドル | LINK REIT | 166,900 | 5,657,910.00 | |
| | 香港ドル 小計 | | 166,900 | 5,657,910.00<br>(113,723,991) | |
| | シンガポールドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 284,138 | 752,965.70 | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 338,529 | 677,058.00 | |
| | シンガポールドル 小計 | | 622,667 | 1,430,023.70<br>(165,968,550) | |
| 投資証券合計 | | | 3,502,653 | 13,505,761,571<br>(13,505,761,571) | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 合計 | | 13,635,059,895<br>(13,635,059,895) | |

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<br>時価比率 | 組入新株予約権<br>証券<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| アメリカドル | 株式　580銘柄 | 98.0% | — | — | — | 74.2% |
| | 投資証券　33銘柄 | — | — | — | 2.0% | 1.5% |
| カナダドル | 株式　85銘柄 | 99.8% | — | — | — | 3.1% |
| | 新株予約権証券　1銘柄 | — | — | — | — | — |
| | 投資証券　2銘柄 | — | — | — | 0.2% | 0.0% |
| ユーロ | 株式　218銘柄 | 99.5% | — | — | — | 9.2% |
| | 投資証券　5銘柄 | — | — | — | 0.5% | 0.0% |
| イギリスポンド | 株式　78銘柄 | 99.2% | — | — | — | 4.1% |
| | 投資証券　2銘柄 | — | — | — | 0.8% | 0.0% |
| スイスフラン | 株式　45銘柄 | 100.0% | — | — | — | 2.7% |
| スウェーデンクローナ | 株式　43銘柄 | 100.0% | — | — | — | 0.9% |
| ノルウェークローネ | 株式　11銘柄 | 100.0% | — | — | — | 0.2% |
| デンマーククローネ | 株式　15銘柄 | 100.0% | — | — | — | 1.1% |
| 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　5銘柄 | 100.0% | — | — | — | 0.0% |
| 香港ドル | 株式　23銘柄 | 95.4% | — | — | — | 0.5% |
| | 投資信託受益証券　1銘柄 | — | — | 1.5% | — | 0.0% |
| | 投資証券　1銘柄 | — | — | — | 3.1% | 0.0% |
| シンガポールドル | 株式　12銘柄 | 92.8% | — | — | — | 0.3% |
| | 投資証券　2銘柄 | — | — | — | 7.2% | 0.0% |
| イスラエルシェケル | 株式　8銘柄 | 100.0% | — | — | — | 0.1% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

### 外国債券インデックス　マザーファンド

#### 貸借対照表

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 694,676,954 |
| コール・ローン | 2,887,615,648 |
| 国債証券 | 343,337,973,241 |
| 派生商品評価勘定 | 11,511,036 |
| 未収入金 | 19,503,567 |
| 未収利息 | 2,291,218,559 |
| 前払費用 | 269,214,701 |
| 差入委託証拠金 | 207,177,212 |
| 流動資産合計 | 349,718,890,918 |
| 資産合計 | 349,718,890,918 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 10,598,816 |
| 前受金 | 3,276,478 |
| 未払金 | 4,725,119 |
| 未払解約金 | 138,251,363 |
| 流動負債合計 | 156,851,776 |
| 負債合計 | 156,851,776 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 95,908,861,237 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 253,653,177,905 |
| 元本等合計 | 349,562,039,142 |
| 純資産合計 | 349,562,039,142 |
| 負債純資産合計 | 349,718,890,918 |

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| １.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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。<br>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 | (1)先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |

| | 2024年 6月10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。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>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 6月10日現在 |
|---|---|---|
| 1． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 95,908,861,237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 3.6447円<br>(1万口当たり純資産額) (36,447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 6月10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。<br>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。<br>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 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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 6月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 6月13日 |
| 期首元本額 | 85,391,300,001円 |
| 期中追加設定元本額 | 17,040,301,080円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,522,739,844円 |
| 期末元本額 | 95,908,861,237円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,089,353,739円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 486,552,982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） | 2,365,608,474円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 9,311,176円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン | 8,735,731,114円 |
| 世界経済インデックスファンド | 22,895,832,910円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 1,846,941,992円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 1,807,410,661円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 1,454,374,209円 |
| ＤＣ外国債券インデックス・オープン | 2,230,914,242円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 1,123,557,697円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 999,192,405円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 583,905,357円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 11,199,926円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 101,550,881円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 56,619,525円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 14,669,105,342円 |
| 外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 790,035,636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） | 13,641,055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） | 45,860,924円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 52,367,411円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 50,954,679円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 707,782,893円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 355,741,537円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,496,776,524円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 50,511,004円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 26,054,749円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 328,286,112円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 124,261,400円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 162,216,823円 |
| ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用） | 628,644,520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） | 1,483,144,020円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 617,206,666円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ１ | 763,870,815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） | 791,856,209円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,503,680,673円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 221,553,735円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 104,165,192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） | 1,229,537,467円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 178,538,932円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 432,872,392円 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 637,963,357円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 962,725,028円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 8,463,215円 |
| グローバル経済コア | 1,176,432,309円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 23,465,678円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 2,916,106円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 66,622,347円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 93,041,058円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 46,712,817円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 64,072,595円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード） | 779,979,384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 | 26,530,120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 | 22,018円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４０ | 22,194円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０４５ | 22,322円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５０ | 22,322円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５ | 22,025円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６０ | 21,345円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０６５ | 21,210円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 16,457円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 13,077,641,232円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 266,683,816円 |
| ＳＭＴＡＭ９資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 96,865,645円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 129,879,215円 |

**（有価証券に関する注記）**

**売買目的有価証券**

| 種類 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 1,164,869,846 |
| 合計 | 1,164,869,846 |

(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 6月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 債券先物取引<br>買建 | 2,271,794,383 | － | 2,275,070,861 | 3,276,478 |
| 合計 | | 2,271,794,383 | － | 2,275,070,861 | 3,276,478 |

(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 6月10日現在）

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 2,706,132,695 | － | 2,703,768,437 | △2,364,258 |
| | アメリカドル | 1,309,449,992 | － | 1,311,801,040 | 2,351,048 |
| | カナダドル | 104,250,297 | － | 103,740,000 | △510,297 |
| | ユーロ | 848,737,912 | － | 844,084,947 | △4,652,965 |
| | イギリスポンド | 153,522,426 | － | 153,695,080 | 172,654 |
| | オフショア人民元 | 290,172,068 | － | 290,447,370 | 275,302 |
| 合計 | | 2,706,132,695 | － | 2,703,768,437 | △2,364,258 |

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | アメリカドル | T 0.25% 05/31/25 | 3,900,000.00 | 3,718,315.77 | |
| | | T 0.25% 06/30/25 | 3,800,000.00 | 3,611,113.28 | |
| | | T 0.25% 07/31/25 | 7,640,000.00 | 7,232,632.82 | |
| | | T 0.25% 08/31/25 | 5,250,000.00 | 4,949,970.69 | |
| | | T 0.25% 09/30/25 | 3,000,000.00 | 2,818,183.59 | |
| | | T 0.25% 10/31/25 | 3,600,000.00 | 3,369,515.61 | |
| | | T 0.375% 01/31/26 | 8,000,000.00 | 7,424,375.04 | |
| | | T 0.375% 07/31/27 | 5,500,000.00 | 4,822,919.91 | |
| | | T 0.375% 09/30/27 | 6,580,000.00 | 5,735,909.37 | |
| | | T 0.375% 11/30/25 | 3,000,000.00 | 2,803,769.52 | |
| | | T 0.375% 12/31/25 | 4,000,000.00 | 3,725,156.24 | |
| | | T 0.5% 02/28/26 | 4,500,000.00 | 4,171,992.21 | |
| | | T 0.5% 04/30/27 | 2,940,000.00 | 2,612,580.46 | |
| | | T 0.5% 05/31/27 | 3,500,000.00 | 3,100,234.37 | |
| | | T 0.5% 06/30/27 | 6,960,000.00 | 6,148,589.07 | |
| | | T 0.5% 08/31/27 | 4,660,000.00 | 4,090,970.28 | |
| | | T 0.5% 10/31/27 | 7,500,000.00 | 6,544,628.92 | |
| | | T 0.625% 03/31/27 | 7,500,000.00 | 6,709,277.32 | |
| | | T 0.625% 05/15/30 | 9,100,000.00 | 7,302,216.83 | |
| | | T 0.625% 07/31/26 | 10,800,000.00 | 9,886,640.65 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 0.625% 08/15/30 | 11,950,000.00 | 9,505,151.41 | |
| | | T 0.625% 11/30/27 | 2,500,000.00 | 2,184,912.10 | |
| | | T 0.625% 12/31/27 | 9,600,000.00 | 8,366,250.04 | |
| | | T 0.75% 01/31/28 | 8,500,000.00 | 7,421,894.51 | |
| | | T 0.75% 03/31/26 | 6,000,000.00 | 5,570,976.54 | |
| | | T 0.75% 04/30/26 | 9,500,000.00 | 8,795,292.94 | |
| | | T 0.75% 05/31/26 | 4,000,000.00 | 3,692,343.76 | |
| | | T 0.75% 08/31/26 | 1,830,000.00 | 1,674,807.41 | |
| | | T 0.875% 06/30/26 | 8,000,000.00 | 7,386,250.00 | |
| | | T 0.875% 09/30/26 | 2,900,000.00 | 2,656,048.83 | |
| | | T 0.875% 11/15/30 | 11,150,000.00 | 8,953,972.71 | |
| | | T 1.125% 02/15/31 | 4,080,000.00 | 3,313,087.50 | |
| | | T 1.125% 02/29/28 | 8,000,000.00 | 7,067,500.00 | |
| | | T 1.125% 05/15/40 | 1,710,000.00 | 1,049,111.71 | |
| | | T 1.125% 08/15/40 | 5,200,000.00 | 3,161,234.38 | |
| | | T 1.125% 08/31/28 | 12,030,000.00 | 10,475,733.37 | |
| | | T 1.25% 03/31/28 | 8,480,000.00 | 7,509,768.77 | |
| | | T 1.25% 04/30/28 | 8,000,000.00 | 7,067,500.00 | |
| | | T 1.25% 05/15/50 | 5,550,000.00 | 2,747,033.21 | |
| | | T 1.25% 05/31/28 | 6,000,000.00 | 5,289,726.54 | |
| | | T 1.25% 06/30/28 | 9,000,000.00 | 7,915,078.08 | |
| | | T 1.25% 08/15/31 | 9,230,000.00 | 7,438,442.60 | |
| | | T 1.25% 09/30/28 | 9,500,000.00 | 8,298,027.32 | |
| | | T 1.25% 11/30/26 | 7,000,000.00 | 6,434,257.83 | |
| | | T 1.25% 12/31/26 | 7,130,000.00 | 6,541,357.25 | |
| | | T 1.375% 08/15/50 | 5,700,000.00 | 2,910,339.85 | |
| | | T 1.375% 10/31/28 | 3,520,000.00 | 3,085,431.25 | |
| | | T 1.375% 11/15/31 | 12,580,000.00 | 10,159,824.25 | |
| | | T 1.375% 11/15/40 | 6,000,000.00 | 3,783,515.64 | |
| | | T 1.375% 12/31/28 | 8,680,000.00 | 7,576,182.00 | |
| | | T 1.5% 01/31/27 | 6,000,000.00 | 5,525,390.64 | |
| | | T 1.5% 02/15/30 | 6,470,000.00 | 5,518,455.09 | |
| | | T 1.5% 08/15/26 | 15,500,000.00 | 14,442,851.64 | |
| | | T 1.5% 11/30/28 | 7,500,000.00 | 6,596,923.80 | |
| | | T 1.625% 02/15/26 | 5,600,000.00 | 5,300,531.26 | |
| | | T 1.625% 05/15/26 | 10,770,000.00 | 10,127,586.30 | |
| | | T 1.625% 05/15/31 | 5,960,000.00 | 4,969,382.79 | |
| | | T 1.625% 08/15/29 | 6,750,000.00 | 5,879,619.15 | |
| | | T 1.625% 10/31/26 | 2,800,000.00 | 2,603,234.36 | |
| | | T 1.625% 11/15/50 | 6,900,000.00 | 3,769,394.51 | |
| | | T 1.625% 11/30/26 | 4,780,000.00 | 4,435,503.91 | |
| | | T 1.75% 01/31/29 | 6,000,000.00 | 5,318,085.96 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 1.75% 08/15/41 | 7,080,000.00 | 4,675,289.04 | |
| | | T 1.75% 11/15/29 | 3,000,000.00 | 2,618,085.93 | |
| | | T 1.875% 02/15/32 | 11,720,000.00 | 9,778,646.10 | |
| | | T 1.875% 02/15/41 | 7,900,000.00 | 5,396,996.07 | |
| | | T 1.875% 02/15/51 | 6,600,000.00 | 3,847,464.85 | |
| | | T 1.875% 02/28/27 | 6,500,000.00 | 6,034,843.75 | |
| | | T 1.875% 02/28/29 | 8,470,000.00 | 7,539,292.59 | |
| | | T 1.875% 07/31/26 | 5,190,000.00 | 4,881,438.30 | |
| | | T 1.875% 11/15/51 | 3,300,000.00 | 1,912,066.39 | |
| | | T 1% 07/31/28 | 7,000,000.00 | 6,077,558.62 | |
| | | T 2.125% 05/31/26 | 3,600,000.00 | 3,415,218.76 | |
| | | T 2.25% 02/15/27 | 5,550,000.00 | 5,210,496.06 | |
| | | T 2.25% 02/15/52 | 4,300,000.00 | 2,735,371.08 | |
| | | T 2.25% 03/31/26 | 7,500,000.00 | 7,155,761.70 | |
| | | T 2.25% 05/15/41 | 6,460,000.00 | 4,670,882.84 | |
| | | T 2.25% 08/15/27 | 7,530,000.00 | 7,005,253.12 | |
| | | T 2.25% 08/15/46 | 1,640,000.00 | 1,092,906.25 | |
| | | T 2.25% 08/15/49 | 5,500,000.00 | 3,553,945.34 | |
| | | T 2.25% 11/15/25 | 4,400,000.00 | 4,231,734.36 | |
| | | T 2.25% 11/15/27 | 7,650,000.00 | 7,085,364.28 | |
| | | T 2.375% 02/15/42 | 5,500,000.00 | 3,998,671.87 | |
| | | T 2.375% 03/31/29 | 4,900,000.00 | 4,457,851.53 | |
| | | T 2.375% 04/30/26 | 2,600,000.00 | 2,482,390.61 | |
| | | T 2.375% 05/15/27 | 11,690,000.00 | 10,964,854.68 | |
| | | T 2.375% 05/15/29 | 6,010,000.00 | 5,457,948.62 | |
| | | T 2.375% 05/15/51 | 8,150,000.00 | 5,359,898.43 | |
| | | T 2.375% 11/15/49 | 4,100,000.00 | 2,720,574.22 | |
| | | T 2.5% 02/15/45 | 2,810,000.00 | 2,001,576.17 | |
| | | T 2.5% 02/15/46 | 2,450,000.00 | 1,725,814.44 | |
| | | T 2.5% 03/31/27 | 7,100,000.00 | 6,698,683.57 | |
| | | T 2.5% 05/15/46 | 1,450,000.00 | 1,018,738.27 | |
| | | T 2.625% 01/31/26 | 4,690,000.00 | 4,516,506.62 | |
| | | T 2.625% 02/15/29 | 7,740,000.00 | 7,135,463.65 | |
| | | T 2.625% 05/31/27 | 2,400,000.00 | 2,265,375.00 | |
| | | T 2.625% 12/31/25 | 5,820,000.00 | 5,613,799.20 | |
| | | T 2.75% 02/15/28 | 6,550,000.00 | 6,149,068.34 | |
| | | T 2.75% 04/30/27 | 5,450,000.00 | 5,169,835.93 | |
| | | T 2.75% 05/31/29 | 5,700,000.00 | 5,265,820.28 | |
| | | T 2.75% 06/30/25 | 5,500,000.00 | 5,365,566.85 | |
| | | T 2.75% 08/15/32 | 12,900,000.00 | 11,413,476.49 | |
| | | T 2.75% 08/15/42 | 7,100,000.00 | 5,447,308.57 | |
| | | T 2.75% 08/15/47 | 4,050,000.00 | 2,950,646.49 | |
| | | T 2.75% 08/31/25 | 6,900,000.00 | 6,707,554.72 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 2.75% 11/15/42 | 6,020,000.00 | 4,602,713.26 | |
| | | T 2.75% 11/15/47 | 3,050,000.00 | 2,217,802.74 | |
| | | T 2.875% 04/30/29 | 3,300,000.00 | 3,069,580.07 | |
| | | T 2.875% 05/15/28 | 10,060,000.00 | 9,461,508.56 | |
| | | T 2.875% 05/15/32 | 10,100,000.00 | 9,047,785.13 | |
| | | T 2.875% 05/15/43 | 5,050,000.00 | 3,914,341.80 | |
| | | T 2.875% 05/15/49 | 6,080,000.00 | 4,490,412.51 | |
| | | T 2.875% 05/15/52 | 10,800,000.00 | 7,910,156.30 | |
| | | T 2.875% 05/31/25 | 3,820,000.00 | 3,735,867.28 | |
| | | T 2.875% 07/31/25 | 5,460,000.00 | 5,325,632.78 | |
| | | T 2.875% 08/15/28 | 13,220,000.00 | 12,395,557.43 | |
| | | T 2.875% 08/15/45 | 2,300,000.00 | 1,744,496.08 | |
| | | T 2.875% 11/15/46 | 940,000.00 | 705,660.93 | |
| | | T 2.875% 11/30/25 | 9,000,000.00 | 8,727,187.50 | |
| | | T 2% 02/15/50 | 2,750,000.00 | 1,668,261.70 | |
| | | T 2% 08/15/25 | 3,450,000.00 | 3,327,632.81 | |
| | | T 2% 08/15/51 | 7,850,000.00 | 4,706,167.00 | |
| | | T 2% 11/15/26 | 3,220,000.00 | 3,018,309.76 | |
| | | T 2% 11/15/41 | 6,200,000.00 | 4,252,085.92 | |
| | | T 3.125% 02/15/42 | 1,050,000.00 | 859,769.52 | |
| | | T 3.125% 02/15/43 | 3,800,000.00 | 3,072,210.92 | |
| | | T 3.125% 05/15/48 | 4,780,000.00 | 3,718,130.45 | |
| | | T 3.125% 08/15/25 | 10,200,000.00 | 9,968,906.25 | |
| | | T 3.125% 08/15/44 | 1,840,000.00 | 1,468,262.50 | |
| | | T 3.125% 08/31/27 | 6,150,000.00 | 5,876,012.70 | |
| | | T 3.125% 08/31/29 | 7,150,000.00 | 6,707,593.75 | |
| | | T 3.125% 11/15/28 | 10,410,000.00 | 9,836,230.04 | |
| | | T 3.25% 05/15/42 | 4,150,000.00 | 3,444,824.19 | |
| | | T 3.25% 06/30/29 | 3,000,000.00 | 2,834,824.23 | |
| | | T 3.375% 05/15/33 | 13,630,000.00 | 12,565,688.63 | |
| | | T 3.375% 05/15/44 | 3,010,000.00 | 2,502,885.55 | |
| | | T 3.375% 08/15/42 | 2,300,000.00 | 1,938,917.96 | |
| | | T 3.375% 11/15/48 | 5,300,000.00 | 4,306,664.03 | |
| | | T 3.5% 01/31/30 | 4,000,000.00 | 3,809,375.00 | |
| | | T 3.5% 02/15/33 | 11,200,000.00 | 10,444,437.47 | |
| | | T 3.5% 02/15/39 | 770,000.00 | 690,623.82 | |
| | | T 3.5% 04/30/30 | 3,500,000.00 | 3,327,871.08 | |
| | | T 3.5% 09/15/25 | 2,900,000.00 | 2,842,962.88 | |
| | | T 3.625% 02/15/44 | 4,890,000.00 | 4,229,850.00 | |
| | | T 3.625% 02/15/53 | 9,550,000.00 | 8,111,717.75 | |
| | | T 3.625% 05/15/53 | 2,300,000.00 | 1,953,562.50 | |
| | | T 3.625% 08/15/43 | 4,700,000.00 | 4,076,332.04 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | T 3.75% 04/15/26 | 6,570,000.00 | 6,434,493.75 | |
| | | T 3.75% 06/30/30 | 3,000,000.00 | 2,888,144.52 | |
| | | T 3.75% 11/15/43 | 4,730,000.00 | 4,172,192.56 | |
| | | T 3.875% 01/15/26 | 6,500,000.00 | 6,387,900.41 | |
| | | T 3.875% 02/15/43 | 2,500,000.00 | 2,255,908.20 | |
| | | T 3.875% 08/15/33 | 8,170,000.00 | 7,821,338.87 | |
| | | T 3.875% 08/15/40 | 1,450,000.00 | 1,339,210.93 | |
| | | T 3.875% 09/30/29 | 3,540,000.00 | 3,441,128.89 | |
| | | T 3.875% 11/30/29 | 8,130,000.00 | 7,898,803.12 | |
| | | T 3% 02/15/47 | 5,920,000.00 | 4,536,662.47 | |
| | | T 3% 02/15/48 | 1,000,000.00 | 761,054.69 | |
| | | T 3% 02/15/49 | 1,000,000.00 | 757,656.25 | |
| | | T 3% 05/15/42 | 2,450,000.00 | 1,961,339.85 | |
| | | T 3% 05/15/45 | 700,000.00 | 543,648.43 | |
| | | T 3% 05/15/47 | 3,210,000.00 | 2,455,650.00 | |
| | | T 3% 07/15/25 | 11,150,000.00 | 10,899,778.27 | |
| | | T 3% 08/15/48 | 3,250,000.00 | 2,466,826.18 | |
| | | T 3% 08/15/52 | 5,200,000.00 | 3,907,109.38 | |
| | | T 3% 09/30/25 | 4,200,000.00 | 4,089,914.05 | |
| | | T 3% 10/31/25 | 5,000,000.00 | 4,862,890.60 | |
| | | T 3% 11/15/44 | 2,800,000.00 | 2,183,125.00 | |
| | | T 3% 11/15/45 | 2,300,000.00 | 1,780,433.58 | |
| | | T 4.125% 08/15/53 | 4,300,000.00 | 3,998,076.18 | |
| | | T 4.125% 08/31/30 | 9,200,000.00 | 9,035,226.52 | |
| | | T 4.125% 10/31/27 | 3,100,000.00 | 3,053,742.17 | |
| | | T 4.125% 11/15/32 | 14,000,000.00 | 13,691,562.50 | |
| | | T 4.25% 02/15/54 | 6,750,000.00 | 6,417,246.04 | |
| | | T 4.25% 02/28/31 | 9,000,000.00 | 8,898,046.92 | |
| | | T 4.25% 05/15/39 | 900,000.00 | 876,937.50 | |
| | | T 4.25% 10/15/25 | 6,900,000.00 | 6,825,070.27 | |
| | | T 4.25% 11/15/40 | 740,000.00 | 714,244.52 | |
| | | T 4.375% 02/15/38 | 1,000,000.00 | 994,785.16 | |
| | | T 4.375% 05/15/40 | 1,900,000.00 | 1,868,011.71 | |
| | | T 4.375% 05/15/41 | 650,000.00 | 635,324.22 | |
| | | T 4.375% 08/15/26 | 6,000,000.00 | 5,943,281.28 | |
| | | T 4.375% 08/31/28 | 14,150,000.00 | 14,070,406.25 | |
| | | T 4.375% 11/15/39 | 960,000.00 | 946,462.50 | |
| | | T 4.375% 11/30/30 | 4,500,000.00 | 4,479,873.03 | |
| | | T 4.5% 02/15/36 | 1,090,000.00 | 1,105,796.48 | |
| | | T 4.5% 05/15/38 | 550,000.00 | 553,587.89 | |
| | | T 4.5% 07/15/26 | 10,000,000.00 | 9,931,250.00 | |
| | | T 4.5% 08/15/39 | 1,700,000.00 | 1,701,460.94 | |
| | | T 4.5% 11/15/33 | 9,270,000.00 | 9,309,832.07 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | T 4.625% 02/15/40 | 1,380,000.00 | 1,397,735.15 | |
| | T 4.625% 09/30/30 | 3,010,000.00 | 3,037,395.69 | |
| | T 4.625% 10/15/26 | 9,520,000.00 | 9,486,531.29 | |
| | T 4.75% 02/15/41 | 750,000.00 | 767,446.29 | |
| | T 4.75% 11/15/53 | 3,180,000.00 | 3,283,598.42 | |
| | T 4.875% 10/31/30 | 2,500,000.00 | 2,557,617.20 | |
| | T 4% 01/15/27 | 7,200,000.00 | 7,072,875.00 | |
| | T 4% 02/15/26 | 6,500,000.00 | 6,398,310.55 | |
| | T 4% 02/28/30 | 6,200,000.00 | 6,056,503.91 | |
| | T 4% 07/31/30 | 3,980,000.00 | 3,883,065.22 | |
| | T 4% 10/31/29 | 6,550,000.00 | 6,405,055.63 | |
| | T 4% 11/15/52 | 7,400,000.00 | 6,734,000.00 | |
| | T 5.0% 05/15/37 | 400,000.00 | 423,671.87 | |
| | T 5.25% 11/15/28 | 1,300,000.00 | 1,340,218.75 | |
| | T 5.375% 02/15/31 | 1,950,000.00 | 2,065,171.87 | |
| | T 5% 08/31/25 | 4,250,000.00 | 4,243,110.36 | |
| | T 6.0% 02/15/26 | 1,700,000.00 | 1,732,539.05 | |
| | T 6.125% 11/15/27 | 1,450,000.00 | 1,521,763.67 | |
| | T 6.25% 05/15/30 | 1,050,000.00 | 1,147,248.04 | |
| アメリカドル 小計 | | 1,165,480,000.00 | 1,028,461,148.07<br>(161,478,684,858) | |
| カナダドル | CAN 0.25% 03/01/26 | 1,340,000.00 | 1,257,318.81 | |
| | CAN 0.5% 09/01/25 | 3,010,000.00 | 2,878,104.74 | |
| | CAN 0.5% 12/01/30 | 2,320,000.00 | 1,927,799.89 | |
| | CAN 1.25% 03/01/27 | 1,880,000.00 | 1,760,841.89 | |
| | CAN 1.25% 06/01/30 | 3,620,000.00 | 3,194,319.92 | |
| | CAN 1.5% 06/01/26 | 910,000.00 | 868,754.81 | |
| | CAN 1.5% 06/01/31 | 3,770,000.00 | 3,317,692.02 | |
| | CAN 1.5% 12/01/31 | 3,620,000.00 | 3,157,249.64 | |
| | CAN 1.75% 12/01/53 | 2,920,000.00 | 2,028,559.01 | |
| | CAN 1% 06/01/27 | 810,000.00 | 750,757.35 | |
| | CAN 1% 09/01/26 | 1,530,000.00 | 1,437,579.29 | |
| | CAN 2.25% 06/01/25 | 1,280,000.00 | 1,254,533.65 | |
| | CAN 2.25% 06/01/29 | 240,000.00 | 227,586.92 | |
| | CAN 2.5% 12/01/32 | 2,300,000.00 | 2,139,666.40 | |
| | CAN 2.75% 06/01/33 | 1,200,000.00 | 1,134,976.41 | |
| | CAN 2.75% 09/01/27 | 1,600,000.00 | 1,557,258.00 | |
| | CAN 2.75% 12/01/48 | 1,050,000.00 | 933,657.83 | |
| | CAN 2.75% 12/01/55 | 1,670,000.00 | 1,466,542.09 | |
| | CAN 2.75% 12/01/64 | 620,000.00 | 539,997.68 | |
| | CAN 2% 06/01/28 | 410,000.00 | 387,443.71 | |
| | CAN 2% 06/01/32 | 1,520,000.00 | 1,366,616.92 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CAN 2% 12/01/51 | 3,650,000.00 | 2,732,892.34 | |
| | CAN 3.25% 09/01/28 | 2,070,000.00 | 2,046,578.48 | |
| | CAN 3.25% 12/01/33 | 1,310,000.00 | 1,287,733.74 | |
| | CAN 3.5% 03/01/28 | 1,160,000.00 | 1,156,480.75 | |
| | CAN 3.5% 08/01/25 | 920,000.00 | 911,546.95 | |
| | CAN 3.5% 12/01/45 | 960,000.00 | 966,514.85 | |
| | CAN 3% 04/01/26 | 1,340,000.00 | 1,316,957.85 | |
| | CAN 3% 06/01/34 | 2,280,000.00 | 2,191,669.75 | |
| | CAN 3% 10/01/25 | 3,290,000.00 | 3,238,629.64 | |
| | CAN 4.0% 06/01/41 | 740,000.00 | 788,380.43 | |
| | CAN 4.5% 02/01/26 | 300,000.00 | 301,844.67 | |
| | CAN 4.5% 11/01/25 | 1,330,000.00 | 1,334,891.93 | |
| | CAN 4% 03/01/29 | 2,400,000.00 | 2,451,531.46 | |
| | CAN 4% 05/01/26 | 2,250,000.00 | 2,250,393.88 | |
| | CAN 5.75% 06/01/29 | 1,490,000.00 | 1,647,808.80 | |
| | CAN 5.75% 06/01/33 | 1,620,000.00 | 1,903,583.73 | |
| | CAN 5% 06/01/37 | 630,000.00 | 729,109.76 | |
| カナダドル 小計 | | 65,360,000.00 | 60,843,805.99<br>(6,939,844,511) | |
| メキシコペソ | MBONO 10% 11/20/36 | 8,550,000.00 | 8,658,927.00 | |
| | MBONO 5.5% 03/04/27 | 33,260,000.00 | 29,687,543.40 | |
| | MBONO 5.75% 03/05/26 | 46,850,000.00 | 43,371,187.91 | |
| | MBONO 7.5% 05/26/33 | 30,430,000.00 | 26,342,642.40 | |
| | MBONO 7.5% 06/03/27 | 31,510,000.00 | 29,404,186.70 | |
| | MBONO 7.75% 05/29/31 | 41,040,000.00 | 36,696,736.80 | |
| | MBONO 7.75% 11/13/42 | 31,010,000.00 | 25,490,220.00 | |
| | MBONO 7.75% 11/23/34 | 10,250,000.00 | 8,895,360.00 | |
| | MBONO 7% 09/03/26 | 9,290,000.00 | 8,674,258.80 | |
| | MBONO 8.5% 03/01/29 | 14,540,000.00 | 13,744,371.20 | |
| | MBONO 8.5% 05/31/29 | 30,830,000.00 | 29,155,314.40 | |
| | MBONO 8.5% 11/18/38 | 21,430,000.00 | 19,218,852.60 | |
| | MBONO 8% 07/31/53 | 22,670,000.00 | 18,758,971.60 | |
| | MBONO 8% 11/07/47 | 24,600,000.00 | 20,435,712.00 | |
| メキシコペソ 小計 | | 356,260,000.00 | 318,534,284.81<br>(2,721,971,023) | |
| ユーロ | BGB 0.1% 06/22/30 | 1,420,000.00 | 1,198,408.29 | |
| | BGB 0.35% 06/22/32 | 1,220,000.00 | 987,795.87 | |
| | BGB 0.4% 06/22/40 | 660,000.00 | 417,343.74 | |
| | BGB 0.65% 06/22/71 | 440,000.00 | 178,471.92 | |
| | BGB 0.8% 06/22/25 | 2,000,000.00 | 1,947,109.39 | |
| | BGB 0.8% 06/22/27 | 1,510,000.00 | 1,414,147.70 | |
| | BGB 0.8% 06/22/28 | 1,600,000.00 | 1,470,662.00 | |
| | BGB 0.9% 06/22/29 | 1,670,000.00 | 1,512,333.21 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BGB 0% 10/22/27 | 900,000.00 | 814,515.74 | |
| | | BGB 0% 10/22/31 | 1,460,000.00 | 1,173,976.13 | |
| | | BGB 1.25% 04/22/33 | 1,310,000.00 | 1,130,518.21 | |
| | | BGB 1.4% 06/22/53 | 1,050,000.00 | 647,087.43 | |
| | | BGB 1.45% 06/22/37 | 800,000.00 | 645,128.00 | |
| | | BGB 1.6% 06/22/47 | 1,080,000.00 | 758,770.20 | |
| | | BGB 1.7% 06/22/50 | 1,100,000.00 | 760,695.92 | |
| | | BGB 1.9% 06/22/38 | 650,000.00 | 546,031.68 | |
| | | BGB 1% 06/22/26 | 1,840,000.00 | 1,762,787.70 | |
| | | BGB 1% 06/22/31 | 1,560,000.00 | 1,364,398.22 | |
| | | BGB 2.15% 06/22/66 | 880,000.00 | 638,350.24 | |
| | | BGB 2.25% 06/22/57 | 670,000.00 | 503,828.27 | |
| | | BGB 2.7% 10/22/29 | 180,000.00 | 177,633.90 | |
| | | BGB 2.75% 04/22/39 | 560,000.00 | 520,069.34 | |
| | | BGB 2.85% 10/22/34 | 680,000.00 | 660,928.38 | |
| | | BGB 3.3% 06/22/54 | 1,020,000.00 | 967,821.90 | |
| | | BGB 3.45% 06/22/43 | 440,000.00 | 438,269.48 | |
| | | BGB 3.5% 06/22/55 | 530,000.00 | 519,524.81 | |
| | | BGB 3.75% 06/22/45 | 930,000.00 | 965,978.44 | |
| | | BGB 3% 06/22/33 | 1,450,000.00 | 1,439,500.55 | |
| | | BGB 3% 06/22/34 | 1,050,000.00 | 1,037,855.43 | |
| | | BGB 4.25% 03/28/41 | 1,750,000.00 | 1,932,813.75 | |
| | | BGB 4.5% 03/28/26 | 1,140,000.00 | 1,165,583.88 | |
| | | BGB 4% 03/28/32 | 880,000.00 | 938,014.00 | |
| | | BGB 5.5% 03/28/28 | 2,040,000.00 | 2,221,802.96 | |
| | | BGB 5% 03/28/35 | 1,810,000.00 | 2,104,260.75 | |
| | | BKO 2.5% 03/19/26 | 250,000.00 | 247,256.87 | |
| | | BKO 2.8% 06/12/25 | 1,490,000.00 | 1,481,606.08 | |
| | | BKO 3.1% 09/18/25 | 1,360,000.00 | 1,356,779.86 | |
| | | BKO 3.1% 12/12/25 | 1,820,000.00 | 1,816,396.40 | |
| | | BTPS 0.25% 03/15/28 | 1,680,000.00 | 1,492,896.30 | |
| | | BTPS 0.45% 02/15/29 | 1,880,000.00 | 1,636,917.88 | |
| | | BTPS 0.5% 02/01/26 | 1,910,000.00 | 1,819,332.30 | |
| | | BTPS 0.5% 07/15/28 | 1,300,000.00 | 1,155,599.25 | |
| | | BTPS 0.6% 08/01/31 | 3,160,000.00 | 2,560,437.40 | |
| | | BTPS 0.85% 01/15/27 | 2,340,000.00 | 2,191,532.25 | |
| | | BTPS 0.9% 04/01/31 | 2,920,000.00 | 2,443,697.63 | |
| | | BTPS 0.95% 03/01/37 | 1,320,000.00 | 917,324.10 | |
| | | BTPS 0.95% 06/01/32 | 2,320,000.00 | 1,883,857.16 | |
| | | BTPS 0.95% 08/01/30 | 2,230,000.00 | 1,908,097.27 | |
| | | BTPS 0.95% 09/15/27 | 1,490,000.00 | 1,377,276.65 | |
| | | BTPS 0.95% 12/01/31 | 2,140,000.00 | 1,763,402.80 | |
| | | BTPS 0% 04/01/26 | 2,240,000.00 | 2,104,986.24 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 0% 08/01/26 | 3,230,000.00 | 3,001,317.61 | |
| | | BTPS 1.1% 04/01/27 | 2,350,000.00 | 2,204,386.95 | |
| | | BTPS 1.2% 08/15/25 | 850,000.00 | 827,056.80 | |
| | | BTPS 1.25% 12/01/26 | 1,670,000.00 | 1,584,602.04 | |
| | | BTPS 1.35% 04/01/30 | 2,250,000.00 | 1,991,787.75 | |
| | | BTPS 1.45% 03/01/36 | 1,180,000.00 | 900,916.43 | |
| | | BTPS 1.5% 04/30/45 | 1,250,000.00 | 782,262.50 | |
| | | BTPS 1.5% 06/01/25 | 2,410,000.00 | 2,363,390.60 | |
| | | BTPS 1.6% 06/01/26 | 1,080,000.00 | 1,042,073.10 | |
| | | BTPS 1.65% 03/01/32 | 2,430,000.00 | 2,102,271.36 | |
| | | BTPS 1.65% 12/01/30 | 2,540,000.00 | 2,253,632.78 | |
| | | BTPS 1.7% 09/01/51 | 1,350,000.00 | 809,393.85 | |
| | | BTPS 1.8% 03/01/41 | 960,000.00 | 684,249.84 | |
| | | BTPS 1.85% 07/01/25 | 2,700,000.00 | 2,653,218.01 | |
| | | BTPS 2.05% 08/01/27 | 2,320,000.00 | 2,226,277.80 | |
| | | BTPS 2.1% 07/15/26 | 1,440,000.00 | 1,401,079.68 | |
| | | BTPS 2.15% 03/01/72 | 690,000.00 | 413,067.81 | |
| | | BTPS 2.15% 09/01/52 | 1,020,000.00 | 667,844.49 | |
| | | BTPS 2.2% 06/01/27 | 2,280,000.00 | 2,202,508.50 | |
| | | BTPS 2.25% 09/01/36 | 1,650,000.00 | 1,370,863.72 | |
| | | BTPS 2.45% 09/01/33 | 1,000,000.00 | 896,288.00 | |
| | | BTPS 2.45% 09/01/50 | 1,380,000.00 | 985,326.90 | |
| | | BTPS 2.5% 11/15/25 | 1,660,000.00 | 1,637,633.57 | |
| | | BTPS 2.5% 12/01/32 | 2,520,000.00 | 2,294,749.80 | |
| | | BTPS 2.65% 12/01/27 | 1,760,000.00 | 1,715,313.60 | |
| | | BTPS 2.7% 03/01/47 | 1,110,000.00 | 859,267.65 | |
| | | BTPS 2.8% 03/01/67 | 830,000.00 | 599,173.22 | |
| | | BTPS 2.8% 06/15/29 | 2,610,000.00 | 2,525,697.00 | |
| | | BTPS 2.8% 12/01/28 | 1,420,000.00 | 1,382,602.52 | |
| | | BTPS 2.95% 02/15/27 | 330,000.00 | 325,676.25 | |
| | | BTPS 2.95% 09/01/38 | 1,110,000.00 | 970,026.78 | |
| | | BTPS 2% 02/01/28 | 2,260,000.00 | 2,150,601.31 | |
| | | BTPS 2% 12/01/25 | 3,220,000.00 | 3,151,984.87 | |
| | | BTPS 3.1% 03/01/40 | 1,420,000.00 | 1,241,331.34 | |
| | | BTPS 3.25% 03/01/38 | 1,860,000.00 | 1,689,233.40 | |
| | | BTPS 3.25% 09/01/46 | 2,270,000.00 | 1,938,349.59 | |
| | | BTPS 3.35% 03/01/35 | 1,890,000.00 | 1,791,939.24 | |
| | | BTPS 3.4% 04/01/28 | 2,000,000.00 | 1,996,278.00 | |
| | | BTPS 3.45% 03/01/48 | 1,820,000.00 | 1,594,476.06 | |
| | | BTPS 3.5% 01/15/26 | 910,000.00 | 909,545.00 | |
| | | BTPS 3.5% 02/15/31 | 2,440,000.00 | 2,417,433.66 | |
| | | BTPS 3.5% 03/01/30 | 2,360,000.00 | 2,356,516.64 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | BTPS 3.7% 06/15/30 | 1,030,000.00 | 1,035,346.31 | |
| | | BTPS 3.8% 04/15/26 | 1,440,000.00 | 1,447,691.04 | |
| | | BTPS 3.8% 08/01/28 | 1,760,000.00 | 1,781,945.77 | |
| | | BTPS 3.85% 07/01/34 | 1,300,000.00 | 1,292,678.92 | |
| | | BTPS 3.85% 09/01/49 | 1,470,000.00 | 1,366,101.87 | |
| | | BTPS 3.85% 09/15/26 | 860,000.00 | 866,908.38 | |
| | | BTPS 3.85% 12/15/29 | 2,860,000.00 | 2,901,567.24 | |
| | | BTPS 3% 08/01/29 | 1,150,000.00 | 1,123,276.30 | |
| | | BTPS 4.1% 02/01/29 | 440,000.00 | 451,328.54 | |
| | | BTPS 4.15% 10/01/39 | 460,000.00 | 456,307.35 | |
| | | BTPS 4.2% 03/01/34 | 1,920,000.00 | 1,968,654.72 | |
| | | BTPS 4.35% 11/01/33 | 1,800,000.00 | 1,870,449.30 | |
| | | BTPS 4.4% 05/01/33 | 1,060,000.00 | 1,108,090.08 | |
| | | BTPS 4.45% 09/01/43 | 1,560,000.00 | 1,586,235.60 | |
| | | BTPS 4.5% 03/01/26 | 2,080,000.00 | 2,114,548.80 | |
| | | BTPS 4.5% 10/01/53 | 1,510,000.00 | 1,534,481.17 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/28 | 2,630,000.00 | 2,761,510.52 | |
| | | BTPS 4.75% 09/01/44 | 1,600,000.00 | 1,695,624.00 | |
| | | BTPS 4% 02/01/37 | 3,070,000.00 | 3,068,529.47 | |
| | | BTPS 4% 04/30/35 | 880,000.00 | 885,878.40 | |
| | | BTPS 4% 10/30/31 | 1,250,000.00 | 1,277,681.25 | |
| | | BTPS 4% 11/15/30 | 1,800,000.00 | 1,837,696.50 | |
| | | BTPS 5.0% 08/01/39 | 2,680,000.00 | 2,914,595.40 | |
| | | BTPS 5.25% 11/01/29 | 2,710,000.00 | 2,942,393.34 | |
| | | BTPS 5.75% 02/01/33 | 2,280,000.00 | 2,604,784.86 | |
| | | BTPS 5% 08/01/34 | 3,170,000.00 | 3,460,758.74 | |
| | | BTPS 5% 09/01/40 | 2,380,000.00 | 2,586,441.20 | |
| | | BTPS 6.5% 11/01/27 | 2,700,000.00 | 2,964,190.14 | |
| | | BTPS 6% 05/01/31 | 1,140,000.00 | 1,305,714.39 | |
| | | BTPS 7.25% 11/01/26 | 1,400,000.00 | 1,520,891.40 | |
| | | DBR 0.25% 02/15/27 | 2,690,000.00 | 2,510,773.37 | |
| | | DBR 0.25% 02/15/29 | 1,370,000.00 | 1,227,686.11 | |
| | | DBR 0.25% 08/15/28 | 2,090,000.00 | 1,892,061.84 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/26 | 3,000,000.00 | 2,873,081.25 | |
| | | DBR 0.5% 02/15/28 | 1,360,000.00 | 1,255,248.04 | |
| | | DBR 0.5% 08/15/27 | 350,000.00 | 325,953.25 | |
| | | DBR 0% 02/15/30 | 970,000.00 | 838,708.56 | |
| | | DBR 0% 02/15/31 | 1,660,000.00 | 1,401,440.06 | |
| | | DBR 0% 02/15/32 | 3,100,000.00 | 2,551,455.00 | |
| | | DBR 0% 05/15/35 | 2,380,000.00 | 1,787,112.23 | |
| | | DBR 0% 05/15/36 | 2,430,000.00 | 1,771,245.22 | |
| | | DBR 0% 08/15/26 | 2,920,000.00 | 2,739,565.89 | |
| | | DBR 0% 08/15/29 | 2,950,000.00 | 2,580,836.25 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | DBR 0% 08/15/30 | 2,350,000.00 | 2,008,935.68 | |
| | | DBR 0% 08/15/30 | 1,480,000.00 | 1,266,131.12 | |
| | | DBR 0% 08/15/31 | 3,990,000.00 | 3,329,447.98 | |
| | | DBR 0% 08/15/50 | 4,580,000.00 | 2,276,082.49 | |
| | | DBR 0% 08/15/52 | 3,020,000.00 | 1,429,037.53 | |
| | | DBR 0% 11/15/27 | 2,420,000.00 | 2,204,065.82 | |
| | | DBR 0% 11/15/28 | 1,990,000.00 | 1,771,312.93 | |
| | | DBR 1.25% 08/15/48 | 3,490,000.00 | 2,577,818.70 | |
| | | DBR 1.7% 08/15/32 | 3,160,000.00 | 2,958,566.59 | |
| | | DBR 1.8% 08/15/53 | 3,050,000.00 | 2,486,536.90 | |
| | | DBR 1% 05/15/38 | 2,080,000.00 | 1,664,822.12 | |
| | | DBR 1% 08/15/25 | 2,430,000.00 | 2,366,230.72 | |
| | | DBR 2.1% 11/15/29 | 3,430,000.00 | 3,335,596.11 | |
| | | DBR 2.2% 02/15/34 | 2,380,000.00 | 2,295,480.23 | |
| | | DBR 2.3% 02/15/33 | 4,630,000.00 | 4,526,890.36 | |
| | | DBR 2.4% 11/15/30 | 1,390,000.00 | 1,371,647.83 | |
| | | DBR 2.5% 07/04/44 | 2,930,000.00 | 2,803,922.10 | |
| | | DBR 2.5% 08/15/46 | 2,920,000.00 | 2,791,228.00 | |
| | | DBR 2.5% 08/15/54 | 1,330,000.00 | 1,268,286.33 | |
| | | DBR 2.6% 08/15/33 | 1,790,000.00 | 1,789,541.30 | |
| | | DBR 3.25% 07/04/42 | 2,030,000.00 | 2,163,068.53 | |
| | | DBR 4.0% 01/04/37 | 2,570,000.00 | 2,919,656.21 | |
| | | DBR 4.25% 07/04/39 | 1,810,000.00 | 2,138,506.66 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/28 | 1,430,000.00 | 1,540,461.06 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/34 | 2,130,000.00 | 2,524,370.99 | |
| | | DBR 4.75% 07/04/40 | 1,980,000.00 | 2,485,043.54 | |
| | | DBR 5.5% 01/04/31 | 3,100,000.00 | 3,627,395.25 | |
| | | DBR 5.625% 01/04/28 | 2,810,000.00 | 3,079,185.35 | |
| | | DBR 6.25% 01/04/30 | 1,250,000.00 | 1,479,245.62 | |
| | | DBR 6.5% 07/04/27 | 2,690,000.00 | 2,973,848.80 | |
| | | FRTR 0.25% 11/25/26 | 3,700,000.00 | 3,452,936.20 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/26 | 4,500,000.00 | 4,275,202.50 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/29 | 5,040,000.00 | 4,474,242.36 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/40 | 2,690,000.00 | 1,757,311.09 | |
| | | FRTR 0.5% 05/25/72 | 1,290,000.00 | 480,658.19 | |
| | | FRTR 0.5% 06/25/44 | 2,030,000.00 | 1,189,997.16 | |
| | | FRTR 0.75% 02/25/28 | 5,200,000.00 | 4,793,247.51 | |
| | | FRTR 0.75% 05/25/28 | 6,860,000.00 | 6,294,420.44 | |
| | | FRTR 0.75% 05/25/52 | 2,940,000.00 | 1,537,591.33 | |
| | | FRTR 0.75% 05/25/53 | 3,040,000.00 | 1,553,674.84 | |
| | | FRTR 0.75% 11/25/28 | 3,850,000.00 | 3,496,429.16 | |
| | | FRTR 0% 02/25/26 | 4,020,000.00 | 3,808,347.00 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | FRTR 0% 02/25/27 | 4,000,000.00 | 3,684,336.00 | |
| | | FRTR 0% 05/25/32 | 3,780,000.00 | 2,987,945.39 | |
| | | FRTR 0% 11/25/29 | 4,820,000.00 | 4,111,966.10 | |
| | | FRTR 0% 11/25/30 | 5,810,000.00 | 4,821,803.23 | |
| | | FRTR 0% 11/25/31 | 4,890,000.00 | 3,926,985.39 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/34 | 5,160,000.00 | 4,348,593.86 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/36 | 4,450,000.00 | 3,598,138.72 | |
| | | FRTR 1.25% 05/25/38 | 2,740,000.00 | 2,118,585.81 | |
| | | FRTR 1.5% 05/25/31 | 6,080,000.00 | 5,526,586.96 | |
| | | FRTR 1.5% 05/25/50 | 3,050,000.00 | 2,043,389.43 | |
| | | FRTR 1.75% 05/25/66 | 1,680,000.00 | 1,090,938.77 | |
| | | FRTR 1.75% 06/25/39 | 3,250,000.00 | 2,665,082.87 | |
| | | FRTR 1% 05/25/27 | 4,970,000.00 | 4,685,436.43 | |
| | | FRTR 1% 11/25/25 | 4,670,000.00 | 4,519,089.51 | |
| | | FRTR 2.5% 05/25/30 | 5,570,000.00 | 5,432,762.83 | |
| | | FRTR 2.5% 05/25/43 | 1,530,000.00 | 1,335,780.27 | |
| | | FRTR 2.5% 09/24/26 | 3,140,000.00 | 3,095,059.53 | |
| | | FRTR 2.75% 02/25/29 | 4,370,000.00 | 4,324,151.05 | |
| | | FRTR 2.75% 10/25/27 | 4,730,000.00 | 4,686,803.27 | |
| | | FRTR 2% 05/25/48 | 2,860,000.00 | 2,194,975.64 | |
| | | FRTR 2% 11/25/32 | 2,900,000.00 | 2,678,737.25 | |
| | | FRTR 3.25% 05/25/45 | 2,860,000.00 | 2,792,908.69 | |
| | | FRTR 3.25% 05/25/55 | 90,000.00 | 85,318.99 | |
| | | FRTR 3.5% 04/25/26 | 4,730,000.00 | 4,755,305.50 | |
| | | FRTR 3.5% 11/25/33 | 3,100,000.00 | 3,200,377.06 | |
| | | FRTR 3% 05/25/33 | 4,210,000.00 | 4,188,956.31 | |
| | | FRTR 3% 05/25/54 | 2,380,000.00 | 2,159,076.50 | |
| | | FRTR 3% 06/25/49 | 770,000.00 | 715,293.81 | |
| | | FRTR 4.5% 04/25/41 | 3,440,000.00 | 3,947,925.28 | |
| | | FRTR 4.75% 04/25/35 | 2,440,000.00 | 2,795,276.20 | |
| | | FRTR 4% 04/25/55 | 2,540,000.00 | 2,777,358.93 | |
| | | FRTR 4% 04/25/60 | 1,780,000.00 | 1,966,213.81 | |
| | | FRTR 4% 10/25/38 | 2,140,000.00 | 2,313,983.07 | |
| | | FRTR 5.5% 04/25/29 | 5,920,000.00 | 6,585,492.06 | |
| | | FRTR 5.75% 10/25/32 | 4,370,000.00 | 5,227,546.95 | |
| | | FRTR 6.0% 10/25/25 | 1,900,000.00 | 1,965,914.80 | |
| | | IRISH 0.2% 05/15/27 | 670,000.00 | 618,584.28 | |
| | | IRISH 0.2% 10/18/30 | 780,000.00 | 662,455.95 | |
| | | IRISH 0.35% 10/18/32 | 380,000.00 | 309,232.41 | |
| | | IRISH 0.4% 05/15/35 | 690,000.00 | 524,194.38 | |
| | | IRISH 0.55% 04/22/41 | 410,000.00 | 271,487.10 | |
| | | IRISH 0.9% 05/15/28 | 770,000.00 | 714,059.50 | |
| | | IRISH 0% 10/18/31 | 1,120,000.00 | 910,019.91 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | IRISH 1.1% 05/15/29 | 980,000.00 | 901,213.14 | |
| | | IRISH 1.3% 05/15/33 | 430,000.00 | 376,098.21 | |
| | | IRISH 1.35% 03/18/31 | 470,000.00 | 427,245.27 | |
| | | IRISH 1.5% 05/15/50 | 800,000.00 | 563,948.00 | |
| | | IRISH 1.7% 05/15/37 | 740,000.00 | 630,871.70 | |
| | | IRISH 1% 05/15/26 | 1,000,000.00 | 961,147.30 | |
| | | IRISH 2.4% 05/15/30 | 930,000.00 | 906,346.38 | |
| | | IRISH 2.6% 10/18/34 | 200,000.00 | 193,195.15 | |
| | | IRISH 2% 02/18/45 | 980,000.00 | 808,918.70 | |
| | | IRISH 3% 10/18/43 | 370,000.00 | 361,867.67 | |
| | | NETHER 0.25% 07/15/25 | 1,910,000.00 | 1,848,045.33 | |
| | | NETHER 0.25% 07/15/29 | 950,000.00 | 835,141.43 | |
| | | NETHER 0.5% 01/15/40 | 1,470,000.00 | 1,020,990.70 | |
| | | NETHER 0.5% 07/15/26 | 1,750,000.00 | 1,660,555.21 | |
| | | NETHER 0.5% 07/15/32 | 1,150,000.00 | 957,824.98 | |
| | | NETHER 0.75% 07/15/27 | 900,000.00 | 842,666.40 | |
| | | NETHER 0.75% 07/15/28 | 1,610,000.00 | 1,480,101.98 | |
| | | NETHER 0% 01/15/26 | 1,190,000.00 | 1,132,002.37 | |
| | | NETHER 0% 01/15/27 | 1,730,000.00 | 1,602,249.43 | |
| | | NETHER 0% 01/15/29 | 1,610,000.00 | 1,414,105.25 | |
| | | NETHER 0% 01/15/38 | 1,170,000.00 | 783,357.70 | |
| | | NETHER 0% 01/15/52 | 1,740,000.00 | 803,866.93 | |
| | | NETHER 0% 07/15/30 | 1,350,000.00 | 1,139,487.75 | |
| | | NETHER 0% 07/15/31 | 1,370,000.00 | 1,125,758.98 | |
| | | NETHER 2.5% 01/15/30 | 1,000,000.00 | 981,966.00 | |
| | | NETHER 2.5% 01/15/33 | 1,550,000.00 | 1,509,879.80 | |
| | | NETHER 2.5% 07/15/33 | 1,320,000.00 | 1,280,524.08 | |
| | | NETHER 2.5% 07/15/34 | 680,000.00 | 655,637.64 | |
| | | NETHER 2.75% 01/15/47 | 1,840,000.00 | 1,784,121.50 | |
| | | NETHER 2% 01/15/54 | 1,120,000.00 | 918,334.76 | |
| | | NETHER 3.25% 01/15/44 | 680,000.00 | 706,886.30 | |
| | | NETHER 3.75% 01/15/42 | 1,700,000.00 | 1,874,545.29 | |
| | | NETHER 4% 01/15/37 | 1,660,000.00 | 1,837,495.50 | |
| | | NETHER 5.5% 01/15/28 | 1,530,000.00 | 1,663,459.91 | |
| | | OBL 0% 04/10/26 | 3,070,000.00 | 2,905,314.45 | |
| | | OBL 0% 04/16/27 | 2,550,000.00 | 2,353,259.85 | |
| | | OBL 0% 10/09/26 | 2,680,000.00 | 2,504,306.56 | |
| | | OBL 0% 10/10/25 | 4,000,000.00 | 3,835,812.00 | |
| | | OBL 1.3% 10/15/27 | 3,550,000.00 | 3,384,337.47 | |
| | | OBL 2.1% 04/12/29 | 2,030,000.00 | 1,976,732.80 | |
| | | OBL 2.2% 04/13/28 | 2,950,000.00 | 2,891,268.45 | |
| | | OBL 2.4% 10/19/28 | 4,270,000.00 | 4,215,213.76 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | RAGB 0.25% 10/20/36 | 720,000.00 | 506,301.84 | |
| | | RAGB 0.5% 02/20/29 | 1,410,000.00 | 1,258,298.45 | |
| | | RAGB 0.5% 04/20/27 | 1,490,000.00 | 1,387,705.90 | |
| | | RAGB 0.7% 04/20/71 | 350,000.00 | 151,908.37 | |
| | | RAGB 0.75% 02/20/28 | 880,000.00 | 812,064.66 | |
| | | RAGB 0.75% 03/20/51 | 780,000.00 | 439,414.95 | |
| | | RAGB 0.75% 10/20/26 | 1,480,000.00 | 1,402,325.89 | |
| | | RAGB 0.85% 06/30/20 | 230,000.00 | 100,267.35 | |
| | | RAGB 0.9% 02/20/32 | 1,230,000.00 | 1,051,419.37 | |
| | | RAGB 0% 02/20/30 | 1,480,000.00 | 1,251,292.64 | |
| | | RAGB 0% 02/20/31 | 1,670,000.00 | 1,368,551.64 | |
| | | RAGB 0% 10/20/28 | 880,000.00 | 774,200.89 | |
| | | RAGB 0% 10/20/40 | 580,000.00 | 343,588.21 | |
| | | RAGB 1.2% 10/20/25 | 1,190,000.00 | 1,156,728.19 | |
| | | RAGB 1.5% 02/20/47 | 1,080,000.00 | 778,218.30 | |
| | | RAGB 1.5% 11/02/86 | 400,000.00 | 233,008.90 | |
| | | RAGB 1.85% 05/23/49 | 660,000.00 | 503,305.77 | |
| | | RAGB 2.1% 09/20/17 | 650,000.00 | 472,904.25 | |
| | | RAGB 2.4% 05/23/34 | 930,000.00 | 874,255.56 | |
| | | RAGB 2.9% 02/20/33 | 1,500,000.00 | 1,479,870.00 | |
| | | RAGB 2.9% 02/20/34 | 720,000.00 | 707,353.37 | |
| | | RAGB 2.9% 05/23/29 | 220,000.00 | 219,488.83 | |
| | | RAGB 3.15% 06/20/44 | 700,000.00 | 688,061.24 | |
| | | RAGB 3.15% 10/20/53 | 440,000.00 | 428,866.56 | |
| | | RAGB 3.2% 07/15/39 | 330,000.00 | 327,592.32 | |
| | | RAGB 3.45% 10/20/30 | 230,000.00 | 235,803.17 | |
| | | RAGB 3.8% 01/26/62 | 420,000.00 | 469,906.41 | |
| | | RAGB 4.15% 03/15/37 | 1,460,000.00 | 1,603,256.07 | |
| | | RAGB 4.85% 03/15/26 | 1,170,000.00 | 1,202,758.83 | |
| | | RAGB 6.25% 07/15/27 | 1,180,000.00 | 1,290,107.21 | |
| | | RFGB 0.125% 04/15/36 | 440,000.00 | 308,831.16 | |
| | | RFGB 0.125% 04/15/52 | 460,000.00 | 206,852.31 | |
| | | RFGB 0.125% 09/15/31 | 630,000.00 | 513,305.88 | |
| | | RFGB 0.25% 09/15/40 | 300,000.00 | 187,959.60 | |
| | | RFGB 0.5% 04/15/26 | 570,000.00 | 543,046.59 | |
| | | RFGB 0.5% 04/15/43 | 490,000.00 | 302,565.20 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/27 | 540,000.00 | 498,250.11 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/28 | 730,000.00 | 658,116.53 | |
| | | RFGB 0.5% 09/15/29 | 530,000.00 | 466,879.49 | |
| | | RFGB 0.75% 04/15/31 | 510,000.00 | 440,340.50 | |
| | | RFGB 0.875% 09/15/25 | 440,000.00 | 427,005.19 | |
| | | RFGB 0% 09/15/26 | 460,000.00 | 428,986.80 | |
| | | RFGB 0% 09/15/30 | 720,000.00 | 598,748.67 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | RFGB 1.125% 04/15/34 | 640,000.00 | 534,486.40 | |
| | | RFGB 1.375% 04/15/27 | 350,000.00 | 333,957.44 | |
| | | RFGB 1.375% 04/15/47 | 610,000.00 | 430,893.63 | |
| | | RFGB 1.5% 09/15/32 | 570,000.00 | 506,442.21 | |
| | | RFGB 2.625% 07/04/42 | 470,000.00 | 430,315.55 | |
| | | RFGB 2.75% 04/15/38 | 400,000.00 | 378,134.00 | |
| | | RFGB 2.75% 07/04/28 | 550,000.00 | 545,302.64 | |
| | | RFGB 2.875% 04/15/29 | 320,000.00 | 318,225.04 | |
| | | RFGB 2.95% 04/15/55 | 230,000.00 | 217,354.02 | |
| | | RFGB 3% 09/15/33 | 580,000.00 | 576,232.82 | |
| | | RFGB 3% 09/15/34 | 430,000.00 | 425,523.03 | |
| | | RFGB 4% 07/04/25 | 640,000.00 | 643,995.96 | |
| | | SPGB 0.1% 04/30/31 | 2,200,000.00 | 1,794,639.00 | |
| | | SPGB 0.5% 04/30/30 | 3,210,000.00 | 2,770,848.72 | |
| | | SPGB 0.5% 10/31/31 | 2,570,000.00 | 2,128,067.29 | |
| | | SPGB 0.6% 10/31/29 | 1,970,000.00 | 1,731,555.14 | |
| | | SPGB 0.7% 04/30/32 | 2,200,000.00 | 1,825,311.40 | |
| | | SPGB 0.8% 07/30/27 | 2,440,000.00 | 2,272,919.78 | |
| | | SPGB 0.8% 07/30/29 | 1,700,000.00 | 1,518,173.52 | |
| | | SPGB 0.85% 07/30/37 | 1,460,000.00 | 1,051,716.11 | |
| | | SPGB 0% 01/31/26 | 2,660,000.00 | 2,524,431.76 | |
| | | SPGB 0% 01/31/27 | 2,910,000.00 | 2,679,647.31 | |
| | | SPGB 0% 01/31/28 | 3,050,000.00 | 2,729,396.94 | |
| | | SPGB 0% 05/31/25 | 2,160,000.00 | 2,088,720.00 | |
| | | SPGB 1.2% 10/31/40 | 2,110,000.00 | 1,472,431.85 | |
| | | SPGB 1.25% 10/31/30 | 2,980,000.00 | 2,664,105.10 | |
| | | SPGB 1.3% 10/31/26 | 2,070,000.00 | 1,982,670.57 | |
| | | SPGB 1.4% 04/30/28 | 2,450,000.00 | 2,301,715.38 | |
| | | SPGB 1.4% 07/30/28 | 2,050,000.00 | 1,919,212.05 | |
| | | SPGB 1.45% 04/30/29 | 2,690,000.00 | 2,496,403.39 | |
| | | SPGB 1.45% 10/31/27 | 2,280,000.00 | 2,160,791.33 | |
| | | SPGB 1.45% 10/31/71 | 660,000.00 | 322,263.15 | |
| | | SPGB 1.5% 04/30/27 | 1,500,000.00 | 1,433,346.18 | |
| | | SPGB 1.85% 07/30/35 | 2,190,000.00 | 1,877,416.92 | |
| | | SPGB 1.9% 10/31/52 | 1,810,000.00 | 1,210,440.21 | |
| | | SPGB 1.95% 04/30/26 | 2,300,000.00 | 2,246,656.10 | |
| | | SPGB 1.95% 07/30/30 | 2,020,000.00 | 1,894,263.08 | |
| | | SPGB 1% 07/30/42 | 1,180,000.00 | 765,657.74 | |
| | | SPGB 1% 10/31/50 | 2,000,000.00 | 1,083,050.00 | |
| | | SPGB 2.15% 10/31/25 | 1,570,000.00 | 1,545,968.40 | |
| | | SPGB 2.35% 07/30/33 | 2,190,000.00 | 2,033,418.27 | |
| | | SPGB 2.5% 05/31/27 | 1,270,000.00 | 1,246,702.48 | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | SPGB 2.55% 10/31/32 | 2,530,000.00 | 2,406,710.57 | |
| | | SPGB 2.7% 10/31/48 | 1,710,000.00 | 1,416,516.97 | |
| | | SPGB 2.8% 05/31/26 | 1,670,000.00 | 1,655,569.69 | |
| | | SPGB 2.9% 10/31/46 | 1,850,000.00 | 1,610,040.65 | |
| | | SPGB 3.15% 04/30/33 | 1,990,000.00 | 1,972,732.77 | |
| | | SPGB 3.25% 04/30/34 | 2,150,000.00 | 2,132,475.65 | |
| | | SPGB 3.45% 07/30/43 | 1,190,000.00 | 1,138,762.75 | |
| | | SPGB 3.45% 07/30/66 | 1,530,000.00 | 1,386,011.87 | |
| | | SPGB 3.5% 05/31/29 | 660,000.00 | 672,427.14 | |
| | | SPGB 3.55% 10/31/33 | 2,270,000.00 | 2,313,947.20 | |
| | | SPGB 3.9% 07/30/39 | 1,660,000.00 | 1,707,476.00 | |
| | | SPGB 4.2% 01/31/37 | 1,800,000.00 | 1,930,010.76 | |
| | | SPGB 4.65% 07/30/25 | 2,840,000.00 | 2,878,943.50 | |
| | | SPGB 4.7% 07/30/41 | 1,880,000.00 | 2,122,593.32 | |
| | | SPGB 4.9% 07/30/40 | 1,730,000.00 | 1,985,546.08 | |
| | | SPGB 4% 10/31/54 | 650,000.00 | 658,771.75 | |
| | | SPGB 5.15% 10/31/28 | 3,710,000.00 | 4,024,183.20 | |
| | | SPGB 5.15% 10/31/44 | 1,420,000.00 | 1,700,302.32 | |
| | | SPGB 5.75% 07/30/32 | 2,250,000.00 | 2,658,006.45 | |
| | | SPGB 5.9% 07/30/26 | 2,310,000.00 | 2,435,141.24 | |
| | | SPGB 6.0% 01/31/29 | 910,000.00 | 1,024,939.82 | |
| | ユーロ 小計 | | 683,970,000.00 | 630,549,205.25<br>(106,707,842,004) | |
| | イギリスポンド | UKT 0.125% 01/30/26 | 1,260,000.00 | 1,176,553.98 | |
| | | UKT 0.125% 01/31/28 | 1,510,000.00 | 1,304,141.70 | |
| | | UKT 0.25% 07/31/31 | 2,710,000.00 | 2,068,482.02 | |
| | | UKT 0.375% 10/22/26 | 2,980,000.00 | 2,715,174.93 | |
| | | UKT 0.375% 10/22/30 | 1,930,000.00 | 1,532,591.77 | |
| | | UKT 0.5% 01/31/29 | 2,180,000.00 | 1,847,855.20 | |
| | | UKT 0.5% 10/22/61 | 2,150,000.00 | 633,605.00 | |
| | | UKT 0.625% 06/07/25 | 1,130,000.00 | 1,085,314.15 | |
| | | UKT 0.625% 07/31/35 | 2,250,000.00 | 1,522,428.75 | |
| | | UKT 0.625% 10/22/50 | 1,450,000.00 | 574,381.25 | |
| | | UKT 0.875% 01/31/46 | 1,530,000.00 | 749,241.00 | |
| | | UKT 0.875% 07/31/33 | 3,400,000.00 | 2,544,338.65 | |
| | | UKT 0.875% 10/22/29 | 2,060,000.00 | 1,745,232.00 | |
| | | UKT 1.125% 01/31/39 | 2,050,000.00 | 1,314,255.00 | |
| | | UKT 1.125% 10/22/73 | 1,050,000.00 | 375,900.00 | |
| | | UKT 1.25% 07/22/27 | 1,250,000.00 | 1,141,562.50 | |
| | | UKT 1.25% 07/31/51 | 2,420,000.00 | 1,162,129.98 | |
| | | UKT 1.25% 10/22/41 | 2,030,000.00 | 1,228,198.72 | |
| | | UKT 1.5% 07/22/26 | 1,600,000.00 | 1,507,952.00 | |
| | | UKT 1.5% 07/22/47 | 1,700,000.00 | 945,935.08 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | UKT 1.5% 07/31/53 | 1,140,000.00 | 571,561.80 | |
| | UKT 1.625% 10/22/28 | 1,070,000.00 | 964,679.90 | |
| | UKT 1.625% 10/22/54 | 1,340,000.00 | 688,224.00 | |
| | UKT 1.625% 10/22/71 | 1,550,000.00 | 700,600.00 | |
| | UKT 1.75% 01/22/49 | 1,080,000.00 | 624,086.64 | |
| | UKT 1.75% 07/22/57 | 1,740,000.00 | 907,443.75 | |
| | UKT 1.75% 09/07/37 | 1,890,000.00 | 1,388,961.00 | |
| | UKT 1% 01/31/32 | 3,700,000.00 | 2,942,425.00 | |
| | UKT 2.5% 07/22/65 | 1,420,000.00 | 885,938.00 | |
| | UKT 2% 09/07/25 | 2,380,000.00 | 2,301,555.20 | |
| | UKT 3.25% 01/22/44 | 2,010,000.00 | 1,650,009.00 | |
| | UKT 3.25% 01/31/33 | 3,960,000.00 | 3,688,725.74 | |
| | UKT 3.5% 01/22/45 | 1,820,000.00 | 1,541,581.86 | |
| | UKT 3.5% 07/22/68 | 1,470,000.00 | 1,184,767.08 | |
| | UKT 3.5% 10/22/25 | 2,350,000.00 | 2,309,869.05 | |
| | UKT 3.75% 01/29/38 | 1,930,000.00 | 1,790,075.00 | |
| | UKT 3.75% 03/07/27 | 650,000.00 | 637,131.21 | |
| | UKT 3.75% 07/22/52 | 1,150,000.00 | 986,403.53 | |
| | UKT 3.75% 10/22/53 | 2,910,000.00 | 2,481,939.00 | |
| | UKT 4.125% 01/29/27 | 3,340,000.00 | 3,308,403.60 | |
| | UKT 4.25% 03/07/36 | 1,890,000.00 | 1,872,234.00 | |
| | UKT 4.25% 06/07/32 | 1,320,000.00 | 1,331,140.80 | |
| | UKT 4.25% 09/07/39 | 1,270,000.00 | 1,231,480.90 | |
| | UKT 4.25% 12/07/27 | 1,800,000.00 | 1,800,090.00 | |
| | UKT 4.25% 12/07/40 | 1,450,000.00 | 1,396,572.57 | |
| | UKT 4.25% 12/07/46 | 1,770,000.00 | 1,666,278.00 | |
| | UKT 4.25% 12/07/49 | 1,610,000.00 | 1,508,892.00 | |
| | UKT 4.25% 12/07/55 | 1,700,000.00 | 1,586,270.00 | |
| | UKT 4.375% 07/31/54 | 1,250,000.00 | 1,188,095.74 | |
| | UKT 4.5% 06/07/28 | 2,690,000.00 | 2,707,943.64 | |
| | UKT 4.5% 09/07/34 | 1,390,000.00 | 1,414,325.00 | |
| | UKT 4.5% 12/07/42 | 2,440,000.00 | 2,403,888.00 | |
| | UKT 4.625% 01/31/34 | 2,230,000.00 | 2,293,905.54 | |
| | UKT 4.75% 10/22/43 | 1,170,000.00 | 1,183,923.00 | |
| | UKT 4.75% 12/07/30 | 1,710,000.00 | 1,772,226.90 | |
| | UKT 4.75% 12/07/38 | 1,400,000.00 | 1,438,640.00 | |
| | UKT 4% 01/22/60 | 1,250,000.00 | 1,118,500.00 | |
| | UKT 4% 10/22/63 | 1,190,000.00 | 1,060,191.11 | |
| | UKT 6.0% 12/07/28 | 2,010,000.00 | 2,160,589.20 | |
| イギリスポンド 小計 | | 109,080,000.00 | 89,864,840.44<br>(17,947,805,932) | |
| スウェーデンクローナ | SGB 0.125% 05/12/31 | 5,280,000.00 | 4,540,237.30 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SGB 0.75% 05/12/28 | 6,780,000.00 | 6,350,093.89 | |
| | SGB 0.75% 11/12/29 | 6,440,000.00 | 5,941,828.71 | |
| | SGB 1.75% 11/11/33 | 4,360,000.00 | 4,143,472.13 | |
| | SGB 1% 11/12/26 | 7,140,000.00 | 6,876,113.23 | |
| | SGB 2.25% 06/01/32 | 5,510,000.00 | 5,466,652.33 | |
| | SGB 3.5% 03/30/39 | 3,970,000.00 | 4,481,534.50 | |
| スウェーデンクローナ 小計 | | 39,480,000.00 | 37,799,932.09<br>(562,084,990) | |
| ノルウェークローネ | NGB 1.25% 09/17/31 | 4,780,000.00 | 4,082,042.32 | |
| | NGB 1.375% 08/19/30 | 5,200,000.00 | 4,581,499.00 | |
| | NGB 1.5% 02/19/26 | 4,520,000.00 | 4,347,158.81 | |
| | NGB 1.75% 02/17/27 | 4,630,000.00 | 4,408,616.55 | |
| | NGB 1.75% 09/06/29 | 4,100,000.00 | 3,753,327.53 | |
| | NGB 2.125% 05/18/32 | 3,730,000.00 | 3,365,336.55 | |
| | NGB 2% 04/26/28 | 4,650,000.00 | 4,391,111.25 | |
| | NGB 3.5% 10/06/42 | 1,860,000.00 | 1,863,464.25 | |
| | NGB 3.625% 04/13/34 | 2,470,000.00 | 2,470,290.71 | |
| | NGB 3% 08/15/33 | 5,180,000.00 | 4,949,231.00 | |
| ノルウェークローネ 小計 | | 41,120,000.00 | 38,212,077.97<br>(559,042,700) | |
| デンマーククローネ | DGB 0.25% 11/15/52 | 5,570,000.00 | 2,901,495.42 | |
| | DGB 0.5% 11/15/27 | 4,430,000.00 | 4,113,483.08 | |
| | DGB 0.5% 11/15/29 | 5,290,000.00 | 4,741,683.56 | |
| | DGB 0% 11/15/31 | 6,540,000.00 | 5,438,277.32 | |
| | DGB 1.75% 11/15/25 | 6,560,000.00 | 6,443,951.10 | |
| | DGB 2.25% 11/15/33 | 4,010,000.00 | 3,893,129.93 | |
| | DGB 4.5% 11/15/39 | 9,470,000.00 | 11,513,398.72 | |
| デンマーククローネ 小計 | | 41,870,000.00 | 39,045,419.13<br>(885,550,105) | |
| ポーランドズロチ | POLGB 0.25% 10/25/26 | 4,500,000.00 | 4,009,419.00 | |
| | POLGB 0% 10/25/25 | 940,000.00 | 878,562.54 | |
| | POLGB 1.25% 10/25/30 | 3,900,000.00 | 3,020,481.75 | |
| | POLGB 1.75% 04/25/32 | 4,610,000.00 | 3,494,769.53 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 4,900,000.00 | 4,636,215.85 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/27 | 4,530,000.00 | 4,166,820.84 | |
| | POLGB 2.75% 04/25/28 | 3,270,000.00 | 2,976,053.16 | |
| | POLGB 2.75% 10/25/29 | 6,000,000.00 | 5,248,476.00 | |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 4,480,000.00 | 4,394,698.55 | |
| | POLGB 3.75% 05/25/27 | 2,110,000.00 | 2,021,941.78 | |
| | POLGB 5.75% 04/25/29 | 4,320,000.00 | 4,367,975.76 | |
| | POLGB 6% 10/25/33 | 4,350,000.00 | 4,448,587.07 | |
| | POLGB 7.5% 07/25/28 | 3,610,000.00 | 3,874,836.82 | |
| | | 51,520,000.00 | 47,538,838.65 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ポーランドズロチ 小計 | | | (1,865,690,246) | |
| オーストラリアドル | ACGB 0.25% 11/21/25 | 2,100,000.00 | 1,986,835.36 | |
| | ACGB 0.5% 09/21/26 | 2,390,000.00 | 2,213,419.72 | |
| | ACGB 1.25% 05/21/32 | 2,770,000.00 | 2,232,338.76 | |
| | ACGB 1.5% 06/21/31 | 2,400,000.00 | 2,025,258.00 | |
| | ACGB 1.75% 06/21/51 | 1,860,000.00 | 1,041,828.36 | |
| | ACGB 1.75% 11/21/32 | 2,000,000.00 | 1,657,692.98 | |
| | ACGB 1% 11/21/31 | 2,780,000.00 | 2,230,390.99 | |
| | ACGB 1% 12/21/30 | 1,710,000.00 | 1,414,407.19 | |
| | ACGB 2.25% 05/21/28 | 1,480,000.00 | 1,391,664.95 | |
| | ACGB 2.5% 05/21/30 | 2,340,000.00 | 2,156,012.51 | |
| | ACGB 2.75% 05/21/41 | 1,330,000.00 | 1,055,386.14 | |
| | ACGB 2.75% 06/21/35 | 1,470,000.00 | 1,276,474.09 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/27 | 1,530,000.00 | 1,474,067.28 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/28 | 1,660,000.00 | 1,582,311.07 | |
| | ACGB 2.75% 11/21/29 | 1,780,000.00 | 1,674,934.32 | |
| | ACGB 3.25% 04/21/29 | 1,810,000.00 | 1,755,835.17 | |
| | ACGB 3.25% 06/21/39 | 940,000.00 | 821,115.11 | |
| | ACGB 3.5% 12/21/34 | 1,690,000.00 | 1,584,871.51 | |
| | ACGB 3.75% 04/21/37 | 1,220,000.00 | 1,152,342.96 | |
| | ACGB 3.75% 05/21/34 | 1,980,000.00 | 1,905,087.39 | |
| | ACGB 3% 03/21/47 | 1,350,000.00 | 1,046,218.62 | |
| | ACGB 3% 11/21/33 | 1,840,000.00 | 1,668,312.23 | |
| | ACGB 4.25% 04/21/26 | 1,770,000.00 | 1,778,433.87 | |
| | ACGB 4.5% 04/21/33 | 3,010,000.00 | 3,080,129.38 | |
| | ACGB 4.75% 04/21/27 | 2,010,000.00 | 2,055,898.14 | |
| | ACGB 4.75% 06/21/54 | 720,000.00 | 739,377.36 | |
| オーストラリアドル 小計 | | 47,940,000.00 | 43,000,643.46<br>(4,438,956,424) | |
| ニュージーランドドル | NZGB 0.25% 05/15/28 | 990,000.00 | 838,444.41 | |
| | NZGB 0.5% 05/15/26 | 730,000.00 | 672,663.40 | |
| | NZGB 1.5% 05/15/31 | 1,000,000.00 | 821,376.88 | |
| | NZGB 1.75% 05/15/41 | 460,000.00 | 294,577.09 | |
| | NZGB 2.75% 04/15/37 | 630,000.00 | 508,086.86 | |
| | NZGB 2.75% 05/15/51 | 600,000.00 | 407,979.19 | |
| | NZGB 2% 05/15/32 | 900,000.00 | 747,488.31 | |
| | NZGB 3.5% 04/14/33 | 1,320,000.00 | 1,214,842.59 | |
| | NZGB 3% 04/20/29 | 830,000.00 | 776,270.46 | |
| | NZGB 4.25% 05/15/34 | 450,000.00 | 436,204.59 | |
| | NZGB 4.5% 04/15/27 | 930,000.00 | 926,580.48 | |
| | NZGB 4.5% 05/15/30 | 490,000.00 | 490,046.59 | |
| | NZGB 4.5% 05/15/35 | 440,000.00 | 433,029.98 | |
| | NZGB 5% 05/15/54 | 380,000.00 | 383,973.24 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ニュージーランドドル 小計 | | 10,150,000.00 | 8,951,564.07<br>(857,470,322) | |
| シンガポールドル | SIGB 0.5% 11/01/25 | 790,000.00 | 758,279.58 | |
| | SIGB 1.25% 11/01/26 | 870,000.00 | 828,870.75 | |
| | SIGB 1.625% 07/01/31 | 560,000.00 | 503,910.66 | |
| | SIGB 1.875% 03/01/50 | 730,000.00 | 568,849.06 | |
| | SIGB 1.875% 10/01/51 | 420,000.00 | 326,004.00 | |
| | SIGB 2.125% 06/01/26 | 830,000.00 | 810,102.43 | |
| | SIGB 2.25% 08/01/36 | 760,000.00 | 685,987.85 | |
| | SIGB 2.375% 06/01/25 | 900,000.00 | 889,814.29 | |
| | SIGB 2.375% 07/01/39 | 380,000.00 | 342,875.90 | |
| | SIGB 2.625% 05/01/28 | 720,000.00 | 704,859.20 | |
| | SIGB 2.625% 08/01/32 | 460,000.00 | 440,578.18 | |
| | SIGB 2.75% 03/01/46 | 820,000.00 | 768,967.30 | |
| | SIGB 2.75% 04/01/42 | 630,000.00 | 593,739.86 | |
| | SIGB 2.875% 07/01/29 | 650,000.00 | 640,444.01 | |
| | SIGB 2.875% 09/01/27 | 420,000.00 | 415,351.81 | |
| | SIGB 2.875% 09/01/30 | 710,000.00 | 696,343.24 | |
| | SIGB 3.375% 09/01/33 | 1,070,000.00 | 1,083,157.67 | |
| | SIGB 3.5% 03/01/27 | 740,000.00 | 744,067.55 | |
| | SIGB 3% 04/01/29 | 150,000.00 | 148,916.25 | |
| | SIGB 3% 08/01/72 | 490,000.00 | 477,084.82 | |
| シンガポールドル 小計 | | 13,100,000.00 | 12,428,204.41<br>(1,442,417,403) | |
| マレーシアリンギット | MGS 2.632% 04/15/31 | 1,650,000.00 | 1,533,300.10 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 1,510,000.00 | 1,507,748.93 | |
| | MGS 3.519% 04/20/28 | 710,000.00 | 707,077.89 | |
| | MGS 3.582% 07/15/32 | 1,310,000.00 | 1,285,001.01 | |
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 2,930,000.00 | 2,940,177.35 | |
| | MGS 3.757% 05/22/40 | 2,950,000.00 | 2,842,177.02 | |
| | MGS 3.828% 07/05/34 | 1,770,000.00 | 1,762,382.11 | |
| | MGS 3.844% 04/15/33 | 1,880,000.00 | 1,876,575.88 | |
| | MGS 3.885% 08/15/29 | 2,160,000.00 | 2,182,141.08 | |
| | MGS 3.892% 03/15/27 | 1,130,000.00 | 1,140,711.94 | |
| | MGS 3.899% 11/16/27 | 1,970,000.00 | 1,989,920.44 | |
| | MGS 3.9% 11/30/26 | 2,470,000.00 | 2,494,773.11 | |
| | MGS 3.906% 07/15/26 | 600,000.00 | 605,440.56 | |
| | MGS 3.955% 09/15/25 | 1,690,000.00 | 1,701,903.85 | |
| | MGS 4.065% 06/15/50 | 3,070,000.00 | 2,996,803.06 | |
| | MGS 4.232% 06/30/31 | 2,490,000.00 | 2,553,696.93 | |
| | MGS 4.254% 05/31/35 | 1,750,000.00 | 1,798,317.15 | |
| | MGS 4.392% 04/15/26 | 2,340,000.00 | 2,379,381.49 | |
| | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | MGS 4.457% 03/31/53 | 1,090,000.00 | 1,132,773.34 | |
| | | MGS 4.498% 04/15/30 | 3,070,000.00 | 3,189,506.19 | |
| | | MGS 4.504% 04/30/29 | 350,000.00 | 363,080.06 | |
| | | MGS 4.642% 11/07/33 | 870,000.00 | 922,155.71 | |
| | | MGS 4.696% 10/15/42 | 1,970,000.00 | 2,111,984.00 | |
| | | MGS 4.736% 03/15/46 | 980,000.00 | 1,056,152.66 | |
| | | MGS 4.762% 04/07/37 | 2,780,000.00 | 2,990,544.69 | |
| | | MGS 4.893% 06/08/38 | 1,840,000.00 | 2,012,349.67 | |
| | | MGS 4.921% 07/06/48 | 1,680,000.00 | 1,860,489.12 | |
| | | MGS 4.935% 09/30/43 | 1,030,000.00 | 1,135,241.17 | |
| | マレーシアリンギット 小計 | | 50,040,000.00 | 51,071,806.51<br>(1,698,632,962) | |
| | イスラエルシェケル | ILGOV 0.5% 02/27/26 | 1,510,000.00 | 1,420,763.07 | |
| | | ILGOV 1.3% 04/30/32 | 2,510,000.00 | 1,942,463.14 | |
| | | ILGOV 1.5% 05/31/37 | 2,880,000.00 | 1,925,392.32 | |
| | | ILGOV 1.75% 08/31/25 | 3,450,000.00 | 3,344,890.91 | |
| | | ILGOV 1% 03/31/30 | 3,530,000.00 | 2,881,026.44 | |
| | | ILGOV 2.25% 09/28/28 | 2,700,000.00 | 2,471,258.16 | |
| | | ILGOV 2.8% 11/29/52 | 1,420,000.00 | 899,704.19 | |
| | | ILGOV 2% 03/31/27 | 2,530,000.00 | 2,368,863.28 | |
| | | ILGOV 3.75% 02/28/29 | 2,040,000.00 | 1,975,781.82 | |
| | | ILGOV 3.75% 03/31/47 | 2,570,000.00 | 2,057,170.63 | |
| | | ILGOV 3.75% 09/30/27 | 230,000.00 | 225,620.22 | |
| | | ILGOV 4% 03/30/35 | 760,000.00 | 706,434.59 | |
| | | ILGOV 5.5% 01/31/42 | 1,880,000.00 | 1,955,407.36 | |
| | | ILGOV 6.25% 10/30/26 | 1,340,000.00 | 1,394,089.23 | |
| | イスラエルシェケル 小計 | | 29,350,000.00 | 25,568,865.36<br>(1,067,707,236) | |
| | オフショア人民元 | CGB 2.04% 02/25/27 | 41,310,000.00 | 41,461,607.70 | |
| | | CGB 2.18% 08/15/26 | 28,600,000.00 | 28,801,226.74 | |
| | | CGB 2.18% 08/25/25 | 17,100,000.00 | 17,192,528.10 | |
| | | CGB 2.22% 09/25/25 | 27,270,000.00 | 27,453,188.95 | |
| | | CGB 2.28% 03/25/31 | 5,000,000.00 | 5,024,050.00 | |
| | | CGB 2.28% 11/25/25 | 30,220,000.00 | 30,455,416.82 | |
| | | CGB 2.3% 05/15/26 | 47,100,000.00 | 47,560,482.57 | |
| | | CGB 2.33% 12/15/25 | 35,250,000.00 | 35,573,397.60 | |
| | | CGB 2.35% 02/25/34 | 13,000,000.00 | 13,064,088.70 | |
| | | CGB 2.37% 01/15/29 | 19,460,000.00 | 19,749,099.70 | |
| | | CGB 2.37% 01/20/27 | 43,880,000.00 | 44,404,357.22 | |
| | | CGB 2.39% 11/15/26 | 42,750,000.00 | 43,272,434.92 | |
| | | CGB 2.4% 07/15/28 | 42,610,000.00 | 43,217,865.73 | |
| | | CGB 2.44% 10/15/27 | 17,700,000.00 | 17,956,789.83 | |
| | | CGB 2.46% 02/15/26 | 29,300,000.00 | 29,636,557.38 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CGB 2.48% 04/15/27 | 20,000,000.00 | 20,331,106.00 | |
| | | CGB 2.48% 09/25/28 | 26,500,000.00 | 26,967,017.45 | |
| | | CGB 2.49% 05/25/44 | 3,350,000.00 | 3,360,149.83 | |
| | | CGB 2.5% 07/25/27 | 26,760,000.00 | 27,216,530.95 | |
| | | CGB 2.52% 08/25/33 | 58,370,000.00 | 59,401,929.06 | |
| | | CGB 2.54% 12/25/30 | 30,500,000.00 | 31,150,519.25 | |
| | | CGB 2.55% 10/15/28 | 27,250,000.00 | 27,836,090.27 | |
| | | CGB 2.6% 09/01/32 | 32,050,000.00 | 32,801,485.96 | |
| | | CGB 2.6% 09/15/30 | 30,500,000.00 | 31,246,338.05 | |
| | | CGB 2.62% 04/15/28 | 23,550,000.00 | 24,066,894.24 | |
| | | CGB 2.62% 06/25/30 | 36,400,000.00 | 37,333,001.16 | |
| | | CGB 2.62% 09/25/29 | 20,940,000.00 | 21,482,082.15 | |
| | | CGB 2.64% 01/15/28 | 38,220,000.00 | 39,062,869.48 | |
| | | CGB 2.67% 05/25/33 | 34,280,000.00 | 35,254,453.56 | |
| | | CGB 2.67% 11/25/33 | 13,600,000.00 | 14,020,022.40 | |
| | | CGB 2.68% 05/21/30 | 33,530,000.00 | 34,522,504.76 | |
| | | CGB 2.69% 08/12/26 | 32,900,000.00 | 33,516,401.24 | |
| | | CGB 2.69% 08/15/32 | 19,420,000.00 | 20,008,593.01 | |
| | | CGB 2.75% 02/17/32 | 14,500,000.00 | 15,006,271.85 | |
| | | CGB 2.75% 06/15/29 | 25,490,000.00 | 26,318,172.64 | |
| | | CGB 2.76% 05/15/32 | 10,700,000.00 | 11,081,304.13 | |
| | | CGB 2.79% 12/15/29 | 30,300,000.00 | 31,331,342.31 | |
| | | CGB 2.8% 03/24/29 | 23,080,000.00 | 23,863,960.66 | |
| | | CGB 2.8% 03/25/30 | 42,000,000.00 | 43,526,758.80 | |
| | | CGB 2.8% 11/15/32 | 4,600,000.00 | 4,780,182.00 | |
| | | CGB 2.85% 06/04/27 | 31,030,000.00 | 31,902,790.11 | |
| | | CGB 2.88% 02/25/33 | 11,300,000.00 | 11,826,602.60 | |
| | | CGB 2.89% 11/18/31 | 24,210,000.00 | 25,293,370.86 | |
| | | CGB 2.91% 10/14/28 | 29,200,000.00 | 30,295,779.64 | |
| | | CGB 2% 06/15/25 | 15,450,000.00 | 15,502,143.75 | |
| | | CGB 3.01% 05/13/28 | 12,590,000.00 | 13,095,575.37 | |
| | | CGB 3.02% 05/27/31 | 21,690,000.00 | 22,858,268.94 | |
| | | CGB 3.02% 10/22/25 | 53,270,000.00 | 54,251,473.11 | |
| | | CGB 3.03% 03/11/26 | 18,800,000.00 | 19,226,812.64 | |
| | | CGB 3.12% 10/25/52 | 8,970,000.00 | 9,921,170.72 | |
| | | CGB 3.19% 04/15/53 | 18,160,000.00 | 20,466,630.53 | |
| | | CGB 3.27% 11/19/30 | 6,850,000.00 | 7,341,122.39 | |
| | | CGB 3.28% 12/03/27 | 14,110,000.00 | 14,793,444.65 | |
| | | CGB 3.29% 05/23/29 | 35,000,000.00 | 37,265,830.00 | |
| | | CGB 3.32% 04/15/52 | 18,600,000.00 | 21,275,213.81 | |
| | | CGB 3.39% 03/16/50 | 20,930,000.00 | 24,048,281.16 | |
| | | CGB 3.53% 10/18/51 | 8,350,000.00 | 9,878,171.07 | |
| | | CGB 3.72% 04/12/51 | 13,540,000.00 | 16,478,324.87 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CGB 3.81% 09/14/50 | 19,620,000.00 | 24,155,714.32 | |
| | | CGB 3.86% 07/22/49 | 17,280,000.00 | 21,310,833.02 | |
| | | CGB 3% 10/15/53 | 9,330,000.00 | 10,200,768.90 | |
| | | CGB 4.08% 10/22/48 | 15,720,000.00 | 19,996,533.25 | |
| | オフショア人民元 小計 | | 1,523,340,000.00 | 1,581,693,928.88<br>(34,164,272,525) | |
| 合計 | | | | 343,337,973,241<br>(343,337,973,241) | |

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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| アメリカドル | 国債証券　209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% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券　369銘柄 | 100.0% | 31.1% |
| 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　7銘柄 | 100.0% | 0.2% |
| ノルウェークローネ | 国債証券　10銘柄 | 100.0% | 0.2% |
| デンマーククローネ | 国債証券　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% |
| マレーシアリンギット | 国債証券　28銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| イスラエルシェケル | 国債証券　14銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| オフショア人民元 | 国債証券　62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。

## 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 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 5,679,534,047 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| コール・ローン | 178,761,782 |
| 株式 | 201,917,761,199 |
| 投資信託受益証券 | 445,041,045 |
| 投資証券 | 198,609,864 |
| 派生商品評価勘定 | 88,710,443 |
| 未収入金 | 2,382,931 |
| 未収配当金 | 377,137,694 |
| 未収利息 | 329 |
| 差入委託証拠金 | 1,779,658,814 |
| 流動資産合計 | 210,667,598,148 |
| 資産合計 | 210,667,598,148 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 65,842,930 |
| 前受金 | 22,278,933 |
| 未払金 | 278,677,428 |
| 未払解約金 | 100,790,187 |
| 流動負債合計 | 467,589,478 |
| 負債合計 | 467,589,478 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 45,436,887,816 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 164,763,120,854 |
| 元本等合計 | 210,200,008,670 |
| 純資産合計 | 210,200,008,670 |
| 負債純資産合計 | 210,667,598,148 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)投資証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| | 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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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 6月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 45,436,887,816口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 4.6262円<br>(1万口当たり純資産額) (46,262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 6月10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。<br>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。<br>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 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 |

| | 2024年 6月10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 | (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br><br>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。<br>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 6月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 6月13日 |
| 期首元本額 | 42,049,511,619円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,787,054,553円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,399,678,356円 |
| 期末元本額 | 45,436,887,816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 | 7,202,261,613円 |
| 世界経済インデックスファンド | 12,125,609,847円 |
| ＤＣ新興国株式インデックス・オープン | 6,202,036,395円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 7,744,961,035円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 78,387,758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） | 1,322,749,098円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 802,327,747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） | 364,647,774円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 18,456,508円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 95,812,576円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 32,497,669円 |
| 外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 2,287,415,109円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 284,089,283円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,304,580,306円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 213,097,133円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 7,352,207円 |
| グローバル経済コア | 649,154,800円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード） | 447,288,396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・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 119,071,973円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 117,051,991円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 51,940,229円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 64,870,529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 | 22,411,953円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 100,064円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,555,801,973円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 133,004,798円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 85,579,104円 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用） | 12,665,918円 |
| ＦＯＦｓ用　新興国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用） | 21,779,998円 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 24,146,098,559 |
| 投資信託受益証券 | 12,146,257 |
| 投資証券 | △34,578,787 |
| 合計 | 24,123,666,029 |

(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 6月10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 | 7,629,725,884 | － | 7,652,004,817 | 22,278,933 |
| 合計 | | 7,629,725,884 | － | 7,652,004,817 | 22,278,933 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年 6月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 198,764,200 | － | 199,352,780 | 588,580 |
| | アメリカドル | 198,764,200 | － | 199,352,780 | 588,580 |
| 合計 | | 198,764,200 | － | 199,352,780 | 588,580 |

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

## 第１　有価証券明細表
### (1)株式

| 通 貨 | 銘　柄 | 株式数（株） | 評価額 | | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | INNER MONGOLIA YITAI COAL-B | 139,400 | 1.85 | 258,447.60 | |
| | CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 36,930 | 16.80 | 620,424.00 | |
| | 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 | 108.90 | 1,732,816.80 | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 72,831 | 23.66 | 1,723,181.46 | |
| | NIO INC - ADR | 231,271 | 4.83 | 1,117,038.93 | |
| | H WORLD GROUP LTD-ADR | 40,826 | 34.85 | 1,422,786.10 | |
| | TAL EDUCATION GROUP- ADR | 79,268 | 10.75 | 852,131.00 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 66,452 | 35.18 | 2,337,781.36 | |
| | AUTOHOME INC-ADR | 12,283 | 27.68 | 339,993.44 | |
| | IQIYI INC-ADR | 59,454 | 4.23 | 251,490.42 | |
| | KANZHUN LTD | 38,815 | 21.42 | 831,417.30 | |
| | TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 158,547 | 14.07 | 2,230,756.29 | |
| | VK CO LTD | 19,368 | 0.00 | — | |
| | OZON HOLDINGS PLC - ADR | 7,523 | 0.00 | — | |
| | PDD HOLDINGS INC-ADR | 104,219 | 143.90 | 14,997,114.10 | |
| | VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 54,676 | 16.11 | 880,830.36 | |
| | LEGEND BIOTECH CORP-ADR | 14,788 | 45.57 | 673,889.16 | |
| | COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 488,730 | 1.60 | 781,968.00 | |
| | CREDICORP LTD | 10,882 | 160.25 | 1,743,840.50 | |
| | TCS GROUP HOLDING-GDR REG S | 14,044 | 0.00 | — | |
| | QIFU TECHNOLOGY INC | 20,753 | 19.94 | 413,814.82 | |
| | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 140,760 | 2.14 | 301,930.20 | |
| | KE HOLDINGS INC | 114,048 | 15.92 | 1,815,644.16 | |
| アメリカドル 小計 | | 1,980,728 | | 35,327,296.00<br>(5,546,738,744) | |
| メキシコペソ | CEMEX SAB-SPONS | 2,664,261 | 12.10 | 32,237,558.10 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 488,892 | 95.15 | 46,518,073.80 | |
| | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 35,000 | 241.62 | 8,456,700.00 | |
| | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 178,552 | 26.15 | 4,669,134.80 | |
| | ALFA S.A.B.-A | 313,500 | 11.17 | 3,501,795.00 | |
| | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 102,000 | 134.19 | 13,687,380.00 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | 33,575 | 563.85 | 18,931,263.75 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT | 53,100 | 163.10 | 8,660,610.00 | |
| | GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B | 59,980 | 295.66 | 17,733,686.80 | |
| | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 42,685 | 175.01 | 7,470,301.85 | |
| | WALMART DE MEXICO-SER V | 941,080 | 62.59 | 58,902,197.20 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM | 81,875 | 174.58 | 14,293,737.50 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 313,140 | 198.72 | 62,227,180.80 | |
| | GRUMA S.A.B.-B | 25,960 | 334.27 | 8,677,649.20 | |
| | GRUPO BIMBO SAB- SERIES A | 279,600 | 67.63 | 18,909,348.00 | |
| | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 181,800 | 33.54 | 6,097,572.00 | |
| | BANCO DEL BAJIO SA | 142,700 | 53.02 | 7,565,954.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 451,600 | 139.31 | 62,912,396.00 | |
| | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 271,700 | 44.47 | 12,082,499.00 | |
| | AMERICA MOVIL SAB DE CV | 3,521,340 | 15.86 | 55,848,452.40 | |
| | OPERADORA DE SITES MEX- A-1 | 221,100 | 17.70 | 3,913,470.00 | |
| メキシコペソ 小計 | | 10,403,440 | | 473,296,960.20<br>(4,044,464,513) | |
| ブラジルレアル | COSAN SA | 162,100 | 12.72 | 2,061,912.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 634,100 | 38.59 | 24,469,919.00 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 841,840 | 36.94 | 31,097,569.60 | |
| | PRIO SA | 130,000 | 39.92 | 5,189,600.00 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 151,900 | 22.16 | 3,366,104.00 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 99,400 | 12.44 | 1,236,536.00 | |
| | GERDAU SA-PREF | 186,708 | 16.97 | 3,168,434.76 | |
| | SUZANO SA | 121,779 | 48.65 | 5,924,548.35 | |
| | VALE SA | 581,587 | 60.41 | 35,133,670.67 | |
| | WEG SA | 314,144 | 37.85 | 11,890,350.40 | |
| | CCR SA | 248,600 | 11.91 | 2,960,826.00 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 137,340 | 42.75 | 5,871,285.00 | |
| | RUMO SA | 244,300 | 19.80 | 4,837,140.00 | |
| | LOJAS RENNER S.A. | 216,447 | 13.17 | 2,850,606.99 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 173,000 | 20.80 | 3,598,400.00 | |
| | ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC | 132,600 | 9.73 | 1,290,198.00 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 259,280 | 25.32 | 6,564,969.60 | |
| | SENDAS DISTRIBUIDORA SA | 299,700 | 12.00 | 3,596,400.00 | |
| | AMBEV SA | 756,200 | 11.56 | 8,741,672.00 | |
| | BRF SA | 119,300 | 18.33 | 2,186,769.00 | |
| | JBS SA | 110,000 | 29.24 | 3,216,400.00 | |
| | NATURA &CO HOLDING SA | 200,308 | 15.10 | 3,024,650.80 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 1,045,154 | 3.89 | 4,065,649.06 | |
| | REDE D'OR SAO LUIZ SA | 95,700 | 26.91 | 2,575,287.00 | |
| | HYPERA SA | 54,500 | 28.71 | 1,564,695.00 | |
| | BANCO BRADESCO S.A. | 326,023 | 11.48 | 3,742,744.04 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 828,182 | 12.95 | 10,724,956.90 | |
| | BANCO DO BRASIL S.A. | 313,000 | 27.18 | 8,507,340.00 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 841,481 | 31.45 | 26,464,577.45 | |
| | ITAUSA SA | 824,701 | 9.70 | 7,999,599.70 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 1,055,809 | 10.75 | 11,349,946.75 | |
| | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 108,900 | 32.69 | 3,559,941.00 | |
| | CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO | 142,000 | 14.53 | 2,063,260.00 | |
| | TOTVS SA | 124,500 | 28.50 | 3,548,250.00 | |
| | TELEFONICA BRASIL S.A. | 89,400 | 45.00 | 4,023,000.00 | |
| | TIM SA | 96,100 | 16.07 | 1,544,327.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 37,000 | 39.89 | 1,475,930.00 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 211,700 | 35.73 | 7,564,041.00 | |
| | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 275,375 | 10.18 | 2,803,317.50 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 50,500 | 74.25 | 3,749,625.00 | |
| | COMPANHIA PARANAENSE DE ENER | 204,600 | 9.25 | 1,892,550.00 | |
| | CPFL ENERGIA SA | 27,200 | 33.34 | 906,848.00 | |
| | ENEVA SA | 102,200 | 12.70 | 1,297,940.00 | |
| | ENGIE BRASIL SA | 46,250 | 43.48 | 2,010,950.00 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 165,100 | 29.48 | 4,867,148.00 | |
| ブラジルレアル 小計 | | 13,186,008 | | 290,579,885.57<br>(8,533,197,977) | |
| チリペソ | EMPRESAS COPEC SA | 90,423 | 7,535.00 | 681,337,305.00 | |
| | EMPRESAS CMPC SA | 135,965 | 1,910.00 | 259,693,150.00 | |
| | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 30,645 | 41,789.00 | 1,280,623,905.00 | |
| | CIA SUD AMERICANA DE VAPORES | 2,461,188 | 60.25 | 148,286,577.00 | |
| | LATAM AIRLINES GROUP SA | 42,366,632 | 13.00 | 550,766,216.00 | |
| | FALABELLA SA | 214,533 | 2,851.00 | 611,633,583.00 | |
| | CENCOSUD SA | 306,432 | 1,786.80 | 547,532,697.60 | |
| | BANCO DE CHILE | 7,583,203 | 108.75 | 824,673,326.25 | |
| | BANCO DE CREDITO E INVERSION | 6,989 | 26,300.00 | 183,810,700.00 | |
| | BANCO SANTANDER CHILE | 11,550,169 | 43.75 | 505,319,893.75 | |
| | ENEL AMERICAS SA | 3,491,315 | 89.00 | 310,727,035.00 | |
| | ENEL CHILE SA | 2,561,278 | 53.96 | 138,206,560.88 | |
| チリペソ 小計 | | 70,798,772 | | 6,042,610,949.48<br>(1,032,730,552) | |
| コロンビアペソ | BANCOLOMBIA SA | 50,698 | 36,200.00 | 1,835,267,600.00 | |
| | BANCOLOMBIA SA-PREF | 61,565 | 35,080.00 | 2,159,700,200.00 | |
| | INTERCONEXION ELECTRICA SA | 50,511 | 18,680.00 | 943,545,480.00 | |
| コロンビアペソ 小計 | | 162,774 | | 4,938,513,280.00<br>(197,096,065) | |
| ユーロ | MOTOR OIL (HELLAS) SA | 5,201 | 26.12 | 135,850.12 | |
| | MYTILINEOS S.A. | 20,295 | 36.96 | 750,103.20 | |
| | OPAP SA | 44,643 | 14.90 | 665,180.70 | |
| | JUMBO SA | 19,341 | 27.44 | 530,717.04 | |
| | ALPHA SERVICES AND HLD | 511,806 | 1.62 | 829,125.72 | |
| | EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 427,661 | 2.10 | 898,515.76 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | NATIONAL BANK OF GREECE | 133,931 | 8.26 | 1,106,805.78 | |
| | PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS | 113,059 | 3.81 | 430,754.79 | |
| | HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 26,207 | 13.76 | 360,608.32 | |
| | PUBLIC POWER CORP | 55,892 | 11.07 | 618,724.44 | |
| ユーロ 小計 | | 1,358,036 | | 6,326,385.87<br>(1,070,614,280) | |
| トルコリラ | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 142,590 | 163.90 | 23,370,501.00 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 258,868 | 47.94 | 12,410,131.92 | |
| | SASA POLYESTER SANAYI | 368,879 | 46.20 | 17,042,209.80 | |
| | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 199,132 | 60.65 | 12,077,355.80 | |
| | KOC HOLDING AS | 89,884 | 213.00 | 19,145,292.00 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 298,748 | 48.20 | 14,399,653.60 | |
| | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | 35,097 | 205.70 | 7,219,452.90 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 86,615 | 302.50 | 26,201,037.50 | |
| | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 16,370 | 1,025.00 | 16,779,250.00 | |
| | TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | 31,603 | 294.25 | 9,299,182.75 | |
| | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 81,228 | 493.50 | 40,086,018.00 | |
| | COCA-COLA ICECEK AS | 20,274 | 798.50 | 16,188,789.00 | |
| | AKBANK T.A.S. | 586,183 | 59.30 | 34,760,651.90 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 211,372 | 92.95 | 19,647,027.40 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 1,876,733 | 15.51 | 29,108,128.83 | |
| | YAPI VE KREDI BANKASI | 371,127 | 31.44 | 11,668,232.88 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 143,091 | 97.60 | 13,965,681.60 | |
| トルコリラ 小計 | | 4,817,794 | | 323,368,596.88<br>(1,573,479,255) | |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 13,303 | 765.00 | 10,176,795.00 | |
| | MONETA MONEY BANK AS | 60,710 | 98.40 | 5,973,864.00 | |
| | CEZ AS | 25,283 | 957.50 | 24,208,472.50 | |
| チェココルナ 小計 | | 99,296 | | 40,359,131.50<br>(277,089,653) | |
| ハンガリーフォリント | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY | 96,018 | 2,840.00 | 272,691,120.00 | |
| | RICHTER GEDEON NYRT | 28,741 | 9,475.00 | 272,320,975.00 | |
| | OTP BANK NYRT | 40,021 | 17,410.00 | 696,765,610.00 | |
| ハンガリーフォリント 小計 | | 164,780 | | 1,241,777,705.00<br>(537,389,236) | |
| ポーランドズロチ | ORLEN SA | 102,979 | 63.09 | 6,496,945.11 | |
| | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 20,186 | 143.20 | 2,890,635.20 | |
| | BUDIMEX | 2,656 | 718.50 | 1,908,336.00 | |
| | LPP SA | 230 | 17,430.00 | 4,008,900.00 | |
| | CD PROJEKT SA | 6,704 | 134.85 | 904,034.40 | |
| | ALLEGRO.EU SA | 83,795 | 37.18 | 3,115,498.10 | |
| | DINO POLSKA SA | 9,471 | 387.40 | 3,669,065.40 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | BANK PEKAO SA | 27,684 | 155.30 | 4,299,325.20 | |
| | M BANK SA | 1,423 | 601.00 | 855,223.00 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 159,920 | 56.94 | 9,105,844.80 | |
| | SANTANDER BANK POLSKA SA | 7,343 | 492.30 | 3,614,958.90 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 116,529 | 48.57 | 5,659,813.53 | |
| | POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 99,800 | 6.78 | 677,242.80 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 638,720 | | 47,205,822.44<br>(1,852,620,825) | |
| 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<br>(134) | |
| 香港ドル | CHINA COAL ENERGY CO - H | 329,000 | 9.82 | 3,230,780.00 | |
| | CHINA OILFIELD SERVICES-H | 242,000 | 7.60 | 1,839,200.00 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 3,869,400 | 4.89 | 18,921,366.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO -H | 575,500 | 39.80 | 22,904,900.00 | |
| | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H | 272,000 | 11.72 | 3,187,840.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 3,800,000 | 7.75 | 29,450,000.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H | 429,000 | 18.06 | 7,747,740.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 1,120,000 | 5.69 | 6,372,800.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 237,500 | 18.14 | 4,308,250.00 | |
| | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 555,500 | 12.88 | 7,154,840.00 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 728,000 | 3.08 | 2,242,240.00 | |
| | CMOC GROUP LTD-H | 810,000 | 7.33 | 5,937,300.00 | |
| | GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H | 54,040 | 20.65 | 1,115,926.00 | |
| | JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | 234,000 | 16.86 | 3,945,240.00 | |
| | MMG LIMITED | 840,000 | 3.30 | 2,772,000.00 | |
| | SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 245,000 | 17.76 | 4,351,200.00 | |
| | ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H | 321,000 | 15.10 | 4,847,100.00 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 905,000 | 17.50 | 15,837,500.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 275,000 | 3.72 | 1,023,000.00 | |
| BOC AVIATION LTD | 68,800 | 57.85 | 3,980,080.00 | |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 546,000 | 4.18 | 2,282,280.00 | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 706,000 | 4.43 | 3,127,580.00 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R | 442,000 | 10.84 | 4,791,280.00 | |
| CITIC LTD | 1,038,000 | 8.03 | 8,335,140.00 | |
| CRRC CORP LTD-H | 936,000 | 5.01 | 4,689,360.00 | |
| FOSUN INTERNATIONAL | 288,000 | 4.78 | 1,376,640.00 | |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 178,000 | 23.90 | 4,254,200.00 | |
| HORIZON CONSTRUCTION DEVELOP | 44,444 | 1.95 | 86,665.80 | |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 166,500 | 19.36 | 3,223,440.00 | |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 408,800 | 14.84 | 6,066,592.00 | |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC | 62,300 | 30.00 | 1,869,000.00 | |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 385,547 | 12.66 | 4,881,025.02 | |
| COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H | 518,050 | 15.04 | 7,791,472.00 | |
| JD LOGISTICS INC | 326,200 | 8.50 | 2,772,700.00 | |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | 322,000 | 8.44 | 2,717,680.00 | |
| ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD | 32,500 | 138.50 | 4,501,250.00 | |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H | 310,000 | 5.38 | 1,667,800.00 | |
| BYD CO LTD-H | 187,000 | 228.00 | 42,636,000.00 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 144,000 | 44.90 | 6,465,600.00 | |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 948,000 | 9.75 | 9,243,000.00 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 493,750 | 11.66 | 5,757,125.00 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 358,344 | 3.14 | 1,125,200.16 | |
| LI AUTO INC-CLASS A | 234,842 | 78.10 | 18,341,160.20 | |
| XPENG INC - CLASS A SHARES | 167,162 | 32.40 | 5,416,048.80 | |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 234,000 | 12.44 | 2,910,960.00 | |
| ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG | 86,700 | 27.30 | 2,366,910.00 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 240,200 | 87.25 | 20,957,450.00 | |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD | 438,000 | 4.63 | 2,027,940.00 | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | 460,600 | 29.80 | 13,725,880.00 | |
| HISENSE HOME APPLIANCES GR-H | 99,000 | 32.95 | 3,262,050.00 | |
| LI NING CO LTD | 380,000 | 20.85 | 7,923,000.00 | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 158,800 | 83.30 | 13,228,040.00 | |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 234,000 | 16.58 | 3,879,720.00 | |
| MEITUAN-CLASS B | 873,750 | 110.40 | 96,462,000.00 | |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 244,500 | 60.10 | 14,694,450.00 | |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD | 166,800 | 17.56 | 2,929,008.00 | |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 79,000 | 10.62 | 838,980.00 | |
| TRIP.COM GROUP LTD | 96,607 | 399.00 | 38,546,193.00 | |
| BAIDU INC-CLASS A | 404,500 | 94.60 | 38,265,700.00 | |
| BILIBILI INC-CLASS Z | 41,600 | 113.60 | 4,725,760.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHINA LITERATURE LTD | 51,600 | 26.30 | 1,357,080.00 | |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD | 1,268,000 | 1.93 | 2,447,240.00 | |
| KINGSOFT CORP LTD | 171,200 | 26.05 | 4,459,760.00 | |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | 452,400 | 52.30 | 23,660,520.00 | |
| NETEASE INC | 338,630 | 146.90 | 49,744,747.00 | |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 1,137,400 | 374.80 | 426,297,520.00 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 2,735,288 | 77.10 | 210,890,704.80 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H | 9,000 | 63.10 | 567,900.00 | |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 252,000 | 9.76 | 2,459,520.00 | |
| JD.COM INC - CL A | 414,161 | 115.70 | 47,918,427.70 | |
| MINISO GROUP HOLDING LTD | 42,904 | 42.75 | 1,834,146.00 | |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 64,600 | 38.20 | 2,467,720.00 | |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 410,000 | 5.15 | 2,111,500.00 | |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 92,000 | 13.90 | 1,278,800.00 | |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 784,000 | 3.86 | 3,026,240.00 | |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | 193,450 | 25.30 | 4,894,285.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 15,200 | 122.70 | 1,865,040.00 | |
| CHINA FEIHE LTD | 564,000 | 3.96 | 2,233,440.00 | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 577,000 | 14.30 | 8,251,100.00 | |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN | 246,000 | 31.30 | 7,699,800.00 | |
| HUISHAN DAIRY UNTRADE | 435,000 | — | — | |
| NONGFU SPRING CO LTD-H | 348,600 | 41.35 | 14,414,610.00 | |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 195,000 | 8.50 | 1,657,500.00 | |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 416,000 | 9.80 | 4,076,800.00 | |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 116,000 | 55.55 | 6,443,800.00 | |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 976,000 | 4.72 | 4,606,720.00 | |
| GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD | 90,600 | 50.90 | 4,611,540.00 | |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 87,500 | 26.20 | 2,292,500.00 | |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 75,400 | 33.95 | 2,559,830.00 | |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 399,200 | 4.49 | 1,792,408.00 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 128,400 | 12.36 | 1,587,024.00 | |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 191,200 | 22.55 | 4,311,560.00 | |
| AKESO INC | 61,000 | 40.65 | 2,479,650.00 | |
| BEIGENE LTD | 110,905 | 95.35 | 10,574,791.75 | |
| CHINA PHARMACEUTICAL GROUP | 1,388,160 | 7.02 | 9,744,883.20 | |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 339,000 | 5.92 | 2,006,880.00 | |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 222,000 | 9.40 | 2,086,800.00 | |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP | 272,000 | 17.82 | 4,847,040.00 | |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 203,000 | 35.80 | 7,267,400.00 | |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 1,971,000 | 2.85 | 5,617,350.00 | |
| WUXI APPTEC CO LTD-H | 63,688 | 33.60 | 2,139,916.80 | |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 628,000 | 11.38 | 7,146,640.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 5,135,000 | 3.31 | 16,996,850.00 | |
| BANK OF CHINA LTD-H | 13,437,200 | 3.79 | 50,926,988.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 1,371,475 | 5.99 | 8,215,135.25 | |
| CHINA CITIC BANK-H | 1,565,200 | 4.82 | 7,544,264.00 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 16,601,620 | 5.66 | 93,965,169.20 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 375,000 | 2.59 | 971,250.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 725,423 | 35.45 | 25,716,245.35 | |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 1,835,900 | 2.96 | 5,434,264.00 | |
| IND&COMM BK OF CHINA-H | 11,401,515 | 4.42 | 50,394,696.30 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 1,850,000 | 4.57 | 8,454,500.00 | |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 483,000 | 4.25 | 2,052,750.00 | |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 351,200 | 9.34 | 3,280,208.00 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 285,775 | 12.50 | 3,572,187.50 | |
| FAR EAST HORIZON LTD | 240,000 | 5.20 | 1,248,000.00 | |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 88,600 | 7.08 | 627,288.00 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 357,200 | 3.86 | 1,378,792.00 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 266,000 | 8.99 | 2,391,340.00 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 1,320,000 | 11.30 | 14,916,000.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 506,600 | 20.60 | 10,435,960.00 | |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY | 184,024 | 8.78 | 1,615,730.72 | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 309,600 | 16.08 | 4,978,368.00 | |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 1,878,000 | 2.72 | 5,108,160.00 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 1,197,288 | 10.14 | 12,140,500.32 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 1,178,000 | 38.10 | 44,881,800.00 | |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | 493,000 | 7.92 | 3,904,560.00 | |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 221,500 | 26.90 | 5,958,350.00 | |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 160,500 | 35.55 | 5,705,775.00 | |
| LENOVO GROUP LTD | 1,588,000 | 10.64 | 16,896,320.00 | |
| SUNNY OPTICAL TECH | 119,500 | 47.55 | 5,682,225.00 | |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 2,704,200 | 17.62 | 47,648,004.00 | |
| ZTE CORP-H | 82,908 | 16.78 | 1,391,196.24 | |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 7,082,000 | 0.99 | 7,011,180.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R | 59,500 | 28.95 | 1,722,525.00 | |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 610,000 | 2.78 | 1,695,800.00 | |
| CGN POWER CO LTD-H | 1,428,000 | 3.18 | 4,541,040.00 | |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 466,400 | 7.65 | 3,567,960.00 | |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 452,000 | 8.05 | 3,638,600.00 | |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 666,000 | 3.88 | 2,584,080.00 | |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED | 196,800 | 28.55 | 5,618,640.00 | |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R | 257,400 | 23.60 | 6,074,640.00 | |
| ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED | 117,000 | 70.70 | 8,271,900.00 | |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD-R | 446,000 | 4.70 | 2,096,200.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 704,000 | 5.54 | 3,900,160.00 | |
| | KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED | 548,000 | 7.83 | 4,290,840.00 | |
| | CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV | 650,000 | — | — | |
| | FLAT GLASS GROUP CO LTD-H | 64,000 | 14.56 | 931,840.00 | |
| | GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD | 3,149,000 | 1.40 | 4,408,600.00 | |
| | HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 90,000 | 22.45 | 2,020,500.00 | |
| | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 895,987 | 4.43 | 3,969,222.41 | |
| | C&D INTERNATIONAL INVESTMENT | 91,454 | 14.94 | 1,366,322.76 | |
| | CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R | 584,540 | 15.36 | 8,978,534.40 | |
| | CHINA RESOURCES LAND LTD-R | 541,111 | 29.10 | 15,746,330.10 | |
| | CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 119,000 | 28.20 | 3,355,800.00 | |
| | CHINA VANKE CO LTD-H | 315,500 | 5.65 | 1,782,575.00 | |
| | LONGFOR PROPERTIES | 343,500 | 12.52 | 4,300,620.00 | |
| 香港ドル 小計 | | 136,119,142 | | 2,045,369,502.78<br>(41,111,927,005) | |
| マレーシアリンギット | PETRONAS DAGANGAN BHD | 88,400 | 18.58 | 1,642,472.00 | |
| | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 416,400 | 6.64 | 2,764,896.00 | |
| | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | 757,600 | 5.89 | 4,462,264.00 | |
| | GAMUDA BHD | 414,102 | 6.05 | 2,505,317.10 | |
| | SIME DARBY BERHAD | 336,346 | 2.75 | 924,951.50 | |
| | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 107,281 | 10.02 | 1,074,955.62 | |
| | MISC BHD | 217,540 | 8.58 | 1,866,493.20 | |
| | GENTING BHD | 271,600 | 4.70 | 1,276,520.00 | |
| | GENTING MALAYSIA BERHAD | 369,700 | 2.65 | 979,705.00 | |
| | MR DIY GROUP M BHD | 303,450 | 1.89 | 573,520.50 | |
| | IOI CORPORATION BHD | 270,340 | 3.90 | 1,054,326.00 | |
| | KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 116,562 | 21.16 | 2,466,451.92 | |
| | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD | 18,200 | 125.50 | 2,284,100.00 | |
| | PPB GROUP BERHAD | 163,480 | 14.82 | 2,422,773.60 | |
| | QL RESOURCES BHD | 124,800 | 6.43 | 802,464.00 | |
| | SD GUTHRIE BHD | 247,046 | 4.34 | 1,072,179.64 | |
| | IHH HEALTHCARE BHD | 471,400 | 6.24 | 2,941,536.00 | |
| | AMMB HOLDINGS BHD | 300,700 | 4.25 | 1,277,975.00 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD | 1,233,202 | 6.96 | 8,583,085.92 | |
| | HONG LEONG BANK BERHAD | 121,292 | 19.40 | 2,353,064.80 | |
| | MALAYAN BANKING BHD | 881,505 | 10.00 | 8,815,050.00 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 2,544,100 | 4.11 | 10,456,251.00 | |
| | RHB BANK BHD | 219,347 | 5.53 | 1,212,988.91 | |
| | AXIATA GROUP BERHAD | 541,089 | 2.80 | 1,515,049.20 | |
| | CELCOMDIGI BHD | 498,000 | 3.81 | 1,897,380.00 | |
| | MAXIS BHD | 267,900 | 3.66 | 980,514.00 | |
| | TELECOM MALAYSIA BHD | 271,552 | 6.30 | 1,710,777.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | PETRONAS GAS BHD | 148,400 | 18.28 | 2,712,752.00 | |
| | TENAGA NATIONAL BHD | 441,775 | 13.76 | 6,078,824.00 | |
| | YTL CORPORATION BERHAD | 812,700 | 3.65 | 2,966,355.00 | |
| | YTL POWER INTERNATIONAL BHD | 499,400 | 5.06 | 2,526,964.00 | |
| | INARI AMERTRON BHD | 274,700 | 3.45 | 947,715.00 | |
| マレーシアリンギット 小計 | | 13,749,909 | | 85,149,672.51<br>(2,832,052,562) | |
| タイバーツ | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 308,100 | 152.50 | 46,985,250.00 | |
| | PTT PCL-NVDR | 1,684,600 | 32.25 | 54,328,350.00 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 293,605 | 51.75 | 15,194,058.75 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 206,400 | 21.10 | 4,355,040.00 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 486,134 | 32.75 | 15,920,888.50 | |
| | SCG PACKAGING PCL-NVDR | 202,700 | 33.75 | 6,841,125.00 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 130,400 | 235.00 | 30,644,000.00 | |
| | AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | 654,900 | 61.75 | 40,440,075.00 | |
| | BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO | 817,000 | 7.70 | 6,290,900.00 | |
| | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | 810,300 | 3.62 | 2,933,286.00 | |
| | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 848,938 | 30.75 | 26,104,843.50 | |
| | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 182,200 | 31.25 | 5,693,750.00 | |
| | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 840,135 | 9.50 | 7,981,282.50 | |
| | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 792,400 | 17.20 | 13,629,280.00 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 956,400 | 58.00 | 55,471,200.00 | |
| | CP AXTRA PCL-NVDR | 237,910 | 28.75 | 6,839,912.50 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 556,400 | 22.70 | 12,630,280.00 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 1,888,100 | 27.25 | 51,450,725.00 | |
| | BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR | 82,700 | 244.00 | 20,178,800.00 | |
| | KASIKORNBANK PCL-NVDR | 133,200 | 128.50 | 17,116,200.00 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 438,650 | 17.70 | 7,764,105.00 | |
| | SCB X PCL-NVDR | 151,200 | 104.50 | 15,800,400.00 | |
| | TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR | 8,727,200 | 1.68 | 14,661,696.00 | |
| | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | 101,500 | 45.50 | 4,618,250.00 | |
| | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 496,000 | 75.00 | 37,200,000.00 | |
| | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 203,800 | 211.00 | 43,001,800.00 | |
| | INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR | 121,850 | 71.50 | 8,712,275.00 | |
| | TRUE CORP PCL/NEW-NVDR | 2,015,618 | 8.45 | 17,031,972.10 | |
| | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 219,900 | 21.50 | 4,727,850.00 | |
| | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 68,200 | 44.25 | 3,017,850.00 | |
| | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 694,100 | 40.25 | 27,937,525.00 | |
| | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 378,400 | 57.50 | 21,758,000.00 | |
| タイバーツ 小計 | | 25,728,940 | | 647,260,969.85<br>(2,757,331,731) | |
| フィリピンペソ | AYALA CORPORATION | 54,410 | 596.50 | 32,455,565.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | JG SUMMIT HOLDINGS INC | 586,123 | 30.00 | 17,583,690.00 | |
| | SM INVESTMENTS CORP | 36,285 | 840.00 | 30,479,400.00 | |
| | INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 153,130 | 354.40 | 54,269,272.00 | |
| | JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 61,010 | 230.00 | 14,032,300.00 | |
| | UNIVERSAL ROBINA CORP | 95,560 | 107.50 | 10,272,700.00 | |
| | BANK OF PHILIPPINE ISLANDS | 234,802 | 119.80 | 28,129,279.60 | |
| | BDO UNIBANK INC | 394,773 | 139.90 | 55,228,742.70 | |
| | METROPOLITAN BANK & TRUST | 545,077 | 69.50 | 37,882,851.50 | |
| | PLDT INC | 20,460 | 1,460.00 | 29,871,600.00 | |
| | MANILA ELECTRIC COMPANY | 53,180 | 363.00 | 19,304,340.00 | |
| | AYALA LAND INC | 1,280,900 | 27.80 | 35,609,020.00 | |
| | SM PRIME HOLDINGS INC | 1,553,350 | 27.55 | 42,794,792.50 | |
| フィリピンペソ 小計 | | 5,069,060 | | 407,913,553.30<br>(1,094,513,646) | |
| インドネシアルピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT | 2,162,300 | 2,840.00 | 6,140,932,000.00 | |
| | UNITED TRACTORS TBK PT | 200,900 | 22,800.00 | 4,580,520,000.00 | |
| | AMMAN MINERAL INTERNASIONAL | 1,103,600 | 11,625.00 | 12,829,350,000.00 | |
| | ANEKA TAMBANG TBK PT | 985,800 | 1,300.00 | 1,281,540,000.00 | |
| | BARITO PACIFIC TBK PT | 2,892,209 | 965.00 | 2,790,981,685.00 | |
| | CHANDRA ASRI PACIFIC TBK | 1,270,900 | 8,500.00 | 10,802,650,000.00 | |
| | INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 754,000 | 9,300.00 | 7,012,200,000.00 | |
| | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 1,623,297 | 2,500.00 | 4,058,242,500.00 | |
| | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 3,277,300 | 4,560.00 | 14,944,488,000.00 | |
| | GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT | 134,639,904 | 58.00 | 7,809,114,432.00 | |
| | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | 3,138,700 | 2,760.00 | 8,662,812,000.00 | |
| | CHAROEN POKPHAND INDONESI PT | 1,553,300 | 5,225.00 | 8,115,992,500.00 | |
| | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 599,400 | 10,575.00 | 6,338,655,000.00 | |
| | INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT | 1,403,800 | 6,200.00 | 8,703,560,000.00 | |
| | UNILEVER INDONESIA TBK PT | 1,157,400 | 3,010.00 | 3,483,774,000.00 | |
| | KALBE FARMA TBK PT | 4,188,500 | 1,600.00 | 6,701,600,000.00 | |
| | BANK CENTRAL ASIA PT | 9,369,500 | 9,325.00 | 87,370,587,500.00 | |
| | BANK MANDIRI | 6,101,792 | 6,275.00 | 38,288,744,800.00 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PT | 2,584,600 | 4,700.00 | 12,147,620,000.00 | |
| | PT BANK RAKYAT INDONESIA | 12,030,502 | 4,350.00 | 52,332,683,700.00 | |
| | TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK | 8,898,500 | 3,050.00 | 27,140,425,000.00 | |
| インドネシアルピア 小計 | | 199,936,204 | | 331,536,473,117.00<br>(3,215,903,789) | |
| 韓国ウォン | HD HYUNDAI | 5,180 | 68,100.00 | 352,758,000.00 | |
| | S-OIL CORPORATION | 6,387 | 67,300.00 | 429,845,100.00 | |
| | SK INNOVATION CO LTD | 10,044 | 103,800.00 | 1,042,567,200.00 | |
| | ENCHEM CO LTD | 1,966 | 279,500.00 | 549,497,000.00 | |
| | HANWHA SOLUTIONS CORPORATION | 18,276 | 29,400.00 | 537,314,400.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HYUNDAI STEEL CO | 11,189 | 29,850.00 | 333,991,650.00 | |
| KOREA ZINC CO LTD | 1,204 | 499,000.00 | 600,796,000.00 | |
| KUM YANG CO LTD | 5,389 | 90,000.00 | 485,010,000.00 | |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 1,898 | 144,200.00 | 273,691,600.00 | |
| LG CHEM LTD | 9,272 | 382,000.00 | 3,541,904,000.00 | |
| LG CHEM LTD-PREFERENCE | 877 | 263,500.00 | 231,089,500.00 | |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 2,316 | 112,000.00 | 259,392,000.00 | |
| POSCO HOLDINGS INC | 13,371 | 386,500.00 | 5,167,891,500.00 | |
| SKC CO LTD | 1,432 | 149,200.00 | 213,654,400.00 | |
| DOOSAN BOBCAT INC | 12,098 | 54,400.00 | 658,131,200.00 | |
| DOOSAN ENERBILITY CO LTD | 82,003 | 19,170.00 | 1,571,997,510.00 | |
| ECOPRO BM CO LTD | 8,232 | 222,000.00 | 1,827,504,000.00 | |
| ECOPRO CO LTD | 15,665 | 107,500.00 | 1,683,987,500.00 | |
| ECOPRO MATERIALS CO LTD | 2,769 | 124,100.00 | 343,632,900.00 | |
| GS HOLDINGS CORP | 6,593 | 42,950.00 | 283,169,350.00 | |
| HANWHA AEROSPACE CO LTD | 5,826 | 209,500.00 | 1,220,547,000.00 | |
| HANWHA OCEAN CO LTD | 14,849 | 30,500.00 | 452,894,500.00 | |
| HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD | 3,567 | 260,000.00 | 927,420,000.00 | |
| HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO | 2,115 | 129,600.00 | 274,104,000.00 | |
| HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR | 6,269 | 135,000.00 | 846,315,000.00 | |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST | 9,768 | 33,050.00 | 322,832,400.00 | |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 13,416 | 51,300.00 | 688,240,800.00 | |
| L&F CO LTD | 4,327 | 164,800.00 | 713,089,600.00 | |
| LG CORP | 16,658 | 81,300.00 | 1,354,295,400.00 | |
| LG ENERGY SOLUTION | 8,760 | 359,000.00 | 3,144,840,000.00 | |
| POSCO FUTURE M CO LTD | 4,758 | 282,000.00 | 1,341,756,000.00 | |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 8,647 | 47,650.00 | 412,029,550.00 | |
| SAMSUNG C&T CORP | 15,406 | 137,600.00 | 2,119,865,600.00 | |
| SAMSUNG E&A CO LTD | 30,300 | 23,100.00 | 699,930,000.00 | |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 95,169 | 9,360.00 | 890,781,840.00 | |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 2,338 | 43,700.00 | 102,170,600.00 | |
| SK INC | 6,394 | 182,000.00 | 1,163,708,000.00 | |
| SK SQUARE CO LTD | 19,731 | 87,500.00 | 1,726,462,500.00 | |
| HANJIN KAL CORP | 7,812 | 69,000.00 | 539,028,000.00 | |
| HMM CO LTD | 35,545 | 19,500.00 | 693,127,500.00 | |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 2,793 | 183,500.00 | 512,515,500.00 | |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 26,822 | 22,150.00 | 594,107,300.00 | |
| HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO | 18,150 | 44,600.00 | 809,490,000.00 | |
| HYUNDAI MOBIS | 10,148 | 223,000.00 | 2,263,004,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO | 23,448 | 265,000.00 | 6,213,720,000.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 6,042 | 157,600.00 | 952,219,200.00 | |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD | 3,449 | 155,700.00 | 537,009,300.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| KIA CORP | 45,204 | 121,100.00 | 5,474,204,400.00 | |
| COWAY CO LTD | 9,036 | 57,900.00 | 523,184,400.00 | |
| LG ELECTRONICS INC | 17,254 | 100,700.00 | 1,737,477,800.00 | |
| HYBE CO LTD | 4,975 | 197,000.00 | 980,075,000.00 | |
| KAKAO CORP | 52,020 | 44,250.00 | 2,301,885,000.00 | |
| KRAFTON INC | 6,265 | 256,000.00 | 1,603,840,000.00 | |
| NAVER CORP | 21,578 | 175,400.00 | 3,784,781,200.00 | |
| NCSOFT CORPORATION | 2,709 | 195,200.00 | 528,796,800.00 | |
| NETMARBLE CORP | 2,465 | 61,300.00 | 151,104,500.00 | |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 1,839 | 343,500.00 | 631,696,500.00 | |
| KT&G CORP | 19,456 | 86,700.00 | 1,686,835,200.00 | |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 3,142 | 92,400.00 | 290,320,800.00 | |
| AMOREPACIFIC CORP | 3,762 | 180,300.00 | 678,288,600.00 | |
| LG H&H CO LTD | 1,321 | 414,500.00 | 547,554,500.00 | |
| HLB INC | 23,903 | 59,600.00 | 1,424,618,800.00 | |
| ALTEOGEN INC | 6,824 | 269,000.00 | 1,835,656,000.00 | |
| CELLTRION INC | 27,796 | 191,100.00 | 5,311,815,600.00 | |
| CELLTRION PHARM INC | 2,169 | 93,700.00 | 203,235,300.00 | |
| HANMI PHARM CO LTD | 1,202 | 296,000.00 | 355,792,000.00 | |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 3,362 | 750,000.00 | 2,521,500,000.00 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 3,197 | 86,200.00 | 275,581,400.00 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 2,100 | 53,500.00 | 112,350,000.00 | |
| YUHAN CORPORATION | 13,854 | 81,800.00 | 1,133,257,200.00 | |
| HANA FINANCIAL GROUP | 51,249 | 60,400.00 | 3,095,439,600.00 | |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 28,330 | 13,620.00 | 385,854,600.00 | |
| KAKAOBANK CORP | 35,459 | 22,700.00 | 804,919,300.00 | |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 64,599 | 79,600.00 | 5,142,080,400.00 | |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD | 80,543 | 47,100.00 | 3,793,575,300.00 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 113,814 | 14,280.00 | 1,625,263,920.00 | |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 4,602 | 67,700.00 | 311,555,400.00 | |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 16,975 | 75,500.00 | 1,281,612,500.00 | |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 31,015 | 7,330.00 | 227,339,950.00 | |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 12,107 | 12,030.00 | 145,647,210.00 | |
| DB INSURANCE CO LTD | 10,074 | 105,600.00 | 1,063,814,400.00 | |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS | 6,144 | 343,000.00 | 2,107,392,000.00 | |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO | 12,131 | 83,700.00 | 1,015,364,700.00 | |
| POSCO DX CO LTD | 9,010 | 39,350.00 | 354,543,500.00 | |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 7,284 | 162,000.00 | 1,180,008,000.00 | |
| COSMOAM&T CO LTD | 3,978 | 165,200.00 | 657,165,600.00 | |
| LG DISPLAY CO LTD | 51,846 | 10,110.00 | 524,163,060.00 | |
| LG INNOTEK CO LTD | 2,696 | 241,000.00 | 649,736,000.00 | |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 11,233 | 151,000.00 | 1,696,183,000.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 822,794 | 77,300.00 | 63,601,976,200.00 | |
| | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 141,877 | 62,800.00 | 8,909,875,600.00 | |
| | SAMSUNG SDI CO LTD | 10,263 | 399,000.00 | 4,094,937,000.00 | |
| | KT CORP | 10,500 | 37,150.00 | 390,075,000.00 | |
| | LG UPLUS CORP | 22,125 | 9,760.00 | 215,940,000.00 | |
| | 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 | 156,800.00 | 1,134,918,400.00 | |
| | SK HYNIX INC | 94,417 | 207,500.00 | 19,591,527,500.00 | |
| 韓国ウォン 小計 | | 2,610,207 | | 211,378,764,840.00<br>(24,076,041,315) | |
| 新台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 238,240 | 65.80 | 15,676,192.00 | |
| | ASIA CEMENT CORP | 454,176 | 41.40 | 18,802,886.40 | |
| | CHINA STEEL | 2,373,261 | 23.70 | 56,246,285.70 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 542,061 | 52.00 | 28,187,172.00 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 597,824 | 62.70 | 37,483,564.80 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 770,752 | 50.80 | 39,154,201.60 | |
| | TAIWAN CEMENT | 1,268,419 | 33.05 | 41,921,247.95 | |
| | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 31,557 | 1,010.00 | 31,872,570.00 | |
| | FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 362,028 | 34.55 | 12,508,067.40 | |
| | FORTUNE ELECTRIC CO LTD | 20,000 | 742.00 | 14,840,000.00 | |
| | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 9,000 | 1,735.00 | 15,615,000.00 | |
| | WALSIN LIHWA CORP | 502,213 | 37.35 | 18,757,655.55 | |
| | CHINA AIRLINES LTD | 465,000 | 23.10 | 10,741,500.00 | |
| | EVA AIRWAYS CORP | 386,000 | 36.90 | 14,243,400.00 | |
| | EVERGREEN MARINE | 183,215 | 218.00 | 39,940,870.00 | |
| | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 472,000 | 30.15 | 14,230,800.00 | |
| | WAN HAI LINES LIMITED | 74,635 | 96.20 | 7,179,887.00 | |
| | YANG MING MARINE TRANSPORT | 217,000 | 82.90 | 17,989,300.00 | |
| | CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 463,061 | 50.40 | 23,338,274.40 | |
| | ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 39,937 | 551.00 | 22,005,287.00 | |
| | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 78,901 | 161.50 | 12,742,511.50 | |
| | NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 31,000 | 375.00 | 11,625,000.00 | |
| | POU CHEN | 273,780 | 37.55 | 10,280,439.00 | |
| | HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 54,060 | 629.00 | 34,003,740.00 | |
| | PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 88,544 | 273.50 | 24,216,784.00 | |
| | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 776,395 | 80.30 | 62,344,518.50 | |
| | PHARMAESSENTIA CORP | 25,000 | 484.00 | 12,100,000.00 | |
| | CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 608,378 | 18.35 | 11,163,736.30 | |
| | CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD | 3,090,237 | 37.20 | 114,956,816.40 | |
| | E.SUN FINANCIAL HOLDING CO | 2,474,537 | 28.95 | 71,637,846.15 | |
| | FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 2,175,358 | 27.80 | 60,474,952.40 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 1,518,361 | 25.20 | 38,262,697.20 | |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 2,066,087 | 39.35 | 81,300,523.45 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 1,791,444 | 23.50 | 42,098,934.00 | |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 2,000,651 | 18.80 | 37,612,238.80 | |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 798,720 | 17.30 | 13,817,856.00 | |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 2,066,926 | 25.85 | 53,430,037.10 | |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 689,985 | 46.20 | 31,877,307.00 | |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 287,702 | 153.00 | 44,018,406.00 | |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,919,822 | 31.80 | 61,050,339.60 | |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 1,731,057 | 58.20 | 100,747,517.40 | |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 2,576,226 | 15.40 | 39,673,880.40 | |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 1,353,451 | 76.00 | 102,862,276.00 | |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 1,931,866 | 9.73 | 18,797,056.18 | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 86,000 | 532.00 | 45,752,000.00 | |
| ACER INC | 617,803 | 49.65 | 30,673,918.95 | |
| ADVANTECH CO LTD | 76,261 | 359.50 | 27,415,829.50 | |
| ASIA VITAL COMPONENTS | 55,000 | 620.00 | 34,100,000.00 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 127,092 | 484.00 | 61,512,528.00 | |
| AUO CORP | 1,268,072 | 18.05 | 22,888,699.60 | |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 118,700 | 222.50 | 26,410,750.00 | |
| COMPAL ELECTRONICS | 805,760 | 36.10 | 29,087,936.00 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 347,903 | 345.00 | 120,026,535.00 | |
| E INK HOLDINGS INC | 144,000 | 215.00 | 30,960,000.00 | |
| GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD | 75,000 | 309.50 | 23,212,500.00 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 2,185,248 | 177.50 | 387,881,520.00 | |
| INNOLUX CORP | 1,320,576 | 13.65 | 18,025,862.40 | |
| INVENTEC CO LTD | 455,511 | 53.00 | 24,142,083.00 | |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 20,040 | 2,365.00 | 47,394,600.00 | |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 353,452 | 107.00 | 37,819,364.00 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 100,000 | 185.50 | 18,550,000.00 | |
| PEGATRON CORP | 340,474 | 111.50 | 37,962,851.00 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 463,270 | 273.00 | 126,472,710.00 | |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 202,100 | 82.60 | 16,693,460.00 | |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 211,000 | 184.00 | 38,824,000.00 | |
| WISTRON CORP | 427,000 | 109.50 | 46,756,500.00 | |
| WIWYNN CORP | 16,000 | 2,630.00 | 42,080,000.00 | |
| WPG HOLDINGS LTD | 260,692 | 86.30 | 22,497,719.60 | |
| YAGEO CORPORATION | 64,588 | 678.00 | 43,790,664.00 | |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 137,922 | 116.50 | 16,067,913.00 | |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 584,315 | 126.50 | 73,915,847.50 | |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 216,000 | 84.90 | 18,338,400.00 | |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 245,200 | 107.00 | 26,236,400.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ALCHIP TECHNOLOGIES LTD | 12,000 | 2,920.00 | 35,040,000.00 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 594,315 | 159.50 | 94,793,242.50 | |
| | EMEMORY TECHNOLOGY INC | 12,000 | 2,385.00 | 28,620,000.00 | |
| | GLOBAL UNICHIP CORP | 13,000 | 1,605.00 | 20,865,000.00 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 42,000 | 542.00 | 22,764,000.00 | |
| | MEDIATEK INC | 266,804 | 1,275.00 | 340,175,100.00 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 259,000 | 64.80 | 16,783,200.00 | |
| | NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 96,045 | 606.00 | 58,203,270.00 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 85,944 | 530.00 | 45,550,320.00 | |
| | SILERGY CORP | 53,000 | 491.00 | 26,023,000.00 | |
| | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 4,243,389 | 879.00 | 3,729,938,931.00 | |
| | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 1,976,000 | 55.10 | 108,877,600.00 | |
| | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 188,000 | 111.00 | 20,868,000.00 | |
| | WINBOND ELECTRONICS CORP | 363,030 | 24.45 | 8,876,083.50 | |
| | RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 279,077 | 47.55 | 13,270,111.35 | |
| 新台湾ドル 小計 | | 59,687,450 | | 7,637,968,025.08<br>(37,183,919,736) | |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 149,952 | 600.10 | 89,986,195.20 | |
| | COAL INDIA LTD | 295,479 | 479.05 | 141,549,214.95 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 125,486 | 523.55 | 65,698,195.30 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 597,036 | 164.10 | 97,973,607.60 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 539,758 | 260.40 | 140,552,983.20 | |
| | PETRONET LNG LTD | 83,779 | 301.20 | 25,234,234.80 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 522,888 | 2,939.45 | 1,537,003,131.60 | |
| | AMBUJA CEMENTS LTD | 73,533 | 621.95 | 45,733,849.35 | |
| | APL APOLLO TUBES LTD | 26,431 | 1,623.70 | 42,916,014.70 | |
| | ASIAN PAINTS LTD | 67,203 | 2,928.70 | 196,817,426.10 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 46,843 | 2,377.75 | 111,380,943.25 | |
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 246,890 | 680.25 | 167,946,922.50 | |
| | JINDAL STAINLESS LTD | 54,371 | 794.75 | 43,211,352.25 | |
| | JINDAL STEEL & POWER LTD | 69,774 | 1,027.05 | 71,661,386.70 | |
| | JSW STEEL LTD | 99,332 | 912.00 | 90,590,784.00 | |
| | NMDC LTD | 146,261 | 258.50 | 37,808,468.50 | |
| | PI INDUSTRIES LTD | 12,797 | 3,639.90 | 46,579,800.30 | |
| | PIDILITE INDUSTRIES LTD | 29,160 | 3,122.95 | 91,065,222.00 | |
| | SHREE CEMENT LTD | 1,387 | 26,052.85 | 36,135,302.95 | |
| | SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD | 4,277 | 9,302.70 | 39,787,647.90 | |
| | SRF LTD | 33,773 | 2,310.15 | 78,020,695.95 | |
| | SUPREME INDUSTRIES LTD | 10,012 | 5,740.20 | 57,470,882.40 | |
| | TATA STEEL LTD | 1,356,728 | 178.95 | 242,786,475.60 | |
| | ULTRATECH CEMENT LTD | 19,852 | 10,462.20 | 207,695,594.40 | |
| | UNITED PHOSPHORUS LTD | 69,651 | 539.75 | 37,594,127.25 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| VEDANTA LTD | 184,749 | 460.45 | 85,067,677.05 | |
| ABB LTD INDIA | 11,720 | 8,071.70 | 94,600,324.00 | |
| ADANI ENTERPRISES LTD | 33,650 | 3,218.70 | 108,309,255.00 | |
| ASHOK LEYLAND LIMITED | 241,973 | 231.30 | 55,968,354.90 | |
| ASTRAL LTD | 19,918 | 2,155.95 | 42,942,212.10 | |
| BHARAT ELECTRONICS LTD | 646,541 | 283.10 | 183,035,757.10 | |
| BHARAT HEAVY ELECTRICALS | 151,803 | 285.35 | 43,316,986.05 | |
| CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU | 70,406 | 663.00 | 46,679,178.00 | |
| CUMMINS INDIA LTD | 20,968 | 3,600.30 | 75,491,090.40 | |
| HAVELLS INDIA LTD | 35,666 | 1,854.35 | 66,137,247.10 | |
| HINDUSTAN AERONAUTICS LTD | 36,316 | 4,745.35 | 172,332,130.60 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 118,675 | 3,532.90 | 419,266,907.50 | |
| POLYCAB INDIA LTD | 7,354 | 6,846.90 | 50,352,102.60 | |
| SIEMENS INDIA LTD | 16,262 | 6,873.90 | 111,783,361.80 | |
| SUZLON ENERGY LTD | 1,500,000 | 49.84 | 74,760,000.00 | |
| THERMAX LTD | 7,627 | 5,227.05 | 39,866,710.35 | |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 52,993 | 977.75 | 51,813,905.75 | |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 104,582 | 1,378.85 | 144,202,890.70 | |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 26,455 | 1,053.90 | 27,880,924.50 | |
| GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE | 394,498 | 86.64 | 34,179,306.72 | |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 26,451 | 4,371.35 | 115,626,578.85 | |
| BAJAJ AUTO LTD | 9,644 | 9,723.20 | 93,770,540.80 | |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | 8,831 | 3,203.35 | 28,288,783.85 | |
| BHARAT FORGE LTD | 30,322 | 1,584.40 | 48,042,176.80 | |
| BOSCH LTD | 1,235 | 30,582.20 | 37,769,017.00 | |
| EICHER MOTORS LTD | 26,253 | 4,760.65 | 124,981,344.45 | |
| HERO MOTOCORP LTD | 21,431 | 5,573.65 | 119,448,893.15 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 165,233 | 2,857.10 | 472,087,204.30 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 24,350 | 12,813.80 | 312,016,030.00 | |
| MRF LTD | 432 | 127,254.30 | 54,973,857.60 | |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN | 521,235 | 156.65 | 81,651,462.75 | |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS | 59,289 | 664.05 | 39,370,860.45 | |
| TATA MOTORS LTD | 277,381 | 970.40 | 269,170,522.40 | |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR | 75,000 | 651.00 | 48,825,000.00 | |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT | 21,152 | 3,925.25 | 83,026,888.00 | |
| TVS MOTOR CO LTD | 41,254 | 2,406.90 | 99,294,252.60 | |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 886 | 38,358.40 | 33,985,542.40 | |
| TITAN CO LTD | 56,531 | 3,443.45 | 194,661,671.95 | |
| INDIAN HOTELS CO LIMITED | 164,497 | 584.90 | 96,214,295.30 | |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | 43,930 | 518.50 | 22,777,705.00 | |
| ZOMATO LTD | 1,054,701 | 184.05 | 194,117,719.05 | |
| INFO EDGE INDIA LTD | 14,356 | 6,215.50 | 89,229,718.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| TRENT LTD | 37,950 | 4,971.05 | 188,651,347.50 | |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 28,592 | 4,745.45 | 135,681,906.40 | |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 22,156 | 5,463.25 | 121,043,767.00 | |
| ITC LTD | 480,447 | 439.10 | 210,964,277.70 | |
| MARICO LTD | 81,711 | 653.00 | 53,357,283.00 | |
| NESTLE INDIA LIMITED | 51,460 | 2,503.60 | 128,835,256.00 | |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | 93,239 | 1,135.90 | 105,910,180.10 | |
| UNITED SPIRITS LTD | 58,580 | 1,308.00 | 76,622,640.00 | |
| VARUN BEVERAGES LTD | 80,358 | 1,518.10 | 121,991,479.80 | |
| COLGATE-PALMOLIVE (INDIA) | 26,000 | 2,963.90 | 77,061,400.00 | |
| DABUR INDIA LTD | 144,837 | 612.60 | 88,727,146.20 | |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 63,396 | 1,426.70 | 90,447,073.20 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 144,060 | 2,576.65 | 371,192,199.00 | |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 14,562 | 6,014.90 | 87,588,973.80 | |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD | 120,191 | 826.30 | 99,313,823.30 | |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 35,415 | 1,264.60 | 44,785,809.00 | |
| CIPLA LTD | 88,546 | 1,497.30 | 132,579,925.80 | |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 21,932 | 4,524.85 | 99,239,010.20 | |
| DR. REDDY'S LABORATORIES | 18,321 | 6,059.05 | 111,007,855.05 | |
| LUPIN LTD | 48,134 | 1,629.20 | 78,419,912.80 | |
| MANKIND PHARMA LTD | 18,295 | 2,126.85 | 38,910,720.75 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 167,480 | 1,507.00 | 252,392,360.00 | |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | 12,220 | 2,842.80 | 34,739,016.00 | |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD | 92,107 | 669.00 | 61,619,583.00 | |
| AXIS BANK LTD | 391,573 | 1,186.70 | 464,679,679.10 | |
| BANDHAN BANK LTD | 74,811 | 196.40 | 14,692,880.40 | |
| BANK OF BARODA | 248,313 | 270.80 | 67,243,160.40 | |
| CANARA BANK | 305,000 | 118.90 | 36,264,500.00 | |
| HDFC BANK LTD | 485,940 | 1,573.25 | 764,505,105.00 | |
| ICICI BANK LTD | 879,852 | 1,121.90 | 987,105,958.80 | |
| IDFC FIRST BANK LTD | 531,028 | 77.68 | 41,250,255.04 | |
| INDUSIND BANK LTD | 48,365 | 1,492.25 | 72,172,671.25 | |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 186,345 | 1,753.05 | 326,672,102.25 | |
| PUNJAB NATIONAL BANK | 272,403 | 125.05 | 34,063,995.15 | |
| STATE BANK OF INDIA | 314,786 | 829.90 | 261,240,901.40 | |
| UNION BANK OF INDIA | 238,889 | 146.65 | 35,033,071.85 | |
| YES BANK LTD | 2,352,478 | 23.18 | 54,530,440.04 | |
| BAJAJ FINANCE LTD | 49,376 | 7,190.15 | 355,020,846.40 | |
| BAJAJ FINSERV LTD | 76,561 | 1,564.70 | 119,794,996.70 | |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT | 2,995 | 8,372.05 | 25,074,289.75 | |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 83,998 | 1,339.15 | 112,485,921.70 | |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 14,173 | 3,821.20 | 54,157,867.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | JIO FINANCIAL SERVICES LTD | 471,182 | 353.15 | 166,397,923.30 | |
| | MUTHOOT FINANCE LTD | 12,423 | 1,773.40 | 22,030,948.20 | |
| | POWER FINANCE CORPORATION | 265,755 | 483.60 | 128,519,118.00 | |
| | REC LTD | 186,584 | 496.80 | 92,694,931.20 | |
| | SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 60,695 | 715.60 | 43,433,342.00 | |
| | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 54,695 | 2,496.45 | 136,543,332.75 | |
| | SUNDARAM FINANCE LTD | 11,164 | 4,544.30 | 50,732,565.20 | |
| | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 207,570 | 562.80 | 116,820,396.00 | |
| | ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 33,631 | 1,654.35 | 55,637,444.85 | |
| | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 45,316 | 571.55 | 25,900,359.80 | |
| | PB FINTECH LTD | 48,956 | 1,288.05 | 63,057,775.80 | |
| | SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 72,736 | 1,425.85 | 103,710,625.60 | |
| | HCL TECHNOLOGIES LTD | 163,324 | 1,431.05 | 233,724,810.20 | |
| | INFOSYS LTD | 579,880 | 1,533.35 | 889,158,998.00 | |
| | LTIMINDTREE LTD | 15,699 | 4,975.55 | 78,111,159.45 | |
| | MPHASIS LTD | 19,317 | 2,472.30 | 47,757,419.10 | |
| | PERSISTENT SYSTEMS LTD | 15,982 | 3,851.25 | 61,550,677.50 | |
| | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 152,359 | 3,892.90 | 593,118,351.10 | |
| | TATA ELXSI LTD | 7,679 | 7,118.80 | 54,665,265.20 | |
| | TECH MAHINDRA LTD | 94,797 | 1,377.50 | 130,582,867.50 | |
| | WIPRO LTD | 247,008 | 484.45 | 119,663,025.60 | |
| | BHARTI AIRTEL LTD | 389,936 | 1,425.80 | 555,970,748.80 | |
| | INDUS TOWERS LTD | 127,238 | 347.40 | 44,202,481.20 | |
| | TATA COMMUNICATIONS LIMITED | 19,824 | 1,811.75 | 35,916,132.00 | |
| | ADANI GREEN ENERGY LTD | 60,702 | 1,863.80 | 113,136,387.60 | |
| | ADANI POWER LTD | 167,705 | 767.25 | 128,671,661.25 | |
| | GAIL INDIA LTD | 504,548 | 212.60 | 107,266,904.80 | |
| | JSW ENERGY LTD | 63,163 | 625.40 | 39,502,140.20 | |
| | NHPC LTD | 546,313 | 103.20 | 56,379,501.60 | |
| | NTPC LTD | 766,679 | 360.70 | 276,541,115.30 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 800,980 | 309.35 | 247,783,163.00 | |
| | TATA POWER CO LTD | 285,870 | 443.45 | 126,769,051.50 | |
| | TORRENT POWER LTD | 28,990 | 1,494.45 | 43,324,105.50 | |
| | DLF LTD | 126,742 | 844.65 | 107,052,630.30 | |
| | GODREJ PROPERTIES LTD | 29,762 | 2,873.05 | 85,507,714.10 | |
| | MACROTECH DEVELOPERS LTD | 41,942 | 1,435.30 | 60,199,352.60 | |
| | PHOENIX MILLS LTD | 17,280 | 3,225.55 | 55,737,504.00 | |
| インドルピー 小計 | | 26,260,504 | | 20,265,360,364.20<br>(38,301,531,088) | |
| カタールリアル | QATAR FUEL QSC | 59,914 | 14.94 | 895,115.16 | |
| | QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT) | 469,730 | 4.40 | 2,066,812.00 | |
| | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 1,307,286 | 1.73 | 2,273,370.35 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | INDUSTRIES QATAR | 282,919 | 12.01 | 3,397,857.19 | |
| | COMMERCIAL BANK QSC | 531,391 | 3.93 | 2,088,898.02 | |
| | DUKHAN BANK | 319,751 | 3.55 | 1,137,354.30 | |
| | MASRAF AL RAYAN | 1,143,101 | 2.33 | 2,663,425.33 | |
| | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC | 214,533 | 10.07 | 2,160,347.31 | |
| | QATAR ISLAMIC BANK | 335,301 | 17.71 | 5,938,180.71 | |
| | QATAR NATIONAL BANK | 741,302 | 13.70 | 10,155,837.40 | |
| | OOREDOO QSC | 72,800 | 9.60 | 698,880.00 | |
| | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 96,512 | 15.05 | 1,452,505.60 | |
| | BARWA REAL ESTATE CO | 207,490 | 2.87 | 595,496.30 | |
| **カタールリアル 小計** | | 5,782,030 | | 35,524,079.67<br>(1,532,153,556) | |
| **南アフリカランド** | EXXARO RESOURCES LTD | 34,217 | 175.58 | 6,007,820.86 | |
| | ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED | 9,991 | 577.33 | 5,768,104.03 | |
| | ANGLOGOLD ASHANTI PLC | 67,443 | 432.20 | 29,148,864.60 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 144,200 | 293.54 | 42,328,468.00 | |
| | HARMONY GOLD MINING CO LTD | 99,861 | 159.43 | 15,920,839.23 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 150,847 | 87.75 | 13,236,824.25 | |
| | KUMBA IRON ORE LTD | 17,679 | 469.01 | 8,291,627.79 | |
| | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 48,069 | 111.71 | 5,369,787.99 | |
| | SASOL LTD | 88,115 | 121.55 | 10,710,378.25 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 799,465 | 21.27 | 17,004,620.55 | |
| | BIDVEST GROUP LTD | 50,303 | 244.76 | 12,312,162.28 | |
| | NASPERS LTD-N SHS | 30,591 | 3,848.94 | 117,742,923.54 | |
| | PEPKOR HOLDINGS LTD | 475,578 | 17.54 | 8,341,638.12 | |
| | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 176,316 | 54.70 | 9,644,485.20 | |
| | BID CORP LTD | 58,066 | 426.00 | 24,736,116.00 | |
| | CLICKS GROUP LTD | 35,422 | 298.71 | 10,580,905.62 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 85,224 | 250.95 | 21,386,962.80 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 56,182 | 233.37 | 13,111,193.34 | |
| | ABSA GROUP LTD | 140,135 | 150.01 | 21,021,651.35 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 14,600 | 2,185.01 | 31,901,146.00 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 88,111 | 222.48 | 19,602,935.28 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 242,949 | 182.35 | 44,301,750.15 | |
| | FIRSTRAND LTD | 816,636 | 63.26 | 51,660,393.36 | |
| | REINET INVESTMENTS SCA | 17,187 | 484.00 | 8,318,508.00 | |
| | REMGRO LTD | 74,679 | 123.61 | 9,231,071.19 | |
| | DISCOVERY LIMITED | 98,779 | 111.24 | 10,988,175.96 | |
| | OLD MUTUAL LTD | 974,656 | 10.29 | 10,029,210.24 | |
| | OUTSURANCE GROUP LTD | 237,864 | 41.43 | 9,854,705.52 | |
| | SANLAM LTD | 307,490 | 71.31 | 21,927,111.90 | |
| | MTN GROUP LTD | 350,498 | 80.70 | 28,285,188.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | VODACOM GROUP | 166,454 | 90.93 | 15,135,662.22 | |
| | NEPI ROCKCASTLE N.V. | 67,336 | 135.00 | 9,090,360.00 | |
| 南アフリカランド 小計 | | 6,024,943 | | 662,991,592.22<br>(5,509,460,131) | |
| アラブ首長国連邦ディルハム | MULTIPLY GROUP | 519,646 | 1.88 | 976,934.48 | |
| | AMERICANA RESTAURANTS INTERN | 431,446 | 3.01 | 1,298,652.46 | |
| | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 444,022 | 3.37 | 1,496,354.14 | |
| | ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 471,430 | 7.81 | 3,681,868.30 | |
| | ABU DHABI ISLAMIC BANK | 250,781 | 10.90 | 2,733,512.90 | |
| | DUBAI ISLAMIC BANK | 525,144 | 5.54 | 2,909,297.76 | |
| | EMIRATES NBD PJSC | 357,699 | 16.10 | 5,758,953.90 | |
| | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 724,019 | 11.80 | 8,543,424.20 | |
| | EMIRATES TELECOM GROUP CO | 642,138 | 16.00 | 10,274,208.00 | |
| | ALDAR PROPERTIES PJSC | 725,831 | 5.66 | 4,108,203.46 | |
| | EMAAR PROPERTIES PJSC | 1,108,668 | 7.40 | 8,204,143.20 | |
| アラブ首長国連邦ディルハム 小計 | | 6,200,824 | | 49,985,552.80<br>(2,140,381,370) | |
| クウェートディナール | BOUBYAN BANK K.S.C | 171,769 | 0.58 | 99,626.02 | |
| | GULF BANK | 162,936 | 0.26 | 42,363.36 | |
| | KUWAIT FINANCE HOUSE | 1,794,507 | 0.72 | 1,297,428.56 | |
| | NATIONAL BANK OF KUWAIT | 1,404,477 | 0.85 | 1,206,445.74 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 296,830 | 0.45 | 133,573.50 | |
| | MABANEE CO KPSC | 150,334 | 0.86 | 129,437.57 | |
| クウェートディナール 小計 | | 3,980,853 | | 2,908,874.75<br>(1,487,220,393) | |
| オフショア人民元 | CHINA MERCHANTS ENERGY -A | 146,700 | 9.30 | 1,364,310.00 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 89,000 | 44.15 | 3,929,350.00 | |
| | COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 64,000 | 18.40 | 1,177,600.00 | |
| | GUANGHUI ENERGY CO LTD-A | 89,500 | 7.86 | 703,470.00 | |
| | PETROCHINA CO LTD-A | 100,000 | 9.99 | 999,000.00 | |
| | SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 96,200 | 26.71 | 2,569,502.00 | |
| | SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A | 237,792 | 10.99 | 2,613,334.08 | |
| | SHANXI COKING COAL ENERGY-A | 79,600 | 11.10 | 883,560.00 | |
| | SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 9,900 | 22.23 | 220,077.00 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP CO-A | 31,050 | 23.87 | 741,163.50 | |
| | YANTAI JEREH OILFIELD-A | 28,000 | 34.00 | 952,000.00 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 164,300 | 7.92 | 1,301,256.00 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 29,440 | 24.30 | 715,392.00 | |
| | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 369,500 | 6.99 | 2,582,805.00 | |
| | CHINA JUSHI CO LTD -A | 92,200 | 11.62 | 1,071,364.00 | |
| | CHINA NORTHERN RARE EARTH -A | 20,800 | 18.19 | 378,352.00 | |
| | CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A | 14,420 | 33.76 | 486,819.20 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A | 11,200 | 32.24 | 361,088.00 | |
| GEM CO LTD-A | 289,800 | 6.53 | 1,892,394.00 | |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A | 24,826 | 18.80 | 466,728.80 | |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A | 37,100 | 14.21 | 527,191.00 | |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A | 147,500 | 7.05 | 1,039,875.00 | |
| HESTEEL CO LTD-A | 832,100 | 2.08 | 1,730,768.00 | |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A | 22,400 | 49.15 | 1,100,960.00 | |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A | 461,000 | 1.46 | 673,060.00 | |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 60,000 | 3.99 | 239,400.00 | |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 22,300 | 8.44 | 188,212.00 | |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 10,140 | 59.20 | 600,288.00 | |
| LB GROUP CO LTD-A | 15,300 | 21.16 | 323,748.00 | |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD-A | 47,100 | 9.45 | 445,095.00 | |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A | 79,200 | 16.37 | 1,296,504.00 | |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 19,500 | 2.76 | 53,820.00 | |
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A | 47,600 | 17.18 | 817,768.00 | |
| RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A | 48,450 | 9.81 | 475,294.50 | |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A | 55,475 | 18.05 | 1,001,323.75 | |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 7,252 | 28.85 | 209,220.20 | |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A | 17,940 | 28.25 | 506,805.00 | |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A | 286,600 | 3.82 | 1,094,812.00 | |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 16,240 | 16.54 | 268,609.60 | |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 109,678 | 5.27 | 578,003.06 | |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A | 137,400 | 3.64 | 500,136.00 | |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 10,800 | 30.46 | 328,968.00 | |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 49,900 | 14.50 | 723,550.00 | |
| TIANQI LITHIUM CORP-A | 11,400 | 34.00 | 387,600.00 | |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A | 9,800 | 14.71 | 144,158.00 | |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 331,600 | 3.79 | 1,256,764.00 | |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A | 40,300 | 87.99 | 3,545,997.00 | |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 14,752 | 25.22 | 372,045.44 | |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A | 16,485 | 41.04 | 676,544.40 | |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS-A | 1,820 | 43.58 | 79,315.60 | |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C | 4,100 | 36.90 | 151,290.00 | |
| ZANGGE MINING CO LTD-A | 37,400 | 25.66 | 959,684.00 | |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A | 7,410 | 26.43 | 195,846.30 | |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A | 129,400 | 23.05 | 2,982,670.00 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 269,100 | 17.76 | 4,779,216.00 | |
| AECC AVIATION POWER CO-A | 11,400 | 37.55 | 428,070.00 | |
| AVICOPTER PLC-A | 15,500 | 41.45 | 642,475.00 | |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 8,400 | 32.09 | 269,556.00 | |
| CHINA BAOAN GROUP-A | 64,000 | 9.29 | 594,560.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A | 55,215 | 38.48 | 2,124,673.20 | |
| CHINA ENERGY ENGINEERING COR | 603,100 | 2.16 | 1,302,696.00 | |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL-A | 230,100 | 8.49 | 1,953,549.00 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 562,400 | 5.61 | 3,155,064.00 | |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 54,780 | 193.20 | 10,583,496.00 | |
| CRRC CORP LTD-A | 185,800 | 7.20 | 1,337,760.00 | |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 43,200 | 18.52 | 800,064.00 | |
| EVE ENERGY CO LTD-A | 39,473 | 41.29 | 1,629,840.17 | |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A | 2,400 | 52.30 | 125,520.00 | |
| GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A | 20,111 | 7.62 | 153,245.82 | |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A | 5,800 | 19.28 | 111,824.00 | |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 11,456 | 51.53 | 590,327.68 | |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A | 41,100 | 14.46 | 594,306.00 | |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A | 48,100 | 17.54 | 843,674.00 | |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 330,900 | 3.21 | 1,062,189.00 | |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 83,980 | 23.77 | 1,996,204.60 | |
| NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A | 8,316 | 66.07 | 549,438.12 | |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A | 12,534 | 47.01 | 589,223.34 | |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 163,200 | 5.34 | 871,488.00 | |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 41,900 | 16.17 | 677,523.00 | |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 486,700 | 3.88 | 1,888,396.00 | |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A | 28,393 | 54.37 | 1,543,727.41 | |
| SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A | 25,060 | 8.19 | 205,241.40 | |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 10,000 | 97.62 | 976,200.00 | |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A | 40,700 | 14.61 | 594,627.00 | |
| TBEA CO LTD-A | 29,274 | 14.39 | 421,252.86 | |
| WEICHAI POWER CO LTD-A | 43,200 | 16.07 | 694,224.00 | |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A | 199,400 | 7.46 | 1,487,524.00 | |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A | 31,600 | 20.57 | 650,012.00 | |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A | 8,260 | 60.88 | 502,868.80 | |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A | 7,300 | 23.51 | 171,623.00 | |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A | 80,100 | 8.11 | 649,611.00 | |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 11,000 | 35.05 | 385,550.00 | |
| AIR CHINA LTD-A | 225,900 | 7.45 | 1,682,955.00 | |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A | 397,100 | 5.24 | 2,080,804.00 | |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A | 40,000 | 3.96 | 158,400.00 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 183,500 | 17.18 | 3,152,530.00 | |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A | 160,500 | 7.23 | 1,160,415.00 | |
| S F HOLDING CO LTD-A | 53,100 | 37.86 | 2,010,366.00 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 5,319 | 34.20 | 181,909.80 | |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A | 44,400 | 5.86 | 260,184.00 | |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A | 55,700 | 16.16 | 900,112.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| YUNDA HOLDING CO LTD-A | 21,840 | 8.62 | 188,260.80 | |
| BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A | 15,120 | 37.09 | 560,800.80 | |
| BYD CO LTD -A | 17,000 | 235.50 | 4,003,500.00 | |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 9,000 | 126.50 | 1,138,500.00 | |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A | 43,352 | 13.31 | 577,015.12 | |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A | 18,500 | 47.45 | 877,825.00 | |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A | 34,300 | 16.16 | 554,288.00 | |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 8,400 | 99.39 | 834,876.00 | |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A | 29,300 | 15.05 | 440,965.00 | |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A | 45,700 | 57.04 | 2,606,728.00 | |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 42,600 | 14.11 | 601,086.00 | |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 39,254 | 19.87 | 779,976.98 | |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A | 2,800 | 49.70 | 139,160.00 | |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A | 43,500 | 41.10 | 1,787,850.00 | |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A | 27,760 | 23.57 | 654,303.20 | |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A | 7,932 | 35.03 | 277,857.96 | |
| MIDEA GROUP CO LTD-A | 50,800 | 65.16 | 3,310,128.00 | |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A | 7,700 | 64.85 | 499,345.00 | |
| QINGDAO HAIER CO LTD-A | 101,100 | 30.62 | 3,095,682.00 | |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A | 8,000 | 52.46 | 419,680.00 | |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 26,200 | 27.26 | 714,212.00 | |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 33,480 | 9.85 | 329,778.00 | |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A | 24,500 | 13.76 | 337,120.00 | |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 53,600 | 8.98 | 481,328.00 | |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A | 139,400 | 6.51 | 907,494.00 | |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 16,300 | 22.31 | 363,653.00 | |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A | 61,500 | 3.67 | 225,705.00 | |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A | 20,720 | 72.60 | 1,504,272.00 | |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 110,500 | 5.73 | 633,165.00 | |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 22,291 | 19.41 | 432,668.31 | |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 17,035 | 35.00 | 596,225.00 | |
| ANGEL YEAST CO LTD-A | 10,700 | 30.10 | 322,070.00 | |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 1,600 | 243.44 | 389,504.00 | |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 2,200 | 40.86 | 89,892.00 | |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A | 18,300 | 64.79 | 1,185,657.00 | |
| ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A | 3,000 | 84.83 | 254,490.00 | |
| CHONGQING BREWERY CO-A | 7,900 | 70.90 | 560,110.00 | |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A | 54,057 | 35.46 | 1,916,861.22 | |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A | 17,000 | 49.24 | 837,080.00 | |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 78,580 | 24.89 | 1,955,856.20 | |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | 34,302 | 27.06 | 928,212.12 | |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 17,300 | 51.72 | 894,756.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| JIANGSU YANGHE BREWERY -A | 9,100 | 91.22 | 830,102.00 | |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 11,500 | 26.72 | 307,280.00 | |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 13,000 | 1,619.18 | 21,049,340.00 | |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A | 18,400 | 166.18 | 3,057,712.00 | |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A | 33,558 | 47.87 | 1,606,421.46 | |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A | 26,800 | 9.72 | 260,496.00 | |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 9,380 | 237.43 | 2,227,093.40 | |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A | 11,400 | 43.50 | 495,900.00 | |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A | 38,160 | 21.56 | 822,729.60 | |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A | 41,500 | 142.34 | 5,907,110.00 | |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 10,100 | 29.64 | 299,364.00 | |
| BY-HEALTH CO LTD-A | 29,700 | 14.78 | 438,966.00 | |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 91,749 | 11.79 | 1,081,720.71 | |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A | 16,000 | 31.79 | 508,640.00 | |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 2,838 | 31.03 | 88,063.14 | |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A | 9,720 | 31.37 | 304,916.40 | |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A | 27,985 | 5.36 | 149,999.60 | |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A | 14,800 | 16.09 | 238,132.00 | |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 14,900 | 299.77 | 4,466,573.00 | |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A | 18,780 | 74.11 | 1,391,785.80 | |
| BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A | 83,180 | 31.19 | 2,594,384.20 | |
| BEIJING TONGRENTANG CO-A | 28,400 | 44.04 | 1,250,736.00 | |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A | 10,487 | 66.58 | 698,224.46 | |
| BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A | 9,067 | 56.30 | 510,472.10 | |
| CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A | 2,200 | 103.69 | 228,118.00 | |
| CHINA RESOURCES SANJIU MED-A | 10,200 | 64.65 | 659,430.00 | |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 14,850 | 30.65 | 455,152.50 | |
| DONG-E-E-JIAOCO LTD-A | 22,193 | 69.79 | 1,548,849.47 | |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 8,000 | 57.05 | 456,400.00 | |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 18,850 | 17.79 | 335,341.50 | |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A | 2,912 | 200.02 | 582,458.24 | |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A | 119,102 | 42.15 | 5,020,149.30 | |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A | 64,100 | 7.43 | 476,263.00 | |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 10,880 | 17.44 | 189,747.20 | |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A | 7,000 | 27.26 | 190,820.00 | |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 9,440 | 17.79 | 167,937.60 | |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 11,232 | 31.89 | 358,188.48 | |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A | 17,000 | 12.32 | 209,440.00 | |
| WUXI APPTEC CO LTD-A | 16,464 | 42.39 | 697,908.96 | |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A | 9,940 | 54.11 | 537,853.40 | |
| ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A | 3,900 | 226.28 | 882,492.00 | |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 9,020 | 17.30 | 156,046.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A | 34,848 | 18.78 | 654,445.44 | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 1,032,100 | 4.26 | 4,396,746.00 | |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | 58,000 | 5.77 | 334,660.00 | |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A | 157,400 | 15.47 | 2,434,978.00 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 511,900 | 7.36 | 3,767,584.00 | |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A | 112,700 | 13.21 | 1,488,767.00 | |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 229,740 | 7.92 | 1,819,540.80 | |
| BANK OF NANJING CO LTD -A | 147,500 | 10.12 | 1,492,700.00 | |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A | 58,300 | 23.68 | 1,380,544.00 | |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A | 45,500 | 7.75 | 352,625.00 | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 124,900 | 7.20 | 899,280.00 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 835,300 | 3.21 | 2,681,313.00 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 186,000 | 33.99 | 6,322,140.00 | |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 273,600 | 3.85 | 1,053,360.00 | |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 401,180 | 2.93 | 1,175,457.40 | |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 119,400 | 6.79 | 810,726.00 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 578,600 | 5.52 | 3,193,872.00 | |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 205,500 | 17.53 | 3,602,415.00 | |
| PING AN BANK CO LTD-A | 119,400 | 10.99 | 1,312,206.00 | |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 141,500 | 5.05 | 714,575.00 | |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 437,300 | 8.31 | 3,633,963.00 | |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A | 122,500 | 2.41 | 295,225.00 | |
| BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A | 79,400 | 9.44 | 749,536.00 | |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A | 57,330 | 6.92 | 396,723.60 | |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 19,900 | 5.20 | 103,480.00 | |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 46,700 | 6.98 | 325,966.00 | |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 28,660 | 14.16 | 405,825.60 | |
| CITIC SECURITIES CO-A | 141,080 | 18.38 | 2,593,050.40 | |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A | 24,100 | 20.69 | 498,629.00 | |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A | 117,427 | 12.16 | 1,427,912.32 | |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A | 3,600 | 15.50 | 55,800.00 | |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A | 60,200 | 5.23 | 314,846.00 | |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 60,600 | 12.47 | 755,682.00 | |
| GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A | 171,679 | 5.39 | 925,349.81 | |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A | 225,100 | 9.28 | 2,088,928.00 | |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 72,300 | 13.78 | 996,294.00 | |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A | 152,050 | 6.29 | 956,394.50 | |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 5,400 | 111.93 | 604,422.00 | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 31,500 | 12.98 | 408,870.00 | |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A | 114,270 | 5.21 | 595,346.70 | |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A | 40,576 | 7.96 | 322,984.96 | |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A | 207,200 | 4.49 | 930,328.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A | 307,600 | 6.37 | 1,959,412.00 | |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 114,000 | 3.71 | 422,940.00 | |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 43,700 | 10.74 | 469,338.00 | |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A | 314,800 | 6.00 | 1,888,800.00 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 100,200 | 28.31 | 2,836,662.00 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 104,800 | 42.12 | 4,414,176.00 | |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 26,900 | 7.82 | 210,358.00 | |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A | 4,823 | 258.57 | 1,247,083.11 | |
| CHINA NATIONAL SOFTWARE -A | 32,266 | 29.40 | 948,620.40 | |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A | 16,562 | 19.39 | 321,137.18 | |
| IFLYTEK CO LTD - A | 10,800 | 41.51 | 448,308.00 | |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A | 3,000 | 53.03 | 159,090.00 | |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 9,531 | 41.28 | 393,439.68 | |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 5,500 | 53.61 | 294,855.00 | |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A | 13,170 | 10.77 | 141,840.90 | |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A | 37,900 | 30.74 | 1,165,046.00 | |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 614,600 | 4.14 | 2,544,444.00 | |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 28,000 | 29.55 | 827,400.00 | |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 34,800 | 8.89 | 309,372.00 | |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A | 9,100 | 44.94 | 408,954.00 | |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 165,100 | 24.53 | 4,049,903.00 | |
| GOERTEK INC -A | 26,900 | 16.95 | 455,955.00 | |
| GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A | 50,000 | 4.75 | 237,500.00 | |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 7,000 | 31.03 | 217,210.00 | |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A | 19,712 | 35.28 | 695,439.36 | |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A | 16,800 | 15.64 | 262,752.00 | |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 46,450 | 32.20 | 1,495,690.00 | |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A | 1,728 | 85.52 | 147,778.56 | |
| NINESTAR CORP-A | 18,543 | 26.36 | 488,793.48 | |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A | 24,300 | 19.90 | 483,570.00 | |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A | 4,760 | 93.83 | 446,630.80 | |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A | 9,009 | 85.91 | 773,963.19 | |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A | 28,500 | 15.11 | 430,635.00 | |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A | 112,200 | 4.47 | 501,534.00 | |
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A | 18,340 | 22.92 | 420,352.80 | |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 4,200 | 29.09 | 122,178.00 | |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 53,710 | 6.35 | 341,058.50 | |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A | 4,700 | 85.04 | 399,688.00 | |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 15,750 | 35.93 | 565,897.50 | |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A | 30,300 | 16.15 | 489,345.00 | |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A | 12,180 | 119.51 | 1,455,631.80 | |
| ZTE CORP-A | 76,400 | 26.79 | 2,046,756.00 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | CHINA UNITED NETWORK-A | 422,800 | 4.57 | 1,932,196.00 | |
| | CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A | 173,800 | 10.40 | 1,807,520.00 | |
| | CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | 241,300 | 4.68 | 1,129,284.00 | |
| | CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 329,880 | 28.31 | 9,338,902.80 | |
| | ENN NATURAL GAS CO LTD-A | 55,600 | 20.52 | 1,140,912.00 | |
| | GD POWER DEVELOPMENT CO -A | 315,700 | 5.96 | 1,881,572.00 | |
| | SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | 176,900 | 18.38 | 3,251,422.00 | |
| | SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 92,300 | 18.68 | 1,724,164.00 | |
| | ADVANCED MICRO-FABRICATION-A | 7,097 | 142.25 | 1,009,548.25 | |
| | AMLOGIC SHANGHAI INC-A | 10,138 | 54.70 | 554,548.60 | |
| | CAMBRICON TECHNOLOGIES-A | 11,422 | 181.00 | 2,067,382.00 | |
| | CHINA RESOURCES MICROELECT-A | 21,032 | 37.01 | 778,394.32 | |
| | GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A | 6,272 | 83.46 | 523,461.12 | |
| | HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 21,168 | 24.56 | 519,886.08 | |
| | HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 7,500 | 17.50 | 131,250.00 | |
| | HYGON INFORMATION TECHNOLO-A | 41,125 | 68.14 | 2,802,257.50 | |
| | INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A | 7,500 | 57.80 | 433,500.00 | |
| | JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 34,202 | 13.99 | 478,485.98 | |
| | JCET GROUP CO LTD-A | 29,800 | 27.75 | 826,950.00 | |
| | JINKO SOLAR CO LTD-A | 22,986 | 8.43 | 193,771.98 | |
| | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 100,340 | 16.74 | 1,679,691.60 | |
| | MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A | 21,055 | 50.60 | 1,065,383.00 | |
| | NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A | 3,100 | 318.39 | 987,009.00 | |
| | SG MICRO CORP-A | 4,095 | 81.42 | 333,414.90 | |
| | STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A | 3,920 | 88.13 | 345,469.60 | |
| | SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A | 4,096 | 138.08 | 565,575.68 | |
| | TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A | 36,875 | 10.02 | 369,487.50 | |
| | TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 32,750 | 8.19 | 268,222.50 | |
| | TONGFU MICROELECTRONIC CO-A | 22,466 | 24.28 | 545,474.48 | |
| | TONGWEI CO LTD-A | 66,600 | 21.78 | 1,450,548.00 | |
| | TRINA SOLAR CO LTD-A | 25,418 | 20.34 | 517,002.12 | |
| | UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 6,859 | 55.77 | 382,526.43 | |
| | WILL SEMICONDUCTOR LTD-A | 7,290 | 100.14 | 730,020.60 | |
| | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A | 17,022 | 31.22 | 531,426.84 | |
| | CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 54,700 | 9.99 | 546,453.00 | |
| | CHINA VANKE CO LTD -A | 414,800 | 8.17 | 3,388,916.00 | |
| | HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A | 522,800 | 3.39 | 1,772,292.00 | |
| | POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 81,800 | 10.42 | 852,356.00 | |
| オフショア人民元 小計 | | 26,120,033 | | 359,425,809.53<br>(7,763,525,600) | |
| サウジアラビアリアル | ADES HOLDING CO | 80,157 | 19.72 | 1,580,696.04 | |
| | SAUDI ARABIAN OIL CO | 708,811 | 28.60 | 20,271,994.60 | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | ADVANCED PETROCHEMICALS CO | 11,775 | 38.90 | 458,047.50 | |
| | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | 37,413 | 110.00 | 4,115,430.00 | |
| | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 47,241 | 30.05 | 1,419,592.05 | |
| | SAUDI ARABIAN MINING CO | 210,844 | 44.60 | 9,403,642.40 | |
| | SAUDI ARAMCO BASE OIL CO | 9,349 | 133.00 | 1,243,417.00 | |
| | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 163,857 | 75.50 | 12,371,203.50 | |
| | SAUDI IND INVESTMENT GROUP | 85,323 | 21.78 | 1,858,334.94 | |
| | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 103,431 | 8.24 | 852,271.44 | |
| | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 51,079 | 36.95 | 1,887,369.05 | |
| | SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES | 6,159 | 280.80 | 1,729,447.20 | |
| | SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 4,207 | 212.40 | 893,566.80 | |
| | JARIR MARKETING CO | 125,000 | 13.22 | 1,652,500.00 | |
| | NAHDI MEDICAL CO | 6,431 | 132.80 | 854,036.80 | |
| | ALMARAI CO | 56,483 | 55.40 | 3,129,158.20 | |
| | SAVOLA | 36,289 | 44.85 | 1,627,561.65 | |
| | DALLAH HEALTHCARE CO | 6,833 | 165.00 | 1,127,445.00 | |
| | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 16,399 | 308.00 | 5,050,892.00 | |
| | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 15,924 | 118.60 | 1,888,586.40 | |
| | AL RAJHI BANK | 346,607 | 81.80 | 28,352,452.60 | |
| | ALINMA BANK | 201,652 | 32.80 | 6,614,185.60 | |
| | ARAB NATIONAL BANK | 195,935 | 20.64 | 4,044,098.40 | |
| | BANK AL-JAZIRA | 122,367 | 16.80 | 2,055,765.60 | |
| | BANK ALBILAD | 112,127 | 34.25 | 3,840,349.75 | |
| | BANQUE SAUDI FRANSI | 94,835 | 36.50 | 3,461,477.50 | |
| | RIYAD BANK | 234,479 | 25.90 | 6,073,006.10 | |
| | SAUDI AWWAL BANK | 147,895 | 39.00 | 5,767,905.00 | |
| | SAUDI INVESTMENT BANK/THE | 88,300 | 13.18 | 1,163,794.00 | |
| | THE SAUDI NATIONAL BANK | 490,774 | 36.55 | 17,937,789.70 | |
| | SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING | 10,957 | 254.00 | 2,783,078.00 | |
| | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE | 14,223 | 237.80 | 3,382,229.40 | |
| | CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 16,655 | 140.20 | 2,335,031.00 | |
| | ARABIAN INTERNET & COMMUNICA | 4,417 | 288.00 | 1,272,096.00 | |
| | ELM CO | 4,094 | 826.00 | 3,381,644.00 | |
| | ETIHAD ETISALAT CO | 48,844 | 50.90 | 2,486,159.60 | |
| | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 90,508 | 11.54 | 1,044,462.32 | |
| | SAUDI TELECOM CO | 339,167 | 37.55 | 12,735,720.85 | |
| | ACWA POWER CO | 24,653 | 387.60 | 9,555,502.80 | |
| | POWER & WATER UTILITY CO FOR | 16,081 | 59.70 | 960,035.70 | |
| | SAUDI ELECTRICITY CO | 162,109 | 17.00 | 2,755,853.00 | |
| | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 100,991 | 12.40 | 1,252,288.40 | |
| **サウジアラビアリアル 小計** | | 4,650,675 | | 196,670,117.89<br>(8,246,378,043) | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 合　計 | 1,386,771,258 | | 201,917,761,199<br>(201,917,761,199) | |

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 投資信託受益証券 | メキシコペソ | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 97,360 | 16,093,608.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 97,360 | 16,093,608.00<br>(137,524,708) | |
| | ブラジルレアル | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 200,300 | 6,545,804.00 | |
| | | ENERGISA SA-UNITS | 37,400 | 1,726,010.00 | |
| | | KLABIN SA-UNIT | 110,000 | 2,200,000.00 | |
| | ブラジルレアル 小計 | | 347,700 | 10,471,814.00<br>(307,516,337) | |
| 投資信託受益証券合計 | | | 445,060 | 445,041,045<br>(445,041,045) | |
| 投資証券 | メキシコペソ | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 613,700 | 14,943,595.00 | |
| | | PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA | 126,346 | 8,298,405.28 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 740,046 | 23,242,000.28<br>(198,609,864) | |
| 投資証券合計 | | | 740,046 | 198,609,864<br>(198,609,864) | |
| 合計 | | | | 643,650,909<br>(643,650,909) | |

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。(　)内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式<br>時価比率 | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率 | 組入投資証券<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| アメリカドル | 株式　26銘柄 | 100.0% | — | — | 2.7% |
| メキシコペソ | 株式　21銘柄 | 92.3% | — | — | 2.0% |
| | 投資信託受益証券 1銘柄 | — | 3.1% | — | 0.1% |
| | 投資証券　2銘柄 | — | — | 4.5% | 0.1% |
| ブラジルレアル | 株式　45銘柄 | 96.5% | — | — | 4.2% |
| | 投資信託受益証券 3銘柄 | — | 3.5% | — | 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　13銘柄 | 100.0% | — | — | 0.9% |
| ロシアルーブル | 株式　14銘柄 | 100.0% | — | — | 0.0% |
| 香港ドル | 株式　157銘柄 | 100.0% | — | — | 20.3% |
| 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　32銘柄 | 100.0% | — | — | 1.4% |
| フィリピンペソ | 株式　13銘柄 | 100.0% | — | — | 0.5% |
| インドネシアルピア | 株式　21銘柄 | 100.0% | — | — | 1.6% |
| 韓国ウォン | 株式　98銘柄 | 100.0% | — | — | 11.9% |
| 新台湾ドル | 株式　88銘柄 | 100.0% | — | — | 18.4% |
| インドルピー | 株式　146銘柄 | 100.0% | — | — | 18.9% |
| 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% | — | — | 2.7% |
| 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　307銘柄 | 100.0% | — | — | 3.8% |
| サウジアラビアリアル | 株式　42銘柄 | 100.0% | — | — | 4.1% |

(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。

## 新興国債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 5,138,869,542 |
| コール・ローン | 1,004,634,888 |
| 国債証券 | 142,378,635,839 |
| 派生商品評価勘定 | 486,779 |
| 未収入金 | 1,692,872 |
| 未収利息 | 2,253,419,261 |
| 前払費用 | 261,711,900 |
| 流動資産合計 | 151,039,451,081 |
| 資産合計 | 151,039,451,081 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 22,890,257 |
| 未払金 | 4,204,216,236 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 未払解約金 | 110,883,533 |
| 流動負債合計 | 4,337,990,026 |
| 負債合計 | 4,337,990,026 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 63,369,306,902 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 83,332,154,153 |
| 元本等合計 | 146,701,461,055 |
| 純資産合計 | 146,701,461,055 |
| 負債純資産合計 | 151,039,451,081 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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。<br>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<br>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。<br><br>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。<br>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<br>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 6月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 63,369,306,902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 2.3150円<br>(1万口当たり純資産額) (23,150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 6月10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。<br>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。<br>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。 |

| | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ３.金融商品に係るリスク管理体制 | 運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。 |

## ２．金融商品の時価等に関する事項

| | 2024年 6月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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 6月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 6月13日 |
| 期首元本額 | 52,846,131,448円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,611,641,661円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,088,466,207円 |
| 期末元本額 | 63,369,306,902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 | 4,938,661,030円 |
| 世界経済インデックスファンド | 23,447,381,475円 |
| ＤＣ新興国債券インデックス・オープン | 5,949,698,315円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 15,140,664,504円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 8,492,787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） | 813,483,115円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,650,005,243円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 230,377,132円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 107,902,442円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 185,017,251円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 510,551,437円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 752,435,028円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 1,135,467,252円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 14,290,816円 |
| グローバル経済コア | 1,168,741,756円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 116,596,974円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 102,841,557円 |

| 区分 | 2024年 6月10日現在 |
|---|---|
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 43,236,344円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 51,781,705円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード） | 298,437,090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 | 41,263,630円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 312,783,629円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 153,184,778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 6月10日現在 |
|---|---|
| | 当期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 672,490,769 |
| 合計 | 672,490,769 |

(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 6月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 1,494,320,860 | － | 1,477,064,460 | △17,256,400 |
| | メキシコペソ | 124,653,586 | － | 118,446,368 | △6,207,218 |
| | ブラジルレアル | 664,852,403 | － | 657,801,741 | △7,050,662 |
| | チェココルナ | 81,703,915 | － | 81,307,590 | △396,325 |
| | ハンガリーフォリント | 39,160,080 | － | 38,752,224 | △407,856 |
| | ポーランドズロチ | 104,101,244 | － | 102,752,208 | △1,349,036 |
| | マレーシアリンギット | 127,974,781 | － | 127,669,248 | △305,533 |
| | タイバーツ | 117,563,514 | － | 117,242,011 | △321,503 |
| | 南アフリカランド | 105,919,338 | － | 104,605,200 | △1,314,138 |
| | オフショア人民元 | 128,391,999 | － | 128,487,870 | 95,871 |
| | 売建 | 664,852,403 | － | 669,999,481 | △5,147,078 |
| | アメリカドル | 664,852,403 | － | 669,999,481 | △5,147,078 |
| 合計 | | 2,159,173,263 | － | 2,147,063,941 | △22,403,478 |

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第１　有価証券明細表

#### (1)株式

該当事項はありません。

#### (2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘　柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---|---|---|---|---|---|
| 国債証券 | メキシコペソ | MBONO 10% 11/20/36 | 38,800,000.00 | 39,294,312.00 | |
| | | MBONO 5.5% 03/04/27 | 160,000,000.00 | 142,814,400.00 | |
| | | MBONO 5.75% 03/05/26 | 175,300,000.00 | 162,283,228.22 | |
| | | MBONO 5% 03/06/25 | 57,500,000.00 | 55,354,675.00 | |
| | | MBONO 7.5% 05/26/33 | 134,000,000.00 | 116,001,120.00 | |
| | | MBONO 7.5% 06/03/27 | 139,000,000.00 | 129,710,630.00 | |
| | | MBONO 7.75% 05/29/31 | 180,800,000.00 | 161,665,936.00 | |
| | | MBONO 7.75% 11/13/42 | 123,500,000.00 | 101,517,000.00 | |
| | | MBONO 7.75% 11/23/34 | 76,100,000.00 | 66,042,624.00 | |
| | | MBONO 7% 09/03/26 | 132,600,000.00 | 123,811,272.00 | |
| | | MBONO 8.5% 03/01/29 | 52,000,000.00 | 49,154,560.00 | |
| | | MBONO 8.5% 05/31/29 | 139,600,000.00 | 132,016,928.00 | |
| | | MBONO 8.5% 11/18/38 | 98,300,000.00 | 88,157,406.00 | |
| | | MBONO 8% 07/31/53 | 118,500,000.00 | 98,056,380.00 | |
| | | MBONO 8% 11/07/47 | 130,700,000.00 | 108,575,104.00 | |
| | メキシコペソ 小計 | | 1,756,700,000.00 | 1,574,455,575.22<br>(13,454,195,226) | |
| | ブラジルレアル | BLTN 0% 01/01/26 | 76,500,000.00 | 64,837,979.68 | |
| | | BLTN 0% 01/01/28 | 18,400,000.00 | 12,368,002.33 | |
| | | BLTN 0% 01/01/30 | 20,200,000.00 | 10,854,732.60 | |
| | | BLTN 0% 07/01/25 | 68,000,000.00 | 61,023,782.74 | |
| | | BLTN 0% 07/01/26 | 78,000,000.00 | 62,542,156.56 | |
| | | BLTN 0% 07/01/27 | 68,000,000.00 | 48,565,746.19 | |
| | | BNTNF 10% 01/01/25 | 54,900,000.00 | 54,695,889.37 | |
| | | BNTNF 10% 01/01/27 | 68,300,000.00 | 66,240,295.88 | |
| | | BNTNF 10% 01/01/29 | 51,400,000.00 | 48,397,621.04 | |
| | | BNTNF 10% 01/01/31 | 28,850,000.00 | 26,462,475.19 | |
| | | BNTNF 10% 01/01/33 | 28,900,000.00 | 26,049,550.74 | |
| | | BNTNF 10% 01/01/35 | 8,000,000.00 | 7,091,613.49 | |
| | ブラジルレアル 小計 | | 569,450,000.00 | 489,129,845.81<br>(14,363,835,965) | |
| | チリペソ | BTPCL 2.3% 10/01/28 | 1,025,000,000.00 | 902,040,017.02 | |
| | | BTPCL 2.5% 03/01/25 | 2,985,000,000.00 | 2,936,142,093.12 | |
| | | BTPCL 4.5% 03/01/26 | 2,160,000,000.00 | 2,153,299,561.20 | |
| | | BTPCL 4.7% 09/01/30 | 2,290,000,000.00 | 2,171,708,953.09 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | BTPCL 5% 03/01/35 | 2,360,000,000.00 | 2,199,330,076.64 | |
| | BTPCL 5% 10/01/28 | 840,000,000.00 | 821,410,706.76 | |
| | BTPCL 6% 01/01/43 | 2,000,000,000.00 | 2,017,968,494.00 | |
| | BTPCL 6% 04/01/33 | 1,650,000,000.00 | 1,673,729,856.15 | |
| | BTPCL 7% 05/01/34 | 620,000,000.00 | 672,047,379.94 | |
| チリペソ 小計 | | 15,930,000,000.00 | 15,547,677,137.92<br>(2,657,222,404) | |
| コロンビアペソ | COLTES 13.25% 02/09/33 | 10,000,000,000.00 | 11,424,293,400.00 | |
| | COLTES 5.75% 11/03/27 | 25,000,000,000.00 | 22,151,780,500.00 | |
| | COLTES 6.25% 11/26/25 | 39,000,000,000.00 | 37,554,785,970.00 | |
| | COLTES 7.25% 10/18/34 | 51,600,000,000.00 | 40,733,021,424.00 | |
| | COLTES 7.25% 10/26/50 | 54,110,000,000.00 | 35,409,358,361.30 | |
| | COLTES 7% 03/26/31 | 10,700,000,000.00 | 9,051,103,785.00 | |
| | COLTES 7% 06/30/32 | 10,000,000,000.00 | 8,154,785,600.00 | |
| コロンビアペソ 小計 | | 200,410,000,000.00 | 164,479,129,040.30<br>(6,564,362,039) | |
| ペルーソル | PERUGB 5.35% 08/12/40 | 6,950,000.00 | 5,718,193.53 | |
| | PERUGB 5.4% 08/12/34 | 9,250,000.00 | 8,197,547.02 | |
| | PERUGB 5.94% 02/12/29 | 10,400,000.00 | 10,449,380.13 | |
| | PERUGB 6.15% 08/12/32 | 11,300,000.00 | 10,898,915.42 | |
| | PERUGB 6.35% 08/12/28 | 6,650,000.00 | 6,826,231.51 | |
| | PERUGB 6.9% 08/12/37 | 11,050,000.00 | 10,719,356.92 | |
| | PERUGB 6.95% 08/12/31 | 12,100,000.00 | 12,392,641.64 | |
| | PERUGB 7.3% 08/12/33 | 10,600,000.00 | 10,912,065.16 | |
| | PERUGB 8.2% 08/12/26 | 4,450,000.00 | 4,701,043.63 | |
| ペルーソル 小計 | | 82,750,000.00 | 80,815,374.96<br>(3,376,991,665) | |
| ウルグアイペソ | URUGUA 8.25% 05/21/31 | 25,000,000.00 | 23,825,803.75 | |
| | URUGUA 8.5% 03/15/28 | 17,000,000.00 | 16,654,033.68 | |
| | URUGUA 9.75% 07/20/33 | 40,000,000.00 | 41,300,000.00 | |
| ウルグアイペソ 小計 | | 82,000,000.00 | 81,779,837.43<br>(329,450,075) | |
| ドミニカペソ | DOMREP 11.25% 09/15/35 | 40,000,000.00 | 42,539,776.80 | |
| | DOMREP 13.625% 02/03/33 | 32,000,000.00 | 38,197,736.32 | |
| ドミニカペソ 小計 | | 72,000,000.00 | 80,737,513.12<br>(213,308,509) | |
| チェココルナ | CZGB 0.05% 11/29/29 | 41,100,000.00 | 33,061,353.75 | |
| | CZGB 0.25% 02/10/27 | 95,200,000.00 | 85,982,260.00 | |
| | CZGB 0.95% 05/15/30 | 98,900,000.00 | 82,579,027.50 | |
| | CZGB 1.2% 03/13/31 | 98,000,000.00 | 81,242,735.00 | |
| | CZGB 1.25% 02/14/25 | 75,500,000.00 | 74,046,813.75 | |
| | CZGB 1.5% 04/24/40 | 34,700,000.00 | 23,673,641.25 | |
| | CZGB 1.75% 06/23/32 | 86,500,000.00 | 72,396,607.50 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | CZGB 1.95% 07/30/37 | 29,000,000.00 | 22,301,000.00 | |
| | CZGB 1% 06/26/26 | 68,800,000.00 | 64,570,382.40 | |
| | CZGB 2.4% 09/17/25 | 75,700,000.00 | 73,933,805.45 | |
| | CZGB 2.5% 08/25/28 | 98,700,000.00 | 92,557,405.50 | |
| | CZGB 2.75% 07/23/29 | 100,500,000.00 | 94,175,836.50 | |
| | CZGB 2% 10/13/33 | 102,500,000.00 | 85,508,190.62 | |
| | CZGB 3.5% 05/30/35 | 57,000,000.00 | 53,327,062.50 | |
| | CZGB 3% 03/03/33 | 28,000,000.00 | 25,575,200.00 | |
| | CZGB 4.2% 12/04/36 | 45,000,000.00 | 44,876,250.00 | |
| | CZGB 4.5% 11/11/32 | 25,000,000.00 | 25,511,250.00 | |
| | CZGB 4.9% 04/14/34 | 47,500,000.00 | 50,082,812.50 | |
| | CZGB 5.5% 12/12/28 | 69,000,000.00 | 72,762,742.50 | |
| | CZGB 5.75% 03/29/29 | 18,000,000.00 | 19,239,390.00 | |
| | CZGB 5% 09/30/30 | 80,000,000.00 | 83,764,600.00 | |
| | CZGB 6.2% 06/16/31 | 27,000,000.00 | 30,322,350.00 | |
| | CZGB 6% 02/26/26 | 68,000,000.00 | 70,037,382.00 | |
| チェココルナ 小計 | | 1,469,600,000.00 | 1,361,528,098.72<br>(9,347,707,314) | |
| ハンガリーフォリント | HGB 1.5% 04/22/26 | 610,500,000.00 | 557,152,190.10 | |
| | HGB 1.5% 08/26/26 | 514,000,000.00 | 461,563,519.00 | |
| | HGB 1% 11/26/25 | 835,000,000.00 | 770,995,371.25 | |
| | HGB 2.25% 04/20/33 | 872,000,000.00 | 619,906,561.44 | |
| | HGB 2.25% 06/22/34 | 291,000,000.00 | 198,717,570.75 | |
| | HGB 2.75% 12/22/26 | 685,500,000.00 | 624,846,685.80 | |
| | HGB 2% 05/23/29 | 733,000,000.00 | 593,399,233.75 | |
| | HGB 3.25% 10/22/31 | 1,042,000,000.00 | 838,725,024.90 | |
| | HGB 3% 04/25/41 | 371,000,000.00 | 233,641,887.50 | |
| | HGB 3% 08/21/30 | 715,000,000.00 | 585,047,570.25 | |
| | HGB 3% 10/27/27 | 932,000,000.00 | 832,072,078.40 | |
| | HGB 3% 10/27/38 | 530,000,000.00 | 351,711,180.00 | |
| | HGB 4.5% 03/23/28 | 603,000,000.00 | 560,861,455.50 | |
| | HGB 4.75% 11/24/32 | 840,000,000.00 | 736,179,570.00 | |
| | HGB 5.5% 06/24/25 | 900,000,000.00 | 889,363,080.00 | |
| | HGB 6.75% 10/22/28 | 767,000,000.00 | 770,410,388.80 | |
| | HGB 7% 10/24/35 | 340,000,000.00 | 347,109,944.00 | |
| | HGB 9.5% 10/21/26 | 230,000,000.00 | 243,661,103.00 | |
| ハンガリーフォリント 小計 | | 11,811,000,000.00 | 10,215,364,414.44<br>(4,420,780,673) | |
| ポーランドズロチ | POLGB 0.25% 10/25/26 | 25,200,000.00 | 22,452,746.40 | |
| | POLGB 0.75% 04/25/25 | 17,300,000.00 | 16,697,873.50 | |
| | POLGB 0% 10/25/25 | 15,200,000.00 | 14,206,543.20 | |
| | POLGB 1.25% 10/25/30 | 22,800,000.00 | 17,658,201.00 | |
| | | | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | POLGB 1.75% 04/25/32 | 22,700,000.00 | 17,208,518.15 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/26 | 21,300,000.00 | 20,153,346.45 | |
| | POLGB 2.5% 07/25/27 | 23,700,000.00 | 21,799,923.60 | |
| | POLGB 2.75% 04/25/28 | 21,000,000.00 | 19,112,268.00 | |
| | POLGB 2.75% 10/25/29 | 38,900,000.00 | 34,027,619.40 | |
| | POLGB 3.25% 07/25/25 | 23,050,000.00 | 22,611,116.47 | |
| | POLGB 3.75% 05/25/27 | 21,100,000.00 | 20,219,417.87 | |
| | POLGB 4.75% 07/25/29 | 7,400,000.00 | 7,152,964.61 | |
| | POLGB 5% 10/25/34 | 4,000,000.00 | 3,797,480.00 | |
| | POLGB 6% 10/25/33 | 32,400,000.00 | 33,134,303.88 | |
| | POLGB 7.5% 07/25/28 | 25,900,000.00 | 27,800,075.80 | |
| ポーランドズロチ 小計 | | 321,950,000.00 | 298,032,398.33<br>(11,696,460,291) | |
| ルーマニアレイ | ROMGB 2.5% 10/25/27 | 7,500,000.00 | 6,665,075.85 | |
| | ROMGB 3.25% 06/24/26 | 11,100,000.00 | 10,517,250.00 | |
| | ROMGB 3.5% 11/25/25 | 5,800,000.00 | 5,604,366.00 | |
| | ROMGB 3.65% 07/28/25 | 10,400,000.00 | 10,142,964.00 | |
| | ROMGB 3.65% 09/24/31 | 8,800,000.00 | 7,263,652.00 | |
| | ROMGB 4.15% 01/26/28 | 9,000,000.00 | 8,420,400.00 | |
| | ROMGB 4.15% 10/24/30 | 7,400,000.00 | 6,454,563.49 | |
| | ROMGB 4.25% 04/28/36 | 6,600,000.00 | 5,202,813.00 | |
| | ROMGB 4.75% 02/24/25 | 8,600,000.00 | 8,523,933.00 | |
| | ROMGB 4.75% 10/11/34 | 10,200,000.00 | 8,643,951.75 | |
| | ROMGB 4.85% 04/22/26 | 4,700,000.00 | 4,602,592.50 | |
| | ROMGB 4.85% 07/25/29 | 7,800,000.00 | 7,260,774.14 | |
| | ROMGB 5.8% 07/26/27 | 6,500,000.00 | 6,420,952.00 | |
| | ROMGB 5% 02/12/29 | 11,200,000.00 | 10,526,944.06 | |
| | ROMGB 6.7% 02/25/32 | 9,600,000.00 | 9,544,848.00 | |
| | ROMGB 7.2% 05/31/27 | 5,800,000.00 | 5,941,136.04 | |
| | ROMGB 7.2% 10/28/26 | 5,300,000.00 | 5,408,521.21 | |
| | ROMGB 7.2% 10/30/33 | 5,300,000.00 | 5,465,764.92 | |
| | ROMGB 7.35% 04/28/31 | 8,200,000.00 | 8,525,126.72 | |
| | ROMGB 7.9% 02/24/38 | 6,100,000.00 | 6,609,899.00 | |
| | ROMGB 8.25% 09/29/32 | 10,200,000.00 | 11,114,736.00 | |
| | ROMGB 8.75% 10/30/28 | 7,500,000.00 | 8,112,750.00 | |
| | ROMGB 8% 04/29/30 | 7,500,000.00 | 7,970,737.50 | |
| ルーマニアレイ 小計 | | 181,100,000.00 | 174,943,751.18<br>(5,947,685,169) | |
| マレーシアリンギット | MGS 2.632% 04/15/31 | 16,200,000.00 | 15,054,219.19 | |
| | MGS 3.502% 05/31/27 | 17,650,000.00 | 17,623,687.90 | |
| | MGS 3.582% 07/15/32 | 21,500,000.00 | 21,089,711.41 | |
| | MGS 3.733% 06/15/28 | 43,000,000.00 | 43,149,360.50 | |
| | MGS 3.757% 05/22/40 | 29,350,000.00 | 28,277,252.80 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | MGS 3.828% 07/05/34 | 8,200,000.00 | 8,164,708.10 | |
| | MGS 3.882% 03/14/25 | 6,200,000.00 | 6,226,609.16 | |
| | MGS 3.885% 08/15/29 | 51,800,000.00 | 52,330,975.90 | |
| | MGS 3.899% 11/16/27 | 25,500,000.00 | 25,757,853.45 | |
| | MGS 3.9% 11/30/26 | 20,450,000.00 | 20,655,105.32 | |
| | MGS 3.906% 07/15/26 | 24,600,000.00 | 24,823,062.96 | |
| | MGS 3.955% 09/15/25 | 33,900,000.00 | 34,138,781.43 | |
| | MGS 4.065% 06/15/50 | 18,250,000.00 | 17,814,871.63 | |
| | MGS 4.254% 05/31/35 | 13,650,000.00 | 14,026,873.77 | |
| | MGS 4.457% 03/31/53 | 7,500,000.00 | 7,794,312.00 | |
| | MGS 4.504% 04/30/29 | 9,400,000.00 | 9,751,293.04 | |
| | MGS 4.642% 11/07/33 | 14,000,000.00 | 14,839,287.40 | |
| | MGS 4.696% 10/15/42 | 26,800,000.00 | 28,731,559.08 | |
| | MGS 4.762% 04/07/37 | 18,500,000.00 | 19,901,106.75 | |
| | MGS 4.893% 06/08/38 | 20,200,000.00 | 22,092,099.66 | |
| | MGS 4.921% 07/06/48 | 11,400,000.00 | 12,624,747.60 | |
| マレーシアリンギット 小計 | | 438,050,000.00 | 444,867,479.05<br>(14,796,158,892) | |
| タイバーツ | THAIGB 0.95% 06/17/25 | 172,200,000.00 | 169,773,144.07 | |
| | THAIGB 1.585% 12/17/35 | 59,800,000.00 | 52,308,104.10 | |
| | THAIGB 1.6% 06/17/35 | 65,100,000.00 | 57,496,659.17 | |
| | THAIGB 1.6% 12/17/29 | 108,100,000.00 | 102,900,611.60 | |
| | THAIGB 1% 06/17/27 | 203,000,000.00 | 194,870,485.39 | |
| | THAIGB 2.125% 12/17/26 | 203,100,000.00 | 201,941,596.80 | |
| | THAIGB 2.25% 03/17/27 | 83,000,000.00 | 82,729,507.15 | |
| | THAIGB 2.35% 06/17/26 | 142,000,000.00 | 141,981,075.66 | |
| | THAIGB 2.4% 03/17/29 | 118,000,000.00 | 117,483,853.84 | |
| | THAIGB 2.65% 06/17/28 | 164,000,000.00 | 165,413,712.80 | |
| | THAIGB 2.8% 06/17/34 | 90,000,000.00 | 90,225,981.00 | |
| | THAIGB 2.875% 06/17/46 | 102,100,000.00 | 92,797,142.16 | |
| | THAIGB 2.875% 12/17/28 | 101,000,000.00 | 102,820,454.30 | |
| | THAIGB 2% 06/17/42 | 93,600,000.00 | 78,884,485.99 | |
| | THAIGB 2% 12/17/31 | 123,000,000.00 | 117,589,746.60 | |
| | THAIGB 3.3% 06/17/38 | 148,700,000.00 | 153,766,684.84 | |
| | THAIGB 3.35% 06/17/33 | 157,000,000.00 | 164,277,546.60 | |
| | THAIGB 3.39% 06/17/37 | 170,000,000.00 | 177,554,035.00 | |
| | THAIGB 3.4% 06/17/36 | 157,200,000.00 | 163,981,466.52 | |
| | THAIGB 3.45% 06/17/43 | 123,000,000.00 | 126,205,404.60 | |
| | THAIGB 3.65% 06/20/31 | 136,500,000.00 | 145,114,938.15 | |
| | THAIGB 3.775% 06/25/32 | 180,000,000.00 | 193,702,554.00 | |
| | THAIGB 3.85% 12/12/25 | 105,400,000.00 | 107,707,522.20 | |
| | THAIGB 4.875% 06/22/29 | 169,500,000.00 | 188,404,453.65 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| タイバーツ 小計 | | 3,175,300,000.00 | 3,189,931,166.19<br>(13,589,106,767) | |
| インドネシアルピア | INDOGB 10.5% 08/15/30 | 7,300,000,000.00 | 8,623,970,340.00 | |
| | INDOGB 11% 09/15/25 | 7,500,000,000.00 | 7,925,025,000.00 | |
| | INDOGB 5.125% 04/15/27 | 63,000,000,000.00 | 60,528,510,000.00 | |
| | INDOGB 5.5% 04/15/26 | 109,000,000,000.00 | 107,230,930,000.00 | |
| | INDOGB 6.125% 05/15/28 | 16,000,000,000.00 | 15,636,800,000.00 | |
| | INDOGB 6.25% 06/15/36 | 37,800,000,000.00 | 35,711,950,302.00 | |
| | INDOGB 6.375% 04/15/32 | 75,000,000,000.00 | 72,790,500,000.00 | |
| | INDOGB 6.375% 07/15/37 | 16,100,000,000.00 | 15,275,128,253.00 | |
| | INDOGB 6.375% 08/15/28 | 88,500,000,000.00 | 87,328,260,000.00 | |
| | INDOGB 6.5% 02/15/31 | 75,500,000,000.00 | 74,017,180,000.00 | |
| | INDOGB 6.5% 06/15/25 | 53,000,000,000.00 | 52,962,900,000.00 | |
| | INDOGB 6.625% 02/15/34 | 82,000,000,000.00 | 80,638,390,000.00 | |
| | INDOGB 6.625% 05/15/33 | 20,000,000,000.00 | 19,677,400,000.00 | |
| | INDOGB 6.875% 04/15/29 | 49,000,000,000.00 | 49,078,400,000.00 | |
| | INDOGB 7.125% 06/15/38 | 24,000,000,000.00 | 24,438,720,000.00 | |
| | INDOGB 7.125% 06/15/42 | 62,800,000,000.00 | 63,873,252,000.00 | |
| | INDOGB 7.125% 06/15/43 | 28,500,000,000.00 | 28,970,107,500.00 | |
| | INDOGB 7.5% 04/15/40 | 51,000,000,000.00 | 53,773,380,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 05/15/38 | 34,700,000,000.00 | 36,339,228,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 06/15/35 | 49,700,000,000.00 | 51,915,129,000.00 | |
| | INDOGB 7.5% 08/15/32 | 18,400,000,000.00 | 19,059,272,000.00 | |
| | INDOGB 7% 02/15/33 | 90,000,000,000.00 | 90,792,000,000.00 | |
| | INDOGB 7% 05/15/27 | 38,600,000,000.00 | 38,903,782,000.00 | |
| | INDOGB 7% 09/15/30 | 85,000,000,000.00 | 85,659,600,000.00 | |
| | INDOGB 8.25% 05/15/29 | 54,200,000,000.00 | 57,360,944,000.00 | |
| | INDOGB 8.25% 05/15/36 | 33,700,000,000.00 | 37,220,639,000.00 | |
| | INDOGB 8.25% 06/15/32 | 13,400,000,000.00 | 14,514,739,300.00 | |
| | INDOGB 8.375% 03/15/34 | 71,000,000,000.00 | 78,381,870,000.00 | |
| | INDOGB 8.375% 04/15/39 | 24,200,000,000.00 | 27,307,909,200.00 | |
| | INDOGB 8.375% 09/15/26 | 40,100,000,000.00 | 41,484,653,000.00 | |
| | INDOGB 8.75% 05/15/31 | 38,700,000,000.00 | 42,592,446,000.00 | |
| | INDOGB 9.5% 07/15/31 | 11,400,000,000.00 | 13,052,658,000.00 | |
| | INDOGB 9% 03/15/29 | 28,700,000,000.00 | 31,168,774,000.00 | |
| インドネシアルピア 小計 | | 1,497,800,000,000.00 | 1,524,234,446,895.00<br>(14,785,074,134) | |
| 南アフリカランド | SAGB 10.5% 12/21/26 | 206,700,000.00 | 212,983,680.00 | |
| | SAGB 11.625% 03/31/53 | 35,000,000.00 | 32,193,000.00 | |
| | SAGB 6.25% 03/31/36 | 72,200,000.00 | 45,677,330.00 | |
| | SAGB 6.5% 02/28/41 | 113,100,000.00 | 65,812,890.00 | |
| | SAGB 7% 02/28/31 | 122,700,000.00 | 99,626,265.00 | |
| | SAGB 8.25% 03/31/32 | 187,500,000.00 | 157,471,875.00 | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | SAGB 8.5% 01/31/37 | 145,700,000.00 | 109,209,435.00 | |
| | SAGB 8.75% 01/31/44 | 112,000,000.00 | 79,772,000.00 | |
| | SAGB 8.75% 02/28/48 | 181,700,000.00 | 128,352,880.00 | |
| | SAGB 8.875% 02/28/35 | 230,000,000.00 | 185,610,000.00 | |
| | SAGB 8% 01/31/30 | 220,100,000.00 | 197,116,057.50 | |
| | SAGB 9% 01/31/40 | 177,300,000.00 | 133,010,460.00 | |
| **南アフリカランド 小計** | | 1,804,000,000.00 | 1,446,835,872.50<br>(12,023,206,100) | |
| **オフショア人民元** | CGB 1.99% 04/09/25 | 13,600,000.00 | 13,639,997.60 | |
| | CGB 2.04% 02/25/27 | 26,000,000.00 | 26,095,420.00 | |
| | CGB 2.18% 08/15/26 | 3,400,000.00 | 3,423,922.06 | |
| | CGB 2.18% 08/25/25 | 10,200,000.00 | 10,255,192.20 | |
| | CGB 2.28% 03/25/31 | 13,000,000.00 | 13,062,530.00 | |
| | CGB 2.3% 05/15/26 | 14,000,000.00 | 14,136,873.80 | |
| | CGB 2.39% 11/15/26 | 2,000,000.00 | 2,024,441.40 | |
| | CGB 2.4% 07/15/28 | 10,000,000.00 | 10,142,658.00 | |
| | CGB 2.44% 10/15/27 | 16,600,000.00 | 16,840,831.14 | |
| | CGB 2.46% 02/15/26 | 21,600,000.00 | 21,848,110.56 | |
| | CGB 2.48% 04/15/27 | 5,400,000.00 | 5,489,398.62 | |
| | CGB 2.48% 09/25/28 | 5,000,000.00 | 5,088,116.50 | |
| | CGB 2.5% 07/25/27 | 6,000,000.00 | 6,102,361.20 | |
| | CGB 2.52% 08/25/33 | 15,700,000.00 | 15,977,561.87 | |
| | CGB 2.54% 12/25/30 | 17,800,000.00 | 18,179,647.30 | |
| | CGB 2.6% 09/01/32 | 16,900,000.00 | 17,296,259.37 | |
| | CGB 2.62% 04/15/28 | 17,800,000.00 | 18,190,688.64 | |
| | CGB 2.62% 06/25/30 | 5,500,000.00 | 5,640,975.45 | |
| | CGB 2.62% 09/25/29 | 4,000,000.00 | 4,103,549.60 | |
| | CGB 2.64% 01/15/28 | 23,200,000.00 | 23,711,631.92 | |
| | CGB 2.67% 05/25/33 | 16,700,000.00 | 17,174,719.21 | |
| | CGB 2.67% 11/25/33 | 5,800,000.00 | 5,979,127.20 | |
| | CGB 2.68% 05/21/30 | 27,300,000.00 | 28,108,093.65 | |
| | CGB 2.69% 08/12/26 | 10,000,000.00 | 10,187,356.00 | |
| | CGB 2.69% 08/15/32 | 10,000,000.00 | 10,303,086.00 | |
| | CGB 2.75% 02/17/32 | 7,700,000.00 | 7,968,847.81 | |
| | CGB 2.75% 06/15/29 | 10,900,000.00 | 11,254,142.09 | |
| | CGB 2.76% 05/15/32 | 13,000,000.00 | 13,463,266.70 | |
| | CGB 2.79% 12/15/29 | 12,000,000.00 | 12,408,452.40 | |
| | CGB 2.8% 03/24/29 | 19,000,000.00 | 19,645,374.90 | |
| | CGB 2.8% 03/25/30 | 9,000,000.00 | 9,327,162.60 | |
| | CGB 2.8% 11/15/32 | 9,900,000.00 | 10,287,783.00 | |
| | CGB 2.85% 06/04/27 | 9,400,000.00 | 9,664,396.62 | |
| | CGB 2.88% 02/25/33 | 17,200,000.00 | 18,001,554.40 | |
| | | | | |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CGB 2.89% 11/18/31 | 8,000,000.00 | 8,357,991.20 | |
| | | CGB 2.91% 10/14/28 | 10,000,000.00 | 10,375,267.00 | |
| | | CGB 3.01% 05/13/28 | 9,800,000.00 | 10,193,537.62 | |
| | | CGB 3.02% 05/27/31 | 8,500,000.00 | 8,957,827.85 | |
| | | CGB 3.02% 10/22/25 | 7,300,000.00 | 7,434,498.85 | |
| | | CGB 3.03% 03/11/26 | 19,500,000.00 | 19,942,704.60 | |
| | | CGB 3.12% 10/25/52 | 5,600,000.00 | 6,193,818.96 | |
| | | CGB 3.12% 12/05/26 | 15,000,000.00 | 15,486,495.00 | |
| | | CGB 3.13% 11/21/29 | 8,300,000.00 | 8,773,143.99 | |
| | | CGB 3.19% 04/15/53 | 6,200,000.00 | 6,987,506.02 | |
| | | CGB 3.22% 12/06/25 | 21,600,000.00 | 22,099,068.00 | |
| | | CGB 3.25% 06/06/26 | 22,000,000.00 | 22,676,504.40 | |
| | | CGB 3.25% 11/22/28 | 10,300,000.00 | 10,877,374.74 | |
| | | CGB 3.27% 11/19/30 | 22,000,000.00 | 23,577,327.40 | |
| | | CGB 3.28% 12/03/27 | 9,700,000.00 | 10,169,837.93 | |
| | | CGB 3.29% 05/23/29 | 14,200,000.00 | 15,119,279.60 | |
| | | CGB 3.32% 04/15/52 | 4,000,000.00 | 4,575,314.80 | |
| | | CGB 3.53% 10/18/51 | 8,800,000.00 | 10,410,527.60 | |
| | | CGB 3.72% 04/12/51 | 8,500,000.00 | 10,344,590.95 | |
| | | CGB 3.81% 09/14/50 | 14,800,000.00 | 18,221,435.88 | |
| | オフショア人民元 小計 | | 659,700,000.00 | 685,797,582.20<br>(14,813,090,616) | |
| 合計 | | | | 142,378,635,839<br>(142,378,635,839) | |

**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<br>時価比率 | 合計金額に<br>対する比率 |
|---|---|---|---|
| メキシコペソ | 国債証券　15銘柄 | 100.0% | 9.4% |
| ブラジルレアル | 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　7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% | 0.1% |
| 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　15銘柄 | 100.0% | 8.2% |
| ルーマニアレイ | 国債証券　23銘柄 | 100.0% | 4.2% |
| マレーシアリンギット | 国債証券　21銘柄 | 100.0% | 10.4% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| タイバーツ | 国債証券　24銘柄 | 100.0% | 9.5% |
| 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% | 8.4% |
| オフショア人民元 | 国債証券　54銘柄 | 100.0% | 10.4% |

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【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8期中間計算期間(2024年6月11日から2024年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。**

## 【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

### （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

| | 第7期<br>（2024年 6月10日現在） | 第8期中間計算期間<br>（2024年12月10日現在） |
|---|---|---|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 192,009,458 | 229,173,187 |
| 親投資信託受益証券 | 18,920,247,812 | 22,066,538,853 |
| 未収入金 | 54,642,144 | 5,643,515 |
| 未収利息 | 354 | 1,358 |
| 流動資産合計 | 19,166,899,768 | 22,301,356,913 |
| 資産合計 | 19,166,899,768 | 22,301,356,913 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 11,390,944 | 24,695,758 |
| 未払受託者報酬 | 4,385,647 | 5,649,559 |
| 未払委託者報酬 | 43,856,432 | 56,495,522 |
| その他未払費用 | 438,506 | 564,892 |
| 流動負債合計 | 60,071,529 | 87,405,731 |
| 負債合計 | 60,071,529 | 87,405,731 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 9,632,696,449 | 10,843,950,888 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 9,474,131,790 | 11,370,000,294 |
| （分配準備積立金） | 4,773,082,315 | 4,555,267,817 |
| 元本等合計 | 19,106,828,239 | 22,213,951,182 |
| 純資産合計 | 19,106,828,239 | 22,213,951,182 |
| 負債純資産合計 | 19,166,899,768 | 22,301,356,913 |

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第7期中間計算期間<br>自　2023年 6月13日<br>至　2023年12月12日 | 第8期中間計算期間<br>自　2024年 6月11日<br>至　2024年12月10日 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 380 | 199,245 |
| 有価証券売買等損益 | 857,953,086 | 764,111,711 |
| 営業収益合計 | 857,953,466 | 764,310,956 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 36,539 | - |
| 受託者報酬 | 3,416,766 | 5,649,559 |
| 委託者報酬 | 34,167,618 | 56,495,522 |
| その他費用 | 341,620 | 564,892 |
| 営業費用合計 | 37,962,543 | 62,709,973 |
| 営業利益又は営業損失（△） | 819,990,923 | 701,600,983 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 819,990,923 | 701,600,983 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 819,990,923 | 701,600,983 |
| 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（△） | 41,936,579 | 8,445,691 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 4,016,820,004 | 9,474,131,790 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 955,322,795 | 1,679,703,058 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 955,322,795 | 1,679,703,058 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 339,483,726 | 476,989,846 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 339,483,726 | 476,989,846 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 5,410,713,417 | 11,370,000,294 |

（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<br>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7期<br>(2024年 6月10日現在) | 第8期中間計算期間<br>(2024年12月10日現在) |
|---|---|---|
| １．計算期間の末日における受益権の総数 | 9,632,696,449口 | 10,843,950,888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 1.9835円<br>(1万口当たり純資産額) (19,835円) | 1口当たり純資産額 2.0485円<br>(1万口当たり純資産額) (20,485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8期中間計算期間<br>(2024年12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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7期<br>自 2023年 6月13日<br>至 2024年 6月10日 | 第8期中間計算期間<br>自 2024年 6月11日<br>至 2024年12月10日 |
|---|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 7,050,089,441円 | 9,632,696,449円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,762,050,547円 | 1,696,922,063円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,179,443,539円 | 485,667,624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12月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 5,581,973,944 |
| 株式 | 708,405,486,314 |
| 派生商品評価勘定 | 222,500 |
| 未収入金 | 119,135,800 |
| 未収配当金 | 431,118,199 |
| 未収利息 | 33,095 |
| 前払金 | 4,050,000 |
| 差入委託証拠金 | 208,370,975 |
| 流動資産合計 | 714,750,390,827 |
| 資産合計 | 714,750,390,827 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 4,418,250 |
| 未払金 | 208,400 |
| 未払解約金 | 182,713,628 |
| 流動負債合計 | 187,340,278 |
| 負債合計 | 187,340,278 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 248,241,431,510 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 466,321,619,039 |
| 元本等合計 | 714,563,050,549 |
| 純資産合計 | 714,563,050,549 |
| 負債純資産合計 | 714,750,390,827 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>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<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>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12月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 248,241,431,510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 2.8785円<br>(1万口当たり純資産額) (28,785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12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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12月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2024年 6月11日 |
| 期首元本額 | 233,002,663,406円 |
| 期中追加設定元本額 | 26,308,271,730円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,069,503,626円 |
| 期末元本額 | 248,241,431,510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） | 260,016,989円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 3,238,448,259円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 12,098,332円 |
| ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン | 10,365,941,850円 |
| 世界経済インデックスファンド | 6,866,777,134円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 2,706,982,304円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 4,754,761,360円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 16,173,431,264円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 18,588,857,796円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープン | 5,948,016,860円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 3,476,721,395円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 11,138,962,472円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 11,039,416,573円 |
| ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ | 9,631,770,389円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 36,332,453円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 545,730,698円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 453,526,443円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 3,707,151,542円 |
| 日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 334,489,562円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 2,593,706円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 7,965,145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） | 94,646,954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） | 12,859,556円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 40,343,390円 |

| 区分 | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| バランスA（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 306,157,555円 |
| バランスB（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 275,512,675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） | 25,602,590円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 8,320,394円 |
| バランスD（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 277,194,979円 |
| バランスE（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 147,662,877円 |
| バランスF（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 208,160,614円 |
| 国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 15,711,647円 |
| ＦＯＦｓ用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 357,663,485円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 2,278,170,245円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ２ | 1,859,938,723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 | 6,163,278,838円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 713,238,772円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 426,263,661円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 541,535,214円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 188,909,027円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 9,737,282円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 45,961,683円 |
| 国内株式ＳＭＴBセレクション（ＳＭＡ専用） | 17,286,529,161円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 184,654,439円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 60,504,071円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 278,973,328円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 44,486,203円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 13,317,906円 |
| グローバル経済コア | 306,732,776円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 36,489,249円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード） | 3,189,007,919円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 29,686,714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 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 68,493,216円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 71,682,833円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 33,808,694円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 43,686,887円 |
| １０資産分散投資ファンド | 113,826,374円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 51,445,562円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 5,636,537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 | 2,848,457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 | 2,086,918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 | 1,529,311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 | 1,048,345円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５ | 618,183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 | 76,231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 | 84,008円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 767,947,270円 |
| ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 43,906,272,676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） | 225,268,420円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 306,874,748円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 21,995,410円 |
| ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用） | 51,558,801,690円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 16,296,754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） | 232,454,900円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年12月10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 | 7,267,700,000 | － | 7,263,650,000 | △4,050,000 |
| 合計 | | 7,267,700,000 | － | 7,263,650,000 | △4,050,000 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 国内債券インデックス　マザーファンド

### 貸借対照表

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 319,074,385 |
| 国債証券 | 600,174,713,990 |
| 地方債証券 | 36,312,803,985 |
| 特殊債券 | 37,221,870,181 |
| 社債券 | 33,225,347,000 |
| 未収入金 | 1,473,984,300 |
| 未収利息 | 1,667,653,389 |
| 前払費用 | 176,407,915 |
| 流動資産合計 | 710,571,855,145 |
| 資産合計 | 710,571,855,145 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 1,300,000,000 |
| 未払解約金 | 186,555,773 |
| 流動負債合計 | 1,486,555,773 |
| 負債合計 | 1,486,555,773 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 543,590,616,677 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 165,494,682,695 |
| 元本等合計 | 709,085,299,372 |
| 純資産合計 | 709,085,299,372 |
| 負債純資産合計 | 710,571,855,145 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年12月10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<br>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。<br>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。<br><br>先物取引 |

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| ２.デリバティブの評価基準及び評価方法 | 債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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<br>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12月10日現在 |
|---|---|---|
| １． | 計算期間の末日における受益権の総数 | 543,590,616,677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　98,317,000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　1.3044円<br>(1万口当たり純資産額)　(13,044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12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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12月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2024年 6月11日 |
| 期首元本額 | 509,548,095,906円 |
| 期中追加設定元本額 | 72,430,262,204円 |
| 期中一部解約元本額 | 38,387,741,433円 |
| 期末元本額 | 543,590,616,677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 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 5,114,664,986円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 19,744,890円 |
| ＳＭＴ　国内債券インデックス・オープン | 17,080,366,979円 |
| 世界経済インデックスファンド | 9,532,945,485円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 29,840,649,727円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 38,168,122,034円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 12,948,954,149円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープン | 399,587,580円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＳ | 86,386,080,237円 |
| ＤＣ日本債券インデックス・オープンＰ | 62,695,511,335円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 21,932,753,691円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 26,847,227,336円 |

| 区分 | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 7,816,233,328円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 231,121,636円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 3,197,397,498円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 1,338,489,531円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 6,899,787,851円 |
| 国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,746,817円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 19,817,710円 |
| マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 9,434,268円 |
| 国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 1,260,056円 |
| バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 48,777,128円 |
| バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 79,894,559円 |
| バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 26,730,658円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 24,465,862円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,511,776,804円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 734,358,246円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 3,212,714,008円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 66,535,191円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 39,632,649円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 878,805,337円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 937,573,258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 | 6,123,857,225円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ１ | 15,857,981,877円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＡ | 19,375,412,408円 |
| 分散投資コア戦略ファンドＳ | 27,608,968,086円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 366,935,550円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 2,288,248,028円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 91,590,667円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 50,749,478円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 65,341,221円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 79,933,144円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 177,929,999円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 261,538,482円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 24,170,192円 |
| グローバル経済コア | 457,634,024円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 60,365,940円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 43,271,966円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 224,964,244円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 135,061,299円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 42,359,910円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 34,599,813円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　国内債券インデックス（ノーロード） | 1,468,835,914円 |
| １０資産分散投資ファンド | 490,400,511円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 738,335,900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 | 14,989,327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 | 9,091,403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 | 5,666,922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 | 3,901,845円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０５５ | 2,671,551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 | 707,064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 | 1,081,790円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 15,172,798,863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） | 112,102,986,291円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 56,058,392円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 22,586,006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） | 674,384,728円 |

**（デリバティブ取引に関する注記）**

該当事項はありません。

**外国株式インデックス　マザーファンド**

**貸借対照表**

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 9,257,507,956 |
| コール・ローン | 520,846,181 |
| 株式 | 814,708,496,999 |
| 投資信託受益証券 | 118,659,047 |
| 投資証券 | 15,147,122,137 |
| 派生商品評価勘定 | 524,720,091 |
| 未収入金 | 2 |
| 未収配当金 | 966,169,623 |
| 未収利息 | 3,088 |
| 差入委託証拠金 | 8,672,925,720 |
| 流動資産合計 | 849,916,450,844 |
| 資産合計 | 849,916,450,844 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 19,096,926 |
| 前受金 | 507,914,565 |
| 未払解約金 | 636,265,853 |
| 流動負債合計 | 1,163,277,344 |
| 負債合計 | 1,163,277,344 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 117,843,127,058 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 730,910,046,442 |
| 元本等合計 | 848,753,173,500 |
| 純資産合計 | 848,753,173,500 |
| 負債純資産合計 | 849,916,450,844 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)新株予約権証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。<br><br>(3)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(4)投資証券 |

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| | 移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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12月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 117,843,127,058口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 7.2024円<br>(1万口当たり純資産額) (72,024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12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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。 |

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| | |

（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12月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2024年 6月11日 |
| 期首元本額 | 115,658,546,387円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,526,523,500円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,341,942,829円 |
| 期末元本額 | 117,843,127,058円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型） | 1,323,704,047円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 5,064,682円 |
| ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン | 34,189,340,704円 |
| 世界経済インデックスファンド | 15,162,022,813円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 854,749,731円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 511,524,389円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 2,878,841,180円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 3,837,933,971円 |
| ＤＣ外国株式インデックス・オープン | 13,576,352,220円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 367,430,304円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 2,003,659,465円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 2,283,863,465円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 7,823,374円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 116,756,255円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 97,015,418円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 8,683,668,872円 |
| 外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 758,544,821円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,449,883円 |
| マイセレクション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） | 12,043,706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） | 5,092,647円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 15,981,722円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 84,692,139円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 97,038,903円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 766,337,047円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 51,211,067円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 9,979,705円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 83,386,982円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 26,264,284円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 625,276,823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） | 630,513,822円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ１ | 1,144,563,006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） | 1,568,119,869円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 945,586,538円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 128,029,331円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 413,372,489円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 20,598,373円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 96,274,986円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 68,537,867円 |
| 外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用） | 6,205,772,915円 |

| 区分 | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 260,081,655円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,306,591,831円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 214,199,240円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 5,500,527円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード） | 3,208,543,641円 |
| グローバル経済コア | 709,130,057円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 15,396,608円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 6,347,090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 | 176,231,858円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 184,553,461円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 86,352,653円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 112,722,990円 |
| １０資産分散投資ファンド | 58,426,014円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 20,794,589円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 12,635,986円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０３５ | 1,721,274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 | 1,260,570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 | 931,534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 | 634,681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 | 375,357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 | 47,092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 | 51,990円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 76,074,601円 |
| ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー） | 67,602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） | 50,587,056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） | 338,298,835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） | 735,131,382円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,473,968,730円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 103,767,198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） | 75,292,695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） | 93,952,994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） | 91,081,058円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年12月10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 | 17,964,237,878 | － | 18,472,152,443 | 507,914,565 |
| 合計 | | 17,964,237,878 | － | 18,472,152,443 | 507,914,565 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

**通貨関連**

**（2024年12月10日現在）**

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 328,005,400 | － | 330,296,800 | △2,291,400 |
| | アメリカドル | 328,005,400 | － | 330,296,800 | △2,291,400 |
| 合計 | | 328,005,400 | － | 330,296,800 | △2,291,400 |

**(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。**

**①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。**

**②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。**

**※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。**

**外国債券インデックス　マザーファンド**

**貸借対照表**

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 569,708,678 |
| コール・ローン | 3,019,547,100 |
| 国債証券 | 370,846,418,709 |
| 派生商品評価勘定 | 14,814,839 |
| 未収利息 | 2,512,852,102 |
| 前払金 | 3,429,496 |
| 前払費用 | 338,079,091 |
| 差入委託証拠金 | 247,274,368 |
| 流動資産合計 | 377,552,124,383 |
| 資産合計 | 377,552,124,383 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 7,401,064 |
| 未払金 | 111,085,855 |
| 未払解約金 | 128,184,652 |
| 流動負債合計 | 246,671,571 |
| 負債合計 | 246,671,571 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 103,742,323,629 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 273,563,129,183 |
| 元本等合計 | 377,305,452,812 |
| 純資産合計 | 377,305,452,812 |
| 負債純資産合計 | 377,552,124,383 |

**注記表**

**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 1 .有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 |

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| | 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。<br>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 | (1)先物取引<br>債券先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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。 |
| 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。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(2)為替予約取引による為替差損益<br>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12月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 103,742,323,629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 3.6369円<br>(1万口当たり純資産額) (36,369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12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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12月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2024年 6月11日 |
| 期首元本額 | 95,908,861,237円 |
| 期中追加設定元本額 | 11,534,545,876円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,701,083,484円 |
| 期末元本額 | 103,742,323,629円 |
| | |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,056,187,152円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 447,616,079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） | 2,360,331,994円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（分配型） | 8,920,030円 |
| ＳＭＴ　グローバル債券インデックス・オープン | 8,314,355,587円 |
| 世界経済インデックスファンド | 26,247,729,123円 |
| ＤＣマイセレクション２５ | 1,801,900,236円 |
| ＤＣマイセレクション５０ | 1,707,950,279円 |
| ＤＣマイセレクション７５ | 1,371,127,004円 |
| ＤＣ外国債券インデックス・オープン | 2,219,486,137円 |
| ＤＣマイセレクションＳ２５ | 1,313,040,908円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０ | 1,182,403,211円 |
| ＤＣマイセレクションＳ７５ | 821,921,655円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５ | 7,127,523円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５ | 101,381,083円 |
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５ | 57,073,011円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 16,292,260,770円 |
| 外国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 793,690,144円 |
| マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 904,113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） | 6,778,810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） | 48,120,440円 |
| バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用） | 50,331,113円 |
| バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 531,634,722円 |
| バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 337,186,971円 |
| バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 1,422,854,853円 |
| 世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用） | 49,913,742円 |
| 世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用） | 22,706,466円 |
| バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 309,120,105円 |
| バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 110,253,040円 |
| バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用） | 156,687,193円 |
| ＦＯＦｓ用外国債券オープン（適格機関投資家専用） | 599,322,699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） | 1,099,063,529円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ１ | 601,330,401円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ１ | 757,219,915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 | 1,690,937,945円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 858,706,346円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,639,664,667円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 224,851,982円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 105,860,799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） | 1,313,026,074円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 161,351,328円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 513,751,286円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 732,686,424円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 1,079,183,253円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 9,846,533円 |
| グローバル経済コア | 1,294,109,112円 |
| ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型） | 26,104,924円 |

| 区分 | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５ | 2,818,917円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 69,039,691円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 112,369,720円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 59,978,096円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 85,904,253円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル債券インデックス（ノーロード） | 1,018,122,757円 |
| １０資産分散投資ファンド | 35,959,703円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 36,001,726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 | 1,975,567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 | 1,327,248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 | 907,886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 | 623,058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 | 390,550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 | 72,413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 | 99,312円 |
| ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型） | 898,105,591円 |
| ＦＯＦｓ用　外国債券インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用） | 14,498,465,416円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 234,830,406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） | 141,650,943円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年12月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 2,066,495,847 | － | 2,063,066,351 | △3,429,496 |
| 合計 | | 2,066,495,847 | － | 2,063,066,351 | △3,429,496 |

(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12月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 2,432,850,832 | － | 2,443,694,103 | 10,843,271 |
| | アメリカドル | 1,182,710,024 | － | 1,187,603,200 | 4,893,176 |
| | カナダドル | 92,526,047 | － | 91,917,660 | △608,387 |
| | ユーロ | 716,707,119 | － | 720,993,405 | 4,286,286 |
| | イギリスポンド | 139,570,509 | － | 140,985,338 | 1,414,829 |
| | オフショア人民元 | 301,337,133 | － | 302,194,500 | 857,367 |
| 合計 | | 2,432,850,832 | － | 2,443,694,103 | 10,843,271 |

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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12月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,320,491,036 |
| コール・ローン | 79,172,105 |
| 株式 | 220,802,841,627 |
| 投資信託受益証券 | 433,512,621 |
| 投資証券 | 200,725,562 |
| 派生商品評価勘定 | 53,971,729 |
| 未収入金 | 2,831,210 |
| 未収配当金 | 165,832,817 |
| 未収利息 | 469 |
| 前払金 | 91,979,476 |
| 差入委託証拠金 | 1,822,466,810 |
| 流動資産合計 | 227,973,825,462 |
| 資産合計 | 227,973,825,462 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 145,951,205 |
| 未払解約金 | 51,277,580 |
| 流動負債合計 | 197,228,785 |
| 負債合計 | 197,228,785 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 48,469,508,043 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 179,307,088,634 |
| 元本等合計 | 227,776,596,677 |
| 純資産合計 | 227,776,596,677 |
| 負債純資産合計 | 227,973,825,462 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 1 .有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)株式<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)投資信託受益証券<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(3)投資証券 |

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| | 移動平均法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | (1)先物取引<br>株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>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。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。<br><br>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.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。<br>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<br>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。<br>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。<br><br>(2)派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br><br>(3)為替予約取引による為替差損益<br>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12月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 48,469,508,043口 |
| 2. | 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 4.6994円<br>(1万口当たり純資産額) (46,994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12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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。 |

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| | |

（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12月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2024年 6月11日 |
| 期首元本額 | 45,436,887,816円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,508,326,885円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,475,706,658円 |
| 期末元本額 | 48,469,508,043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 | 6,911,473,817円 |
| 世界経済インデックスファンド | 13,791,412,248円 |
| ＤＣ新興国株式インデックス・オープン | 6,414,012,387円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 7,903,817,980円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 85,228,640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 | 1,285,647,921円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,425,846,748円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 824,865,439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） | 369,748,267円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 18,734,051円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 86,835,863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） | 3,049,344,902円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 296,831,765円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,480,426,895円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 236,501,961円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 8,140,336円 |
| グローバル経済コア | 655,515,854円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード） | 619,429,904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 | 128,323,764円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 134,319,589円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 62,924,550円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 82,107,844円 |
| １０資産分散投資ファンド | 18,033,997円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 29,892,945円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 12,234,425円 |
| ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー） | 12,025円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,638,031,360円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 117,728,847円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 82,065,950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） | 15,169,282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） | 22,175,890円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年12月10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<br>買建 | 6,413,409,202 | － | 6,321,429,726 | △91,979,476 |
| 合計 | | 6,413,409,202 | － | 6,321,429,726 | △91,979,476 |

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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12月10日現在 |
|---|---|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,786,731,515 |
| コール・ローン | 544,755,451 |
| 国債証券 | 151,521,552,716 |
| 派生商品評価勘定 | 8,418,447 |
| 未収入金 | 3,209,304 |
| 未収利息 | 2,140,480,924 |
| 前払費用 | 283,162,676 |
| 流動資産合計 | 156,288,311,033 |
| 資産合計 | 156,288,311,033 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 340,765,593 |
| 未払解約金 | 65,770,132 |
| 流動負債合計 | 406,535,725 |
| 負債合計 | 406,535,725 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 67,465,396,853 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（△） | 88,416,378,455 |
| 元本等合計 | 155,881,775,308 |
| 純資産合計 | 155,881,775,308 |
| 負債純資産合計 | 156,288,311,033 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券<br>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。<br>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<br>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。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。 |

| | 2024年12月10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。<br>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<br>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12月10日現在 |
|---|---|---|
| 1. | 計算期間の末日における受益権の総数 | 67,465,396,853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 2.3105円<br>(1万口当たり純資産額) (23,105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12月10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<br>売買目的有価証券<br>「(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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。<br><br>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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。<br>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12月10日現在 |
|---|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2024年 6月11日 |
| 期首元本額 | 63,369,306,902円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,344,929,462円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,248,839,511円 |
| 期末元本額 | 67,465,396,853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 | 3,576,803,873円 |
| 世界経済インデックスファンド | 26,794,545,661円 |
| ＤＣ新興国債券インデックス・オープン | 6,053,468,342円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド | 16,242,673,018円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（ＳＭＡ専用） | 3,603,644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 | 1,334,062,306円 |
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 880,119,925円 |

| 区分 | 2024年12月10日現在 |
|---|---|
| ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,785,299,647円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 233,688,310円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 109,605,125円 |
| ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン | 167,663,630円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン | 610,373,773円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 865,180,624円 |
| ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 1,273,942,245円 |
| ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン | 15,661,581円 |
| グローバル経済コア | 1,282,429,236円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０ | 138,513,850円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０ | 127,428,898円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０ | 56,623,680円 |
| ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０ | 70,612,987円 |
| Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国債券インデックス（ノーロード） | 378,513,864円 |
| １０資産分散投資ファンド | 57,976,459円 |
| グローバル１０資産バランスファンド | 56,153,234円 |
| ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 274,602,861円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 168,278,979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） | 140,614,168円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年12月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 369,198,602 | － | 377,617,049 | 8,418,447 |
| | メキシコペソ | 58,349,108 | － | 59,547,964 | 1,198,856 |
| | チェココルナ | 31,415,136 | － | 32,101,272 | 686,136 |
| | ハンガリーフォリント | 14,211,510 | － | 14,486,899 | 275,389 |
| | ポーランドズロチ | 43,304,408 | － | 44,276,196 | 971,788 |
| | マレーシアリンギット | 59,040,168 | － | 60,204,848 | 1,164,680 |
| | タイバーツ | 53,547,209 | － | 55,304,480 | 1,757,271 |
| | 南アフリカランド | 50,302,065 | － | 51,881,720 | 1,579,655 |
| | オフショア人民元 | 59,028,998 | － | 59,813,670 | 784,672 |
| 合計 | | 369,198,602 | － | 377,617,049 | 8,418,447 |

(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。

①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。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## ２【ファンドの現況】

### 【ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

#### 【純資産額計算書】

（2024年12月30日現在）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 22,870,057,881円 |
| Ⅱ　負債総額 | 16,447,167円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 22,853,610,714円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 10,943,239,985口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.0884円 |
| （1万口当たり純資産額） | （20,884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）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 730,841,539,611円 |
| Ⅱ　負債総額 | 421,230,891円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 730,420,308,720円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 249,458,929,129口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.9280円 |
| （1万口当たり純資産額） | （29,280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）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 720,633,985,132円 |
| Ⅱ　負債総額 | 8,459,733,126円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 712,174,252,006円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 546,661,074,835口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 1.3028円 |
| （1万口当たり純資産額） | （13,028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）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 865,641,218,356円 |
| Ⅱ　負債総額 | 385,662,133円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 865,255,556,223円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 117,490,737,801口 |

| | |
|---|---|
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 7.3645円 |
| （1万口当たり純資産額） | （73,645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）

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

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 231,804,868,338円 |
| Ⅱ　負債総額 | 162,939,885円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 231,641,928,453円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 48,536,649,921口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 4.7725円 |
| （1万口当たり純資産額） | （47,725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）

| | |
|---|---|
| Ⅰ　資産総額 | 160,187,291,964円 |
| Ⅱ　負債総額 | 19,230,460円 |
| Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ） | 160,168,061,504円 |
| Ⅳ　発行済口数 | 67,638,784,519口 |
| Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） | 2.3680円 |
| （1万口当たり純資産額） | （23,680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。

**①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。**

**②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。**

**③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。**

**④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。**

**⑤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ます。）に支払います。**

**⑥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

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の３分の２以上をもって行います。
取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。
監査等委員である取締役の任期は、選任後２年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。
取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長１名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。
取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。
取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

②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

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 3月10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 |
| 単位型株式投資信託 | 57 | 202,229 |
| 単位型公社債投資信託 | 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<br>（2023年3月31日） | | 当事業年度<br>（2024年3月31日） |
|---|---|---|---|---|
| 資産の部 | | | | |
| 流動資産 | | | | |
| 現金及び預金 | | 23,067 | | 14,909 |
| 金銭の信託 | | 14,693 | | 18,596 |
| 前払費用 | | 198 | | 429 |
| 未収委託者報酬 | | 9,147 | | 10,943 |
| 未収運用受託報酬 | | 5,815 | | 5,967 |
| 未収収益 | | 176 | | 185 |
| 短期差入証拠金 | | 3,541 | | 3,660 |
| その他 | | 1,566 | | 4,074 |
| 流動資産合計 | | 58,207 | | 58,767 |
| 固定資産 | | | | |
| 有形固定資産 | | | | |
| 建物 | ※1 | 255 | ※1 | 219 |
| 器具備品 | ※1 | 560 | ※1 | 436 |
| 有形固定資産合計 | | 816 | | 655 |
| 無形固定資産 | | | | |
| ソフトウェア | | 7,203 | | 7,463 |
| その他 | | 40 | | 61 |
| 無形固定資産合計 | | 7,244 | | 7,524 |
| 投資その他の資産 | | | | |
| 投資有価証券 | | 4,063 | | 5,753 |
| 関係会社株式 | | 5,636 | | 6,077 |
| 繰延税金資産 | | 1,181 | | 1,196 |
| その他 | | 31 | | 31 |
| 投資その他の資産合計 | | 10,911 | | 13,058 |
| 固定資産合計 | | 18,972 | | 21,238 |
| 資産合計 | | 77,179 | | 80,005 |

（単位：百万円）

| | 前事業年度<br>（2023年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>至　2023年3月31日） | （自　2023年4月1日<br>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<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 利益剰余金 | | | | |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金合計 | 株主資本合計 |
| | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 500 | 2,100 | 44,755 | 47,355 | 66,595 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | △3,367 | △3,367 | △3,367 |
| 当期純利益 | | | 4,585 | 4,585 | 4,585 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | ― | ― | 1,218 | 1,218 | 1,218 |
| 当期末残高 | 500 | 2,100 | 45,974 | 48,574 | 67,813 |

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|
| | その他有価証券評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 49 | △510 | △460 | 66,134 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | △3,367 |
| 当期純利益 | | | | 4,585 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 310 | △560 | △250 | △250 |
| 当期変動額合計 | 310 | △560 | △250 | 968 |
| 当期末残高 | 360 | △1,071 | △710 | 67,103 |

## 注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

２．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

３．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

４．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

５．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

６．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理
数理計算上の差異　：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

７．収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

（1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（2）投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（3）投資助言業務

当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

（4）成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

８．ヘッジ会計の会計処理

（1）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

（2）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

（3）ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

（4）ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

９．グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

| | 前事業年度<br>(2023年3月31日) | | 当事業年度<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>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）

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。

①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。

②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。

③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) | | | | |
| その他有価証券 | － | 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) | | | | |
| その他有価証券 | － | 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<br>（2023年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（2023年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>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<br>(2023年3月31日) | 当事業年度<br>(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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>売建 | 12,195 | － | △9 | △9 |
| | 債券先物取引<br>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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>売建 | 10,306 | － | △268 | △268 |
| 店頭 | トータルリターンスワップ取引<br>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<br>会計の方法 | デリバティブ取引<br>の種類等 | 主なヘッジ対象 | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的<br>処理方法 | 為替予約取引<br>売建 | | | | |
| | 米ドル | 投資有価証券<br>関係会社株式 | 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<br>会計の方法 | デリバティブ取引<br>の種類等 | 主なヘッジ対象 | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的<br>処理方法 | 為替予約取引<br>売建 | | | | |
| | 米ドル | 投資有価証券<br>関係会社株式 | 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<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>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<br>（2023年3月31日） | 当事業年度<br>（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<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>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<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>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<br>（2023年3月31日） | 当事業年度<br>（2024年3月31日） |
|---|---|---|
| 繰延税金資産 | | |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 未払事業税 | 58 | 百万円 | 63 | 百万円 |
| 賞与引当金損金算入限度超過額 | 187 | 〃 | 220 | 〃 |
| 退職給付引当金損金算入限度超過額 | 277 | 〃 | 298 | 〃 |
| 税務上の費用認識差額 | 412 | 〃 | 256 | 〃 |
| 繰延ヘッジ損益 | 225 | 〃 | 472 | 〃 |
| その他 | 75 | 〃 | 78 | 〃 |
| 繰延税金資産 合計 | 1,236 | 〃 | 1,390 | 〃 |
| 繰延税金負債 | | | | |
| 有価証券評価差額 | △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㈱ | 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<br>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
① 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。
② 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㈱ | 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<br>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
① 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。
② 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<br>（自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自 2023年4月1日<br>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<br>（自　2022年4月1日<br>至　2023年3月31日） | 当事業年度<br>（自　2023年4月1日<br>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<br>（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 | | 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<br>（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<br>（自　2024年4月1日<br>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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 500 | 2,100 | 45,974 | 48,574 | 67,813 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | △2,943 | △2,943 | △2,943 |
| 中間純利益 | | | 2,785 | 2,785 | 2,785 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | － | － | △157 | △157 | △157 |
| 当中間期末残高 | 500 | 2,100 | 45,816 | 48,416 | 67,655 |

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|---|---|---|---|---|
| | その他有価証券評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 360 | △1,071 | △710 | 67,103 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | △2,943 |
| 中間純利益 | | | | 2,785 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 92 | 112 | 205 | 205 |
| 当中間期変動額合計 | 92 | 112 | 205 | 47 |
| 当中間期末残高 | 453 | △958 | △504 | 67,150 |

**注記事項**
**（重要な会計方針）**

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

**1．資産の評価基準及び評価方法**
**(1) 有価証券**
**子会社株式**
**移動平均法による原価法によっております。**
**その他有価証券**
**市場価格のない株式等以外のもの**
**時価法によっております。**
**（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）**
**市場価格のない株式等**
**移動平均法による原価法によっております。**
**なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。**

**(2) デリバティブ**

時価法によっております。

(3) 金銭の信託
時価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法
(1) 有形固定資産
定額法によっております。
(2) 無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3．引当金の計上基準
(1) 賞与引当金
従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。
(2) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。
過去勤務費用　　：発生事業年度に損益処理
数理計算上の差異　：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理
なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

4．収益及び費用の計上基準
当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
(1) 投資信託委託業務
当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
(2) 投資一任業務
当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
(3) 投資助言業務
当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
(4) 成功報酬
当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6．ヘッジ会計の方法
(1) ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
(3) ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
(4) ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

7．グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

| 第39期中間会計期間末<br>（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<br>（自　2024年4月1日<br>至　2024年9月30日） |
|---|
| ※1　減価償却実施額<br>有形固定資産　　83百万円<br>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 | 263百万円 |
| 投資有価証券償還損 | 239百万円 |
| 為替差損 | 146百万円 |
| デリバティブ費用 | 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<br>定時株主総会 | 普通株式 | 2,943 | 981,032 | 2024年3月31日 | 2024年6月21日 |

（２）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

（リース取引関係）
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）
第39期中間会計期間末（2024年9月30日）
金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2及び（注２）、（注３）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。
レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

| 区　分 | 中間貸借対照表計上額（百万円）（*1） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託 | 2,561 | 15,657 | － | 18,219 |
| 投資有価証券(*2) | | | | |
| その他有価証券 | － | 3,269 | － | 3,269 |
| 資産計 | 2,561 | 18,927 | － | 21,488 |
| デリバティブ取引(*3) | | | | |
| 株式関連取引 | (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おりません。

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すこととした額 | 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）

| | 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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 店頭 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル<br>英ポンド<br>カナダドル<br>スイスフラン<br>香港ドル<br>ユーロ<br>買建<br>米ドル<br>ユーロ | <br><br>5,053<br>173<br>130<br>74<br>120<br>461<br><br>42<br>11 | <br><br>－<br>－<br>－<br>－<br>－<br>－<br><br><br> | <br><br>△83<br>△5<br>△2<br>△1<br>△1<br>△9<br><br>△0<br>△0 | <br><br>△83<br>△5<br>△2<br>△1<br>△1<br>△9<br><br>△0<br>△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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>売建 | 10,399 | － | △281 | △281 |
| 店頭 | トータルリターンスワップ取引<br>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<br>会計の方法 | デリバティブ取引<br>の種類等 | 主なヘッジ対象 | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち1年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) |
|---|---|---|---|---|---|
| 原則的<br>処理方法 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル<br>英ポンド<br>スイスフラン<br>香港ドル<br>ユーロ<br>シンガポールドル | <br><br>投資有価証券<br>関係会社株式 | <br>1,833<br>4,463<br>49<br>95<br>31<br>433 | <br>－<br>－<br>－<br>－<br>－<br>－ | <br>△30<br>△137<br>△0<br>△1<br>△0<br>△11 |
| 合計 | | | 6,906 | － | △182 |

（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<br>（自　2024年4月1日<br>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おりません。 | |

（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<br>（自 2024年4月1日<br>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 3月10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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2024年3月末日現在）

③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）<br>（2024年3月末日現在） | 事業の内容 |
|---|---|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。 |
| 株式会社ＳＢＩ証券 | 54,323 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社東京スター銀行 | 26,000 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社静岡銀行 | 90,845 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社北國銀行 | 26,673 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 楽天証券株式会社 | 19,495 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 松井証券株式会社 | 11,945 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

| | | |
|---|---|---|
| マネックス証券株式会社 | 13,195 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 三菱ＵＦＪ　ｅスマート証券株式会社 | 7,196 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 野村證券株式会社 | 10,000 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| ＳＭＢＣ日興証券株式会社 | 135,000 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社三菱ＵＦＪ銀行 | 1,711,958 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| ＰａｙＰａｙ銀行株式会社 | 72,216 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| ｍｏｏｍｏｏ証券株式会社 | 3,500 | 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

**２【関係業務の概要】**

**(1)受託会社**

**当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。**

**(2)販売会社**

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

**３【資本関係】**

**(1)受託会社**

**該当事項はありません。**

**(2)販売会社**

**該当事項はありません。**

**(参考)再信託受託会社**

**①名称　　：株式会社日本カストディ銀行**
**②設立年月日　：2000年6月20日**
**③資本金の額　：51,000百万円（2024年3月末日現在）**
**④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。**
**⑤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。**

**①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。**

**②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。**

**③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。**

**④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。**

**⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。**

**(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。**

**(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。**

**(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやＳＮＳのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。**

**(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。**

**(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。**

**(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。**

**(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。**

# 独立監査人の監査報告書

2024年６月３日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　三　上　和　彦

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　田　中　洋　一

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

**・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**

**・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**

**・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

**・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

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

**利害関係**

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

**以　上**

---

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

**２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の監査報告書

2024年8月22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SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2023年6月13日から2024年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2024年6月10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。**

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

**利害関係**

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

**以　上**

---

**（注）１．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。**
**２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。**

# 独立監査人の中間監査報告書

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<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 三　上　和　彦 |
| 指定有限責任社員<br>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．ＸＢＲＬ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18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SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2024年6月11日から2024年12月10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、SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2024年12月10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6月11日から2024年12月10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、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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。**