

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年10月10日提出
【計算期間】	第13期(自 2024年7月11日至 2025年7月10日)
【ファンド名】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【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 小林 隆宏
【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
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

各ファンドにつき上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

のとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2) 債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3) 不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7) その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

ないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

<ファンドの特色>

1. 長期分散投資により、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指します。

- 投資対象ファンドを通じて、国内外の株式・債券といった様々な資産に分散投資し、これらをうまく組み合わせることでも中長期的に安定した収益の獲得を目指します。
- 今後も先進国の安定成長と新興国の高い経済成長が見込まれることから、投資対象の多様化により、世界経済の成長果実をじっくりと享受することを目指します。

2. 短期的な下振れリスクの抑制を目指します。

- 保有資産の価値を守り、収益を安定させるために、市場の下落局面でも損失の抑制や収益の獲得を目指します。
 - 市場の下振れリスクに伴う保有資産の価値の減少を抑制するために、投資対象ファンドを通じてヘッジファンド^{※1}等に投資し、オルタナティブ運用^{※2}を行います。
- ※1 実質的に金利、為替、株式、債券、商品等に対して裁定取引やデリバティブ取引等の様々な手法を活用してリスクを回避しながら利益を追求するファンドを指します。
- ※2 株式や債券等の伝統的資産とは異なる資産への投資を言います。具体的な投資対象は、リート、パンクローン、コモディティ、ヘッジファンド等があり、一般に株式や債券等との価格運動性(相関性)が低く、分散投資効果があるとされています。なお、オルタナティブ運用では、世界経済の成長に沿った収益の獲得を目指した運用を行うこともあります。

3. 市場環境の変化に対応して、適切なポートフォリオへの見直しを行います。

- 各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の値動きの関係(相関関係)、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。また、各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合の定期的な見直しを行うほか、市場環境等の変化に応じた調整を行います。
- 投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びパンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものではありません。従って、運用者の判断で投資対象とする資産やファンドを追加・除外したり、それらへの投資割合を変更する運用を行います。

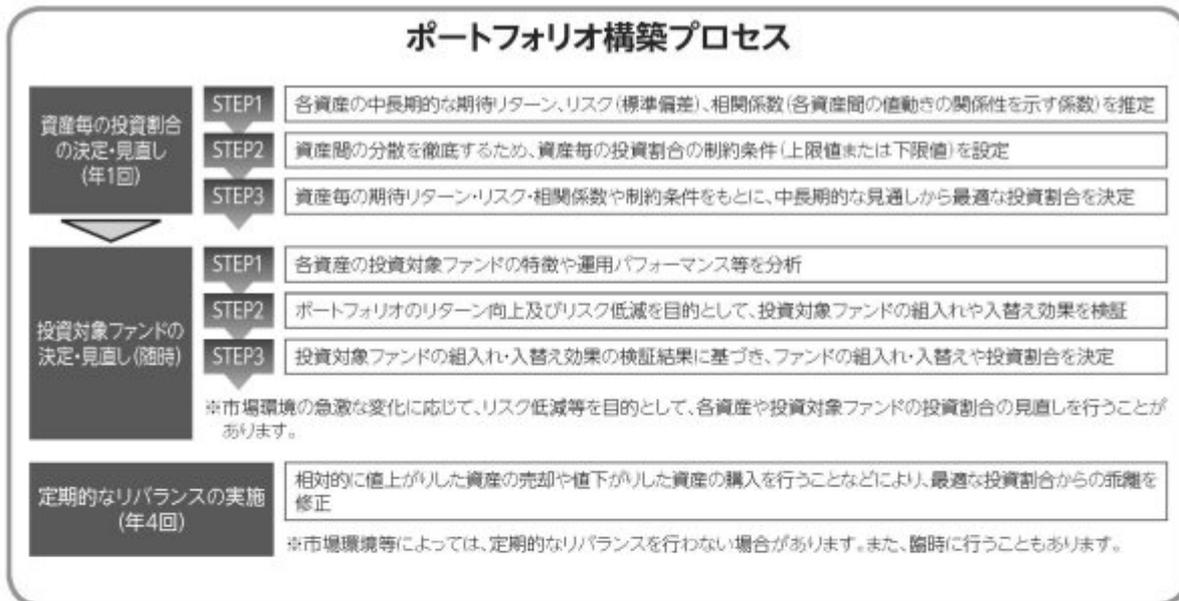
4. 運用目的・リスク許容度に応じて2つのファンドから選択できます。

	「株式」「リート」「コモディティ」への 投資割合の合計 ^{※3}	運用の特徴
分散投資コア戦略ファンドA 愛称:コアラップA	原則50%未満	安定性を重視
分散投資コア戦略ファンドS 愛称:コアラップS	原則75%未満	安定性と収益性の バランスを重視

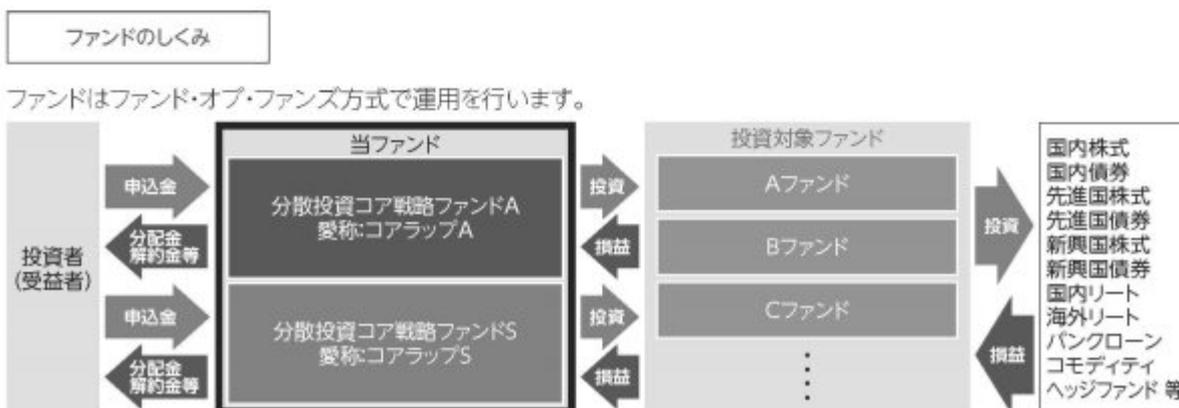
3 純資産総額に対する投資対象ファンドへの投資割合の合計です。なお、当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。

ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3 投資リスク (1)ファンドのリスク ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。



? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
 - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
 - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
 - 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

〈ご参考情報〉

バンクローン

銀行などの金融機関が、事業拡大などのために資金調達を希望する企業などに対して行う融資(ローン)を指します。一般的に、バンクローンは投資適格未満の格付を有する企業への変動金利のローンです。

コモディティ

金や原油、穀物などの「商品」のことです。商品への投資に際しては、商品インデックスに連動する仕組み債券に投資するファンドなどがあります。

ヘッジファンド

ヘッジとは元々“回避する”という意味で、投資対象資産の価格変動に伴うリスクを回避する投資行動のことをいいます。裁定取引やデリバティブ取引(先物取引、オプション取引等)等を活用して実質的に金利・債券・株式・リート・コモディティ等に投資を行います。市場環境に関わらず収益(絶対収益)を追求するファンド*などがあります。

※特定の市場の動向に関わらず収益を追求することを目標として運用を行うファンドのことで、絶対に収益が得られるという意味ではありません。

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

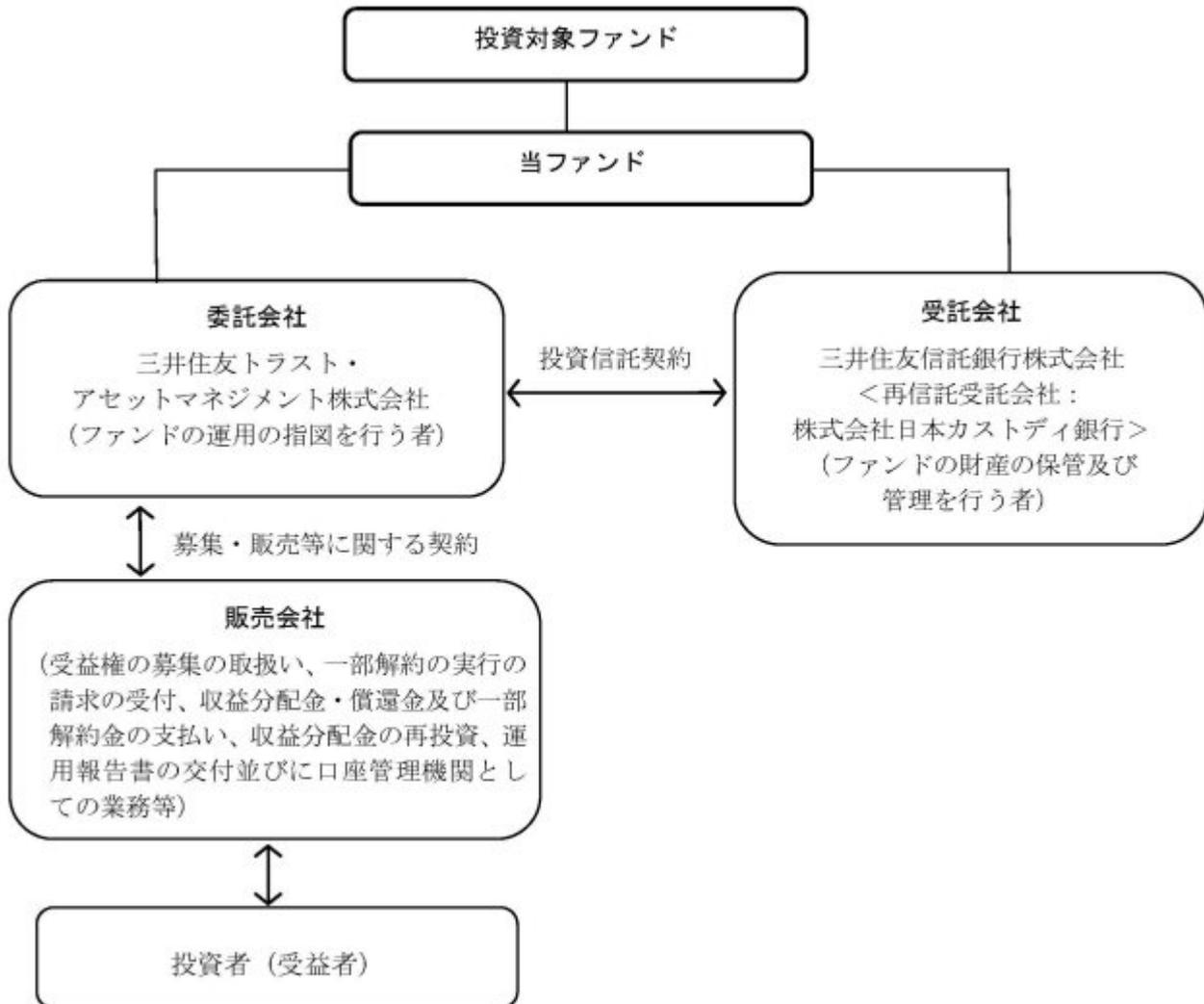
(2)【ファンドの沿革】

2013年3月29日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2025年 7月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

当ファンドは、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

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

投資対象

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

投資態度

イ．主として、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内不動産投資信託証券（以下「国内リート」といいます。）、海外不動産投資信託証券（以下「海外リート」といいます。）、貸付債権（以下「バンクローン」といいます。）、コモディティ^{*1}、ヘッジファンド^{*2}及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

*1：コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドとは、実質的にコモディティリンク債券やコモディティ関連デリバティブ等を活用するファンドを指します。

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

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

投資割合の決定にあたっては、先進国債券、新興国債券及びバンクローン等を投資対象とし、為替ヘッジを行うことで為替変動リスクの低減を図るファンドを国内債券と位置づける場合があります。

ハ．国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、以下の割合とします。

分散投資コア戦略ファンドA	分散投資コア戦略ファンドS
50%未満	75%未満

なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合には、上記の制限を超えた投資割合とする場合があります。

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

ホ．投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

ト．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。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ．次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

有価証券の指図範囲

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

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

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

（参考）投資対象ファンドの概要

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

以下の内容は、2025年7月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記

載内容が変更となることがあります。

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

1. 国内株式インデックス マザーファンド

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

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

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

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

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

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

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

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

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

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

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

2. 日本株式最小分散インデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式
投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI日本株最小分散インデックス（配当込み）（ ）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>株式以外の資産への投資割合は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI 日本株最小分散インデックス（配当込み）
決算日	年1回：1月22日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年4月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCI 日本株最小分散インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本の株式市場に上場する日本株を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、指数値の変動幅を一定の制約条件下で最小化することを目指します。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。MSCI 日本株最小分散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 日本株最小分散インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

3. 国内債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の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。
主要投資対象	わが国の公社債

投資態度	<p>NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>投資信託財産に属する資産の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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI 総合
決算日	年1回：5月29日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000年5月30日
信託期間	原則として無期限

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

「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。

4. 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
決算日	年1回：12月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年1月15日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

5. 外国株式インデックス マザーファンド

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

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

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

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

6. 外国株式最小分散インデックスマザーファンド

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

運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界の主要国の株式
投資態度	主としてわが国を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）（配当込み、円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目指します。 株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 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。
ベンチマーク	MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：5月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年7月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「MSCIコクサイ最小分散インデックス（JPY）」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に上場する銘柄を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、対円の為替変動を含めた指数値の変動幅を、一定の制約条件下で最小化することを目指します。「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コクサイ最小分散インデックス（JPY）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コクサイ最小分散インデックス（JPY）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。

7. 外国債券インデックス マザーファンド

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

運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の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。
主要投資対象	日本を除く世界の主要国の公社債
投資態度	<p>FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p>

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

「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。

8. 新興国株式インデックス マザーファンド

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

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

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

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

9.新興国債券インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）（ ）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	新興国の債券
投資態度	<p>主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。</p> <p>組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は行いません。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨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。

10. J-REITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券

投資態度	<p>わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに東証REIT指数（配当込み）との連動を維持するため、国内において行われるわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄に東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書、公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）及び不動産投資信託証券に係る投資法人の発行する新投資口予約権証券に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうちわが国の不動産投信指数を対象とする先物取引及び外国の取引所における当該取引と類似の取引を行うことを指図することができます。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	東証REIT指数（配当込み）

決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

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

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

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

11. グローバルREITインデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）（ ）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券並びに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券

投資態度	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>不動産投資信託証券の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>投資信託財産が運用対象とする不動産投資信託証券の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものをいいます。）のうち不動産投信指数を対象とする先物取引並びに外国の取引所における当該取引と類似の取引（以下当マザーファンドにおいて「不動産投信指数先物取引」といいます。）を活用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）における時価の構成割合が10%を超える銘柄がある場合には、当該銘柄にS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>投資信託証券以外の有価証券への投資は、コマーシャル・ペーパー、短期社債等、外国法人の発行する譲渡性預金証書及び公社債（国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券及び社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券及び短期社債等を除きます。）をいいます。）に限るものとし、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）及び債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新投資口予約権証券に係る取引を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2008年1月9日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's^(R)及びS&P^(R)は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R)はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者又はいかなる一般人に対して、株式全般又は具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示又は黙示を問わず、いかなる表明又は保証もしません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesと当社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indices又はそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、及び商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は当社又は当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成又は計算において当社又は当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格又は数量、あるいは当ファンドの新規設定又は販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、又は償還される計算式の決定又は計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、又は取引に関して、いかなる義務又は責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、又はホルードの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

12. グローバル・コモディティ（米ドル建て） マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）（ ）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	米ドル建て債券
投資態度	<p>ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>米ドル建て債券への投資は高位とすることを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>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、金利に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった受取金利、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（スワップ取引）、並びに金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月26日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2008年7月1日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity IndexSM）及び「ブルームバーグ（Bloomberg^(R)）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的で

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

13. ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券（以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 < 別に定める金現物に投資する上場投資信託証券 >（2025年7月31日現在） iShares Gold Trust SPDR Gold Shares iShares Gold Trust Micro SPDR Gold MiniShares Trust

投資態度	<p>主として投資対象上場投資信託証券に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標（円ヘッジベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>投資対象上場投資信託証券は、この投資信託の商品性及び運用上の効率性等を損なわない範囲で、委託者の判断により見直しを行うことがあります。</p> <p>投資対象上場投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。））を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。））を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。））を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>

ベンチマーク	LBMA金価格（円ヘッジベース）（ ）（2025年7月31日現在） ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。
決算日	年1回：7月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2017年10月11日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

14. HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本国債及び国内外の上場投資信託証券を主要投資対象とし、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主として日本国債及び国内外の上場投資信託証券に投資し、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引を組み合わせることで、HFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）（ ）の騰落率と概ね同程度の投資成果を目指します。</p> <p>ポートフォリオの構築にあたっては、計量手法に基づいてHFRI総合指数（円ヘッジ・円ベース）の値動きを分析し、日本国債及び上場投資信託証券や上場投資証券の投資割合、株価指数先物取引、債券先物取引、為替予約取引の取引量等を決定します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行います。</p> <p>なお、当該為替ヘッジとは別に、為替予約取引を活用することで収益の獲得を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月17日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年10月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

HFRI 総合指数（円ヘッジ・円ベース）（HFRI Weighted Composite Index JPY）は、HFRI Fund Weighted Composite Index の日本円ヘッジバージョンであり、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）が月次為替予約のコストを適用して算出します。

HFRI Fund Weighted Composite Indexは、HFRのデータベースに登録されたヘッジファンドを対象とするグローバルな等加重インデックスです。データベースへの登録条件は、運用会社がHFRからの質問項目に回答すること、5,000万米ドル以上の運用資産残高を有するか、12か月間以上の運用実績と1,000万米ドル以上の運用資産残高を有すること、毎月、手数料控除後の米ドルベースのパフォーマンスと運用資産残高をHFRに対して報告することとなっています。なお、ファンド・オブ・ヘッジファンドは対象としていません。

「HFRI Weighted Composite Index JPY」及び「HFRI」は、Hedge Fund Research, Inc.（以下「HFR」）の商標です。その使用については、ライセンス契約に基づいてHFRから三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に許諾されています。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社、その関連会社、又はそれらの金融商品とは一切関係ありません。HFRは、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社のいかなる金融商品の組成にも関与しておらず、それらの金融商品への投資を支持、承認、推奨するものではありません。また、それらの当該金融商品に関連するいかなる種類又は性質の損害に対しても責任を負いません。

15. G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）

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

運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限り、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り、）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年3月25日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

16.F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

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

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜 0.06%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2016年1月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

18. マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）

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

運用の基本方針	この投資信託は、わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」といいます。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引（以下総称して「有価証券先物取引等」といいます。）、オプション取引、スワップ取引（トータル・リターン・スワップ取引を含みます。）、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引（以下、「デリバティブ取引」といいます。）及び為替予約取引を主要取引対象とします。
投資態度	<p>主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。</p> <p>ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。</p> <p>実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジを行うことがあります。</p> <p>信用取引による株式の売付の建玉の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>債券（転換社債券、他社株転換可能債券、新株引受権付社債券及び新株予約権付社債券を除きます。）の空売りに係る債券の実質時価総額は、投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>有価証券先物取引等は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>株価指数先物取引に係る実質投資額（買建玉の実質時価総額と売建玉の実質時価総額の差額の絶対値をいいます。以下同じ。）は、原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>債券先物取引に係る実質投資額は原則として投資信託財産の純資産総額の500%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>為替予約取引は、以下の範囲で行うことを基本とします。</p> <p>為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額のいずれか大きい方の額は原則として投資信託財産の純資産総額の200%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>また、為替予約取引の買い予約の実質合計額と売り予約の実質合計額との差額の絶対値の額は原則として投資信託財産の純資産総額の100%以下とし、当該範囲を超えた場合には速やかに調整するものとします。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の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、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：2月7日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配を行わないことがあります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.88%（税抜 0.8%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2013年4月2日
信託期間	2013年4月2日から2026年3月26日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

19. ウェスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
------	--------------------------

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

収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.418%（税抜 0.38%） このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。 投資顧問会社の報酬は、委託者が収受する委託者報酬から支弁されます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年4月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

20. フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）

運用会社	フィデリティ投信株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、親投資信託であるフィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・マザーファンド受益証券を通じて、主として日本を含む世界の株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利への投資を行ない、投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・マザーファンド受益証券を主要な投資対象とします。
投資態度	<p>フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利に投資を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引を通じたレバレッジ取引を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、キャッシュ代替として主として日本国債に投資を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券への投資を通じて、複数のクオンツ・モデルを活用したシステムティックな運用を効果的に行ない、中長期的な資産の成長を目指します。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。</p> <p>収益獲得を目的としない為替エクスポージャーについては為替ヘッジを行なう場合があります。</p> <p>資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>債券への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブの利用による買いポジション、売りポジションのグロスの合計額は投資信託財産の純資産総額の250%以内とします。</p> <p>デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとし、</p> <p>投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの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%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：7月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。</p> <p>分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行なうものではありません。</p> <p>留保益の運用については特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.55%（税抜 0.5%）</p> <p>その他の費用</p> <ul style="list-style-type: none"> ・法定書類等の作成等に要する費用、監査費用等について、年率0.1%（税込）を上限としてファンドから支払うことができます。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2025年7月31日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

21. Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I (acc) JPY

投資顧問会社	Franklin Advisers, Inc.
運用の基本方針	株式市場と比べて低いボラティリティ及び伝統的なアセットクラスに対して低い相関性を維持しつつ、中長期的に資産価値を向上させることを目指します。
主要投資対象	日本の国債を含む株式、債券、デリバティブ、通貨等の幅広い資産に投資します。

投資態度	<p>当戦略は、主に、計量的な分析に基づくシステムティックな取引を行うことを目指します。</p> <p>アルゴリズムを活用した独自の運用プロセスを通じて投資機会を特定し、伝統資産と相関の低い複数の運用手法を用います。</p> <p>多様な投資機会を追求し、日本の国債を含む株式、債券、デリバティブ、通貨など幅広い資産に投資します。</p> <p>投資目的の達成を約束するものではありません。</p>
主な投資制限	<p>投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p> <p>一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>年率0.82%以内</p> <p>その他の費用</p> <p>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、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等及びデリバティブ取引に要する費用等並びに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年10月25日
信託期間	原則として無期限

関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・投資顧問会社（インベストメント・マネジャー） Franklin Advisers, Inc. ・副投資顧問会社（サブ・インベストメント・マネジャー） K2/D&S Management Co., L.L.C. Templeton Asset Management Limited ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） JPMorgan Chase Bank, N.A. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） Franklin Templeton Investments (Asia) Limited ・保管受託銀行（カストディ） JPMorgan Chase Bank, N.A.
------	--

22. Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged

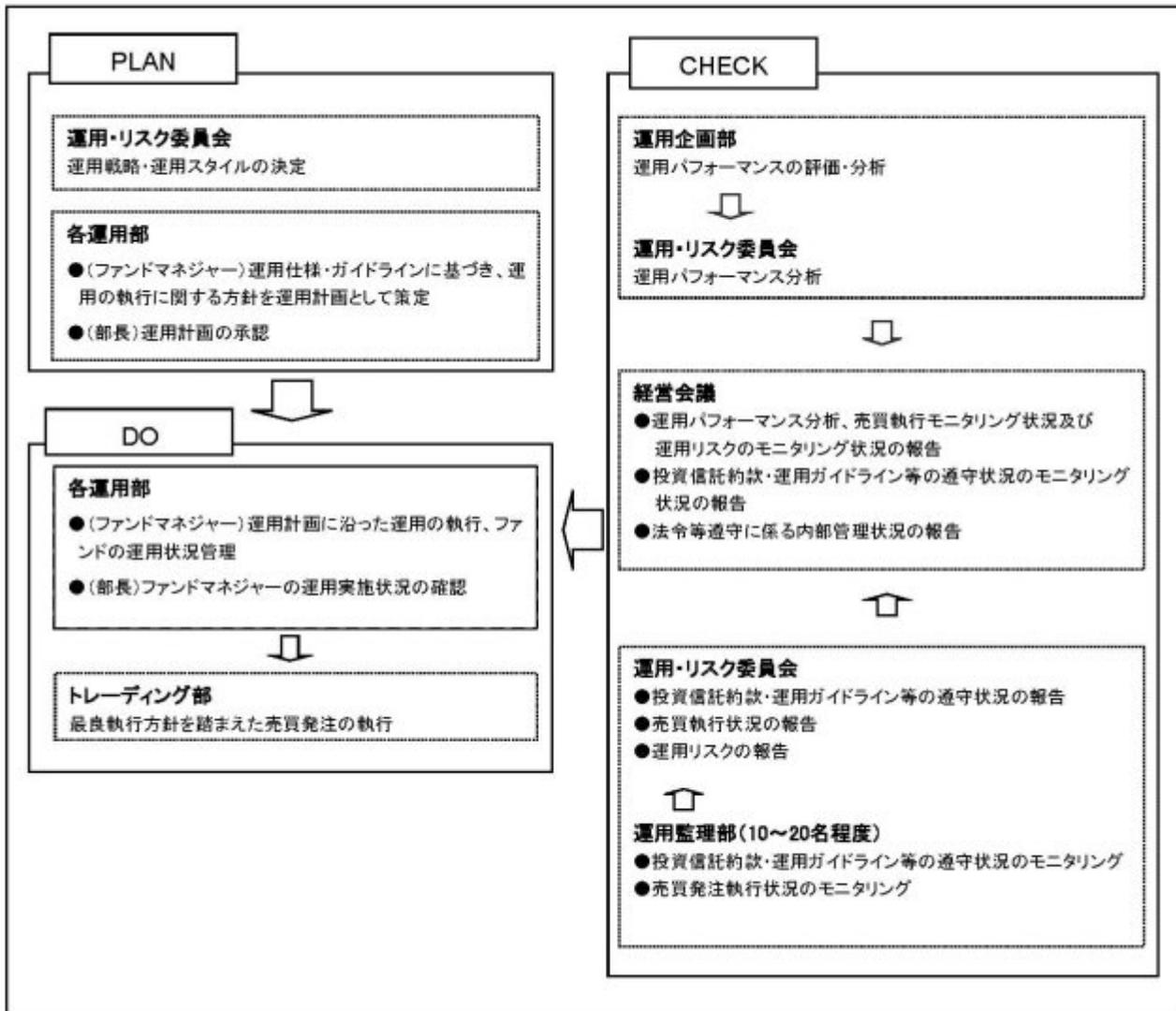
管理会社	Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited
運用の基本方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主としてトータル・リターン・スワップを通じて、日本を含む世界の株式等に実質的に投資を行います。また、米国国債等に投資を行います。
投資態度	<p>主としてトータル・リターン・スワップを通じて、世界の株式等の買建（ロングポジション）及び売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル型のイベントドリブン戦略により、市場動向に左右されにくい絶対収益の獲得を目指します。</p> <p>実質的な株式への投資については、原則としてM&Aやその他様々な企業イベントに着目し、株価上昇が予想される銘柄を購入し、株価下落が予想される銘柄を売却します。</p> <p>実質的な株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。</p> <p>資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>空売りする有価証券（現物に限ります）の時価総額は、投資信託財産の純資産総額以内とします。</p> <p>投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の15%以下とします。</p> <p>受益者の保護に欠け、若しくは投資信託財産の適正を害する取引は行いません。</p> <p>デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。

信託報酬	<p>運用会社報酬：年率1.00%</p> <p>成功報酬：20%</p> <p>1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の20%</p> <p>事務代行会社報酬：年率0.20%（上限）</p> <p>保管会社報酬：年率0.02%（上限）</p> <p>トータル・リターン・スワップに係る費用</p> <p>トータル・リターン・スワップの利用には、年率0.25%（上限）程度の費用がかかります。</p> <p>また、その他トータル・リターン・スワップを通じて行う運用に関連し、各種費用が発生します。これらの費用は、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。</p> <p>その他の費用</p> <p>ファンドにかかる租税、ファンドの組入有価証券の売買時にかかる費用、ファンドの事務処理に要する費用、ファンド財産の監査にかかる費用、ファンドの設立にかかる費用、現地での登録料、法律顧問費用、管理費用、借入金や立替金に関する利息、ファンドの運用報告書等の印刷及び配布等に関する費用等はファンドの信託財産から負担されます。</p> <p>上記の報酬等は将来変更される場合があります。なお、これらの報酬・費用等については、取引内容等により金額が決定し、その発生若しくは請求の都度費用として認識されるため、又は運用状況等により変動するため、その上限額及び計算方法を記載することができません。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年10月25日
信託期間	原則として無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社（マネージャー） Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited ・ 副投資顧問会社（サブ・インベストメントアドバイザー） Neuberger Berman Europe Limited Neuberger Berman Investment Advisers LLC ・ 受託会社（トラスティ） Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited ・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited ・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited ・ 保管受託銀行（カストディ） Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited

（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回の毎決算時（決算日は毎年7月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・ 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・ 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ・ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を

行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．同一銘柄の投資信託証券への投資割合

同一銘柄の投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ニ．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ホ．デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ヘ．公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ト．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。

チ．外国為替予約取引の指図

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

リ．資金の借入れ

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

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

（八）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。

（二）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

<その他の投資制限>

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

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

債券、バンクローン等の価格は、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。なお、債券、バンクローン等が変動金利である場合、こうした金利変動による価格の変動は固定金利の場合と比べて小さくなる傾向があります。また、発行者・債務者等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。加えて、物価連動債券の価格は、物価変動及び将来の物価変動に対する市場予想の変化によっても変動します。債券、バンクローン等の価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格変動リスク

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

商品（コモディティ）の価格変動リスク

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

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して

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

信用リスク

有価証券等の発行体等が財政難、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、有価証券等の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。相対的に格付が低い発行体等の有価証券等に投資する際には、信用度に関するマーケットの考え方の変化の影響をより大きく受ける可能性があり、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るリスクがより高いものになると想定されます。

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

資産等の選定・配分に係るリスク

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

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

ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

仕組み債券に係るリスク

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

また、仕組み債券の価格は取引に関わる関係法人の財務状況等及びそれらに関する外部評価等、市場や経済環境の悪化や混乱、また概ね連動を目指すファンドの流動性の制約等により変動し、あるいは債券取引が一部不可能となる等、概ね連動を目指す対象と大きく乖離することがあります。加

えて、通常、仕組み債券の取引に関わるブローカーは限定的であり（1社の場合もあります）、取引にあたっては高いコストがかかる場合があります。

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

ブローカーの信用リスク

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

有価証券の貸付等に係るリスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) リスクの管理体制

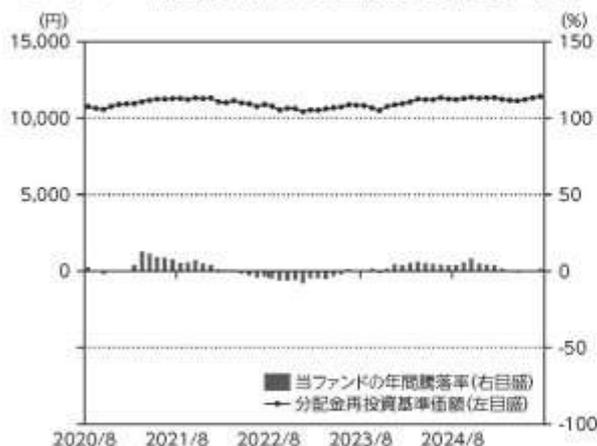
委託会社におけるリスク管理体制

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

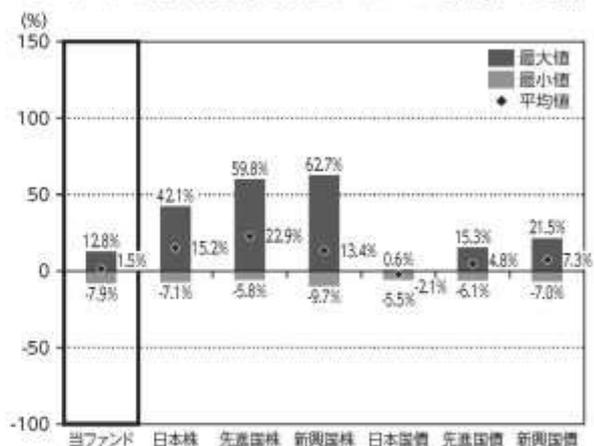
〔参考情報〕

分散投資コア戦略ファンドA

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

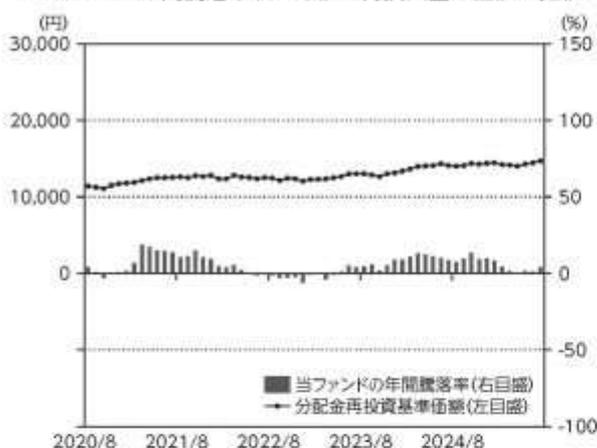


当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

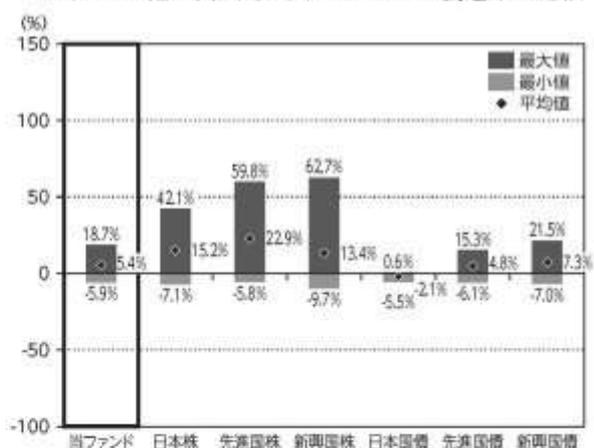


分散投資コア戦略ファンドS

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



当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*当ファンドの年間騰落率は、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。

*2020年8月～2025年7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。

*各資産クラスの詳細については、後掲「各資産クラスの指数について」をご覧ください。

【参考情報】

各資産クラスの指数について

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.935%（税抜 0.85%）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 0.495% （税抜 0.45%）	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 0.385% （税抜 0.35%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

2025年10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。）

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

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

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

（参考）各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
国内株式インデックス マザーファンド	ありません。
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。
外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	ありません。
外国債券インデックス マザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
新興国債券インデックス マザーファンド	ありません。
J-REITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバルREITインデックス マザーファンド	ありません。
グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド	ありません。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
H F リターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
F0Fs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）
F0Fs用 M A N A H L ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.066% （税抜 0.06%）

マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.88% (税抜 0.8%)
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	年率 0.418% (税抜 0.38%)
フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）	年率 0.55% (税抜 0.5%)
Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I(acc)JPY	年率 0.82%以内
Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged	運用会社報酬：年率1.00% 成功報酬：20% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の20% 事務代行会社報酬：年率0.20%（上限） 保管会社報酬：年率0.02%（上限）

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

実質的な信託報酬率：年率0.935%～1.42646%程度（税抜 0.85%～1.3145%程度）
（投資対象とする投資信託証券：年率0.0%～0.49146%程度（税抜0.0%～0.4645%程度））
品貸料の額は運用状況等によって変動するため、品貸料及び品貸料に対する信託報酬の額については、上記「実質的な信託報酬率」及び「投資対象とする投資信託証券」では考慮しておりません。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券の価格に反映される費用は、仕組み債券の発行・管理にあたり発行者等に支払う手数料、仕組み債券の連動対象となるファンド及びファンドが組み入

れるヘッジファンド等の運用者に支払う運用報酬（成功報酬を含みます。）等
財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（ご参考）

《 仕組み債券の費用にかかる記載 》

・ FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

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

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

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

実質的に投資対象とする円建債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

- ・ 円建債券は、円建債券の評価額に対して年率0.24%程度が発行・管理手数料等としてかかります。
- ・ 円建債券の連動対象となるMAN AHLファンドにおいては、固定報酬（運用報酬として1.35%（MAN AHLファンドの純資産総額に対する年率。以下同じ。）、加えてサービスマネジャー費用として0.25%、ブローカレッジ費用として1.00%）、成功報酬、その他管理費用、監査費用等がかかります。

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

・ グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド

主要投資対象である米ドル建て債券の価格に反映される費用等は、以下の通りです。

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

これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2025年7月31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
分散投資コア 戦略ファンドA	1.04%	0.95%	0.09%
分散投資コア 戦略ファンドS	1.04%	0.95%	0.09%

※対象期間は2024年7月11日～2025年7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。

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2025年7月31日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドA】**(1)【投資状況】**

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	5,842,980,784	6.24
投資証券	ケイマン	2,208,274,241	2.36
	アイルランド	1,376,316,458	1.47
	小計	3,584,590,699	3.83
親投資信託受益証券	日本	82,029,877,202	87.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,149,846,765	2.30
合計(純資産総額)		93,607,295,450	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】**【投資有価証券の主要銘柄】****イ. 評価額上位銘柄明細**

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	19,940,534,655	1.2595	25,116,322,223	1.2566	25,057,275,847	26.77
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	20,350,131,725	0.8173	16,632,162,658	0.8158	16,601,637,461	17.74
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	1,165,209,477	7.4102	8,634,435,267	7.6537	8,918,163,774	9.53
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3,010,680,362	1.8981	5,714,572,395	1.8664	5,619,133,827	6.00
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	1,636,908,834	2.9970	4,905,815,775	3.1366	5,134,328,248	5.48
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックス マザーファンド	1,398,631,227	3.0658	4,287,923,615	3.1628	4,423,590,844	4.73

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	860,374,363	3.6687	3,156,455,425	3.7150	3,196,290,758	3.41
日本	親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）	2,625,091,266	1.0718	2,813,737,699	1.0807	2,836,936,131	3.03
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	992,309,611	2.5026	2,483,354,032	2.5361	2,516,596,404	2.69
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,066,487,955	2.2293	2,377,521,598	2.3265	2,481,184,227	2.65
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	2,337,733,486	1.018	2,379,812,688	1.0225	2,390,332,489	2.55
日本	投資信託受益証券	FOFs用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	2,150,222,205	1.0995	2,364,169,314	1.1017	2,368,899,803	2.53
ケイマン	投資証券	Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I(acc) JPY	2,235,910.09	990.56	2,214,803,098	987.64	2,208,274,241	2.36
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	650,842,343	2.4431	1,590,072,928	2.4780	1,612,787,325	1.72
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	266,005,185	5.0749	1,349,949,713	5.3002	1,409,880,681	1.51
アイルランド	投資証券	Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged	1,325,445.847	1,033.86	1,370,325,443	1,038.38	1,376,316,458	1.47
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	671,130,251	1.7689	1,187,162,300	1.8331	1,230,248,863	1.31
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド（適格機関投資家専用）	1,137,077,424	0.9494	1,079,541,306	0.9531	1,083,748,492	1.16
日本	親投資信託受益証券	HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,058,847,884	0.9333	988,222,730	0.9367	991,822,812	1.06

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	6.24
投資証券	3.83
親投資信託受益証券	87.63
合計	97.70

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533

第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
第10期計算期間末	(2022年 7月11日)	83,363,228,383	83,363,228,383	10,759	10,759
第11期計算期間末	(2023年 7月10日)	87,419,162,186	87,419,162,186	10,781	10,781
第12期計算期間末	(2024年 7月10日)	91,968,608,759	91,968,608,759	11,398	11,398
第13期計算期間末	(2025年 7月10日)	92,679,634,072	92,679,634,072	11,318	11,318
	2024年 7月末日	90,803,364,722		11,235	
	8月末日	90,776,915,346		11,212	
	9月末日	90,972,156,757		11,270	
	10月末日	92,631,625,994		11,355	
	11月末日	92,091,870,012		11,292	
	12月末日	91,857,803,182		11,323	
	2025年 1月末日	92,390,235,573		11,334	
	2月末日	91,030,594,439		11,220	
	3月末日	91,138,728,659		11,167	
	4月末日	90,322,255,884		11,119	
	5月末日	91,578,803,612		11,214	
	6月末日	92,247,509,231		11,314	
	7月末日	93,607,295,450		11,410	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0
第13期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	4.5
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0.2

第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	5.7
第13期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	0.7

(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4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	10,745,359,555	4,666,858,341	77,480,101,954
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	9,056,644,310	5,449,171,076	81,087,575,188
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	8,522,680,283	8,924,705,373	80,685,550,098
第13期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	8,095,974,966	6,891,102,452	81,890,422,612

(注)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。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	17,352,355,223	7.20
投資証券	ケイマン	5,511,526,254	2.29
	アイルランド	3,379,891,084	1.40
	小計	8,891,417,338	3.69
親投資信託受益証券	日本	207,865,793,017	86.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,746,598,763	2.80
合計(純資産総額)		240,856,164,341	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	5,814,358,427	7.4102	43,085,558,816	7.6537	44,501,355,092	18.48
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	30,975,652,875	1.2594	39,011,555,194	1.2566	38,924,005,402	16.16
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	31,144,706,411	0.8173	25,454,568,549	0.8158	25,407,851,490	10.55
日本	親投資信託受益証券	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	10,218,627,046	1.8981	19,395,975,996	1.8664	19,072,045,518	7.92

日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,070,743,368	2.9970	18,194,017,873	3.1366	19,041,493,648	7.91
日本	親投資信託受益証券	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	4,881,919,021	2.5026	12,217,490,541	2.5361	12,381,034,829	5.14
日本	親投資信託受益証券	グローバルREITインデックスマザーファンド	3,899,032,670	3.0658	11,953,654,359	3.1628	12,331,860,528	5.12
日本	親投資信託受益証券	GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）	7,301,996,109	1.0718	7,826,404,010	1.0807	7,891,267,194	3.28
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	1,256,430,541	5.0749	6,376,259,352	5.3002	6,659,333,153	2.76
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	1,730,938,568	3.6687	6,350,294,324	3.7150	6,430,436,780	2.67
日本	投資信託受益証券	FOFs用MAN AHL ダイバースフィード リンクファンド（適格機関投資家専用）	6,365,841,833	0.9494	6,043,730,236	0.9531	6,067,283,851	2.52
日本	投資信託受益証券	マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	5,537,363,830	1.018	5,637,036,378	1.0225	5,661,954,516	2.35
日本	投資信託受益証券	FOFs用ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	5,104,036,359	1.0995	5,611,887,976	1.1017	5,623,116,856	2.33
ケイマン	投資証券	Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I(acc) JPY	5,580,501.25	990.56	5,527,821,318	987.64	5,511,526,254	2.29
日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	2,183,883,081	2.2293	4,868,530,552	2.3265	5,080,803,987	2.11
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,549,900,694	1.7689	4,510,519,337	1.8331	4,674,222,962	1.94
アイルランド	投資証券	Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged	3,254,965.508	1,033.86	3,365,178,640	1,038.38	3,379,891,084	1.40
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	1,312,489,912	2.4431	3,206,544,104	2.4780	3,252,350,001	1.35
日本	親投資信託受益証券	HFRリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,367,601,616	0.9333	2,209,682,588	0.9367	2,217,732,433	0.92

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	7.20
投資証券	3.69
親投資信託受益証券	86.30
合計	97.20

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759

第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
第10期計算期間末	(2022年 7月11日)	177,910,582,335	177,910,582,335	12,378	12,378
第11期計算期間末	(2023年 7月10日)	194,020,660,452	194,020,660,452	12,871	12,871
第12期計算期間末	(2024年 7月10日)	223,716,185,671	223,716,185,671	14,489	14,489
第13期計算期間末	(2025年 7月10日)	237,598,994,386	237,598,994,386	14,517	14,517
	2024年 7月末日	218,173,828,846		14,109	
	8月末日	216,975,913,730		14,008	
	9月末日	217,938,702,669		14,099	
	10月末日	224,756,461,991		14,374	
	11月末日	223,691,993,882		14,272	
	12月末日	229,688,112,239		14,396	
	2025年 1月末日	231,687,749,842		14,449	
	2月末日	227,252,993,730		14,223	
	3月末日	228,204,740,716		14,166	
	4月末日	224,717,667,557		14,013	
	5月末日	230,457,394,101		14,280	
	6月末日	232,588,669,825		14,465	
	7月末日	240,856,164,341		14,708	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0
第13期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3

第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	1.4
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	4.0
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	12.6
第13期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	0.2

(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4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	17,903,179,345	10,752,318,272	143,734,318,300
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	20,898,235,211	13,888,973,046	150,743,580,465
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	18,352,523,646	14,690,213,957	154,405,890,154
第13期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	22,882,394,011	13,622,827,724	163,665,456,441

(注)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	770,955,074,930	99.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,979,209,121	0.90
合計(純資産総額)		777,934,284,051	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	4,747,890,000	0.61

(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	9,842,500	2,729.29	26,863,036,825	2,696.50	26,540,301,250	3.41
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,697,700	2,003.93	23,441,371,961	2,110.50	24,687,995,850	3.17
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,387,000	3,963.17	25,312,766,790	3,682.00	23,516,934,000	3.02
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,757,000	4,081.41	19,415,267,370	4,697.00	22,343,629,000	2.87
日本	株式	任天堂	その他製品	1,168,900	12,336.63	14,420,286,807	12,690.00	14,833,341,000	1.91
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,765,300	3,680.18	13,856,981,754	3,855.00	14,515,231,500	1.87
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,407,700	8,967.80	12,623,972,060	9,052.00	12,742,500,400	1.64
日本	株式	三菱重工業	機械	3,270,200	3,303.15	10,801,961,130	3,630.00	11,870,826,000	1.53
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,436,700	4,005.66	9,760,591,722	4,482.00	10,921,289,400	1.40
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,620,500	2,933.56	10,620,953,980	2,988.00	10,818,054,000	1.39
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	916,000	7,956.83	7,288,456,280	11,810.00	10,817,960,000	1.39
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	391,900	24,172.87	9,473,347,753	27,330.00	10,710,627,000	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,740,900	6,163.00	10,729,166,700	6,124.00	10,661,271,600	1.37
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,316,800	7,633.18	10,051,371,424	7,933.00	10,446,174,400	1.34
日本	株式	キーエンス	電気機器	185,200	62,282.73	11,534,761,596	55,200.00	10,223,040,000	1.31
日本	株式	三井物産	卸売業	2,816,200	3,027.84	8,527,003,008	3,100.00	8,730,220,000	1.12
日本	株式	NTT	情報・通信業	55,236,300	155.85	8,608,577,355	152.70	8,434,583,010	1.08
日本	株式	信越化学工業	化学	1,649,300	4,649.76	7,668,849,168	4,395.00	7,248,673,500	0.93
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,652,300	4,254.73	7,030,090,379	4,200.00	6,939,660,000	0.89
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,386,900	1,494.16	6,554,730,504	1,569.00	6,883,046,100	0.88
日本	株式	HOYA	精密機器	356,400	17,678.15	6,300,492,660	19,180.00	6,835,752,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	29,788,300	222.95	6,641,301,485	218.60	6,511,722,380	0.84
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,609,600	2,504.54	6,535,847,584	2,485.50	6,486,160,800	0.83
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,902,100	2,945.53	5,602,692,613	3,342.00	6,356,818,200	0.82
日本	株式	第一三共	医薬品	1,705,100	3,881.98	6,619,164,098	3,720.00	6,342,972,000	0.82
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	132,200	48,570.30	6,420,993,660	46,380.00	6,131,436,000	0.79
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	583,500	7,689.44	4,486,788,240	10,350.00	6,039,225,000	0.78
日本	株式	日本電気	電気機器	1,322,400	3,796.14	5,020,015,536	4,399.00	5,817,237,600	0.75
日本	株式	富士通	電気機器	1,720,800	3,341.29	5,749,691,832	3,305.00	5,687,244,000	0.73
日本	株式	丸紅	卸売業	1,609,800	2,930.03	4,716,762,294	3,113.00	5,011,307,400	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	0.28
		建設業	2.28
		食料品	2.93
		繊維製品	0.40

パルプ・紙	0.14
化学	4.73
医薬品	3.84
石油・石炭製品	0.45
ゴム製品	0.63
ガラス・土石製品	0.64
鉄鋼	0.76
非鉄金属	1.06
金属製品	0.47
機械	6.16
電気機器	17.60
輸送用機器	6.85
精密機器	2.02
その他製品	3.13
電気・ガス業	1.25
陸運業	2.37
海運業	0.60
空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	7.73
卸売業	6.87
小売業	4.67
銀行業	9.11
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	3.27
その他金融業	1.11
不動産業	1.82
サービス業	4.41
小計	99.10
合計	99.10

(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	161円		4,708,863,550	4,747,890,000	0.61

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

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

日本株式最小分散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	5,854,645,380	99.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		49,801,383	0.84
合計(純資産総額)		5,904,446,763	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	17,694,000	0.30

(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	東海旅客鉄道	陸運業	28,300	2,822.48	79,876,250	3,511.00	99,361,300	1.68
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	56,900	1,537.47	87,482,161	1,695.00	96,445,500	1.63
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	37,100	2,245.49	83,307,945	2,546.00	94,456,600	1.60
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	12,900	7,792.18	100,519,139	7,303.00	94,208,700	1.60
日本	株式	任天堂	その他製品	7,400	9,601.49	71,051,041	12,690.00	93,906,000	1.59
日本	株式	イオン	小売業	19,200	3,710.55	71,242,718	4,833.00	92,793,600	1.57
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	23,900	3,769.80	90,098,351	3,855.00	92,134,500	1.56
日本	株式	花王	化学	13,500	6,008.00	81,108,035	6,810.00	91,935,000	1.56
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	43,200	1,909.15	82,475,583	2,110.50	91,173,600	1.54
日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	23,800	3,330.34	79,262,148	3,810.00	90,678,000	1.54
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	11,300	7,106.48	80,303,277	7,933.00	89,642,900	1.52
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	27,600	2,698.28	74,472,724	3,218.00	88,816,800	1.50
日本	株式	三菱商事	卸売業	29,400	2,495.53	73,368,641	2,988.00	87,847,200	1.49
日本	株式	オービック	情報・通信業	16,200	4,545.69	73,640,243	5,420.00	87,804,000	1.49
日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	29,800	3,024.21	90,121,702	2,919.50	87,001,100	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	20,700	4,062.38	84,091,417	4,200.00	86,940,000	1.47
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	17,200	4,680.42	80,503,229	5,004.00	86,068,800	1.46
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	31,900	2,864.87	91,389,399	2,696.50	86,018,350	1.46
日本	株式	セコム	サービス業	15,800	5,174.96	81,764,480	5,416.00	85,572,800	1.45

日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	13,900	5,389.48	74,913,789	6,131.00	85,220,900	1.44
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	389,700	195.93	76,356,172	218.60	85,188,420	1.44
日本	株式	NTT	情報・通信業	556,700	150.69	83,889,439	152.70	85,008,090	1.44
日本	株式	KDDI	情報・通信業	33,600	2,416.20	81,184,501	2,485.50	83,512,800	1.41
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	1,800	49,123.33	88,422,000	46,380.00	83,484,000	1.41
日本	株式	ANAホールディングス	空運業	29,700	2,794.42	82,994,396	2,808.00	83,397,600	1.41
日本	株式	富士通	電気機器	25,200	2,795.84	70,455,350	3,305.00	83,286,000	1.41
日本	株式	キヤノン	電気機器	19,200	4,827.91	92,695,911	4,300.00	82,560,000	1.40
日本	株式	中外製薬	医薬品	11,200	6,659.72	74,588,944	7,360.00	82,432,000	1.40
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	19,000	3,906.53	74,224,110	4,318.00	82,042,000	1.39
日本	株式	日本オラクル	情報・通信業	5,000	14,645.23	73,226,168	16,405.00	82,025,000	1.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	鉱業	0.05
		建設業	3.14
		食料品	4.94
		化学	4.90
		医薬品	9.96
		石油・石炭製品	0.22
		ゴム製品	1.44
		鉄鋼	1.47
		機械	0.60
		電気機器	9.61
		輸送用機器	3.51
		精密機器	1.96
		その他製品	2.38
		電気・ガス業	3.89
		陸運業	5.38
		海運業	1.53
		空運業	2.05
		情報・通信業	11.90
		卸売業	5.06
		小売業	6.65
銀行業	5.83		
保険業	2.62		
その他金融業	1.62		
不動産業	3.30		
サービス業	5.13		
		小計	99.16

合計	99.16
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建		6円	16,938,078	17,694,000	0.30

(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	626,371,690,370	85.38
地方債証券	日本	36,095,289,428	4.92
特殊債券	日本	37,674,375,569	5.14
	韓国	397,992,000	0.05
	国際機関	297,960,000	0.04
	小計	38,370,327,569	5.23
社債券	日本	32,143,094,000	4.38
	フランス	1,288,069,000	0.18
	オーストラリア	397,444,000	0.05
	小計	33,828,607,000	4.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,073,369,695	0.15
合計(純資産総額)		733,592,544,672	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174回利付国債(5年)	6,810,000,000	98.80	6,728,547,900	98.74	6,724,806,900	0.700	2029/9/20	0.92
日本	国債証券	第378回利付国債(10年)	6,560,000,000	99.36	6,518,354,800	98.86	6,485,675,200	1.400	2035/3/20	0.88
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	98.02	6,440,242,500	98.04	6,441,425,100	0.100	2028/3/20	0.88
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	6,640,000,000	95.92	6,369,486,400	95.68	6,353,550,400	0.800	2033/9/20	0.87

日本	国債証券	第373回利付国債（10年）	6,690,000,000	94.03	6,291,239,300	93.78	6,274,149,600	0.600	2033/12/20	0.86
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	6,570,000,000	95.15	6,251,957,000	95.01	6,242,288,400	0.800	2034/3/20	0.85
日本	国債証券	第178回利付国債（5年）	6,220,000,000	99.94	6,216,691,400	99.71	6,202,148,600	1.000	2030/3/20	0.85
日本	国債証券	第368回利付国債（10年）	6,620,000,000	92.99	6,156,467,600	92.78	6,142,367,000	0.200	2032/9/20	0.84
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	6,450,000,000	95.09	6,133,766,600	95.02	6,128,919,000	0.100	2030/9/20	0.84
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	6,570,000,000	93.41	6,137,037,000	93.16	6,121,006,200	0.200	2032/6/20	0.83
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	6,130,000,000	98.93	6,064,409,000	99.03	6,071,029,400	0.005	2026/12/20	0.83
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	6,410,000,000	94.82	6,078,596,600	94.69	6,070,141,800	0.100	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	第370回利付国債（10年）	6,430,000,000	94.36	6,067,605,200	94.11	6,051,787,400	0.500	2033/3/20	0.82
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	6,220,000,000	94.12	5,854,384,900	94.03	5,848,728,200	0.100	2031/6/20	0.80
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	6,240,000,000	93.30	5,821,920,000	93.03	5,805,134,400	0.400	2033/6/20	0.79
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	6,200,000,000	93.73	5,811,694,000	93.54	5,799,480,000	0.200	2032/3/20	0.79
日本	国債証券	第377回利付国債（10年）	5,940,000,000	97.53	5,793,399,000	97.37	5,783,837,400	1.200	2034/12/20	0.79
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	98.86	5,684,910,000	98.96	5,690,602,500	0.100	2027/3/20	0.78
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	5,680,000,000	99.27	5,639,047,200	99.35	5,643,136,800	0.100	2026/9/20	0.77
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	5,780,000,000	97.53	5,637,240,000	97.52	5,637,176,200	0.100	2028/9/20	0.77
日本	国債証券	第375回利付国債（10年）	5,790,000,000	97.31	5,634,480,600	97.13	5,623,827,000	1.100	2034/6/20	0.77
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	6,007,000,000	93.50	5,616,586,710	93.28	5,603,389,670	0.100	2031/12/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	5,930,000,000	94.73	5,617,582,200	94.48	5,602,723,300	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	5,900,000,000	93.79	5,533,905,000	93.65	5,525,822,000	0.100	2031/9/20	0.75
日本	国債証券	第154回利付国債（5年）	5,550,000,000	98.46	5,465,052,500	98.48	5,466,028,500	0.100	2027/9/20	0.75
日本	国債証券	第376回利付国債（10年）	5,740,000,000	95.27	5,468,633,700	95.10	5,458,854,800	0.900	2034/9/20	0.74
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	5,545,000,000	95.39	5,289,375,500	95.31	5,285,438,550	0.100	2030/6/20	0.72
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	5,325,000,000	97.79	5,207,530,500	97.80	5,208,116,250	0.100	2028/6/20	0.71
日本	国債証券	第168回利付国債（5年）	5,230,000,000	98.80	5,167,460,100	98.73	5,163,892,800	0.600	2029/3/20	0.70
日本	国債証券	第153回利付国債（5年）	5,150,000,000	98.48	5,071,720,000	98.53	5,074,398,000	0.005	2027/6/20	0.69

(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	85.38
地方債証券	4.92
特殊債券	5.23
社債券	4.61

合計	100.15
----	--------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	33,509,127,463	46.41
	中国	8,264,718,467	11.45
	フランス	5,325,891,501	7.38
	イタリア	5,053,112,778	7.00
	ドイツ	4,188,922,948	5.80
	イギリス	4,078,491,135	5.65
	スペイン	3,262,487,242	4.52
	カナダ	1,403,072,200	1.94
	ベルギー	1,096,338,824	1.52
	オランダ	957,827,691	1.33
	オーストラリア	890,691,076	1.23
	オーストリア	821,586,101	1.14
	メキシコ	582,154,523	0.81
	ポーランド	480,978,041	0.67
	ポルトガル	450,630,555	0.62
	マレーシア	374,466,949	0.52
	フィンランド	369,291,391	0.51
	アイルランド	310,288,587	0.43
	シンガポール	286,595,267	0.40
	イスラエル	266,028,153	0.37
	ニュージーランド	205,348,122	0.28
デンマーク	167,513,904	0.23	
スウェーデン	135,591,868	0.19	
ノルウェー	121,833,291	0.17	
	小計	72,602,988,077	100.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		403,470,013	0.56
合計(純資産総額)		72,199,518,064	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	165,430,751	0.23
	買建	ドイツ	165,070,855	0.23

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		73,875,200,825	102.32

(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 4.25% 12/31/26	4,070,000	14,989.76	610,083,608	14,980.14	609,691,724	4.250	2026/12/31	0.84
アメリカ	国債証券	T 6.125% 11/15/27	3,500,000	15,790.98	552,684,643	15,664.94	548,272,970	6.125	2027/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	4,230,000	12,370.74	523,282,461	12,701.35	537,267,506	1.375	2031/11/15	0.74
中国	国債証券	CGB 1.46% 05/25/28	22,200,000	2,073.79	460,381,700	2,072.96	460,198,837	1.460	2028/5/25	0.64
アメリカ	国債証券	T 1.5% 02/15/30	3,350,000	13,245.84	443,735,858	13,444.51	450,391,300	1.500	2030/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	3,340,000	12,924.06	431,663,867	13,030.48	435,218,175	1.875	2032/2/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	3,000,000	14,254.79	427,643,814	14,272.87	428,186,171	3.500	2033/2/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 4.125% 10/31/27	2,800,000	14,956.21	418,774,014	15,005.23	420,146,535	4.125	2027/10/31	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.875% 06/30/26	2,750,000	14,332.47	394,143,107	14,498.08	398,697,213	0.875	2026/6/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/27	2,630,000	15,127.23	397,846,186	15,072.92	396,417,946	4.500	2027/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/35	2,560,000	15,350.28	392,967,416	15,255.28	390,535,337	4.625	2035/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 4.375% 05/15/34	2,570,000	15,074.99	387,427,326	15,028.57	386,234,393	4.375	2034/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.5% 09/30/29	2,550,000	14,420.33	367,718,476	14,697.11	374,776,471	3.500	2029/9/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.625% 11/15/26	2,400,000	15,071.46	361,715,206	15,041.12	360,986,930	4.625	2026/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 3.625% 05/31/28	2,390,000	14,910.40	356,358,699	14,834.25	354,538,619	3.625	2028/5/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/29	2,280,000	14,955.92	340,995,044	15,049.58	343,130,504	4.125	2029/3/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	2,450,000	13,420.29	328,797,321	13,749.42	336,860,881	1.125	2028/8/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 11/15/33	2,190,000	15,284.09	334,721,591	15,198.68	332,851,131	4.500	2033/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.125% 10/31/26	2,290,000	14,126.10	323,487,881	14,403.88	329,848,861	1.125	2026/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/34	2,270,000	14,559.54	330,501,771	14,446.77	327,941,715	3.875	2034/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 4.375% 01/31/32	2,150,000	15,138.28	325,473,155	15,161.62	325,974,960	4.375	2032/1/31	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.625% 03/31/27	2,260,000	13,808.07	312,062,405	14,140.11	319,566,568	0.625	2027/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 4% 03/31/30	2,090,000	14,933.16	312,103,137	14,974.59	312,969,073	4.000	2030/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	2,090,000	14,321.30	299,315,322	14,506.29	303,181,549	2.875	2028/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 08/31/26	2,050,000	14,100.14	289,052,874	14,407.96	295,363,285	0.750	2026/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/34	1,990,000	14,909.91	296,707,214	14,839.79	295,311,935	4.250	2034/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/28	2,000,000	14,344.94	286,898,828	14,526.13	290,522,701	2.750	2028/2/15	0.40

アメリカ	国債証券	T 4.125% 03/31/31	1,900,000	14,943.37	283,924,156	15,011.06	285,210,310	4.125	2031/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	1,880,000	14,300.00	268,840,142	14,538.39	273,321,848	1.500	2026/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 0.75% 01/31/28	1,970,000	13,478.94	265,535,238	13,828.49	272,421,358	0.750	2028/1/31	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.56
合計	100.56

(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	4	アメリカ ドル	436,042.44	65,140,380	432,750	64,648,522	0.09
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	3	アメリカ ドル	336,430.29	50,259,321	333,000	49,746,870	0.07
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	3	アメリカ ドル	346,602.15	51,778,895	341,625	51,035,359	0.07
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	2	ユーロ	214,514.2	36,628,300	214,140	36,564,405	0.05
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	2	ユーロ	235,404.2	40,195,267	234,480	40,037,460	0.06
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	4	ユーロ	520,728.4	88,914,374	518,120	88,468,990	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	売建	228,265,000.00	32,852,051,339	34,081,219,957	47.20
	カナダドル	売建	13,300,000.00	1,405,255,472	1,435,762,929	1.99
	メキシコペソ	売建	75,603,000.00	573,683,124	598,541,390	0.83
	ユーロ	売建	130,259,000.00	22,052,462,422	22,236,552,966	30.80
	イギリスポンド	売建	21,103,000.00	4,161,758,711	4,174,696,753	5.78
	スウェーデンクローナ	売建	9,066,000.00	137,194,858	138,497,655	0.19
	ノルウェークローネ	売建	8,572,000.00	121,898,135	124,306,000	0.17
	デンマーククローネ	売建	7,432,000.00	168,700,454	170,005,513	0.24
	ポーランドズロチ	売建	12,286,000.00	488,963,142	490,568,922	0.68
	オーストラリアドル	売建	9,388,000.00	885,896,825	902,892,777	1.25
	ニュージーランドドル	売建	2,347,000.00	205,215,577	206,881,478	0.29

シンガポールドル	売建	2,495,000.00	282,491,135	287,658,779	0.40
マレーシアリングット	売建	10,682,000.00	365,069,100	374,805,743	0.52
イスラエルシェケル	売建	6,184,000.00	264,336,514	273,320,432	0.38
オフショア人民元	売建	404,316,000.00	8,143,575,947	8,379,489,531	11.61

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

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

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	633,206,972,941	71.51
	イギリス	32,814,466,671	3.71
	カナダ	29,693,656,990	3.35
	スイス	23,336,816,279	2.64
	ドイツ	23,078,914,061	2.61
	フランス	22,536,889,038	2.55
	アイルランド	15,996,948,313	1.81
	オーストラリア	14,411,821,049	1.63
	オランダ	14,105,018,179	1.59
	スペイン	7,415,381,590	0.84
	スウェーデン	6,858,005,348	0.77
	イタリア	6,118,028,329	0.69
	デンマーク	4,343,185,583	0.49
	香港	3,538,781,933	0.40
	シンガポール	2,931,225,025	0.33
	フィンランド	2,346,918,741	0.27
	イスラエル	2,153,444,360	0.24
	ベルギー	1,907,544,594	0.22
	ルクセンブルク	1,682,884,422	0.19
	ケイマン	1,662,575,072	0.19
	ノルウェー	1,374,632,143	0.16
	ジャージー	1,109,258,437	0.13
	リベリア	1,016,025,098	0.11
	バミューダ	892,572,410	0.10
	キュラソー	619,817,577	0.07
	ニュージーランド	619,765,849	0.07
	オーストリア	516,504,933	0.06
	パナマ	391,088,099	0.04
	ポルトガル	346,730,352	0.04
マン島	99,902,614	0.01	
	小計	857,125,776,030	96.80

新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	74,651,598	0.01
	オーストラリア	67,238,834	0.01
	小計	141,890,432	0.02
投資証券	アメリカ	12,646,471,969	1.43
	オーストラリア	901,534,340	0.10
	フランス	345,060,700	0.04
	シンガポール	235,764,539	0.03
	香港	207,744,048	0.02
	イギリス	190,703,557	0.02
	小計	14,527,279,153	1.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,660,631,736	1.54
合計(純資産総額)		885,455,577,351	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	10,224,232,926	1.15
	買建	カナダ	351,529,048	0.04
	買建	ドイツ	1,727,764,822	0.20
	買建	イギリス	722,246,570	0.08
	買建	オーストラリア	356,386,852	0.04

(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		463,780,153	0.05
	売建		732,799,742	0.08

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	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	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,962,318	20,139.26	39,519,643,983	26,781.14	52,553,123,483	5.94

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	567,884	68,333.97	38,805,770,378	76,672.92	43,541,326,546	4.92
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	1,207,785	29,940.74	36,161,981,250	31,229.97	37,719,100,790	4.26
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	767,527	30,583.12	23,473,370,958	34,388.08	26,393,783,025	2.98
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	175,902	96,157.86	16,914,360,118	103,857.42	18,268,728,227	2.06
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	358,530	35,777.41	12,827,275,201	45,208.40	16,208,568,297	1.83
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	467,983	25,747.36	12,049,329,817	29,359.61	13,739,801,502	1.55
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	397,781	25,899.74	10,302,426,188	29,495.56	11,732,773,989	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	232,889	53,284.42	12,409,356,500	47,661.38	11,099,812,431	1.25
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,075	39,362.77	8,820,212,934	44,761.72	10,029,983,686	1.13
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	108,505	75,163.28	8,155,591,911	71,109.63	7,715,751,488	0.87
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	64,676	107,520.46	6,953,993,575	113,548.35	7,343,853,162	0.83
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	138,315	53,753.50	7,434,916,708	52,422.44	7,250,810,466	0.82
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,183	180,540.80	6,171,426,262	176,907.63	6,047,233,790	0.68
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	349,119	15,254.21	5,325,535,553	16,716.74	5,836,131,901	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	65,950	86,056.55	5,675,430,003	83,525.44	5,508,502,959	0.62
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	357,062	14,530.69	5,188,359,676	14,578.97	5,205,596,222	0.59
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	136,252	24,483.99	3,335,993,499	37,437.13	5,100,884,382	0.58
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,929	151,432.13	5,440,805,354	138,560.71	4,978,348,069	0.56
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	195,149	22,779.69	4,445,434,468	24,986.97	4,876,182,482	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	80,488	54,985.40	4,425,665,587	55,585.03	4,473,927,991	0.51
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,886	25,007.91	4,748,653,467	22,838.74	4,336,757,591	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	585,035	6,582.93	3,851,250,053	7,164.74	4,191,626,240	0.47
アメリカ	株式	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	ソフトウェア・サービス	173,464	18,542.88	3,216,523,406	23,694.74	4,110,185,750	0.46
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	143,252	27,361.38	3,919,572,755	28,281.02	4,051,312,806	0.46
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	84,562	44,967.48	3,802,540,800	43,199.75	3,653,057,260	0.41

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	155,927	20,131.79	3,139,090,617	22,940.32	3,577,016,586	0.40
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	131,563	16,849.81	2,216,812,505	26,816.99	3,528,124,826	0.40
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	84,756	36,407.83	3,085,782,625	40,865.63	3,463,607,718	0.39
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,892	112,806.90	3,597,637,939	107,145.62	3,417,088,272	0.39

(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	3.61
		素材	3.10
		資本財	7.63
		商業・専門サービス	1.49
		運輸	1.38
		自動車・自動車部品	1.75
		耐久消費財・アパレル	0.94
		消費者サービス	1.93
		メディア・娯楽	6.98
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.96
		生活必需品流通・小売り	1.74
		食品・飲料・タバコ	2.72
		家庭用品・パーソナル用品	1.25
		ヘルスケア機器・サービス	3.27
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.01
		銀行	6.42
		金融サービス	7.28
		保険	3.01
		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	10.74
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.91		
電気通信サービス	1.17		
公益事業	2.67		
半導体・半導体製造装置	10.52		
不動産管理・開発	0.30		
	小計	96.80	
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.02
投資証券			1.64
合計			98.46

(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	214	アメリカドル	66,720,361.9	9,967,354,864	68,439,875	10,224,232,926	1.15
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	10	カナダドル	3,216,337	347,332,233	3,255,200	351,529,048	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	27	スイスフラン	3,230,849	593,248,493	3,218,130	590,913,030	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	123	ユーロ	6,566,048.6	1,121,152,798	6,657,990	1,136,851,792	0.13
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	17	オーストラリアドル	3,646,544	350,870,463	3,703,875	356,386,852	0.04
	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	40	イギリスポンド	3,583,030	709,189,128	3,649,000	722,246,570	0.08

(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	3,105,000.00	461,349,697	463,780,153	0.05
	アメリカドル	売建	4,220,000.00	625,446,200	630,354,482	0.07
	ユーロ	売建	600,000.00	102,834,000	102,445,260	0.01

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

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

外国株式最小分散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	11,957,593,777	61.54
	スイス	1,263,483,349	6.50
	カナダ	1,026,423,812	5.28
	ドイツ	881,690,517	4.54
	オランダ	389,335,542	2.00
	オーストラリア	345,770,200	1.78
	アイルランド	341,811,065	1.76
	フランス	300,752,442	1.55
	シンガポール	276,084,613	1.42

	香港	252,069,998	1.30
	スペイン	199,531,069	1.03
	イギリス	183,345,278	0.94
	フィンランド	150,718,518	0.78
	イスラエル	130,267,393	0.67
	デンマーク	74,112,701	0.38
	ベルギー	49,668,340	0.26
	イタリア	46,402,752	0.24
	スウェーデン	44,143,060	0.23
	バミューダ	41,309,368	0.21
	ニュージーランド	30,435,856	0.16
	ケイマン	23,108,349	0.12
	オーストリア	8,424,925	0.04
	小計	18,016,482,924	92.72
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	31,045,585	0.16
投資証券	アメリカ	300,232,959	1.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,084,021,343	5.58
合計(純資産総額)		19,431,782,811	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	477,767,893	2.46
	買建	カナダ	281,223,238	1.45

(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(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4,008	66,347.42	265,920,490	76,672.92	307,305,078	1.58
アメリカ	株式	CENCORA INC	ヘルスケア機器・サービス	6,391	42,434.79	271,200,760	43,592.00	278,596,485	1.43
アメリカ	株式	MCKESSON CORP	ヘルスケア機器・サービス	2,534	103,671.55	262,703,717	106,801.89	270,636,012	1.39
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	6,257	44,690.78	279,630,247	43,199.75	270,300,836	1.39

ドイツ	株式	DEUTSCHE TELEKOM	電気通信サービス	49,299	5,523.76	272,315,967	5,434.97	267,938,709	1.38
アメリカ	株式	T-MOBILE US INC	電気通信サービス	7,323	36,418.18	266,690,371	36,089.63	264,284,406	1.36
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	3,691	76,747.61	283,275,460	71,109.63	262,465,681	1.35
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	14,924	16,703.99	249,290,492	17,447.57	260,387,570	1.34
アメリカ	株式	REPUBLIC SERVICES INC	商業・専門サービス	7,407	37,135.36	275,061,658	34,612.16	256,372,337	1.32
カナダ	株式	WASTE CONNECTIONS INC	商業・専門サービス	8,919	29,179.61	260,252,972	28,263.09	252,078,536	1.30
アメリカ	株式	MOTOROLA SOLUTIONS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,664	60,794.48	222,750,997	65,144.49	238,689,438	1.23
アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	ソフトウェア・サービス	2,849	85,223.65	242,802,193	82,514.07	235,082,593	1.21
カナダ	株式	AGNICO EAGLE MINES	素材	12,615	17,656.36	222,735,044	18,433.89	232,543,560	1.20
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	5,859	37,258.02	218,294,757	38,880.24	227,799,334	1.17
アメリカ	株式	WASTE MANAGEMENT INC	商業・専門サービス	6,278	34,796.06	218,449,680	34,734.66	218,064,251	1.12
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	4,748	46,861.32	222,497,568	45,356.29	215,351,702	1.11
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,423	23,042.55	194,087,449	24,986.97	210,465,260	1.08
アメリカ	株式	SOUTHERN CO	公益事業	14,273	13,496.17	192,630,904	14,177.11	202,349,905	1.04
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	48,110	4,158.89	200,084,311	4,108.22	197,646,705	1.02
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	18,457	8,929.04	164,803,297	10,199.60	188,254,058	0.97
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,298	11,370.67	173,948,652	12,212.63	186,828,852	0.96
アメリカ	株式	MARSH & MCLENNAN COS	保険	6,228	33,911.28	211,199,497	29,961.65	186,601,208	0.96
アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	公益事業	12,152	16,074.72	195,340,062	15,325.92	186,240,581	0.96
アメリカ	株式	DUKE ENERGY CORP	公益事業	10,332	17,966.16	185,626,425	17,998.50	185,960,576	0.96
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	28,719	6,516.22	187,139,335	6,364.01	182,768,118	0.94
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	7,822	23,596.36	184,570,753	22,838.74	178,644,649	0.92
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC		7,136	22,308.20	159,191,324	24,855.50	177,368,906	0.91
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	8,087	19,490.97	157,623,538	21,341.85	172,591,585	0.89
アメリカ	株式	WEC ENERGY GROUP INC	公益事業	10,619	16,076.68	170,718,323	16,187.90	171,899,314	0.88
アメリカ	株式	AUTOZONE INC	一般消費財・サービス流通・小売り	297	547,605.77	162,638,916	574,122.20	170,514,294	0.88

(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	0.95
		素材	4.38
		資本財	2.30
		商業・専門サービス	4.84
		運輸	1.59
		自動車・自動車部品	0.17
		耐久消費財・アパレル	0.74
		消費者サービス	2.08
		メディア・娯楽	0.94
		一般消費財・サービス流通・小売り	2.66
		生活必需品流通・小売り	1.29
		食品・飲料・タバコ	6.48
		家庭用品・パーソナル用品	2.71
		ヘルスケア機器・サービス	6.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.61
		銀行	1.61
		金融サービス	4.01
		保険	5.85
		ソフトウェア・サービス	14.05
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.39
電気通信サービス	8.56		
公益事業	7.52		
半導体・半導体製造装置	1.15		
不動産管理・開発	0.58		
	小計	92.72	
新株予約権証券			
投資信託受益証券			0.16
投資証券			1.55
合計			94.42

(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	10	アメリカドル	3,047,726	455,299,786	3,198,125	477,767,893	2.46
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	8	カナダドル	2,538,238	274,104,321	2,604,160	281,223,238	1.45

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

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

外国債券インデックス 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	182,538,934,687	45.11
	中国	45,037,940,298	11.13
	フランス	29,031,168,561	7.17
	イタリア	27,549,729,710	6.81
	ドイツ	22,922,440,194	5.66
	イギリス	22,243,192,165	5.50
	スペイン	17,765,509,330	4.39
	カナダ	7,649,750,075	1.89
	ベルギー	6,011,404,013	1.49
	オランダ	5,228,894,200	1.29
	オーストラリア	4,866,794,889	1.20
	オーストリア	4,514,017,049	1.12
	メキシコ	3,210,607,569	0.79
	ポーランド	2,653,767,350	0.66
	ポルトガル	2,472,614,524	0.61
	マレーシア	2,056,228,818	0.51
	フィンランド	2,030,270,071	0.50
	アイルランド	1,714,661,657	0.42
	シンガポール	1,574,169,832	0.39
	イスラエル	1,463,174,712	0.36
	ニュージーランド	1,110,496,929	0.27
デンマーク	895,558,555	0.22	
スウェーデン	717,665,871	0.18	
ノルウェー	650,154,705	0.16	
	小計	395,909,145,764	97.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,760,803,276	2.16
合計(純資産総額)		404,669,949,040	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	4,011,616,354	0.99
	買建	ドイツ	3,768,385,907	0.93

(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		10,394,203,141	2.57

(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 1.25% 12/31/26	19,030,000	14,293.88	2,720,125,428	14,370.61	2,734,728,540	1.250	2026/12/31	0.68
アメリカ	国債証券	T 0.875% 09/30/26	17,160,000	14,313.13	2,456,134,414	14,393.37	2,469,903,377	0.875	2026/9/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 0.375% 07/31/27	16,100,000	13,823.82	2,225,636,139	13,927.40	2,242,312,688	0.375	2027/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/29	15,200,000	14,140.98	2,149,430,319	14,232.02	2,163,267,568	2.625	2029/7/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.625% 11/30/27	15,500,000	13,756.71	2,132,291,333	13,858.54	2,148,075,014	0.625	2027/11/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/34	13,770,000	14,291.54	1,967,945,902	14,446.77	1,989,320,450	3.875	2034/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/15/26	13,000,000	15,003.77	1,950,490,699	15,004.94	1,950,642,414	4.375	2026/12/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.625% 05/31/28	13,000,000	14,910.40	1,938,352,757	14,834.25	1,928,452,749	3.625	2028/5/31	0.48
アメリカ	国債証券	T 4.375% 07/15/27	12,800,000	15,053.37	1,926,832,220	15,059.21	1,927,579,179	4.375	2027/7/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,967.38	1,903,754,096	14,111.51	1,923,400,110	3.375	2033/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	12,500,000	14,474.39	1,809,299,637	14,538.39	1,817,299,527	1.500	2026/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 1.625% 10/31/26	12,300,000	14,434.80	1,775,481,476	14,493.74	1,782,730,971	1.625	2026/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 3.625% 03/31/30	12,000,000	14,835.12	1,780,215,272	14,731.83	1,767,820,566	3.625	2030/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 4% 02/15/34	11,600,000	14,497.54	1,681,714,744	14,646.93	1,699,043,984	4.000	2034/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,482.07	1,692,954,759	14,532.55	1,698,855,582	2.375	2027/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/31/29	11,000,000	15,198.39	1,671,822,905	15,249.15	1,677,407,527	4.500	2029/5/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/35	10,990,000	15,165.91	1,666,733,564	15,255.28	1,676,556,009	4.625	2035/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.125% 08/31/28	12,030,000	13,645.84	1,641,594,889	13,749.42	1,654,055,672	1.125	2028/8/31	0.41
アメリカ	国債証券	T 3.875% 10/15/27	11,000,000	14,903.98	1,639,438,539	14,925.86	1,641,845,696	3.875	2027/10/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 04/30/29	11,300,000	14,325.97	1,618,835,258	14,406.21	1,627,902,250	2.875	2029/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/33	11,070,000	14,432.47	1,597,674,931	14,577.77	1,613,760,203	3.875	2033/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,131.94	1,582,777,708	14,272.87	1,598,561,706	3.500	2033/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,537.67	1,577,239,189	12,701.35	1,597,831,023	1.375	2031/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 4.375% 08/31/28	10,420,000	15,114.06	1,574,885,719	15,146.74	1,578,290,877	4.375	2028/8/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/31/26	10,800,000	14,339.39	1,548,654,934	14,424.89	1,557,889,039	0.625	2026/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	T 4% 02/28/30	10,350,000	14,906.32	1,542,804,216	14,979.84	1,550,414,361	4.000	2030/2/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,874.38	1,508,877,756	13,030.48	1,527,172,764	1.875	2032/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	10,410,000	14,522.34	1,511,775,804	14,587.11	1,518,518,825	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/34	10,180,000	14,690.40	1,495,483,307	14,839.79	1,510,691,209	4.250	2034/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,994.43	1,499,443,774	14,985.32	1,498,532,435	4.500	2026/7/15	0.37

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.84
合計	97.84

(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	109	アメリカドル	11,805,336.48	1,763,599,217	11,792,437.5	1,761,672,238	0.44
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	買建	69	アメリカドル	7,666,331.1	1,145,273,203	7,659,000	1,144,178,010	0.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	65	アメリカドル	7,405,088.25	1,106,246,133	7,401,875	1,105,766,106	0.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	38	ユーロ	4,071,309.8	695,176,149	4,068,660	694,723,695	0.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	53	ユーロ	6,223,201.3	1,062,611,622	6,213,720	1,060,992,690	0.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	91	ユーロ	11,810,741.1	2,016,684,042	11,787,230	2,012,669,522	0.50

(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	33,510,000.00	4,969,076,511	4,995,868,509	1.23
	カナダドル	買建	3,390,000.00	364,841,041	365,623,026	0.09
	ユーロ	買建	18,920,000.00	3,233,989,529	3,227,888,224	0.80
	イギリスポンド	買建	3,010,000.00	595,155,167	594,629,714	0.15
	オフショア人民元	買建	58,420,000.00	1,205,561,428	1,210,193,668	0.30

(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	台湾	49,411,600,446	18.72
	ケイマン	46,435,288,670	17.59
	インド	43,871,414,162	16.62

	韓国	28,393,395,603	10.75
	中国	28,302,631,318	10.72
	ブラジル	8,800,648,790	3.33
	サウジアラビア	8,799,613,615	3.33
	南アフリカ	7,399,799,395	2.80
	メキシコ	4,625,726,642	1.75
	アラブ首長国連邦	4,434,464,999	1.68
	マレーシア	3,261,385,444	1.24
	インドネシア	2,921,877,594	1.11
	タイ	2,864,183,901	1.08
	ポーランド	2,774,234,508	1.05
	香港	2,219,018,723	0.84
	カタール	2,007,297,080	0.76
	クウェート	2,006,492,379	0.76
	ギリシャ	1,631,255,813	0.62
	トルコ	1,384,545,682	0.52
	フィリピン	1,167,815,195	0.44
	チリ	1,048,563,058	0.40
	バミューダ	1,039,419,562	0.39
	ハンガリー	793,293,326	0.30
	イギリス	706,240,817	0.27
	アメリカ	684,717,696	0.26
	ルクセンブルク	464,944,582	0.18
	チェコ	423,068,028	0.16
	コロンビア	296,791,782	0.11
	オランダ	176,160,688	0.07
	エジプト	136,385,248	0.05
	シンガポール	95,264,333	0.04
	ペルー	94,340,233	0.04
	ロシア	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	258,671,879,312	97.98
新株予約権証券	マレーシア	-	-
投資信託受益証券	ブラジル	411,694,874	0.16
	メキシコ	121,674,573	0.05
	小計	533,369,447	0.20
投資証券	メキシコ	247,399,068	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,552,834,314	1.72
合計(純資産総額)		264,005,482,141	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	4,512,806,732	1.71

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		1,798,643	0.00
	売建		1,558,166,525	0.59

(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	4,766,389	5,443.93	25,947,908,326	5,803.87	27,663,525,957	10.48
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,244,300	8,054.39	10,022,089,173	10,441.98	12,992,955,714	4.92
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売	3,315,888	1,814.69	6,017,335,985	2,227.24	7,385,285,021	2.80
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	922,794	6,132.49	5,659,026,144	7,819.02	7,215,344,742	2.73
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	1,101,464	3,017.01	3,323,136,343	3,463.77	3,815,224,568	1.45
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	3,298,400	609.59	2,010,674,954	1,041.34	3,434,772,348	1.30
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	104,819	21,515.59	2,255,243,397	28,378.94	2,974,653,160	1.13
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	18,360,620	118.11	2,168,649,943	155.77	2,860,103,548	1.08
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,185,776	2,195.52	2,603,397,668	2,410.92	2,858,821,746	1.08
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	1,023,868	2,161.19	2,212,783,218	2,533.70	2,594,181,519	0.98
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	964,050	3,596.87	3,467,570,178	2,423.14	2,336,035,829	0.88
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売	134,681	17,428.93	2,347,345,876	16,869.11	2,271,949,789	0.86
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	2,443,248	1,078.49	2,635,040,525	861.78	2,105,560,586	0.80
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	297,804	6,468.55	1,926,362,744	6,934.50	2,065,121,838	0.78

インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	651,722	3,113.91	2,029,409,705	2,597.57	1,692,897,100	0.64
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	502,386	2,701.39	1,357,143,799	3,302.26	1,659,012,458	0.63
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	720,000	1,908.89	1,374,404,708	2,299.51	1,655,652,960	0.63
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	33,931.64	1,106,103,643	47,095.26	1,535,211,383	0.58
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,568,515	92.62	1,164,188,867	115.07	1,446,271,590	0.55
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	382,348	3,749.21	1,433,504,448	3,771.49	1,442,023,570	0.55
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,318,000	940.03	1,238,963,604	1,070.82	1,411,348,668	0.53
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	343,430	2,315.68	795,275,700	3,902.90	1,340,374,321	0.51
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,474,200	71.70	966,172,901	87.11	1,173,759,121	0.44
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	1,182,457	1,108.94	1,311,282,564	967.41	1,143,930,659	0.43
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	468,311	2,928.86	1,371,620,911	2,413.63	1,130,333,225	0.43
ケイマン	株式	TRIP.COM GROUP LTD	消費者サービス	119,857	9,925.48	1,189,639,010	9,392.07	1,125,706,053	0.43
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	590,000	2,173.15	1,282,161,356	1,885.30	1,112,328,062	0.42
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	165,389	5,086.24	841,208,690	6,321.98	1,045,587,604	0.40
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	自動車・自動車部品	185,509	5,055.52	937,846,148	5,482.17	1,016,992,709	0.39
台湾	株式	DELTA ELECTRONICS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	377,903	2,010.89	759,922,891	2,663.25	1,006,450,165	0.38

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.14
		素材	5.78
		資本財	4.88
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	1.76
		自動車・自動車部品	3.59
		耐久消費財・アパレル	1.08
		消費者サービス	2.26
		メディア・娯楽	7.14
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.68
		生活必需品流通・小売り	1.07
		食品・飲料・タバコ	2.66
		家庭用品・パーソナル用品	0.53

	ヘルスケア機器・サービス	0.67
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.76
	銀行	17.66
	金融サービス	2.61
	保険	3.05
	ソフトウェア・サービス	1.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.55
	電気通信サービス	2.64
	公益事業	2.38
	半導体・半導体製造装置	13.64
	不動産管理・開発	1.51
	小計	97.98
新株予約権証券		
投資信託受益証券		0.20
投資証券		0.09
合計		98.28

(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	485	アメリカドル	29,621,425	4,425,144,680	30,208,225	4,512,806,732	1.71

(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	12,045.37	1,793,796	1,798,643	0.00
	アメリカドル	売建	8,000,000.00	1,185,680,000	1,194,984,800	0.45
	香港ドル	売建	19,000,000.00	358,720,000	361,374,300	0.14
	カタールリアル	売建	43,965.60	1,793,796	1,807,425	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	インドネシア	17,419,495,807	9.88

マレーシア	17,360,402,027	9.85
メキシコ	17,337,157,830	9.83
中国	17,293,185,526	9.81
インド	17,066,962,061	9.68
タイ	15,155,356,181	8.59
ポーランド	12,745,875,733	7.23
南アフリカ	12,447,966,652	7.06
ブラジル	11,163,699,014	6.33
チェコ	8,544,803,165	4.85
コロンビア	6,025,556,651	3.42
ルーマニア	5,480,291,235	3.11
ハンガリー	3,816,347,031	2.16
ペルー	3,303,797,728	1.87
チリ	2,900,441,401	1.64
トルコ	2,134,013,670	1.21
ドミニカ共和国	489,985,479	0.28
ウルグアイ	269,477,916	0.15
小計	170,954,815,107	96.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	5,374,855,617	3.05
合計(純資産総額)	176,329,670,724	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		1,396,876,780	0.79

(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% 07/01/26	90,000,000	2,190.26	1,971,242,490	2,364.41	2,127,977,251	0.000	2026/7/1	1.21
マレーシア	国債証券	MGS 3.906% 07/15/26	51,600,000	3,536.71	1,824,945,765	3,543.29	1,828,340,479	3.906	2026/7/15	1.04
マレーシア	国債証券	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000	3,824.83	1,671,452,962	3,980.73	1,739,581,745	4.893	2038/6/8	0.99
マレーシア	国債証券	MGS 2.632% 04/15/31	50,600,000	3,277.55	1,658,444,868	3,391.89	1,716,296,352	2.632	2031/4/15	0.97
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	221,800,000	724.50	1,606,941,721	752.83	1,669,792,071	7.750	2031/5/29	0.95

メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 03/01/29	204,000,000	756.52	1,543,306,367	789.03	1,609,622,243	8.500	2029/3/1	0.91
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	179,700,000	865.31	1,554,977,291	860.59	1,546,496,803	10.500	2026/12/21	0.88
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	191,000,000	752.63	1,437,542,099	785.08	1,499,514,394	8.875	2035/2/28	0.85
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	195,000,000	723.20	1,410,254,779	762.42	1,486,719,789	5.500	2027/3/4	0.84
メキシコ	国債証券	MBONO 7% 09/03/26	180,600,000	754.83	1,363,236,536	784.08	1,416,061,823	7.000	2026/9/3	0.80
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	169,600,000	791.44	1,342,289,702	822.15	1,394,381,775	8.000	2030/1/31	0.79
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	36,900,000	3,560.03	1,313,653,431	3,715.61	1,371,061,988	2.750	2029/10/25	0.78
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	53,800,000	2,538.94	1,365,952,621	2,546.96	1,370,266,176	10.000	2027/1/1	0.78
ポーランド	国債証券	POLGB 6% 10/25/33	30,100,000	4,097.89	1,233,467,298	4,207.35	1,266,414,406	6.000	2033/10/25	0.72
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/23/34	176,100,000	683.18	1,203,092,109	718.30	1,264,932,180	7.750	2034/11/23	0.72
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,453.47	1,261,086,569	2,442.65	1,255,525,192	10.000	2029/1/1	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	159,000,000	753.57	1,198,182,958	784.28	1,247,006,746	7.500	2027/6/3	0.71
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	59,500,000	1,945.50	1,157,577,625	2,095.45	1,246,797,468	0.000	2027/7/1	0.71
ポーランド	国債証券	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000	4,302.08	1,226,094,967	4,335.93	1,235,742,592	7.500	2028/7/25	0.70
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000	757.25	1,170,718,276	788.56	1,219,121,877	8.500	2029/5/31	0.69
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	151,000,000	766.71	1,157,736,105	803.43	1,213,182,783	8.250	2032/3/31	0.69
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000	2.38	1,288,918,779	2.23	1,210,029,509	7.250	2050/10/26	0.69
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/29	69,000,000	1,702.04	1,174,414,089	1,741.49	1,201,633,520	0.000	2029/1/1	0.68
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	183,000,000	639.41	1,170,138,189	652.23	1,193,585,889	7.750	2042/11/13	0.68
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	174,700,000	669.03	1,168,809,561	676.33	1,181,557,570	8.750	2048/2/28	0.67
南アフリカ	国債証券	SAGB 9% 01/31/40	161,300,000	704.60	1,136,527,704	724.73	1,169,003,296	9.000	2040/1/31	0.66
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	159,200,000	704.91	1,122,222,543	731.06	1,163,850,181	8.500	2037/1/31	0.66
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/31	49,850,000	2,344.61	1,168,788,932	2,319.63	1,156,338,253	10.000	2031/1/1	0.66
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 11/07/47	175,700,000	646.61	1,136,109,835	654.88	1,150,627,016	8.000	2047/11/7	0.65
マレーシア	国債証券	MGS 4.696% 10/15/42	29,200,000	3,773.76	1,101,938,367	3,933.16	1,148,484,123	4.696	2042/10/15	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.95
合計	96.95

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

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	28,830,000.00	225,213,499	227,468,700	0.13
	トルコリラ	買建	8,160,000.00	28,914,600	29,466,576	0.02
	チェココルナ	買建	16,170,000.00	112,218,687	112,033,845	0.06
	ハンガリーフォリント	買建	118,510,000.00	50,677,443	50,518,205	0.03
	ポーランドズロチ	買建	4,190,000.00	168,118,528	166,965,634	0.09
	マレーシアリングギット	買建	6,440,000.00	222,594,656	225,708,476	0.13
	タイバーツ	買建	43,120,000.00	194,243,382	196,359,856	0.11
	南アフリカランド	買建	19,710,000.00	161,835,417	163,179,090	0.09
	オフショア人民元	買建	10,870,000.00	222,388,645	225,176,398	0.13

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

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

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	101,041,100,900	97.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,225,697,896	2.16
合計(純資産総額)		103,266,798,796	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	2,207,816,000	2.14

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	55,381	129,467.86	7,170,059,554	138,700	7,681,344,700	7.44
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	47,947	112,349.65	5,386,828,668	122,900	5,892,686,300	5.71
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	48,476	92,208.05	4,469,877,431	110,100	5,337,207,600	5.17
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	29,748	141,057.33	4,196,173,452	159,400	4,741,831,200	4.59
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	27,222	147,548.09	4,016,554,105	162,500	4,423,575,000	4.28
日本	投資証券	GLP投資法人	30,717	128,726.37	3,954,087,907	132,400	4,066,930,800	3.94

日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	48,057	81,528.56	3,918,018,007	81,700	3,926,256,900	3.80
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	14,695	233,232.52	3,427,351,881	253,100	3,719,304,500	3.60
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	18,601	160,930	2,993,458,930	197,800	3,679,277,800	3.56
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	51,533	63,386.55	3,266,499,081	67,200	3,463,017,600	3.35
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,640	139,346.62	2,876,114,236	165,800	3,422,112,000	3.31
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	19,223	151,417.67	2,910,701,870	156,100	3,000,710,300	2.91
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,351	68,644.1	2,357,993,479	82,900	2,847,697,900	2.76
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	25,247	84,162.75	2,124,856,949	99,300	2,507,027,100	2.43
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	27,886	73,715.33	2,055,625,692	78,500	2,189,051,000	2.12
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	17,093	114,543.45	1,957,891,190	123,700	2,114,404,100	2.05
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	20,614	99,495.82	2,051,006,833	101,400	2,090,259,600	2.02
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	16,117	117,892.13	1,900,067,459	118,400	1,908,252,800	1.85
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	14,414	109,349.1	1,576,157,927	129,300	1,863,730,200	1.80
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,203	143,889.73	1,755,886,375	143,900	1,756,011,700	1.70
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	18,615	91,172.79	1,697,181,485	93,800	1,746,087,000	1.69
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	10,978	127,409.9	1,398,705,882	136,600	1,499,594,800	1.45
日本	投資証券	イオンリート投資法人	11,336	126,415.55	1,433,046,674	128,900	1,461,210,400	1.41
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	16,407	80,807.93	1,325,815,707	86,100	1,412,642,700	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	13,788	91,290.21	1,258,709,415	102,400	1,411,891,200	1.37
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,733	288,911.67	1,367,418,934	297,000	1,405,701,000	1.36
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,249	132,325.21	1,091,550,657	165,000	1,361,085,000	1.32
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	3,814	304,766.63	1,162,379,926	351,000	1,338,714,000	1.30
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	17,994	61,418.96	1,105,172,766	73,500	1,322,559,000	1.28
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	6,259	155,659.45	974,272,497	196,900	1,232,397,100	1.19

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.84
合計	97.84

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	1,196円		2,111,939,730	2,207,816,000	2.14

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	112,213,761,861	77.42
	オーストラリア	11,337,281,934	7.82
	イギリス	6,102,823,350	4.21
	シンガポール	4,854,069,810	3.35
	フランス	3,019,408,101	2.08
	カナダ	1,929,768,630	1.33
	香港	1,531,676,807	1.06
	ベルギー	1,492,853,951	1.03
	スペイン	747,374,635	0.52
	韓国	249,030,283	0.17
	オランダ	248,947,210	0.17
	ガンジー	239,413,481	0.17
	イスラエル	225,618,472	0.16
	ニュージーランド	124,060,397	0.09
	アイルランド	60,593,834	0.04
	ドイツ	45,334,969	0.03
	イタリア	18,635,945	0.01
	小計	144,440,653,670	99.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		502,560,169	0.35
合計(純資産総額)		144,943,213,839	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	買建	アメリカ	499,325,617	0.34

(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		67,203,192	0.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	406,815	20,817.49	8,468,869,838	24,855.50	10,111,593,568	6.98
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	607,639	17,182.83	10,440,962,378	16,207.32	9,848,200,386	6.79
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	64,030	136,366.17	8,731,526,493	119,069.80	7,624,039,653	5.26
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	207,133	26,903.64	5,572,632,721	26,486.84	5,486,300,080	3.79
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	590,869	8,566.02	5,061,397,208	8,483.85	5,012,848,752	3.46
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	200,657	26,494.31	5,316,270,066	24,718.06	4,959,853,652	3.42
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,328,686	3,401.37	4,519,362,000	3,364.81	4,470,780,457	3.08
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	103,264	49,941.07	5,157,115,375	43,121.42	4,452,890,676	3.07
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	692,910	4,693.19	3,251,961,869	4,859.65	3,367,304,724	2.32
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	139,188	24,743.08	3,443,939,985	22,309.90	3,105,270,723	2.14
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	296,077	9,708.68	2,874,518,899	9,931.44	2,940,473,093	2.03
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	193,555	17,545.17	3,395,956,818	14,632.75	2,832,242,023	1.95
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	93,283	34,533.20	3,221,361,259	29,326.75	2,735,687,304	1.89
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	225,702	10,901.53	2,460,499,088	9,755.16	2,201,760,702	1.52
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	374,507	5,017.12	1,878,948,363	4,687.85	1,755,635,711	1.21
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	76,918	23,721.42	1,824,604,695	22,227.73	1,709,713,159	1.18
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	42,132	45,161.08	1,902,726,854	40,105.23	1,689,713,946	1.17
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	442,679	3,678.35	1,628,330,058	3,271.64	1,448,286,766	1.00
香港	投資証券	LINK REIT	1,692,600	693.20	1,173,313,245	844.48	1,429,380,389	0.99
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	78,514	18,702.37	1,468,398,390	17,418.87	1,367,625,473	0.94
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	143,756	8,537.31	1,227,290,131	9,511.66	1,367,358,382	0.94
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,427,980	332.82	1,140,909,362	362.74	1,243,497,688	0.86
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	179,843	7,407.77	1,332,237,054	6,831.60	1,228,616,284	0.85
アメリカ	投資証券	UDR INC	198,469	6,589.34	1,307,780,637	5,944.22	1,179,745,007	0.81
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	100,747	16,558.29	1,668,198,650	11,656.90	1,174,397,876	0.81
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	69,912	18,074.80	1,263,646,103	16,749.60	1,170,998,511	0.81
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	454,612	3,352.69	1,524,176,836	2,572.49	1,169,487,461	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	106,909	11,039.25	1,180,195,240	10,802.39	1,154,872,809	0.80
イギリス	投資証券	SEGR0 PLC	890,973	1,523.54	1,357,441,687	1,275.85	1,136,753,941	0.78
アメリカ	投資証券	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	190,686	6,070.77	1,157,612,177	5,800.81	1,106,133,961	0.76

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.65
合計	99.65

(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

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 (%)
-------	----	-----	-------	-----------	----	----	----------------	-------------	----------------	-------------	-----------------

不動産 投信指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ商品 取引所	DJ US REIT	買建	91	アメリカ ドル	3,313,340.3	494,979,907	3,342,430	499,325,617	0.34
-------------------------	----------	--------------	------------	----	----	------------	-------------	-------------	-----------	-------------	------

(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	450,000.00	67,016,400	67,203,192	0.05

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	48,585,620,361	100.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		397,307,954	0.82
合計(純資産総額)		48,188,312,407	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		49,364,766,135	102.44

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST	5,277,941	9,339.86	49,295,244,806	9,205.41	48,585,620,361	100.82

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	100.82
合計	100.82

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	331,681,931.92	49,364,522,983	49,364,766,135	102.44

(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。

HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	1,198,856,400	37.35
投資信託受益証券	アメリカ	418,105,740	13.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,592,563,502	49.62
合計(純資産総額)		3,209,525,642	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	795,828,540	24.80
	買建	ドイツ	207,905,200	6.48
	買建	イギリス	252,786,299	7.88
	売建	ドイツ	262,628,013	8.18
債券先物取引	売建	アメリカ	165,822,900	5.17

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		1,224,496,963	38.15

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第1263回国庫短期証券	1,200,000,000	99.89	1,198,734,000	99.90	1,198,856,400		2025/10/20	37.35
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	21,680	13,682.63	296,639,420	13,870.86	300,720,277			9.37
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GSCI COMMODITY DYNAM	29,151	3,919.99	114,271,733	4,026.80	117,385,463			3.66

(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。

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	37.35
投資信託受益証券	13.03
合計	50.38

(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(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMIN	買建	7	アメリカドル	2,206,137.5	329,574,881	2,238,687.5	334,437,526	10.42
	アメリカ	シカゴ商品取引所	RUSS2000EMIN	買建	22	アメリカドル	2,463,560	368,031,228	2,465,650	368,343,453	11.48
	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	10	アメリカドル	624,550	93,301,524	622,850	93,047,561	2.90
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	売建	12	スイスフラン	1,428,360	262,275,463	1,430,280	262,628,013	8.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DAX INDEX FU	買建	2	ユーロ	1,208,650	206,376,987	1,217,600	207,905,200	6.48
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	14	イギリスポンド	1,252,790	247,964,724	1,277,150	252,786,299	7.88	
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	10	アメリカドル	1,106,250	165,262,687	1,110,000	165,822,900	5.17

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

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

種類	資産の名称	買建/売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	5,436,000.00	804,731,850	810,797,882	25.26
	カナダドル	売建	70,000.00	7,573,125	7,551,866	0.24
	ユーロ	売建	1,085,000.00	186,956,350	185,143,315	5.77
	イギリスポンド	売建	493,000.00	97,798,283	97,434,301	3.04
	スイスフラン	売建	654,000.00	121,057,885	120,103,241	3.74

スウェーデンクローナ	売建	227,000.00	3,460,047	3,466,358	0.11
------------	----	------------	-----------	-----------	------

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

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

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	11,647,952,100	48.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,174,955,623	51.11
合計(純資産総額)		23,822,907,723	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	ドイツ	8,957,485,237	37.60
	買建	イギリス	13,277,085,021	55.73
	売建	日本	5,245,140,000	22.02
	売建	アメリカ	8,738,866,830	36.68

(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		9,822,097,634	41.23
	売建		12,399,614,340	52.05

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第1300回国庫短期証券	7,000,000,000	99.47	6,963,152,000	99.60	6,972,217,000		2026/4/20	29.27
日本	国債証券	第1319回国庫短期証券	3,000,000,000	99.38	2,981,583,000	99.38	2,981,493,000		2026/7/21	12.52
日本	国債証券	第1294回国庫短期証券	1,700,000,000	99.38	1,689,511,000	99.66	1,694,242,100		2026/3/23	7.11

(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	48.89
合計	48.89

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	日本	大阪取引所	長期国債標準物先物	売建	38	円	5,247,717,460	5,247,717,460	5,245,140,000	5,245,140,000	22.02
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	527	アメリカドル	58,711,385.43	8,770,893,869	58,497,000	8,738,866,830	36.68
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	405	ユーロ	52,630,160.5	8,986,599,905	52,459,650	8,957,485,237	37.60
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	LONG GILT FU	買建	730	イギリスポンド	67,491,805	13,358,652,964	67,079,700	13,277,085,021	55.73

(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	16,416,000.00	2,403,888,387	2,448,226,423	10.28
	カナダドル	買建	3,727,000.00	400,735,051	402,054,597	1.69
	ユーロ	買建	20,456,000.00	3,501,799,636	3,490,427,736	14.65
	イギリスポンド	買建	2,580,000.00	510,806,149	509,845,409	2.14
	ノルウェークローネ	買建	205,159,000.00	2,966,598,173	2,971,543,469	12.47
	スイスフラン	売建	28,206,000.00	5,189,609,583	5,179,916,252	21.74
	スウェーデンクローナ	売建	168,573,000.00	2,589,592,843	2,574,059,133	10.80
	オーストラリアドル	売建	3,889,000.00	373,683,509	373,676,509	1.57
	ニュージーランドドル	売建	48,500,000.00	4,272,968,638	4,271,962,446	17.93

(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。

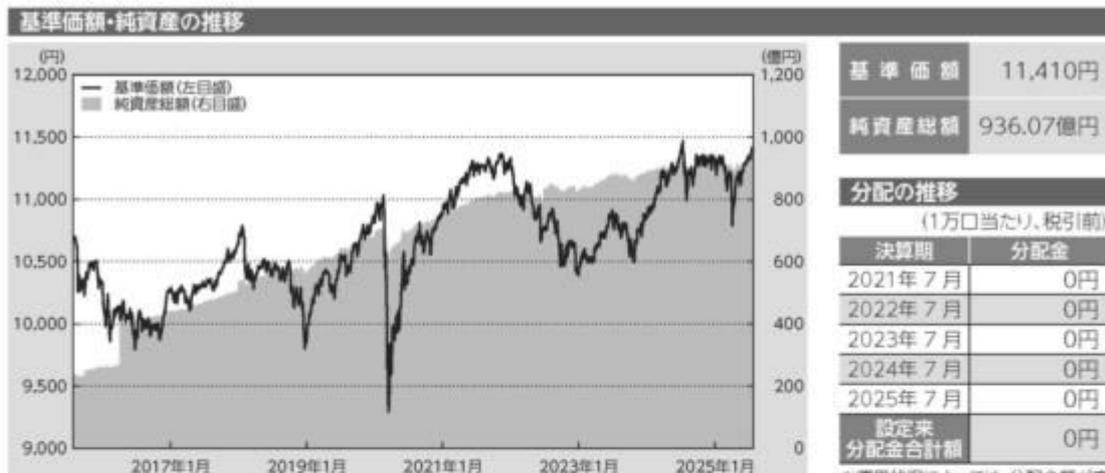
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

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：2013年3月29日
作成基準日：2025年7月31日

分散投資コア戦略ファンドA


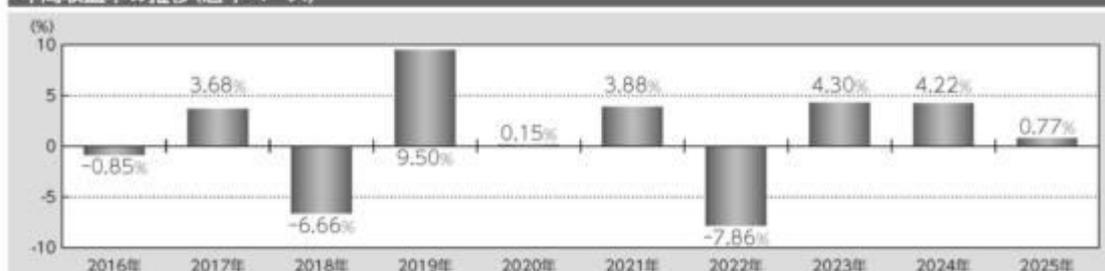
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
国内債券インデックス マザーファンド	26.8%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	17.7%
外国株式インデックス マザーファンド	9.5%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.0%
国内株式インデックス マザーファンド	5.5%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.7%
外国債券インデックス マザーファンド	3.4%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	3.0%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	2.7%
J-REITインデックス マザーファンド	2.7%

※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)


※2025年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

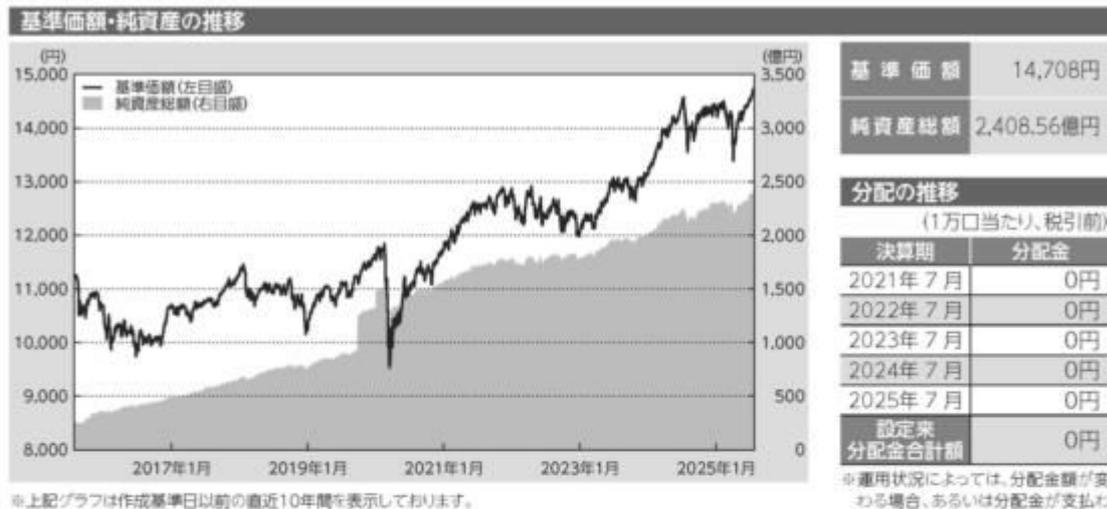
記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

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

当初設定日：2013年3月29日

作成基準日：2025年7月31日

分散投資コア戦略ファンドS

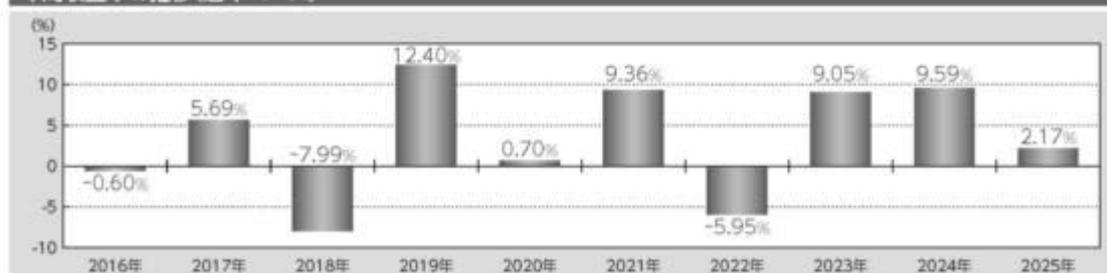


主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	18.5%
国内債券インデックス マザーファンド	16.2%
外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	10.5%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	7.9%
国内株式インデックス マザーファンド	7.9%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	5.1%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.1%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	3.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	2.8%
外国債券インデックス マザーファンド	2.7%

※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)



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 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

1口以上1口単位とします。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

<一部解約代金の支払い>

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

益者に支払われます。

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

< 受付不可日 >

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

< お問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

イ．内国投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

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

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

ハ．外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

ニ．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。

ホ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

（イ）国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

（海外REITを含みます。）（上場には店頭登録を含みます。）

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

（ハ）公社債等（仕組債を含みます。）

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

（ニ）株価指数先物取引

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

（ホ）債券先物取引

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

ヘ．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。（2013年 3月29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7月11日から翌年7月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年3月29日から2013年7月10日までとします。

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・ 受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・ やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

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

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管

理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

販売会社は、毎決算日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1【財務諸表】

【分散投資コア戦略ファンドA】

(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13期計算期間(2024年7月11日から2025年7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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期 (2025年 7月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,430,586,544	1,507,086,249
投資信託受益証券	9,894,177,256	7,802,836,209
投資証券	-	3,585,128,541
親投資信託受益証券	81,074,372,629	80,133,530,410
未収入金	90,000,000	200,000,000
未収利息	2,638	19,285
流動資産合計	92,489,139,067	93,228,600,694
資産合計	92,489,139,067	93,228,600,694
負債の部		
流動負債		
未払解約金	100,885,295	124,821,720
未払受託者報酬	24,627,091	24,920,614
未払委託者報酬	394,033,301	398,239,151
その他未払費用	984,621	985,137
流動負債合計	520,530,308	548,966,622
負債合計	520,530,308	548,966,622
純資産の部		
元本等		
元本	80,685,550,098	81,890,422,612
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	11,283,058,661	10,789,211,460
(分配準備積立金)	7,000,854,528	7,110,891,051
元本等合計	91,968,608,759	92,679,634,072
純資産合計	91,968,608,759	92,679,634,072
負債純資産合計	92,489,139,067	93,228,600,694

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 至	2023年 7月11日 2024年 7月10日	自 至	2024年 7月11日 2025年 7月10日
営業収益				
受取配当金		-		8,422,471
受取利息		280,380		4,385,526
有価証券売買等損益		5,838,894,841		184,918,623
その他収益		2,001		-
営業収益合計		5,839,177,222		197,726,620
営業費用				
支払利息		316,609		-
受託者報酬		48,788,272		50,254,322
委託者報酬		780,612,154		803,578,302
その他費用		1,972,780		1,986,953
営業費用合計		831,689,815		855,819,577
営業利益又は営業損失（ ）		5,007,487,407		658,092,957
経常利益又は経常損失（ ）		5,007,487,407		658,092,957
当期純利益又は当期純損失（ ）		5,007,487,407		658,092,957
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（ ）		176,343,053		105,336,957
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,331,586,998		11,283,058,661
剰余金増加額又は欠損金減少額		819,632,576		1,018,164,198
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		819,632,576		1,018,164,198
剰余金減少額又は欠損金増加額		699,305,267		959,255,399
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		699,305,267		959,255,399
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,283,058,661		10,789,211,460

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
	(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
	(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期 (2025年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,685,550,098口	81,890,422,612口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1398円 (11,398円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1318円 (11,318円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日			第13期 自 2024年 7月11日 至 2025年 7月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,162,981,337円	費用控除後の配当等収益額	A	679,258,649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	511,477,244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	- 円
収益調整金額	C	5,312,736,445円	収益調整金額	C	6,072,207,088円
分配準備積立金額	D	5,326,395,947円	分配準備積立金額	D	6,431,632,402円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,313,590,973円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,183,098,139円
当ファンドの期末残存口数	F	80,685,550,098口	当ファンドの期末残存口数	F	81,890,422,612口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,526円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,609円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 2024年 7月11日 至 2025年 7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。 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13期 (2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第12期	第13期
	自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日	自 2024年 7月11日 至 2025年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	81,087,575,188円	80,685,550,098円
期中追加設定元本額	8,522,680,283円	8,095,974,966円
期中一部解約元本額	8,924,705,373円	6,891,102,452円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期	第13期
	(2024年 7月10日現在)	(2025年 7月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券	138,943,370	368,318,760
投資証券	-	14,468,541
親投資信託受益証券	5,264,490,077	824,569,269
合計	5,403,433,447	470,719,050

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	2,497,870,900	1,979,312,901	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	2,337,733,486	2,379,812,688	
	FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	2,150,222,205	2,364,169,314	

	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイ ドリンクファンド(適格機関投資家専用)	1,137,077,424	1,079,541,306	
投資信託受益証券合計		8,122,904,015	7,802,836,209	
投資証券	Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged	1,325,445.847	1,370,325,443	
	Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I(acc) JPY	2,235,910.09	2,214,803,098	
投資証券合計		3,561,355.937	3,585,128,541	
親投資信託受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,066,487,955	2,377,521,598	
	グローバルREITインデックス マザー ファンド	1,398,631,227	4,287,923,615	
	新興国株式インデックス マザーファンド	266,005,185	1,349,949,713	
	国内株式インデックス マザーファンド	1,636,908,834	4,905,815,775	
	外国株式インデックス マザーファンド	1,205,130,404	8,930,257,319	
	国内債券インデックス マザーファンド	18,906,344,545	23,816,322,223	
	外国債券インデックス マザーファンド	860,374,363	3,156,455,425	
	新興国債券インデックス マザーファンド	650,842,343	1,590,072,928	
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	3,010,680,362	5,714,572,395	
	日本株式最小分散インデックスマザー ファンド	671,130,251	1,187,162,300	
	HFRリターン・ターゲット・マザー ファンド(為替ヘッジあり)	1,058,847,884	988,222,730	
	外国株式最小分散インデックスマ ザーファンド	992,309,611	2,483,354,032	
	外国債券インデックスマザー ファンド(為替ヘッジあり)	20,350,131,725	16,632,162,658	
	GBCAマザーファンド(ミドル リスク型)	2,532,180,367	2,713,737,699	
親投資信託受益証券合計		54,606,005,056	80,133,530,410	
合計			91,521,495,160	

(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。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(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13期計算期間(2024年7月11日から2025年7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)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期 (2025年 7月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,522,250,945	3,923,924,597
投資信託受益証券	29,136,083,307	24,252,841,232
投資証券	-	8,892,999,958
親投資信託受益証券	192,082,585,348	201,445,388,275
未収入金	200,000,000	400,000,000
未収利息	6,495	50,212
流動資産合計	224,940,926,095	238,915,204,274
資産合計	224,940,926,095	238,915,204,274
負債の部		
流動負債		
未払解約金	234,491,087	254,539,160
未払受託者報酬	58,172,317	62,476,742
未払委託者報酬	930,756,954	997,834,187
その他未払費用	1,320,066	1,359,799
流動負債合計	1,224,740,424	1,316,209,888
負債合計	1,224,740,424	1,316,209,888
純資産の部		
元本等		
元本	154,405,890,154	163,665,456,441
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	69,310,295,517	73,933,537,945
(分配準備積立金)	44,187,923,836	42,093,979,380
元本等合計	223,716,185,671	237,598,994,386
純資産合計	223,716,185,671	237,598,994,386
負債純資産合計	224,940,926,095	238,915,204,274

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 至	2023年 7月11日 2024年 7月10日	自 至	2024年 7月11日 2025年 7月10日
営業収益				
受取配当金		-		17,739,341
受取利息		683,873		12,222,863
有価証券売買等損益		26,683,359,636		2,669,798,930
その他収益		2,148		-
営業収益合計		26,684,045,657		2,699,761,134
営業費用				
支払利息		719,035		-
受託者報酬		112,367,373		123,903,717
委託者報酬		1,797,877,795		1,980,665,657
その他費用		2,608,664		2,722,551
営業費用合計		1,913,572,867		2,107,291,925
営業利益又は営業損失（ ）		24,770,472,790		592,469,209
経常利益又は経常損失（ ）		24,770,472,790		592,469,209
当期純利益又は当期純損失（ ）		24,770,472,790		592,469,209
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（ ）		886,683,099		367,547,715
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		43,277,079,987		69,310,295,517
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,396,100,907		9,752,925,164
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,396,100,907		9,752,925,164
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,246,675,068		6,089,699,660
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,246,675,068		6,089,699,660
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		69,310,295,517		73,933,537,945

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
	(2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
	(3)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期 (2025年 7月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	154,405,890,154口	163,665,456,441口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4489円 (14,489円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4517円 (14,517円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日			第13期 自 2024年 7月11日 至 2025年 7月10日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,953,624,249円	費用控除後の配当等収益額	A	1,542,510,658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	20,930,165,442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	- 円
収益調整金額	C	25,122,371,681円	収益調整金額	C	31,839,558,565円
分配準備積立金額	D	20,304,134,145円	分配準備積立金額	D	40,551,468,722円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	69,310,295,517円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,933,537,945円
当ファンドの期末残存口数	F	154,405,890,154口	当ファンドの期末残存口数	F	163,665,456,441口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,488円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	4,517円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金額	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13期 自 2024年 7月11日 至 2025年 7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。 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13期 (2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第12期	第13期
	自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日	自 2024年 7月11日 至 2025年 7月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	150,743,580,465円	154,405,890,154円
期中追加設定元本額	18,352,523,646円	22,882,394,011円
期中一部解約元本額	14,690,213,957円	13,622,827,724円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期	第13期
	(2024年 7月10日現在)	(2025年 7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)
投資信託受益証券	473,595,303	2,098,322,094
投資証券	-	15,339,958
親投資信託受益証券	25,061,586,792	5,640,124,802
合計	25,535,182,095	3,557,142,666

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	8,783,678,246	6,960,186,642	
	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,537,363,830	5,637,036,378	
	F O F s 用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	5,104,036,359	5,611,887,976	

	F O F s用MAN AHL ダイバーシファイ ド リンクファンド（適格機関投資家専用）	6,365,841,833	6,043,730,236
投資信託受益証券合計		25,790,920,268	24,252,841,232
投資証券	Neuberger Berman Event Driven Fund JPY I Accumulating Class - Hedged	3,254,965.508	3,365,178,640
	Franklin K2 Athena Risk Premia Enhanced SP I(acc) JPY	5,580,501.25	5,527,821,318
投資証券合計		8,835,466.758	8,892,999,958
親投資信託受益証券	J - R E I Tインデックス マザーファンド	2,183,883,081	4,868,530,552
	グローバルR E I Tインデックス マザー ファンド	3,899,032,670	11,953,654,359
	新興国株式インデックス マザーファンド	1,256,430,541	6,376,259,352
	国内株式インデックス マザーファンド	6,070,743,368	18,194,017,873
	外国株式インデックス マザーファンド	5,940,445,804	44,019,891,496
	国内債券インデックス マザーファンド	27,833,258,073	35,061,555,194
	外国債券インデックス マザーファンド	1,730,938,568	6,350,294,324
	新興国債券インデックス マザーファンド	1,312,489,912	3,206,544,104
	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	10,218,627,046	19,395,975,996
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,549,900,694	4,510,519,337
	H Fリターン・ターゲット・マザーファンド （為替ヘッジあり）	2,367,601,616	2,209,682,588
	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	4,881,919,021	12,217,490,541
	外国債券インデックスマザーファンド（為替 ヘッジあり）	31,144,706,411	25,454,568,549
	G B C Aマザーファンド（ミドルリスク型）	7,116,174,312	7,626,404,010
親投資信託受益証券合計		108,506,151,117	201,445,388,275
合計			234,591,229,465

(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

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	26,749,355,976
株式	742,288,474,850

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	53,530,750
未収入金	114,300,586
未収配当金	1,209,047,501
未収利息	342,296
その他未収収益	12,975,817
差入委託証拠金	388,781,860
流動資産合計	770,816,809,636
資産合計	770,816,809,636
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,148,400
前受金	30,549,000
未払解約金	159,232,074
未払利息	2,156,567
受入担保金	17,449,991,053
流動負債合計	17,665,077,094
負債合計	17,665,077,094
純資産の部	
元本等	
元本	251,300,064,379
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	501,851,668,163
元本等合計	753,151,732,542
純資産合計	753,151,732,542
負債純資産合計	770,816,809,636

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	251,300,064,379口
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	株式 16,460,189,200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 2.9970円 (1万口当たり純資産額) (29,970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

	2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	233,103,107,390円
期中追加設定元本額	43,060,221,999円
期中一部解約元本額	24,863,265,010円
期末元本額	251,300,064,379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）	245,341,639円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,052,406,800円
SBI資産設計オープン（分配型）	11,179,258円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,872,166,032円
世界経済インデックスファンド	7,442,193,577円
日本株式インデックス・オープン	2,624,440,761円
DCマイセレクション25	4,475,773,973円

区分	2025年 7月10日現在
DCマイセレクション50	15,412,315,780円
DCマイセレクション75	18,153,328,204円
DC日本株式インデックス・オープン	5,870,181,062円
DCマイセレクションS25	3,696,283,027円
DCマイセレクションS50	11,273,925,017円
DCマイセレクションS75	11,403,977,316円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,706,413,104円
DCターゲット・イヤーフンド2025	17,320,136円
DCターゲット・イヤーフンド2035	525,878,073円
DCターゲット・イヤーフンド2045	451,088,804円
DC世界経済インデックスファンド	3,771,434,488円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	244,405,160円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,415,164円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	7,682,417円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	10,633,547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)	51,340,747円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,832,566円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	8,573,557円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	37,035,232円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	9,835,199円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	35,187,409円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	217,912,791円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	236,713,576円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,706,569,190円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	23,220,749円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	7,443,465円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	226,549,816円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	135,048,564円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	178,147,234円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	13,522,958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)	344,464,069円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,429,180,584円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,039,525,314円
コア投資戦略ファンド(安定型)	473,359,873円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,178,916,518円
分散投資コア戦略ファンドA	1,636,908,834円
分散投資コア戦略ファンドS	6,070,743,368円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	770,584,524円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	438,628,860円
コア投資戦略ファンド(切替型)	483,834,437円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	183,659,065円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,501,212円
SMT インデックスバランス・オープン	44,337,519円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	17,742,363,623円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	168,737,013円
SMT 世界経済インデックス・オープン	66,386,499円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	317,572,355円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	48,315,461円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,632,611円
グローバル経済コア	408,026,188円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	38,522,303円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	3,845,929,266円
DCターゲット・イヤーフンド2055	32,054,191円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	382,899,809円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	129,826,131円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	83,021,374円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	90,793,471円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	44,596,472円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	56,805,790円
10資産分散投資ファンド	115,434,019円
グローバル10資産バランスファンド	58,049,849円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	10,126,874円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2035	43,533,070円

区分	2025年 7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）2040	22,491,922円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	16,706,546円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	10,910,009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	5,605,234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	1,689,866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	2,262,738円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	1,245,283,357円
DCターゲット・イヤー ファンド2065	85,427円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,385,442,410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）	199,082,229円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	314,865,997円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	24,194,780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）	51,167,026,434円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,342,218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）	239,032,289円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	31,770円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	21,431円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	24,595円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	12,732円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	24,704円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	21,384円
国内株式インデックスファンドT（一般投資家私募/適格機関投資家転売制限付）	2,687,919,369円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		260,237,277
合計		260,237,277

(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

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,497,386,000	-	8,527,935,000	30,549,000
	合計	8,497,386,000	-	8,527,935,000	30,549,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	11,000	4,510.00	49,610,000	

ニッセイ	262,000	863.30	226,184,600	
マルハニチロ	38,900	3,024.00	117,633,600	
ユキグニファクトリー	22,300	1,100.00	24,530,000	
カネコ種苗	7,400	1,378.00	10,197,200	
サカタのタネ	32,400	3,485.00	112,914,000	
ホクト	23,300	1,792.00	41,753,600	
住石ホールディングス	32,900	601.00	19,772,900	
日鉄鉱業	10,500	7,520.00	78,960,000	
I N P E X	791,900	2,073.50	1,642,004,650	
石油資源開発	143,700	1,040.00	149,448,000	
K & O エナジーグループ	11,900	2,784.00	33,129,600	
ショーボンドホールディングス	34,400	4,714.00	162,161,600	
ミライト・ワン	83,000	2,573.50	213,600,500	
タマホーム	16,500	3,405.00	56,182,500	貸付有価証券 11,100株
第一カッター興業	6,700	1,287.00	8,622,900	
安藤・間	151,800	1,571.00	238,477,800	
東急建設	82,100	1,045.00	85,794,500	
コムシスホールディングス	92,900	3,407.00	316,510,300	
ビーアールホールディングス	38,400	327.00	12,556,800	
高松コンストラクショングループ	19,500	3,055.00	59,572,500	
東建コーポレーション	5,600	13,980.00	78,288,000	
ヤマウラ	13,300	1,291.00	17,170,300	
オリエンタル白石	97,000	377.00	36,569,000	
大成建設	166,400	8,585.00	1,428,544,000	
大林組	605,000	2,159.00	1,306,195,000	
清水建設	500,800	1,634.50	818,557,600	
長谷工コーポレーション	168,100	2,210.00	371,501,000	
松井建設	17,100	1,191.00	20,366,100	
鹿島建設	406,400	3,766.00	1,530,502,400	
不動テトラ	11,500	2,288.00	26,312,000	
鉄建建設	11,700	2,987.00	34,947,900	
西松建設	29,200	4,854.00	141,736,800	
三井住友建設	144,600	596.00	86,181,600	
大豊建設	25,300	815.00	20,619,500	
奥村組	32,400	4,380.00	141,912,000	
東鉄工業	20,200	4,025.00	81,305,000	
浅沼組	73,400	765.00	56,151,000	
戸田建設	225,500	957.40	215,893,700	
熊谷組	30,200	4,405.00	133,031,000	
矢作建設工業	24,900	1,836.00	45,716,400	
ピーエス・コンストラクション	13,300	1,818.00	24,179,400	

日本ハウスホールディングス	39,100	292.00	11,417,200	貸付有価証券 26,100株
新日本建設	25,700	1,674.00	43,021,800	
東亜道路工業	31,700	1,594.00	50,529,800	
東亜建設工業	55,300	1,738.00	96,111,400	
日本国土開発	56,100	482.00	27,040,200	
若築建設	5,400	4,420.00	23,868,000	
東洋建設	52,800	1,554.00	82,051,200	
五洋建設	239,800	942.20	225,939,560	
世紀東急工業	26,200	1,442.00	37,780,400	
福田組	6,900	5,020.00	34,638,000	
住友林業	475,200	1,460.00	693,792,000	
大和ハウス工業	553,000	4,929.00	2,725,737,000	
ライト工業	36,000	2,890.00	104,040,000	
積水ハウス	556,000	3,172.00	1,763,632,000	
日特建設	17,500	1,125.00	19,687,500	
北陸電気工事	12,600	1,217.00	15,334,200	
ユアテック	33,800	2,286.00	77,266,800	
日本リーテック	14,300	1,884.00	26,941,200	
四電工	23,000	1,290.00	29,670,000	
中電工	28,400	3,400.00	96,560,000	
関電工	100,400	3,387.00	340,054,800	
きんでん	125,800	4,468.00	562,074,400	
東京エネシス	19,600	1,342.00	26,303,200	
トーエネック	30,400	1,278.00	38,851,200	
住友電設	14,900	6,420.00	95,658,000	
日本電設工業	34,400	2,690.00	92,536,000	
エクシオグループ	189,500	1,915.00	362,892,500	
新日本空調	23,800	2,439.00	58,048,200	
九電工	39,600	6,245.00	247,302,000	
三機工業	38,200	4,170.00	159,294,000	
日揮ホールディングス	181,400	1,252.00	227,112,800	
中外炉工業	6,000	3,340.00	20,040,000	
太平電業	12,100	5,650.00	68,365,000	
高砂熱学工業	44,200	7,179.00	317,311,800	
朝日工業社	17,100	2,520.00	43,092,000	
明星工業	30,800	1,517.00	46,723,600	
大気社	46,900	2,580.00	121,002,000	
ダイダン	32,100	4,340.00	139,314,000	
日比谷総合設備	14,900	3,730.00	55,577,000	
飛島ホールディングス	18,800	1,865.00	35,062,000	
フィル・カンパニー	3,600	932.00	3,355,200	
テスホールディングス	44,400	394.00	17,493,600	

インフロニア・ホールディングス	192,100	1,242.00	238,588,200	
東洋エンジニアリング	26,900	1,039.00	27,949,100	
レイズネクスト	26,500	1,829.00	48,468,500	
ニッポン	62,300	2,110.00	131,453,000	
日清製粉グループ本社	182,800	1,695.00	309,846,000	
日東富士製粉	3,300	7,030.00	23,199,000	
昭和産業	15,600	2,882.00	44,959,200	
中部飼料	25,500	1,597.00	40,723,500	
フィード・ワン	26,900	1,040.00	27,976,000	
日本甜菜製糖	9,600	2,357.00	22,627,200	
D M三井製糖	18,200	3,030.00	55,146,000	
ウェルネオシュガー	10,300	2,239.00	23,061,700	
森永製菓	74,900	2,354.00	176,314,600	
中村屋	4,600	3,085.00	14,191,000	貸付有価証券 3,000株
江崎グリコ	52,600	4,473.00	235,279,800	
名糖産業	8,200	2,033.00	16,670,600	
井村屋グループ	10,100	2,441.00	24,654,100	
不二家	12,600	2,434.00	30,668,400	
山崎製パン	123,100	3,066.00	377,424,600	
モロゾフ	17,800	1,573.00	27,999,400	貸付有価証券 12,100株
亀田製菓	11,700	4,035.00	47,209,500	
寿スピリッツ	108,800	2,054.00	223,475,200	
カルビー	84,200	2,624.00	220,940,800	
森永乳業	68,400	3,294.00	225,309,600	
六甲バター	13,500	1,244.00	16,794,000	
ヤクルト本社	262,900	2,614.50	687,352,050	
明治ホールディングス	236,600	3,094.00	732,040,400	
雪印メグミルク	49,400	2,718.00	134,269,200	
プリマハム	24,700	2,274.00	56,167,800	
日本ハム	76,700	4,876.00	373,989,200	
丸大食品	18,500	1,816.00	33,596,000	
S Foods	20,300	2,596.00	52,698,800	
柿安本店	7,800	2,606.00	20,326,800	貸付有価証券 5,200株
伊藤ハム米久ホールディングス	28,100	4,975.00	139,797,500	
サッポロホールディングス	60,600	7,044.00	426,866,400	
アサヒグループホールディングス	1,381,700	1,855.00	2,563,053,500	
キリンホールディングス	766,400	1,975.50	1,514,023,200	
シマダヤ	5,300	1,888.00	10,006,400	
宝ホールディングス	124,100	1,187.00	147,306,700	
オエノンホールディングス	59,600	601.00	35,819,600	

養命酒製造	6,100	3,200.00	19,520,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	115,300	2,269.50	261,673,350	
ライフドリンク カンパニー	40,200	2,002.00	80,480,400	
サントリー食品インターナショナル	129,600	4,451.00	576,849,600	
ダイドーグループホールディングス	20,800	2,594.00	53,955,200	貸付有価証券 12,100株
伊藤園	60,300	3,252.00	196,095,600	
キーコーヒー	20,600	1,971.00	40,602,600	貸付有価証券 14,000株
日清オイリオグループ	25,900	4,905.00	127,039,500	
不二製油	36,700	2,735.50	100,392,850	
J - オイルミルズ	21,100	2,013.00	42,474,300	
キッコーマン	609,700	1,283.50	782,549,950	
味の素	843,300	3,950.00	3,331,035,000	
ブルドックソース	9,800	1,798.00	17,620,400	
キューピー	98,900	3,888.00	384,523,200	
ハウス食品グループ本社	61,900	2,827.50	175,022,250	
カゴメ	78,700	2,824.50	222,288,150	
アリアケジャパン	18,300	6,530.00	119,499,000	
エバラ食品工業	4,800	2,510.00	12,048,000	
ニチレイ	143,600	1,794.00	257,618,400	
東洋水産	85,200	8,951.00	762,625,200	
イートアンドホールディングス	9,500	2,035.00	19,332,500	貸付有価証券 6,400株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,100	1,051.00	10,615,100	
日清食品ホールディングス	230,000	2,897.50	666,425,000	
フジッコ	18,900	1,573.00	29,729,700	
ロック・フィールド	20,600	1,510.00	31,106,000	貸付有価証券 13,900株
日本たばこ産業	1,118,000	4,155.00	4,645,290,000	
ケンコーマヨネーズ	11,500	1,780.00	20,470,000	
わらべや日洋ホールディングス	12,300	2,555.00	31,426,500	
なとり	11,600	1,994.00	23,130,400	貸付有価証券 7,800株
ファーマフーズ	24,400	806.00	19,666,400	
ユーグレナ	114,300	402.00	45,948,600	貸付有価証券 77,800株
紀文食品	16,000	1,083.00	17,328,000	
ピクルスホールディングス	10,800	972.00	10,497,600	
理研ビタミン	15,500	2,715.00	42,082,500	
片倉工業	17,200	2,437.00	41,916,400	
ゲンゼ	26,600	3,660.00	97,356,000	
東洋紡	80,900	932.00	75,398,800	
ユニチカ	60,500	180.00	10,890,000	

富士紡ホールディングス	7,100	5,850.00	41,535,000	
倉敷紡績	12,600	7,200.00	90,720,000	
シキボウ	13,400	975.00	13,065,000	
日本毛織	48,000	1,494.00	71,712,000	
帝国繊維	21,200	2,804.00	59,444,800	
帝人	179,800	1,216.50	218,726,700	
東レ	1,368,000	995.30	1,361,570,400	
セーレン	36,100	2,374.00	85,701,400	
小松マテーレ	27,100	717.00	19,430,700	
ワコールホールディングス	38,300	4,935.00	189,010,500	
ホギメディカル	25,200	3,795.00	95,634,000	
T S Iホールディングス	57,900	1,132.00	65,542,800	
ワールド	28,800	2,613.00	75,254,400	貸付有価証券 19,600株
三陽商会	9,700	2,671.00	25,908,700	
オンワードホールディングス	121,400	603.00	73,204,200	
ルックホールディングス	6,000	2,379.00	14,274,000	
ゴールドウイン	33,200	8,087.00	268,488,400	
特種東海製紙	9,100	3,855.00	35,080,500	
王子ホールディングス	708,800	753.90	534,364,320	
日本製紙	97,500	1,061.00	103,447,500	
北越コーポレーション	105,100	1,016.00	106,781,600	貸付有価証券 71,100株
大王製紙	94,500	843.00	79,663,500	
レンゴー	170,500	843.40	143,799,700	
トーモク	10,800	3,065.00	33,102,000	
ザ・パック	41,700	1,107.00	46,161,900	
北の達人コーポレーション	78,900	149.00	11,756,100	貸付有価証券 53,600株
クラレ	249,700	1,839.00	459,198,300	
旭化成	1,240,700	1,022.00	1,267,995,400	
レゾナック・ホールディングス	168,000	3,498.00	587,664,000	
住友化学	1,505,400	360.40	542,546,160	
住友精化	8,800	4,370.00	38,456,000	
日産化学	95,600	4,512.00	431,347,200	
ラサ工業	6,700	4,095.00	27,436,500	
クレハ	38,700	3,245.00	125,581,500	
多木化学	7,300	2,845.00	20,768,500	
テイカ	13,400	1,252.00	16,776,800	
石原産業	31,000	2,125.00	65,875,000	
日本曹達	39,700	3,280.00	130,216,000	
東ソー	249,900	2,219.00	554,528,100	
トクヤマ	60,400	3,139.00	189,595,600	

セントラル硝子	23,600	3,030.00	71,508,000	
東亜合成	86,900	1,426.00	123,919,400	
大阪ソーダ	65,400	1,790.00	117,066,000	
関東電化工業	40,200	855.00	34,371,000	
デンカ	68,100	2,054.50	139,911,450	
信越化学工業	1,664,500	4,650.00	7,739,925,000	貸付有価証券 1,117,600株
日本カーバイド工業	9,900	1,889.00	18,701,100	
堺化学工業	13,100	2,715.00	35,566,500	
第一稀元素化学工業	20,500	649.00	13,304,500	
エア・ウォーター	176,600	2,188.50	386,489,100	
日本酸素ホールディングス	181,600	5,499.00	998,618,400	
日本化学工業	6,900	2,023.00	13,958,700	
日本パーカラライジング	83,400	1,305.00	108,837,000	
高压ガス工業	27,200	1,008.00	27,417,600	
四国化成ホールディングス	21,200	2,088.00	44,265,600	
戸田工業	4,300	1,388.00	5,968,400	
ステラ ケミファ	10,000	3,960.00	39,600,000	
保土谷化学工業	11,800	1,450.00	17,110,000	
日本触媒	119,900	1,660.50	199,093,950	
大日精化工業	12,700	3,190.00	40,513,000	
カネカ	46,100	4,018.00	185,229,800	
三菱瓦斯化学	147,900	2,417.00	357,474,300	
三井化学	168,400	3,430.00	577,612,000	
東京応化工業	89,300	4,042.00	360,950,600	
大阪有機化学工業	15,700	2,604.00	40,882,800	
三菱ケミカルグループ	1,368,300	782.10	1,070,147,430	
KHネオケム	33,700	2,680.00	90,316,000	
ダイセル	210,500	1,233.50	259,651,750	
住友ベークライト	59,000	4,188.00	247,092,000	
積水化学工業	369,400	2,555.00	943,817,000	
日本ゼオン	135,400	1,540.50	208,583,700	
アイカ工業	47,200	3,636.00	171,619,200	
UBE	96,500	2,294.50	221,419,250	
積水樹脂	24,500	1,994.00	48,853,000	
旭有機材	12,500	4,080.00	51,000,000	
ニチバン	11,600	1,879.00	21,796,400	
リケンテクノス	33,500	1,097.00	36,749,500	
大倉工業	8,700	4,160.00	36,192,000	
積水化成成品工業	26,300	337.00	8,863,100	
群栄化学工業	4,400	2,797.00	12,306,800	
ダイキョーニシカワ	41,300	684.00	28,249,200	
森六	10,400	2,269.00	23,597,600	

恵和	12,100	1,105.00	13,370,500	
日本化薬	125,400	1,321.00	165,653,400	
カーリット	18,500	1,180.00	21,830,000	
日本精化	12,400	2,482.00	30,776,800	
扶桑化学工業	17,400	4,010.00	69,774,000	
トリケミカル研究所	20,400	3,400.00	69,360,000	
A D E K A	65,300	2,864.00	187,019,200	
日油	214,900	2,890.00	621,061,000	
ハリマ化成グループ	14,600	807.00	11,782,200	
花王	455,800	6,566.00	2,992,782,800	
第一工業製薬	6,700	4,000.00	26,800,000	
石原ケミカル	7,900	1,943.00	15,349,700	
三洋化成工業	11,500	3,795.00	43,642,500	
大日本塗料	20,800	1,192.00	24,793,600	
日本ペイントホールディングス	828,200	1,203.00	996,324,600	
関西ペイント	149,200	2,004.00	298,996,800	貸付有価証券 104,700株
中国塗料	42,300	2,653.00	112,221,900	
藤倉化成	23,700	553.00	13,106,100	
太陽ホールディングス	32,600	6,520.00	212,552,000	
D I C	66,500	2,906.00	193,249,000	
サカタインクス	41,600	2,024.00	84,198,400	
a r t i e n c e	33,100	3,060.00	101,286,000	
富士フイルムホールディングス	1,129,900	2,995.00	3,384,050,500	
資生堂	391,300	2,522.00	986,858,600	
ライオン	235,800	1,452.00	342,381,600	
高砂香料工業	12,700	7,540.00	95,758,000	
マンダム	37,100	1,448.00	53,720,800	
ミルボン	30,100	2,426.00	73,022,600	
コーセー	38,100	5,749.00	219,036,900	
コタ	19,000	1,442.00	27,398,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	96,100	1,271.00	122,143,100	
ノエビアホールディングス	16,700	4,405.00	73,563,500	
新日本製薬	10,700	2,271.00	24,299,700	
I - n e	6,200	1,692.00	10,490,400	
アクシージア	11,800	477.00	5,628,600	貸付有価証券 8,400株
エステー	14,700	1,604.00	23,578,800	
コニシ	59,000	1,178.00	69,502,000	
長谷川香料	35,800	3,020.00	108,116,000	
小林製薬	49,100	5,214.00	256,007,400	
荒川化学工業	17,300	1,013.00	17,524,900	
メック	15,400	2,702.00	41,610,800	

日本高純度化学	4,700	3,025.00	14,217,500	
タカラバイオ	58,900	818.00	48,180,200	
J C U	20,400	3,240.00	66,096,000	
O A Tアグリオ	7,700	2,165.00	16,670,500	
デクセリアルズ	160,300	2,033.00	325,889,900	
アース製薬	17,100	4,685.00	80,113,500	貸付有価証券 11,500株
北興化学工業	16,400	1,387.00	22,746,800	
大成ラミックグループ	5,400	2,515.00	13,581,000	
クミアイ化学工業	74,500	802.00	59,749,000	
日本農薬	28,600	843.00	24,109,800	
アキレス	10,200	1,088.00	11,097,600	
有沢製作所	28,200	1,470.00	41,454,000	
日東電工	592,600	2,762.00	1,636,761,200	
レック	24,000	1,173.00	28,152,000	
三光合成	23,600	676.00	15,953,600	
Z A C R O S	14,800	3,770.00	55,796,000	
前澤化成工業	13,200	1,785.00	23,562,000	貸付有価証券 9,000株
未来工業	8,900	3,390.00	30,171,000	
J S P	15,400	1,866.00	28,736,400	貸付有価証券 3,500株
エフピコ	41,400	2,595.00	107,433,000	
信越ポリマー	40,400	1,693.00	68,397,200	
ニフコ	70,100	3,471.00	243,317,100	
バルカー	14,400	3,090.00	44,496,000	
ユニ・チャーム	1,171,300	1,028.50	1,204,682,050	
協和キリン	220,400	2,485.50	547,804,200	
武田薬品工業	1,667,600	4,336.00	7,230,713,600	
アステラス製薬	1,643,900	1,377.00	2,263,650,300	
住友ファーマ	166,800	994.00	165,799,200	
塩野義製薬	621,700	2,468.00	1,534,355,600	
日本新薬	49,100	3,150.00	154,665,000	
中外製薬	586,600	6,859.00	4,023,489,400	
科研製薬	31,700	3,768.00	119,445,600	
エーザイ	244,600	3,966.00	970,083,600	
ロート製薬	198,000	2,037.00	403,326,000	
小野薬品工業	383,300	1,591.00	609,830,300	
久光製薬	41,700	4,027.00	167,925,900	
持田製薬	22,900	2,881.00	65,974,900	
参天製薬	334,600	1,649.00	551,755,400	
扶桑薬品工業	7,300	2,079.00	15,176,700	
ツムラ	64,400	3,546.00	228,362,400	

キッセイ薬品工業	30,100	4,025.00	121,152,500	
生化学工業	35,700	612.00	21,848,400	
栄研化学	29,600	2,037.00	60,295,200	
JCRファーマ	63,400	594.00	37,659,600	
東和薬品	25,200	3,030.00	76,356,000	
富士製薬工業	13,900	1,324.00	18,403,600	
ゼリア新薬工業	29,700	2,042.00	60,647,400	
ネクセラファーマ	87,900	873.00	76,736,700	
第一三共	1,720,800	3,210.00	5,523,768,000	
杏林製薬	40,200	1,486.00	59,737,200	
大幸薬品	42,500	277.00	11,772,500	貸付有価証券 28,900株
ダイト	25,700	1,022.00	26,265,400	
大塚ホールディングス	455,300	6,600.00	3,004,980,000	
ペプチドリーム	90,800	1,576.00	143,100,800	
セルソース	12,500	682.00	8,525,000	
あすか製薬ホールディングス	16,600	2,359.00	39,159,400	
サワイグループホールディングス	96,800	1,843.00	178,402,400	
日本コークス工業	190,100	89.00	16,918,900	貸付有価証券 126,900株
ニチレキグループ	19,900	2,467.00	49,093,300	
ユシロ	9,700	2,135.00	20,709,500	
富士石油	49,200	316.00	15,547,200	
出光興産	810,500	915.00	741,607,500	貸付有価証券 292,000株
E N E O Sホールディングス	2,837,100	729.10	2,068,529,610	
コスモエネルギーホールディングス	61,700	6,256.00	385,995,200	
横浜ゴム	93,700	4,161.00	389,885,700	
TOYO TIRE	107,700	3,062.00	329,777,400	
ブリヂストン	548,600	6,003.00	3,293,245,800	
住友ゴム工業	183,800	1,663.00	305,659,400	
藤倉コンポジット	18,000	1,460.00	26,280,000	
オカモト	9,900	4,810.00	47,619,000	
フコク	11,100	1,659.00	18,414,900	
ニッタ	18,400	3,840.00	70,656,000	
住友理工	36,400	1,728.00	62,899,200	
三ツ星ベルト	26,100	3,375.00	88,087,500	
バンドー化学	27,800	1,704.00	47,371,200	
日東紡績	21,100	6,570.00	138,627,000	
A G C	182,300	4,360.00	794,828,000	
日本板硝子	95,900	495.00	47,470,500	
日本電気硝子	62,600	3,556.00	222,605,600	
オハラ	8,900	1,117.00	9,941,300	

住友大阪セメント	32,500	3,791.00	123,207,500	
太平洋セメント	115,600	3,696.00	427,257,600	
日本ヒューム	16,400	2,350.00	38,540,000	貸付有価証券 11,100株
日本コンクリート工業	36,300	290.00	10,527,000	貸付有価証券 17,600株
三谷セキサン	6,600	7,780.00	51,348,000	
アジアパイルホールディングス	26,600	978.00	26,014,800	
東海カーボン	172,900	1,010.50	174,715,450	
日本カーボン	10,700	4,015.00	42,960,500	
東洋炭素	13,200	4,740.00	62,568,000	
ノリタケ	20,300	3,810.00	77,343,000	
TOTO	136,000	3,776.00	513,536,000	
日本碍子	208,200	1,824.00	379,756,800	
日本特殊陶業	153,200	4,890.00	749,148,000	
MARUWA	7,800	42,290.00	329,862,000	
品川リフラクトリーズ	23,100	1,656.00	38,253,600	
黒崎播磨	12,700	3,495.00	44,386,500	
ヨータイ	9,600	1,711.00	16,425,600	
フジインコーポレーテッド	50,400	2,041.00	102,866,400	
ニチアス	47,400	5,541.00	262,643,400	
ニチハ	23,500	3,055.00	71,792,500	
日本製鉄	976,300	2,799.50	2,733,151,850	
神戸製鋼所	387,700	1,614.00	625,747,800	
中山製鋼所	39,700	624.00	24,772,800	
合同製鐵	10,800	3,805.00	41,094,000	
JFEホールディングス	580,900	1,772.50	1,029,645,250	
東京製鐵	53,800	1,648.00	88,662,400	
共英製鋼	18,800	2,151.00	40,438,800	
大和工業	36,300	8,955.00	325,066,500	
東京鐵鋼	8,500	5,540.00	47,090,000	
大阪製鐵	8,900	2,901.00	25,818,900	貸付有価証券 6,000株
淀川製鋼所	89,000	1,124.00	100,036,000	
中部鋼鋳	15,700	2,056.00	32,279,200	
丸一鋼管	58,700	3,590.00	210,733,000	
モリ工業	24,400	850.00	20,740,000	
大同特殊鋼	121,400	995.10	120,805,140	
日本冶金工業	13,000	4,050.00	52,650,000	
愛知製鋼	43,200	2,154.00	93,052,800	
大平洋金属	17,800	1,756.00	31,256,800	
新日本電工	115,100	253.00	29,120,300	
栗本鐵工所	8,900	6,520.00	58,028,000	

三菱製鋼	14,300	1,607.00	22,980,100	
日本精線	15,300	1,088.00	16,646,400	
エンビプロ・ホールディングス	19,100	507.00	9,683,700	貸付有価証券 13,000株
J X 金属	487,200	841.90	410,173,680	
大紀アルミニウム工業所	28,000	1,007.00	28,196,000	
日本軽金属ホールディングス	56,600	1,650.00	93,390,000	
三井金属鉱業	48,200	5,218.00	251,507,600	
三菱マテリアル	138,100	2,267.00	313,072,700	
住友金属鉱山	244,000	3,499.00	853,756,000	
D O W A ホールディングス	52,100	4,800.00	250,080,000	
古河機械金属	24,900	2,486.00	61,901,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	33,800	1,449.00	48,976,200	貸付有価証券 23,000株
東邦チタニウム	40,300	1,275.00	51,382,500	貸付有価証券 27,200株
U A C J	26,400	5,380.00	142,032,000	
C K サンエツ	4,800	3,785.00	18,168,000	
古河電気工業	64,300	7,315.00	470,354,500	
住友電気工業	665,900	3,213.00	2,139,536,700	
フジクラ	206,800	7,760.00	1,604,768,000	
S W C C	25,900	8,000.00	207,200,000	貸付有価証券 17,600株
平河ヒューテック	13,300	1,408.00	18,726,400	
リョービ	20,800	2,174.00	45,219,200	
A R E ホールディングス	78,300	1,925.00	150,727,500	
稲葉製作所	10,700	1,847.00	19,762,900	
宮地エンジニアリンググループ	23,200	1,879.00	43,592,800	
トーカロ	55,600	1,926.00	107,085,600	
S U M C O	367,000	1,151.00	422,417,000	
川田テクノロジーズ	12,200	3,905.00	47,641,000	
R S T e c h n o l o g i e s	14,800	2,960.00	43,808,000	
東洋製罐グループホールディングス	114,000	2,905.00	331,170,000	
ホッカンホールディングス	10,400	1,985.00	20,644,000	
コロナ	10,800	911.00	9,838,800	
横河ブリッジホールディングス	33,200	2,611.00	86,685,200	
三和ホールディングス	190,300	4,716.00	897,454,800	
文化シャッター	50,400	2,402.00	121,060,800	
三協立山	24,300	656.00	15,940,800	
アルインコ	14,700	1,016.00	14,935,200	
L I X I L	281,100	1,728.50	485,881,350	
ノーリツ	27,100	1,950.00	52,845,000	
長府製作所	21,500	1,877.00	40,355,500	
リンナイ	100,500	3,677.00	369,538,500	

日東精工	27,900	595.00	16,600,500	
岡部	34,400	852.00	29,308,800	
ジーテクト	21,500	1,776.00	38,184,000	
東ブレ	34,000	1,949.00	66,266,000	
高周波熱錬	27,800	1,128.00	31,358,400	
東京製綱	11,400	1,310.00	14,934,000	
サンコール	21,400	293.00	6,270,200	
パイオラックス	25,900	1,729.00	44,781,100	
エイチワン	19,800	1,290.00	25,542,000	
日本発條	161,500	1,622.00	261,953,000	
中央発條	12,500	1,861.00	23,262,500	
立川ブラインド工業	8,700	1,695.00	14,746,500	
日本製鋼所	57,200	8,047.00	460,288,400	
三浦工業	87,600	2,893.50	253,470,600	
タクマ	61,900	2,067.00	127,947,300	
ツガミ	40,200	1,843.00	74,088,600	
オークマ	33,000	3,730.00	123,090,000	
芝浦機械	24,300	3,420.00	83,106,000	
アマダ	252,300	1,579.00	398,381,700	
アイダエンジニアリング	42,300	880.00	37,224,000	
F U J I	82,000	2,613.50	214,307,000	
牧野フライス製作所	20,900	11,490.00	240,141,000	
オーエスジー	83,200	1,755.50	146,057,600	
旭ダイヤモンド工業	47,100	725.00	34,147,500	
D M G 森精機	119,000	3,300.00	392,700,000	
ソディック	49,800	1,024.00	50,995,200	
ディスコ	90,900	43,010.00	3,909,609,000	
日東工器	7,100	1,785.00	12,673,500	
日進工具	15,700	738.00	11,586,600	
富士ダイス	14,000	762.00	10,668,000	
リケンNPR	23,700	2,400.00	56,880,000	
島精機製作所	30,000	993.00	29,790,000	
オプトラン	31,000	1,554.00	48,174,000	
イワキポンプ	12,600	2,499.00	31,487,400	
フリュー	17,800	1,009.00	17,960,200	
ヤマシンフィルタ	39,900	634.00	25,296,600	貸付有価証券 23,300株
日阪製作所	22,200	1,361.00	30,214,200	
やまびこ	30,800	2,148.00	66,158,400	
野村マイクロ・サイエンス	31,200	2,384.00	74,380,800	
平田機工	27,100	1,983.00	53,739,300	
P E G A S U S	20,800	541.00	11,252,800	

マルマエ	8,000	1,562.00	12,496,000	貸付有価証券 5,400株
タツモ	13,500	2,128.00	28,728,000	貸付有価証券 9,100株
ナブテスコ	118,400	2,642.50	312,872,000	
三井海洋開発	23,900	6,760.00	161,564,000	
レオン自動機	19,800	1,230.00	24,354,000	
S M C	53,600	49,560.00	2,656,416,000	
ホソカワミクロン	14,300	4,975.00	71,142,500	
ユニオンツール	8,300	5,380.00	44,654,000	
瑞光	16,100	970.00	15,617,000	
オイレス工業	25,600	2,040.00	52,224,000	
日精エー・エス・ビー機械	7,500	6,180.00	46,350,000	
サトー	23,500	2,065.00	48,527,500	
技研製作所	17,700	1,391.00	24,620,700	
日本エアーテック	8,800	1,059.00	9,319,200	
日精樹脂工業	12,500	853.00	10,662,500	
ワイエイシイホールディングス	19,100	771.00	14,726,100	貸付有価証券 12,900株
小松製作所	930,300	4,791.00	4,457,067,300	
住友重機械工業	111,600	3,035.00	338,706,000	
日立建機	75,200	4,283.00	322,081,600	
日工	28,000	720.00	20,160,000	
巴工業	22,100	1,441.00	31,846,100	
井関農機	17,700	1,410.00	24,957,000	
T O W A	57,800	1,880.00	108,664,000	
北川鉄工所	7,400	1,392.00	10,300,800	
ローツェ	98,600	1,923.50	189,657,100	
クボタ	965,100	1,614.50	1,558,153,950	
荏原実業	9,000	3,555.00	31,995,000	
三菱化工機	19,900	2,014.00	40,078,600	
月島ホールディングス	24,800	2,170.00	53,816,000	
帝国電機製作所	12,500	3,100.00	38,750,000	
新東工業	42,000	863.00	36,246,000	
澁谷工業	17,700	3,350.00	59,295,000	
アイチ コーポレーション	31,300	1,357.00	42,474,100	
小森コーポレーション	45,300	1,519.00	68,810,700	
鶴見製作所	14,300	3,760.00	53,768,000	
酒井重工業	7,400	2,023.00	14,970,200	
荏原製作所	387,400	2,776.50	1,075,616,100	
西島製作所	16,200	2,079.00	33,679,800	
A I R M A N	19,000	1,935.00	36,765,000	
ダイキン工業	245,800	18,110.00	4,451,438,000	

オルガノ	29,200	9,230.00	269,516,000	
トーヨーカネツ	6,700	3,935.00	26,364,500	
栗田工業	105,600	5,592.00	590,515,200	
椿本チエイン	83,300	1,820.00	151,606,000	
木村化工機	14,400	941.00	13,550,400	
アネスト岩田	32,100	1,443.00	46,320,300	
ダイフク	318,500	3,631.00	1,156,473,500	
サムコ	5,100	2,896.00	14,769,600	
タダノ	108,600	1,042.50	113,215,500	
フジテック	60,600	6,000.00	363,600,000	
C K D	52,200	2,613.00	136,398,600	
平和	62,800	2,032.00	127,609,600	
理想科学工業	30,200	1,096.00	33,099,200	
S A N K Y O	218,000	2,697.00	587,946,000	
日本金銭機械	22,800	918.00	20,930,400	貸付有価証券 15,400株
マースグループホールディングス	12,700	2,859.00	36,309,300	
ガリレイ	27,800	3,065.00	85,207,000	
ダイコク電機	8,300	2,112.00	17,529,600	
竹内製作所	34,200	4,650.00	159,030,000	
アマノ	53,600	4,430.00	237,448,000	
J U K I	29,200	392.00	11,446,400	
ジャノメ	15,200	1,101.00	16,735,200	
マックス	22,800	4,705.00	107,274,000	
グローリー	49,400	3,571.00	176,407,400	
新晃工業	54,100	1,263.00	68,328,300	
大和冷機工業	28,900	1,633.00	47,193,700	
セガサミーホールディングス	154,600	3,102.00	479,569,200	
T P R	24,000	2,023.00	48,552,000	
ツバキ・ナカシマ	46,500	339.00	15,763,500	
ホシザキ	121,500	5,203.00	632,164,500	
大豊工業	16,300	568.00	9,258,400	
日本精工	349,400	687.50	240,212,500	
N T N	446,500	239.80	107,070,700	
ジェイテクト	155,800	1,219.50	189,998,100	
不二越	13,900	3,155.00	43,854,500	
日本トムソン	51,400	549.00	28,218,600	
T H K	108,900	3,844.00	418,611,600	
Y U S H I N	17,400	587.00	10,213,800	貸付有価証券 4,500株
前澤給装工業	13,500	1,222.00	16,497,000	
イーグル工業	20,900	1,897.00	39,647,300	
P I L L A R	17,500	3,745.00	65,537,500	

キッツ	61,200	1,190.00	72,828,000	
マキタ	234,800	4,438.00	1,042,042,400	
三井E & S	100,900	2,730.00	275,457,000	
カナデビア	154,600	990.00	153,054,000	
三菱重工業	3,300,400	3,250.00	10,726,300,000	
I H I	151,300	14,895.00	2,253,613,500	
スター精密	31,800	1,700.00	54,060,000	
キオクシアホールディングス	113,200	2,557.00	289,452,400	貸付有価証券 76,400株
日清紡ホールディングス	141,900	920.00	130,548,000	
イビデン	108,300	6,326.00	685,105,800	
コニカミノルタ	422,000	442.80	186,861,600	
ブラザー工業	252,300	2,484.50	626,839,350	
ミネベアミツミ	328,400	2,166.00	711,314,400	
日立製作所	4,800,900	4,115.00	19,755,703,500	
三菱電機	1,919,600	3,096.00	5,943,081,600	
富士電機	114,800	6,540.00	750,792,000	
安川電機	205,000	2,920.00	598,600,000	
シンフォニアテクノロジー	18,700	9,450.00	176,715,000	
明電舎	31,800	5,150.00	163,770,000	
山洋電気	8,200	9,500.00	77,900,000	
デンヨー	14,200	2,840.00	40,328,000	
PHCホールディングス	35,600	910.00	32,396,000	
KOKUSAI ELECTRIC	133,200	3,257.00	433,832,400	貸付有価証券 56,000株
ソシオネクスト	188,600	2,669.50	503,467,700	
東芝テック	28,200	2,941.00	82,936,200	
芝浦メカトロニクス	13,700	10,460.00	143,302,000	
マブチモーター	82,100	2,106.50	172,943,650	
ニデック	833,400	2,666.50	2,222,261,100	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	12,700	290.00	3,683,000	
トレックス・セミコンダクター	9,100	1,425.00	12,967,500	
東光高岳	10,300	2,352.00	24,225,600	
ダブル・スコープ	57,900	231.00	13,374,900	貸付有価証券 38,600株
ダイヘン	17,600	6,730.00	118,448,000	
ヤーマン	37,000	845.00	31,265,000	貸付有価証券 200株
JVCケンウッド	149,200	1,123.50	167,626,200	
ミマキエンジニアリング	15,800	1,909.00	30,162,200	
大崎電気工業	40,500	996.00	40,338,000	
オムロン	172,900	3,831.00	662,379,900	
日東工業	25,400	3,255.00	82,677,000	
I D E C	27,500	2,266.00	62,315,000	

ジーエス・ユアサ コーポレーション	84,300	2,701.00	227,694,300	
B U F F A L O	4,400	2,248.00	9,891,200	
テクノメディカ	3,800	1,836.00	6,976,800	貸付有価証券 800株
日本電気	1,334,600	3,866.00	5,159,563,600	
富士通	1,736,700	3,258.00	5,658,168,600	
沖電気工業	91,400	1,597.00	145,965,800	
電気興業	7,600	2,100.00	15,960,000	
サンケン電気	19,300	8,483.00	163,721,900	
アイホン	11,500	2,734.00	31,441,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,438,000	1,893.00	2,722,134,000	
セイコーエプソン	234,900	1,859.00	436,679,100	
ワコム	131,500	668.00	87,842,000	
アルバック	41,400	5,279.00	218,550,600	
アクセル	9,700	966.00	9,370,200	
E I Z O	24,600	2,141.00	52,668,600	
日本信号	43,000	1,075.00	46,225,000	
京三製作所	43,900	503.00	22,081,700	
能美防災	25,600	3,735.00	95,616,000	
ホーチキ	11,900	3,070.00	36,533,000	
エレコム	45,300	1,826.00	82,717,800	
パナソニック ホールディングス	2,229,600	1,448.00	3,228,460,800	
シャープ	272,700	639.30	174,337,110	
アンリツ	132,900	1,801.00	239,352,900	
ソニーグループ	6,446,000	3,607.00	23,250,722,000	
T D K	1,630,100	1,616.00	2,634,241,600	
帝国通信工業	8,400	2,215.00	18,606,000	
タムラ製作所	75,200	483.00	36,321,600	
アルプスアルパイン	153,400	1,528.00	234,395,200	
日本電波工業	18,100	730.00	13,213,000	
鈴木	10,200	1,757.00	17,921,400	
メイコー	18,800	6,780.00	127,464,000	
日本トリム	4,300	4,435.00	19,070,500	
フォスター電機	19,200	1,555.00	29,856,000	
S M K	4,500	2,217.00	9,976,500	
ヨコオ	16,900	1,415.00	23,913,500	
ホシデン	46,400	2,215.00	102,776,000	
ヒロセ電機	27,400	17,175.00	470,595,000	
日本航空電子工業	49,100	2,422.00	118,920,200	
T O A	19,100	986.00	18,832,600	
マクセル	36,200	1,832.00	66,318,400	
古野電気	22,400	4,230.00	94,752,000	
スミダコーポレーション	25,700	948.00	24,363,600	

アイコム	7,300	2,889.00	21,089,700	貸付有価証券 4,300株
リオン	7,900	2,536.00	20,034,400	
横河電機	206,500	3,788.00	782,222,000	
新電元工業	7,200	2,224.00	16,012,800	
アズビル	491,800	1,355.50	666,634,900	
日本光電工業	167,400	1,637.50	274,117,500	
チノー	7,800	2,326.00	18,142,800	
日本電子材料	11,500	2,271.00	26,116,500	
堀場製作所	35,400	10,685.00	378,249,000	
アドバンテスト	588,900	11,245.00	6,622,180,500	
エスベック	16,700	3,110.00	51,937,000	
キーエンス	186,900	55,480.00	10,369,212,000	
日置電機	9,800	5,310.00	52,038,000	
シスメックス	484,000	2,444.00	1,182,896,000	
日本マイクロニクス	30,800	5,350.00	164,780,000	
メガチップス	14,500	5,160.00	74,820,000	
O B A R A G R O U P	11,400	3,675.00	41,895,000	貸付有価証券 6,900株
コーセル	23,300	1,100.00	25,630,000	
イリソ電子工業	18,900	2,807.00	53,052,300	
オブテックスグループ	34,400	1,654.00	56,897,600	
千代田インテグレ	6,600	2,834.00	18,704,400	
レーザーテック	72,500	18,735.00	1,358,287,500	
スタンレー電気	106,300	2,884.50	306,622,350	
ウシオ電機	71,200	1,773.50	126,273,200	
日本セラミック	17,200	2,936.00	50,499,200	
古河電池	13,900	1,378.00	19,154,200	
山一電機	15,400	2,591.00	39,901,400	
図研	17,200	5,460.00	93,912,000	
日本電子	43,300	4,298.00	186,103,400	
カシオ計算機	149,500	1,143.00	170,878,500	
ファナック	892,400	3,734.00	3,332,221,600	
日本シイエムケイ	55,600	336.00	18,681,600	
エンプラス	5,500	4,025.00	22,137,500	
大真空	22,600	553.00	12,497,800	
ローム	338,700	1,900.50	643,699,350	貸付有価証券 228,800株
浜松ホトニクス	312,400	1,735.00	542,014,000	
三井ハイテック	83,100	690.00	57,339,000	
京セラ	1,161,200	1,627.50	1,889,853,000	
太陽誘電	82,000	2,575.00	211,150,000	
村田製作所	1,646,200	2,131.00	3,508,052,200	

双葉電子工業	36,000	626.00	22,536,000	
ニチコン	47,700	1,210.00	57,717,000	
日本ケミコン	23,200	1,133.00	26,285,600	
K O A	30,600	825.00	25,245,000	
市光工業	34,400	369.00	12,693,600	
小糸製作所	193,700	1,779.50	344,689,150	
ミツバ	35,000	830.00	29,050,000	
S C R E E Nホールディングス	78,100	11,995.00	936,809,500	
キャノン電子	17,800	2,468.00	43,930,400	
キャノン	932,000	4,017.00	3,743,844,000	
リコー	477,700	1,321.00	631,041,700	
象印マホービン	56,000	1,860.00	104,160,000	
東京エレクトロン	395,500	26,760.00	10,583,580,000	
イノテック	13,600	1,421.00	19,325,600	
トヨタ紡織	78,700	2,040.00	160,548,000	
ユニプレス	32,700	1,009.00	32,994,300	
豊田自動織機	159,400	16,280.00	2,595,032,000	
モリタホールディングス	29,500	2,191.00	64,634,500	
三櫻工業	25,900	632.00	16,368,800	
デンソー	1,830,700	1,951.00	3,571,695,700	
東海理化電機製作所	52,100	2,303.00	119,986,300	
川崎重工業	140,800	10,080.00	1,419,264,000	
名村造船所	53,300	3,030.00	161,499,000	
日本車輛製造	7,200	2,063.00	14,853,600	
三菱ロジスネクスト	29,800	1,920.00	57,216,000	
日産自動車	2,335,700	303.00	707,717,100	貸付有価証券 1,591,100株
いすゞ自動車	548,500	1,933.00	1,060,250,500	
トヨタ自動車	9,933,400	2,473.50	24,570,264,900	
日野自動車	281,100	379.50	106,677,450	貸付有価証券 189,900株
三菱自動車工業	714,400	405.40	289,617,760	
武蔵精密工業	45,800	3,205.00	146,789,000	
日産車体	28,400	1,092.00	31,012,800	
新明和工業	53,800	1,677.00	90,222,600	
極東開発工業	25,300	2,571.00	65,046,300	
トビー工業	15,100	2,396.00	36,179,600	
ティラド	4,100	4,720.00	19,352,000	
曙ブレーキ工業	114,000	106.00	12,084,000	貸付有価証券 77,000株
タチエス	34,500	1,740.00	60,030,000	
N O K	72,600	2,130.00	154,638,000	
フタバ産業	56,300	780.00	43,914,000	

カヤバ	31,700	3,090.00	97,953,000	
大同メタル工業	36,500	661.00	24,126,500	
プレス工業	71,100	556.00	39,531,600	
太平洋工業	42,800	1,357.00	58,079,600	
アイシン	371,300	1,873.50	695,630,550	
マツダ	573,900	844.20	484,486,380	
本田技研工業	4,427,400	1,484.50	6,572,475,300	
スズキ	1,510,100	1,652.00	2,494,685,200	
S U B A R U	563,500	2,523.50	1,421,992,250	
ヤマハ発動機	782,600	1,058.50	828,382,100	
エクセディ	30,600	4,210.00	128,826,000	
豊田合成	53,500	2,975.50	159,189,250	
愛三工業	35,400	1,698.00	60,109,200	
ヨロズ	19,300	897.00	17,312,100	貸付有価証券 12,800株
エフ・シー・シー	32,700	2,889.00	94,470,300	
シマノ	79,700	20,260.00	1,614,722,000	
テイ・エス テック	75,200	1,714.00	128,892,800	
リガク・ホールディングス	127,800	738.00	94,316,400	
テルモ	1,241,500	2,448.50	3,039,812,750	
日機装	48,300	1,286.00	62,113,800	
日本エム・ディ・エム	14,800	549.00	8,125,200	
島津製作所	269,000	3,416.00	918,904,000	
J M S	17,300	430.00	7,439,000	
長野計器	12,200	1,927.00	23,509,400	
ブイ・テクノロジー	9,100	2,929.00	26,653,900	
東京計器	13,100	4,050.00	53,055,000	
愛知時計電機	8,900	2,267.00	20,176,300	
インターアクション	11,300	1,332.00	15,051,600	
東京精密	38,300	9,560.00	366,148,000	
マニー	74,800	1,208.00	90,358,400	
ニコン	279,700	1,437.00	401,928,900	
トプコン	106,000	3,256.00	345,136,000	
オリンパス	1,034,800	1,676.00	1,734,324,800	
理研計器	26,500	2,855.00	75,657,500	
タムロン	101,600	888.00	90,220,800	
H O Y A	359,600	17,780.00	6,393,688,000	
ノーリツ鋼機	53,200	1,487.00	79,108,400	
A & D ホロンホールディングス	23,300	1,915.00	44,619,500	
朝日インテック	227,800	2,283.50	520,181,300	
シチズン時計	171,900	846.00	145,427,400	
メニコン	69,700	1,152.00	80,294,400	
松風	18,800	1,986.00	37,336,800	

セイコーグループ	28,900	4,140.00	119,646,000	
ニプロ	155,800	1,333.00	207,681,400	貸付有価証券 104,500株
三井松島ホールディングス	12,800	5,060.00	64,768,000	貸付有価証券 8,600株
パラマウントベッドホールディングス	40,200	2,506.00	100,741,200	
トランザクション	12,000	2,450.00	29,400,000	
ニホンフラッシュ	15,800	802.00	12,671,600	貸付有価証券 500株
前田工織	38,100	1,905.00	72,580,500	
アートネイチャー	19,200	754.00	14,476,800	
フルヤ金属	16,000	2,467.00	39,472,000	貸付有価証券 10,700株
バンダイナムコホールディングス	499,600	4,631.00	2,313,647,600	
S H O E I	51,200	1,767.00	90,470,400	
フランスベッドホールディングス	26,100	1,255.00	32,755,500	貸付有価証券 18,200株
パイロットコーポレーション	28,600	4,139.00	118,375,400	
萩原工業	12,500	1,524.00	19,050,000	
フジシールインターナショナル	42,000	2,730.00	114,660,000	
タカラトミー	78,500	3,225.00	253,162,500	
広済堂ホールディングス	70,600	472.00	33,323,200	貸付有価証券 47,700株
プロネクサス	19,400	1,099.00	21,320,600	
T O P P A Nホールディングス	226,500	3,942.00	892,863,000	
大日本印刷	366,500	2,193.50	803,917,750	
共同印刷	21,100	1,301.00	27,451,100	
N I S S H A	32,000	1,299.00	41,568,000	
T A K A R A & C O M P A N Y	10,100	3,395.00	34,289,500	
アシックス	667,200	3,720.00	2,481,984,000	
ツツミ	4,400	2,235.00	9,834,000	
ローランド	13,500	3,015.00	40,702,500	
小松ウオール工業	12,400	2,367.00	29,350,800	
ヤマハ	316,300	1,008.50	318,988,550	
河合楽器製作所	5,700	2,619.00	14,928,300	
クリナップ	18,300	702.00	12,846,600	
ピジョン	119,000	1,697.50	202,002,500	
キングジム	16,500	829.00	13,678,500	貸付有価証券 11,200株
リンテック	35,500	2,933.00	104,121,500	
イトーキ	37,300	2,149.00	80,157,700	
任天堂	1,179,700	12,680.00	14,958,596,000	
三菱鉛筆	25,600	2,043.00	52,300,800	
タカラスタANDARD	42,300	2,499.00	105,707,700	
コクヨ	355,900	878.00	312,480,200	

ナカバヤシ	20,100	512.00	10,291,200	
グローブライド	18,400	2,155.00	39,652,000	
オカムラ	56,200	2,273.00	127,742,600	
美津濃	55,700	2,646.00	147,382,200	
グリムス	8,300	2,474.00	20,534,200	
東京電力ホールディングス	1,572,100	519.00	815,919,900	
中部電力	688,600	1,818.50	1,252,219,100	
関西電力	911,500	1,719.50	1,567,324,250	
中国電力	324,600	741.00	240,528,600	
北陸電力	191,100	714.50	136,540,950	
東北電力	492,000	1,045.50	514,386,000	
四国電力	174,000	1,214.00	211,236,000	
九州電力	430,800	1,269.50	546,900,600	
北海道電力	195,600	785.40	153,624,240	
沖縄電力	47,700	925.00	44,122,500	
電源開発	140,700	2,539.00	357,237,300	
エフオン	13,600	321.00	4,365,600	
イーレックス	36,400	742.00	27,008,800	貸付有価証券 6,800株
レノバ	51,000	762.00	38,862,000	
東京瓦斯	337,100	4,756.00	1,603,247,600	
大阪瓦斯	361,400	3,662.00	1,323,446,800	
東邦瓦斯	68,600	4,121.00	282,700,600	
北海道瓦斯	55,800	586.00	32,698,800	
広島ガス	39,500	355.00	14,022,500	
西部ガスホールディングス	19,500	1,790.00	34,905,000	
静岡ガス	42,600	1,096.00	46,689,600	
メタウォーター	24,800	2,278.00	56,494,400	
SBSホールディングス	16,700	3,045.00	50,851,500	
東武鉄道	196,800	2,499.00	491,803,200	
相鉄ホールディングス	61,700	2,290.00	141,293,000	
東急	524,000	1,684.00	882,416,000	
京浜急行電鉄	231,200	1,527.00	353,042,400	
小田急電鉄	309,000	1,655.00	511,395,000	
京王電鉄	92,000	3,455.00	317,860,000	
京成電鉄	325,300	1,261.50	410,365,950	
富士急行	23,000	2,058.00	47,334,000	
東日本旅客鉄道	1,030,500	3,226.00	3,324,393,000	
西日本旅客鉄道	460,800	3,272.00	1,507,737,600	
東海旅客鉄道	719,700	3,328.00	2,395,161,600	
東京地下鉄	416,600	1,617.00	673,642,200	貸付有価証券 281,400株
西武ホールディングス	203,400	4,569.00	929,334,600	

鴻池運輸	31,800	3,065.00	97,467,000	
西日本鉄道	54,100	2,036.00	110,147,600	
ハマキョウレックス	63,800	1,391.00	88,745,800	
サカイ引越センター	23,700	2,648.00	62,757,600	
近鉄グループホールディングス	199,800	2,804.00	560,239,200	
阪急阪神ホールディングス	247,500	3,827.00	947,182,500	
南海電気鉄道	83,200	2,192.50	182,416,000	
京阪ホールディングス	102,800	3,079.00	316,521,200	
神戸電鉄	5,100	2,319.00	11,826,900	貸付有価証券 3,400株
名古屋鉄道	206,200	1,641.00	338,374,200	
山陽電気鉄道	14,000	1,966.00	27,524,000	貸付有価証券 9,500株
ヤマトホールディングス	226,700	1,980.50	448,979,350	
山九	42,600	8,117.00	345,784,200	
丸全昭和運輸	11,500	6,810.00	78,315,000	
センコーグループホールディングス	122,800	2,048.00	251,494,400	
ニッコンホールディングス	106,100	3,225.00	342,172,500	貸付有価証券 71,800株
福山通運	19,900	3,475.00	69,152,500	
セイノーホールディングス	91,800	2,198.00	201,776,400	
神奈川中央交通	5,300	3,475.00	18,417,500	
A Z - C O M丸和ホールディングス	57,900	1,126.00	65,195,400	
九州旅客鉄道	142,900	3,674.00	525,014,600	
S Gホールディングス	313,200	1,628.50	510,046,200	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	200,600	3,196.00	641,117,600	
日本郵船	364,000	5,100.00	1,856,400,000	
商船三井	355,000	4,707.00	1,670,985,000	
川崎汽船	402,000	2,005.00	806,010,000	貸付有価証券 287,600株
N Sユナイテッド海運	11,700	3,845.00	44,986,500	
飯野海運	68,500	1,035.00	70,897,500	
乾汽船	23,700	1,181.00	27,989,700	貸付有価証券 16,000株
日本航空	427,700	2,929.00	1,252,733,300	
A N Aホールディングス	507,600	2,945.00	1,494,882,000	貸付有価証券 343,800株
日新	12,500	8,080.00	101,000,000	
三菱倉庫	185,800	1,170.00	217,386,000	
三井倉庫ホールディングス	57,600	3,750.00	216,000,000	
住友倉庫	54,300	3,045.00	165,343,500	
澁澤倉庫	8,500	4,075.00	34,637,500	
日本トランスシティ	37,500	1,088.00	40,800,000	
中央倉庫	11,000	1,368.00	15,048,000	

安田倉庫	12,700	1,813.00	23,025,100	
上組	81,900	4,085.00	334,561,500	
キューソー流通システム	12,400	3,245.00	40,238,000	
エーアイティー	11,700	1,790.00	20,943,000	
日本コンセプト	6,700	3,045.00	20,401,500	
クロスキャット	10,700	1,007.00	10,774,900	
システナ	267,900	396.00	106,088,400	
デジタルアーツ	11,900	7,700.00	91,630,000	
日鉄ソリューションズ	63,900	3,846.00	245,759,400	貸付有価証券 43,100株
キューブシステム	9,900	1,102.00	10,909,800	
コア	8,300	1,888.00	15,670,400	
手間いらず	2,700	3,060.00	8,262,000	
ラクーンホールディングス	14,000	665.00	9,310,000	貸付有価証券 9,500株
ソリトンシステムズ	9,700	1,347.00	13,065,900	
ソフトクリエイイトホールディングス	13,500	2,103.00	28,390,500	
T I S	198,100	4,628.00	916,806,800	
グリーホールディングス	62,800	484.00	30,395,200	
G M Oペパボ	2,300	1,500.00	3,450,000	
コーエーテクモホールディングス	140,900	2,113.00	297,721,700	
三菱総合研究所	9,000	4,560.00	41,040,000	
ファインデックス	14,900	739.00	11,011,100	
ブレインパッド	14,000	1,298.00	18,172,000	
K L a b	55,300	121.00	6,691,300	
ポルトウウィンホールディングス	26,700	375.00	10,012,500	
ネクソン	402,700	2,817.00	1,134,405,900	
アイスタイル	64,100	568.00	36,408,800	
エムアップホールディングス	23,000	2,081.00	47,863,000	
エイチームホールディングス	12,500	1,277.00	15,962,500	貸付有価証券 8,400株
セルシス	35,500	1,664.00	59,072,000	
エニグモ	20,900	296.00	6,186,400	貸付有価証券 14,000株
コロブラ	63,700	513.00	32,678,100	
ブロードリーフ	75,300	722.00	54,366,600	
デジタルハーツホールディングス	13,400	957.00	12,823,800	貸付有価証券 3,000株
メディアドゥ	8,500	1,738.00	14,773,000	
じげん	46,400	460.00	21,344,000	
フィックスターズ	25,900	1,921.00	49,753,900	
C A R T A H O L D I N G S	10,400	2,082.00	21,652,800	貸付有価証券 7,200株
オブティム	19,300	495.00	9,553,500	貸付有価証券 4,800株

セレス	8,500	2,460.00	20,910,000	
S H I F T	168,200	1,563.50	262,980,700	
セック	3,200	5,080.00	16,256,000	
テクマトリックス	40,500	2,142.00	86,751,000	
プロシップ	8,200	2,954.00	24,222,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,700	2,803.50	108,495,450	
GMOペイメントゲートウェイ	37,500	8,696.00	326,100,000	
システムリサーチ	12,900	1,865.00	24,058,500	
インターネットイニシアティブ	102,400	2,689.50	275,404,800	
さくらインターネット	29,300	3,840.00	112,512,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,700	2,021.00	11,519,700	
SRAホールディングス	10,700	4,580.00	49,006,000	
朝日ネット	20,200	675.00	13,635,000	
e B A S E	26,400	508.00	13,411,200	
アバントグループ	26,300	1,477.00	38,845,100	
アドソル日進	15,400	1,184.00	18,233,600	
フリービット	9,800	1,384.00	13,563,200	
コムチュア	24,800	1,680.00	41,664,000	
アステリア	14,700	632.00	9,290,400	
アイル	10,500	2,610.00	27,405,000	
マークライnz	11,100	1,876.00	20,823,600	
メディカル・データ・ビジョン	22,400	411.00	9,206,400	
g u m i	34,600	617.00	21,348,200	貸付有価証券 23,300株
テラスカイ	7,200	2,640.00	19,008,000	貸付有価証券 4,900株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,800	2,340.00	25,272,000	
ネオジャパン	4,900	1,749.00	8,570,100	
P R T I M E S	3,800	2,390.00	9,082,000	
ラクス	88,700	2,257.50	200,240,250	
ダブルスタンダード	6,700	1,570.00	10,519,000	
オープンドア	13,200	496.00	6,547,200	貸付有価証券 8,800株
アカツキ	9,100	2,927.00	26,635,700	
U b i c o mホールディングス	6,000	955.00	5,730,000	
カナミックネットワーク	23,600	423.00	9,982,800	
チェンジホールディングス	46,500	1,115.00	51,847,500	
オークネット	17,300	1,613.00	27,904,900	
オロ	7,800	3,015.00	23,517,000	
ユーザーローカル	9,100	1,804.00	16,416,400	
P K S H A Technology	22,300	3,455.00	77,046,500	
マネーフォワード	46,100	5,095.00	234,879,500	
S u n A s t e r i s k	13,500	471.00	6,358,500	

プラスアルファ・コンサルティング	23,800	2,212.00	52,645,600	
電算システムホールディングス	8,300	2,566.00	21,297,800	
Appier Group	57,300	1,540.00	88,242,000	貸付有価証券 23,500株
ビジョナル	22,400	10,905.00	244,272,000	
ハイマックス	5,900	1,192.00	7,032,800	
野村総合研究所	406,200	5,331.00	2,165,452,200	
日本システム技術	17,400	1,815.00	31,581,000	
インテージホールディングス	14,100	1,893.00	26,691,300	
東邦システムサイエンス	8,700	1,236.00	10,753,200	
ソースネクスト	97,400	185.00	18,019,000	貸付有価証券 65,800株
シンプレクス・ホールディングス	37,000	3,820.00	141,340,000	
HEROZ	7,400	1,040.00	7,696,000	貸付有価証券 5,000株
ラクスル	44,200	1,272.00	56,222,400	
メルカリ	103,400	2,559.00	264,600,600	
I P S	5,400	2,254.00	12,171,600	
システムサポートホールディングス	6,500	2,588.00	16,822,000	
ボードルア	5,100	2,941.00	14,999,100	
イーソル	12,600	525.00	6,615,000	
ウイングアーク1st	19,500	3,725.00	72,637,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	7,500	1,072.00	8,040,000	
サーバーワークス	3,300	2,334.00	7,702,200	
Sansan	53,100	2,024.00	107,474,400	
ギフトィ	16,600	1,555.00	25,813,000	
メドレー	20,600	3,320.00	68,392,000	貸付有価証券 13,900株
ベース	9,200	3,340.00	30,728,000	
J M D C	22,800	3,920.00	89,376,000	
フォーカスシステムズ	12,500	1,391.00	17,387,500	
クレスコ	29,800	1,568.00	46,726,400	
フジ・メディア・ホールディングス	180,000	3,403.00	612,540,000	貸付有価証券 122,600株
オービック	348,000	5,501.00	1,914,348,000	
ジャストシステム	26,900	3,680.00	98,992,000	
T D C ソフト	31,600	1,282.00	40,511,200	
L I N E ヤフー	3,000,400	532.70	1,598,313,080	
トレンドマイクロ	98,500	9,513.00	937,030,500	
I D ホールディングス	12,300	2,332.00	28,683,600	
日本オラクル	35,900	16,500.00	592,350,000	
アルファシステムズ	5,900	3,490.00	20,591,000	貸付有価証券 3,900株
フューチャー	46,600	2,255.00	105,083,000	

CAC Holdings	11,500	1,981.00	22,781,500	
オービックビジネスコンサルタント	31,600	8,226.00	259,941,600	
アイティフォー	21,500	1,481.00	31,841,500	
東計電算	5,200	3,830.00	19,916,000	
大塚商会	212,400	2,876.00	610,862,400	
サイボウズ	25,800	3,925.00	101,265,000	
電通総研	18,200	6,530.00	118,846,000	
ACCESS	19,600	670.00	13,132,000	
デジタルガレージ	30,000	4,260.00	127,800,000	
EMシステムズ	29,600	732.00	21,667,200	
ウェザーニューズ	14,900	4,165.00	62,058,500	
CIJ	51,400	468.00	24,055,200	
ビジネスエンジニアリング	4,400	5,060.00	22,264,000	
WOWOW	14,100	1,230.00	17,343,000	
スカラ	17,400	410.00	7,134,000	
ANYCOLOR	25,600	4,835.00	123,776,000	
システムソフト	65,600	73.00	4,788,800	
アルゴグラフィックス	17,200	5,080.00	87,376,000	
マーベラス	34,800	527.00	18,339,600	
エイベックス	35,200	1,254.00	44,140,800	
BIPROGY	63,300	5,883.00	372,393,900	
都築電気	10,900	2,890.00	31,501,000	
TBSホールディングス	92,600	4,730.00	437,998,000	
日本テレビホールディングス	165,900	3,063.00	508,151,700	
朝日放送グループホールディングス	23,400	677.00	15,841,800	貸付有価証券 11,900株
テレビ朝日ホールディングス	45,500	2,707.00	123,168,500	
スカパーJSATホールディングス	145,600	1,357.00	197,579,200	
テレビ東京ホールディングス	11,600	3,425.00	39,730,000	
ビジョン	28,500	1,087.00	30,979,500	
U-NEXT HOLDINGS	63,000	2,291.00	144,333,000	
日本通信	150,900	152.00	22,936,800	
NTT	55,746,200	152.60	8,506,870,120	
KDDI	2,633,700	2,433.50	6,409,108,950	
ソフトバンク	30,063,300	217.60	6,541,774,080	
光通信	21,700	41,560.00	901,852,000	
エムティーアイ	12,700	912.00	11,582,400	
GMOインターネットグループ	60,500	3,589.00	217,134,500	
ファイバーゲート	7,200	692.00	4,982,400	貸付有価証券 4,900株
KADOKAWA	96,000	3,912.00	375,552,000	
学研ホールディングス	34,300	940.00	32,242,000	
ゼンリン	32,100	1,033.00	33,159,300	

アイネット	11,000	1,856.00	20,416,000	
松竹	10,700	13,310.00	142,417,000	貸付有価証券 7,300株
東宝	110,700	8,296.00	918,367,200	
東映	31,000	5,120.00	158,720,000	
ピー・シー・エー	12,300	1,767.00	21,734,100	貸付有価証券 600株
ビジネスブレイン太田昭和	8,000	2,534.00	20,272,000	
D T S	31,900	4,975.00	158,702,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	94,200	9,719.00	915,529,800	
シーイーシー	22,700	2,179.00	49,463,300	
カプコン	372,500	4,334.00	1,614,415,000	
アイ・エス・ビー	8,800	1,368.00	12,038,400	
S C S K	153,000	4,191.00	641,223,000	
N S W	8,300	2,590.00	21,497,000	
アイネス	14,600	1,654.00	24,148,400	
T K C	29,200	4,335.00	126,582,000	
N S D	72,100	3,503.00	252,566,300	
コナミグループ	70,200	20,150.00	1,414,530,000	
福井コンピュータホールディングス	13,000	3,035.00	39,455,000	
J B C Cホールディングス	49,700	1,269.00	63,069,300	
ミロク情報サービス	16,600	1,800.00	29,880,000	
ソフトバンクグループ	924,500	10,740.00	9,929,130,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	30,200	2,647.00	79,939,400	
高千穂交易	15,600	1,938.00	30,232,800	貸付有価証券 10,600株
伊藤忠食品	4,400	10,020.00	44,088,000	
あらた	30,200	3,070.00	92,714,000	
トーメンデバイス	2,900	5,970.00	17,313,000	
東京エレクトロン デバイス	19,700	2,560.00	50,432,000	
円谷フィールズホールディングス	32,000	2,127.00	68,064,000	
双日	220,100	3,606.00	793,680,600	
アルフレッサ ホールディングス	173,800	2,032.50	353,248,500	
横浜冷凍	49,700	1,052.00	52,284,400	
ラサ商事	10,600	1,459.00	15,465,400	
アルコニックス	28,200	1,972.00	55,610,400	
神戸物産	152,900	4,324.00	661,139,600	
あい ホールディングス	35,600	2,377.00	84,621,200	
ダイワボウホールディングス	87,500	2,622.00	229,425,000	
マクニカホールディングス	150,200	1,928.50	289,660,700	
ラクト・ジャパン	8,400	4,100.00	34,440,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,200	1,217.00	33,102,400	
八洲電機	16,000	1,683.00	26,928,000	

メディアスホールディングス	12,800	865.00	11,072,000	貸付有価証券 8,600株
レスター	16,800	2,539.00	42,655,200	
TOKAIホールディングス	107,400	1,010.00	108,474,000	
三洋貿易	24,300	1,462.00	35,526,600	
ビューティガレージ	5,300	1,713.00	9,078,900	
ウイン・パートナーズ	14,400	1,323.00	19,051,200	
シップヘルスケアホールディングス	78,100	2,045.00	159,714,500	
明治電機工業	9,800	1,823.00	17,865,400	
コメダホールディングス	51,700	3,030.00	156,651,000	
アセンテック	7,600	1,681.00	12,775,600	貸付有価証券 5,000株
フルサト・マルカホールディングス	15,800	2,299.00	36,324,200	
ヤマエグループホールディングス	21,300	2,562.00	54,570,600	
小野建	21,100	1,394.00	29,413,400	
佐島電機	12,500	1,649.00	20,612,500	
伯東	11,000	3,710.00	40,810,000	
コンドーテック	15,200	1,483.00	22,541,600	貸付有価証券 1,200株
ナガイレーベン	25,000	2,146.00	53,650,000	
松田産業	15,000	3,535.00	53,025,000	
第一興商	76,500	1,628.50	124,580,250	
メディバルホールディングス	214,500	2,379.50	510,402,750	
S P K	8,000	2,211.00	17,688,000	
萩原電気ホールディングス	8,500	3,210.00	27,285,000	
アズワン	60,600	2,387.50	144,682,500	
スズデン	11,300	1,681.00	18,995,300	
シモジマ	13,200	1,229.00	16,222,800	
ドウシシャ	18,300	2,474.00	45,274,200	
高速	11,700	2,774.00	32,455,800	
たけびし	8,400	1,822.00	15,304,800	貸付有価証券 5,600株
リックス	4,500	3,075.00	13,837,500	
丸文	17,600	1,044.00	18,374,400	
ハビネット	15,100	5,650.00	85,315,000	
橋本総業ホールディングス	7,800	1,282.00	9,999,600	貸付有価証券 5,300株
日本ライフライン	52,300	1,433.00	74,945,900	
タカショー	16,000	422.00	6,752,000	貸付有価証券 10,800株
I D O M	67,200	1,100.00	73,920,000	
進和	12,000	3,110.00	37,320,000	
ダイترون	8,400	3,655.00	30,702,000	
シークス	28,200	1,217.00	34,319,400	
オーハシテクニカ	9,200	1,982.00	18,234,400	

白銅	5,500	2,300.00	12,650,000	貸付有価証券 600株
伊藤忠商事	1,329,000	7,590.00	10,087,110,000	
丸紅	1,624,700	2,992.50	4,861,914,750	
長瀬産業	87,300	2,802.00	244,614,600	
蝶理	10,600	4,040.00	42,824,000	
豊田通商	593,800	3,241.00	1,924,505,800	
三共生興	25,700	610.00	15,677,000	
兼松	82,700	2,834.00	234,371,800	
三井物産	2,842,200	3,018.00	8,577,759,600	
日本紙パルプ商事	94,500	631.00	59,629,500	
カメイ	20,500	2,526.00	51,783,000	
スターゼン	40,900	1,092.00	44,662,800	
山善	66,600	1,246.00	82,983,600	貸付有価証券 45,300株
椿本興業	10,900	2,445.00	26,650,500	
住友商事	1,184,800	3,705.00	4,389,684,000	
内田洋行	7,800	9,760.00	76,128,000	
三菱商事	3,654,000	2,873.00	10,497,942,000	
第一実業	18,300	2,488.00	45,530,400	
キヤノンマーケティングジャパン	38,800	5,091.00	197,530,800	
西華産業	9,500	4,755.00	45,172,500	
佐藤商事	13,700	1,522.00	20,851,400	
東京産業	20,000	769.00	15,380,000	
ユアサ商事	17,000	4,595.00	78,115,000	
神鋼商事	13,000	2,020.00	26,260,000	
阪和興業	32,500	5,690.00	184,925,000	
正栄食品工業	13,100	4,030.00	52,793,000	
カナデン	14,500	2,008.00	29,116,000	貸付有価証券 1,500株
RYODEN	15,500	2,785.00	43,167,500	
岩谷産業	196,400	1,512.00	296,956,800	
極東貿易	11,500	1,496.00	17,204,000	
アステナホールディングス	37,200	474.00	17,632,800	
三愛オブリ	46,100	1,907.00	87,912,700	
稲畑産業	53,500	3,295.00	176,282,500	
G S Iクレオス	10,600	2,077.00	22,016,200	
明和産業	28,200	704.00	19,852,800	
ワキタ	29,100	1,700.00	49,470,000	
東邦ホールディングス	51,000	4,775.00	243,525,000	貸付有価証券 34,500株
サンゲツ	49,600	2,975.00	147,560,000	
ミツウロコグループホールディングス	24,500	2,078.00	50,911,000	
シナネンホールディングス	5,300	6,500.00	34,450,000	

伊藤忠エネクス	49,000	1,824.00	89,376,000	
サンリオ	160,600	6,746.00	1,083,407,600	
サンワテクノス	9,000	2,419.00	21,771,000	
新光商事	26,600	945.00	25,137,000	
トーヨー	8,500	3,150.00	26,775,000	
三信電気	8,000	2,359.00	18,872,000	
東陽テクニカ	18,200	1,491.00	27,136,200	
モスフードサービス	29,100	3,675.00	106,942,500	
加賀電子	40,100	2,848.00	114,204,800	
ソーダニッカ	19,300	1,074.00	20,728,200	貸付有価証券 13,000株
立花エレテック	11,800	2,703.00	31,895,400	
フォーバル	7,800	1,379.00	10,756,200	貸付有価証券 5,200株
PALTAC	30,800	4,103.00	126,372,400	
三谷産業	34,500	363.00	12,523,500	貸付有価証券 16,700株
コーア商事ホールディングス	17,700	700.00	12,390,000	貸付有価証券 11,900株
KPPグループホールディングス	39,900	771.00	30,762,900	
ヤマタネ	15,900	2,307.00	36,681,300	
泉州電業	12,800	4,140.00	52,992,000	
トラスコ中山	41,500	2,061.00	85,531,500	
オートバックスセブン	68,800	1,453.00	99,966,400	
モリト	15,700	1,382.00	21,697,400	
加藤産業	24,500	5,580.00	136,710,000	
イエローハット	67,900	1,529.00	103,819,100	
JKホールディングス	15,200	1,217.00	18,498,400	
日伝	11,000	2,730.00	30,030,000	
杉本商事	17,500	1,751.00	30,642,500	
因幡電機産業	55,600	4,001.00	222,455,600	
東テク	19,800	2,745.00	54,351,000	
ミスミグループ本社	298,800	1,904.00	568,915,200	
スズケン	60,500	5,264.00	318,472,000	
ジェコス	11,800	1,230.00	14,514,000	
インターメスティック	15,200	1,950.00	29,640,000	貸付有価証券 10,300株
サンエー	33,600	2,951.00	99,153,600	
カワチ薬品	15,600	2,791.00	43,539,600	
エービーシー・マート	86,600	2,969.00	257,115,400	
ハードオフコーポレーション	8,000	1,702.00	13,616,000	
アスクル	46,600	1,428.00	66,544,800	
ゲオホールディングス	22,500	1,642.00	36,945,000	
アダストリア	27,400	2,947.00	80,747,800	

くら寿司	23,200	3,595.00	83,404,000	
キャンドウ	7,100	3,540.00	25,134,000	貸付有価証券 4,800株
パルグループホールディングス	45,400	4,180.00	189,772,000	
エディオン	86,300	2,097.00	180,971,100	
サーラコーポレーション	41,900	924.00	38,715,600	
ハローズ	7,900	4,715.00	37,248,500	
あみやき亭	14,600	1,466.00	21,403,600	
大黒天物産	7,100	6,920.00	49,132,000	貸付有価証券 4,800株
ハニーズホールディングス	17,800	1,480.00	26,344,000	貸付有価証券 11,900株
アルペン	19,200	2,352.00	45,158,400	貸付有価証券 12,900株
クオールホールディングス	24,700	1,892.00	46,732,400	
ジinzホールディングス	13,400	8,860.00	118,724,000	
ビックカメラ	105,400	1,726.50	181,973,100	
DCMホールディングス	102,600	1,358.00	139,330,800	
MonotaRO	280,400	2,764.50	775,165,800	
J.フロント リテイリング	227,100	1,991.50	452,269,650	
ドトール・日レスホールディングス	35,200	2,589.00	91,132,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	348,700	3,081.00	1,074,344,700	貸付有価証券 235,600株
ブロンコピリー	11,700	3,515.00	41,125,500	貸付有価証券 3,400株
ZOZO	436,600	1,546.50	675,201,900	
トレジャー・ファクトリー	13,800	1,887.00	26,040,600	
物語コーポレーション	38,400	3,745.00	143,808,000	
三越伊勢丹ホールディングス	292,500	2,130.50	623,171,250	
Hamee	9,400	1,239.00	11,646,600	
ウエルシアホールディングス	102,700	2,572.00	264,144,400	
クリエイトSDホールディングス	28,100	3,215.00	90,341,500	貸付有価証券 18,900株
シュッピン	19,600	1,140.00	22,344,000	貸付有価証券 13,400株
オイシックス・ラ・大地	32,000	1,645.00	52,640,000	
ネクステージ	45,400	1,900.00	86,260,000	
ジョイフル本田	55,000	2,078.00	114,290,000	
エターナルホスピタリティグループ	8,200	3,065.00	25,133,000	貸付有価証券 5,600株
ホットランドホールディングス	15,300	2,003.00	30,645,900	貸付有価証券 10,300株
すかいらーくホールディングス	270,400	2,944.50	796,192,800	貸付有価証券 182,700株
SFPホールディングス	11,200	2,196.00	24,595,200	
綿半ホールディングス	15,600	1,594.00	24,866,400	

ヨシックスホールディングス	6,700	2,514.00	16,843,800	貸付有価証券 4,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	84,800	907.00	76,913,600	
あさひ	16,800	1,313.00	22,058,400	
日本調剤	13,100	3,065.00	40,151,500	貸付有価証券 4,800株
コスモス薬品	39,200	9,233.00	361,933,600	
セブン&アイ・ホールディングス	2,184,000	2,164.50	4,727,268,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	148,700	1,376.00	204,611,200	
ツルハホールディングス	34,700	11,325.00	392,977,500	貸付有価証券 23,500株
サンマルクホールディングス	19,600	2,349.00	46,040,400	
トリドールホールディングス	55,800	4,224.00	235,699,200	貸付有価証券 300株
TOKYO BASE	22,300	428.00	9,544,400	
JMホールディングス	14,400	2,680.00	38,592,000	
アレンザホールディングス	15,100	1,029.00	15,537,900	貸付有価証券 10,200株
串カツ田中ホールディングス	6,200	1,432.00	8,878,400	貸付有価証券 4,200株
バロックジャパンリミテッド	23,500	795.00	18,682,500	貸付有価証券 15,800株
クスリのアオキホールディングス	51,500	3,838.00	197,657,000	
力の源ホールディングス	14,800	1,400.00	20,720,000	貸付有価証券 10,000株
FOOD & LIFE COMPANIES	113,600	7,470.00	848,592,000	
メディカルシステムネットワーク	20,100	498.00	10,009,800	
ノジマ	64,600	3,460.00	223,516,000	
カップ・クリエイト	31,100	1,472.00	45,779,200	貸付有価証券 21,000株
良品計画	215,900	7,046.00	1,521,231,400	
アドヴァングループ	16,900	807.00	13,638,300	
アルビス	6,600	2,964.00	19,562,400	貸付有価証券 4,300株
G-7ホールディングス	21,800	1,320.00	28,776,000	
イオン北海道	48,700	887.00	43,196,900	貸付有価証券 32,900株
コジマ	37,500	1,378.00	51,675,000	貸付有価証券 20,800株
コーナン商事	21,900	3,960.00	86,724,000	
エコス	7,500	2,543.00	19,072,500	貸付有価証券 2,800株
ワタミ	23,900	1,017.00	24,306,300	
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	399,500	4,994.00	1,995,103,000	
西松屋チェーン	43,900	2,147.00	94,253,300	

ゼンショーホールディングス	112,400	7,987.00	897,738,800	
幸楽苑	17,200	1,018.00	17,509,600	貸付有価証券 6,200株
サイゼリヤ	25,600	5,000.00	128,000,000	
V Tホールディングス	77,900	459.00	35,756,100	
魚力	7,000	2,412.00	16,884,000	
フジ・コーポレーション	9,000	2,825.00	25,425,000	
ユナイテッドアローズ	21,300	2,145.00	45,688,500	
ハイデイ日高	32,100	3,235.00	103,843,500	
コロワイド	111,600	1,835.00	204,786,000	貸付有価証券 75,600株
壱番屋	78,500	916.00	71,906,000	貸付有価証券 45,400株
スギホールディングス	106,300	3,369.00	358,124,700	
薬王堂ホールディングス	9,800	2,153.00	21,099,400	
ダブルエー	5,600	1,365.00	7,644,000	貸付有価証券 2,800株
スクロール	29,200	1,050.00	30,660,000	
ヨンドシーホールディングス	18,900	1,735.00	32,791,500	
木曽路	30,100	2,331.00	70,163,100	貸付有価証券 20,500株
S R Sホールディングス	32,900	1,232.00	40,532,800	
千趣会	40,000	242.00	9,680,000	貸付有価証券 26,700株
リテールパートナーズ	29,600	1,413.00	41,824,800	
上新電機	19,700	2,408.00	47,437,600	
日本瓦斯	94,700	2,663.00	252,186,100	
ロイヤルホールディングス	34,800	2,627.00	91,419,600	貸付有価証券 23,700株
チヨダ	18,800	1,184.00	22,259,200	
ライフコーポレーション	41,000	2,348.00	96,268,000	
リンガーハット	25,500	2,172.00	55,386,000	貸付有価証券 17,200株
M r M a x H D	25,500	777.00	19,813,500	
A O K Iホールディングス	42,600	1,682.00	71,653,200	
オークワ	30,600	938.00	28,702,800	貸付有価証券 19,300株
コメリ	26,700	2,962.00	79,085,400	貸付有価証券 6,000株
青山商事	42,400	2,290.00	97,096,000	
しまむら	46,500	10,710.00	498,015,000	
高島屋	266,100	1,117.50	297,366,750	貸付有価証券 186,100株
松屋	33,500	1,014.00	33,969,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	96,200	1,958.00	188,359,600	
近鉄百貨店	11,500	1,772.00	20,378,000	

丸井グループ	115,500	3,003.00	346,846,500	
アクシアル リテイリング	54,300	1,116.00	60,598,800	
イオン	803,500	4,320.00	3,471,120,000	
イズミ	30,000	3,201.00	96,030,000	
平和堂	32,400	2,918.00	94,543,200	
フジ	36,400	1,985.00	72,254,000	貸付有価証券 24,600株
ヤオコー	23,400	9,562.00	223,750,800	
ゼビオホールディングス	27,100	1,136.00	30,785,600	
ケースホールディングス	122,500	1,527.50	187,118,750	
シルバーライフ	5,800	727.00	4,216,600	
Genky DrugStores	17,400	4,095.00	71,253,000	
ブックオフグループホールディングス	14,600	1,418.00	20,702,800	貸付有価証券 9,800株
ギフトホールディングス	9,900	3,425.00	33,907,500	貸付有価証券 6,600株
アインホールディングス	19,900	5,545.00	110,345,500	
Genki Global Dining	11,300	3,945.00	44,578,500	
ヤマダホールディングス	608,900	457.30	278,449,970	
アークランズ	59,000	1,727.00	101,893,000	
ニトリホールディングス	72,000	13,445.00	968,040,000	
グルメ杵屋	16,400	932.00	15,284,800	貸付有価証券 11,000株
ケーユーホールディングス	11,900	1,124.00	13,375,600	
吉野家ホールディングス	77,500	3,251.00	251,952,500	貸付有価証券 52,700株
松屋フーズホールディングス	9,400	6,040.00	56,776,000	
サガミホールディングス	32,000	1,670.00	53,440,000	
王将フードサービス	38,700	3,620.00	140,094,000	
ミニストップ	16,400	1,885.00	30,914,000	貸付有価証券 11,100株
アークス	33,400	3,085.00	103,039,000	
パローホールディングス	37,900	2,609.00	98,881,100	
ベルク	9,900	7,660.00	75,834,000	
大庄	13,700	1,137.00	15,576,900	貸付有価証券 8,200株
ファーストリテイリング	133,400	46,740.00	6,235,116,000	
サンドラッグ	66,800	4,504.00	300,867,200	
サックスパー ホールディングス	19,200	815.00	15,648,000	貸付有価証券 12,900株
ベルーナ	48,000	955.00	45,840,000	
いよぎんホールディングス	240,900	1,661.50	400,255,350	
しずおかフィナンシャルグループ	405,400	1,678.50	680,463,900	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	154,900	1,797.50	278,432,750	
楽天銀行	85,300	6,645.00	566,818,500	

京都フィナンシャルグループ	231,600	2,682.50	621,267,000	
めぶきフィナンシャルグループ	896,600	769.70	690,113,020	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,600	6,670.00	157,412,000	
九州フィナンシャルグループ	323,800	753.70	244,048,060	
ゆうちょ銀行	1,499,200	1,586.50	2,378,480,800	
富山第一銀行	58,400	1,026.00	59,918,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	959,800	933.60	896,069,280	
西日本フィナンシャルホールディングス	112,500	2,234.00	251,325,000	
三十三フィナンシャルグループ	16,500	3,185.00	52,552,500	
第四北越フィナンシャルグループ	57,800	3,465.00	200,277,000	
ひろぎんホールディングス	256,000	1,210.50	309,888,000	
おきなわフィナンシャルグループ	14,500	3,220.00	46,690,000	
十六フィナンシャルグループ	25,800	5,110.00	131,838,000	
北國フィナンシャルホールディングス	17,800	5,070.00	90,246,000	
プロクレアホールディングス	21,000	1,432.00	30,072,000	
あいちフィナンシャルグループ	34,300	2,632.00	90,277,600	
あおぞら銀行	127,000	2,121.50	269,430,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,805,600	1,972.50	23,286,546,000	
りそなホールディングス	2,257,000	1,304.00	2,943,128,000	
三井住友トラストグループ	646,300	3,879.00	2,506,997,700	
三井住友フィナンシャルグループ	3,800,100	3,595.00	13,661,359,500	
千葉銀行	562,900	1,338.50	753,441,650	貸付有価証券 377,900株
群馬銀行	312,000	1,256.00	391,872,000	
武蔵野銀行	28,000	3,445.00	96,460,000	
千葉興業銀行	43,500	1,511.00	65,728,500	
筑波銀行	80,800	240.00	19,392,000	
七十七銀行	58,900	4,969.00	292,674,100	
秋田銀行	12,300	3,035.00	37,330,500	
山形銀行	20,300	1,524.00	30,937,200	
岩手銀行	11,600	3,245.00	37,642,000	
東邦銀行	211,700	342.00	72,401,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	160,300	3,994.00	640,238,200	
スルガ銀行	124,000	1,393.00	172,732,000	
八十二銀行	414,000	1,223.50	506,529,000	
山梨中央銀行	20,600	2,626.00	54,095,600	
大垣共立銀行	35,100	2,642.00	92,734,200	
福井銀行	16,400	1,807.00	29,634,800	
清水銀行	7,300	1,400.00	10,220,000	
滋賀銀行	27,800	6,140.00	170,692,000	
南都銀行	27,700	4,320.00	119,664,000	
百五銀行	173,100	726.00	125,670,600	
紀陽銀行	65,800	2,576.00	169,500,800	

ほくほくフィナンシャルグループ	103,500	2,895.00	299,632,500	
山陰合同銀行	115,200	1,241.00	142,963,200	
百十四銀行	18,000	4,570.00	82,260,000	
四国銀行	26,700	1,167.00	31,158,900	
阿波銀行	25,200	3,030.00	76,356,000	
大分銀行	10,700	4,150.00	44,405,000	
宮崎銀行	11,700	3,815.00	44,635,500	
佐賀銀行	10,700	2,363.00	25,284,100	
琉球銀行	42,200	1,204.00	50,808,800	
セブン銀行	659,300	267.10	176,099,030	
みずほフィナンシャルグループ	2,459,200	4,003.00	9,844,177,600	
山口フィナンシャルグループ	180,500	1,600.50	288,890,250	
名古屋銀行	11,500	8,560.00	98,440,000	
北洋銀行	248,200	598.00	148,423,600	
愛媛銀行	26,900	1,020.00	27,438,000	
京葉銀行	82,700	1,066.00	88,158,200	
栃木銀行	84,300	413.00	34,815,900	
北日本銀行	6,300	2,990.00	18,837,000	
東和銀行	33,800	739.00	24,978,200	
トモニホールディングス	175,800	593.00	104,249,400	
フィデアホールディングス	19,000	1,465.00	27,835,000	
池田泉州ホールディングス	255,300	627.00	160,073,100	
F P G	58,600	2,374.00	139,116,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	29,800	1,739.00	51,822,200	
S B I ホールディングス	296,500	5,328.00	1,579,752,000	
ジャフコ グループ	54,800	2,426.50	132,972,200	
大和証券グループ本社	1,316,000	1,006.50	1,324,554,000	
野村ホールディングス	3,094,900	928.40	2,873,305,160	
岡三証券グループ	145,400	679.00	98,726,600	
丸三証券	61,200	906.00	55,447,200	
東洋証券	53,200	499.00	26,546,800	貸付有価証券 31,000株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	218,500	507.00	110,779,500	
水戸証券	50,500	561.00	28,330,500	
いちよし証券	37,100	785.00	29,123,500	
松井証券	126,800	701.00	88,886,800	
マネックスグループ	177,200	750.00	132,900,000	
極東証券	22,900	1,528.00	34,991,200	
岩井コスモホールディングス	21,000	2,313.00	48,573,000	
アイザワ証券グループ	25,900	1,340.00	34,706,000	貸付有価証券 14,800株
スパークス・グループ	20,400	1,438.00	29,335,200	
かんぽ生命保険	214,400	3,375.00	723,600,000	

F P パートナー	8,400	2,130.00	17,892,000	貸付有価証券 5,400株
S O M P O ホールディングス	848,800	4,185.00	3,552,228,000	
アニコム ホールディングス	61,800	707.00	43,692,600	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	1,348,900	3,098.00	4,178,892,200	
第一生命ホールディングス	3,362,100	1,080.00	3,631,068,000	
東京海上ホールディングス	1,757,000	5,697.00	10,009,629,000	
T & D ホールディングス	494,400	3,168.00	1,566,259,200	
全国保証	96,500	3,165.00	305,422,500	
ジェイリース	13,800	1,436.00	19,816,800	
S B I アルヒ	19,900	818.00	16,278,200	
プレミアグループ	31,600	2,044.00	64,590,400	
ネットプロテクションズホールディングス	63,900	679.00	43,388,100	
クレディセゾン	116,900	3,968.00	463,859,200	
芙蓉総合リース	51,000	3,916.00	199,716,000	
みずほリース	139,100	1,085.00	150,923,500	
東京センチュリー	138,100	1,705.00	235,460,500	
日本証券金融	68,200	1,745.00	119,009,000	
アイフル	307,000	433.00	132,931,000	
リコーリース	17,600	5,390.00	94,864,000	
イオンフィナンシャルサービス	106,300	1,292.50	137,392,750	
アコム	440,100	422.00	185,722,200	
ジャックス	22,300	4,160.00	92,768,000	
オリエントコーポレーション	61,000	999.00	60,939,000	
オリックス	1,056,700	3,296.00	3,482,883,200	
三菱HCキャピタル	923,400	1,084.50	1,001,427,300	
日本取引所グループ	1,095,500	1,476.00	1,616,958,000	
イー・ギャランティ	30,800	1,474.00	45,399,200	
N E C キャピタルソリューション	9,300	3,855.00	35,851,500	貸付有価証券 6,200株
r o b o t h o m e	54,600	153.00	8,353,800	貸付有価証券 36,400株
大東建託	62,700	15,330.00	961,191,000	
いちご	157,100	415.00	65,196,500	
日本駐車場開発	221,200	259.00	57,290,800	
スター・マイカ・ホールディングス	19,600	940.00	18,424,000	
S R E ホールディングス	7,000	3,120.00	21,840,000	
ヒューリック	429,700	1,465.00	629,510,500	
野村不動産ホールディングス	577,700	859.50	496,533,150	
三重交通グループホールディングス	40,500	495.00	20,047,500	
ディア・ライフ	30,900	1,254.00	38,748,600	
地主	16,500	2,262.00	37,323,000	
J P M C	10,900	1,173.00	12,785,700	

フージャースホールディングス	28,400	1,285.00	36,494,000	
オープンハウスグループ	59,100	6,760.00	399,516,000	
東急不動産ホールディングス	553,800	1,051.50	582,320,700	
飯田グループホールディングス	176,600	2,075.50	366,533,300	
A n d D oホールディングス	11,200	1,072.00	12,006,400	貸付有価証券 7,400株
ケイアイスター不動産	10,100	4,805.00	48,530,500	
グッドコムアセット	15,400	1,167.00	17,971,800	貸付有価証券 10,500株
ジェイ・エス・ビー	7,800	3,960.00	30,888,000	
ロードスターキャピタル	10,700	2,841.00	30,398,700	
霞ヶ関キャピタル	7,600	17,160.00	130,416,000	貸付有価証券 5,100株
パーク24	143,700	1,922.50	276,263,250	
パラカ	5,900	1,829.00	10,791,100	
三井不動産	2,527,700	1,376.00	3,478,115,200	
三菱地所	1,049,100	2,722.50	2,856,174,750	
平和不動産	60,000	2,226.00	133,560,000	
東京建物	161,000	2,556.00	411,516,000	
京阪神ビルディング	31,100	1,504.00	46,774,400	
住友不動産	299,500	5,534.00	1,657,433,000	
テオーシー	33,600	710.00	23,856,000	
レオパレス21	161,100	675.00	108,742,500	
スターツコーポレーション	30,300	4,610.00	139,683,000	
フジ住宅	24,000	675.00	16,200,000	
空港施設	26,600	820.00	21,812,000	
明和地所	15,300	936.00	14,320,800	貸付有価証券 10,200株
ゴールドクレスト	12,700	3,370.00	42,799,000	
エスリード	8,800	4,660.00	41,008,000	貸付有価証券 4,400株
日神グループホールディングス	30,600	513.00	15,697,800	
エスコン	48,200	1,023.00	49,308,600	
M I R A R T Hホールディングス	107,800	376.00	40,532,800	
カチタス	49,700	2,476.00	123,057,200	
トーセイ	30,800	2,772.00	85,377,600	
サンフロンティア不動産	30,900	2,076.00	64,148,400	
F Jネクストホールディングス	19,800	1,204.00	23,839,200	
グランディハウス	18,300	537.00	9,827,100	
日本空港ビルデング	65,200	4,576.00	298,355,200	
L I F U L L	57,200	186.00	10,639,200	
M I X I	35,700	3,400.00	121,380,000	
ジェイエイシーリクルートメント	69,600	1,041.00	72,453,600	
日本M&Aセンターホールディングス	282,800	715.20	202,258,560	

メンバーズ	7,600	1,189.00	9,036,400	
UTグループ	25,100	2,491.00	62,524,100	
アイティメディア	10,400	1,615.00	16,796,000	貸付有価証券 7,000株
ケアネット	39,500	676.00	26,702,000	
E・Jホールディングス	12,700	1,502.00	19,075,400	
オープンアップグループ	64,300	1,716.00	110,338,800	
コシダカホールディングス	57,100	1,284.00	73,316,400	貸付有価証券 39,200株
パソナグループ	22,900	2,361.00	54,066,900	
リンクアンドモチベーション	45,700	493.00	22,530,100	
エス・エム・エス	73,500	1,453.00	106,795,500	
パーソルホールディングス	1,751,900	286.50	501,919,350	
クックパッド	53,300	221.00	11,779,300	貸付有価証券 36,300株
学情	9,900	1,800.00	17,820,000	貸付有価証券 6,700株
スタジオアリス	9,700	2,145.00	20,806,500	貸付有価証券 6,500株
N J S	4,800	5,570.00	26,736,000	貸付有価証券 3,200株
総合警備保障	321,000	1,015.00	325,815,000	
カカクコム	138,600	2,653.50	367,775,100	
セントケア・ホールディング	12,400	752.00	9,324,800	
ルネサンス	15,100	1,051.00	15,870,100	
ディップ	33,700	2,299.00	77,476,300	貸付有価証券 22,800株
デジタルホールディングス	9,900	1,172.00	11,602,800	
新日本科学	20,500	1,387.00	28,433,500	
エムスリー	379,700	1,874.50	711,747,650	貸付有価証券 254,900株
ワールドホールディングス	7,600	2,269.00	17,244,400	
ディー・エヌ・エー	76,900	2,388.50	183,675,650	貸付有価証券 51,500株
博報堂DYホールディングス	217,900	1,169.00	254,725,100	
ぐるなび	36,400	252.00	9,172,800	
タカミヤ	26,600	321.00	8,538,600	
ファンコミュニケーションズ	26,500	464.00	12,296,000	
ライク	10,100	1,377.00	13,907,700	貸付有価証券 6,700株
エスプール	61,200	350.00	21,420,000	
WDBホールディングス	9,900	1,643.00	16,265,700	
アドウェイズ	24,000	347.00	8,328,000	
バリューコマース	17,100	783.00	13,389,300	
インフォマート	181,700	418.00	75,950,600	

J Pホールディングス	49,400	532.00	26,280,800	貸付有価証券 32,900株
C Lホールディングス	4,800	785.00	3,768,000	貸付有価証券 3,200株
プレステージ・インターナショナル	89,200	600.00	53,520,000	
アミューズ	11,800	1,611.00	19,009,800	
ドリームインキュベータ	4,700	2,271.00	10,673,700	貸付有価証券 3,200株
クイック	13,200	2,288.00	30,201,600	
電通グループ	204,400	2,962.50	605,535,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	9,400	889.00	8,356,600	
イオンファンタジー	8,400	2,895.00	24,318,000	
シーティーエス	26,600	817.00	21,732,200	
H . U . グループホールディングス	56,300	3,147.00	177,176,100	
アルプス技研	16,300	2,734.00	44,564,200	
サニックスホールディングス	27,800	250.00	6,950,000	
日本空調サービス	20,800	1,093.00	22,734,400	
オリエンタルランド	1,132,300	3,074.00	3,480,690,200	
ダスキン	40,900	3,958.00	161,882,200	
明光ネットワークジャパン	25,500	745.00	18,997,500	
ファルコホールディングス	7,700	2,282.00	17,571,400	
ラウンドワン	181,500	1,481.00	268,801,500	
リゾートトラスト	151,800	1,798.00	272,936,400	
ビー・エム・エル	23,700	3,300.00	78,210,000	
リソー教育	120,800	222.00	26,817,600	
早稲田アカデミー	10,700	2,527.00	27,038,900	
ユー・エス・エス	395,200	1,630.00	644,176,000	
東京個別指導学院	23,200	357.00	8,282,400	
サイバーエージェント	389,400	1,520.00	591,888,000	
楽天グループ	1,360,800	808.50	1,100,206,800	
クリーク・アンド・リバー社	9,800	1,600.00	15,680,000	
S B I グローバルアセットマネジメント	37,900	622.00	23,573,800	貸付有価証券 25,600株
テー・オー・ダブリュー	34,700	308.00	10,687,600	
G M O インターネット	4,800	2,066.00	9,916,800	貸付有価証券 3,200株
山田コンサルティンググループ	9,800	1,624.00	15,915,200	
セントラルスポーツ	7,300	2,413.00	17,614,900	
フルキャストホールディングス	15,300	1,632.00	24,969,600	貸付有価証券 10,100株
エン・ジャパン	31,400	1,751.00	54,981,400	
テクノプロ・ホールディングス	116,900	4,298.00	502,436,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	10,200	634.00	6,466,800	
K e e P e r 技研	11,900	3,270.00	38,913,000	貸付有価証券 8,000株

Gunosy	15,500	657.00	10,183,500	
イー・ガーディアン	9,000	2,101.00	18,909,000	
ジャパンマテリアル	58,900	1,400.00	82,460,000	
ベクトル	26,400	1,082.00	28,564,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	16,100	1,325.00	21,332,500	
キャリアリンク	7,100	2,184.00	15,506,400	
I B J	14,900	846.00	12,605,400	
アサンテ	9,600	1,611.00	15,465,600	貸付有価証券 3,500株
バリューHR	17,300	1,648.00	28,510,400	貸付有価証券 11,700株
M&Aキャピタルパートナーズ	15,600	2,961.00	46,191,600	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	996.00	7,768,800	
シグマクシス・ホールディングス	56,100	1,182.00	66,310,200	
ウィルグループ	16,300	927.00	15,110,100	
メドピア	15,400	756.00	11,642,400	
リクルートホールディングス	1,420,700	8,379.00	11,904,045,300	
エラン	25,600	813.00	20,812,800	貸付有価証券 8,600株
日本郵政	1,907,000	1,335.50	2,546,798,500	
ベルシステム24ホールディングス	21,000	1,291.00	27,111,000	
鎌倉新書	16,700	564.00	9,418,800	貸付有価証券 11,300株
エアトリ	15,800	949.00	14,994,200	
アトラエ	15,100	759.00	11,460,900	
ストライク	9,500	3,825.00	36,337,500	貸付有価証券 6,400株
ソラスト	53,400	422.00	22,534,800	
セラク	5,900	1,616.00	9,534,400	
インソース	41,900	987.00	41,355,300	
ペイカレント	141,200	7,958.00	1,123,669,600	
Orchestra Holdings	4,400	690.00	3,036,000	
アイモバイル	28,700	647.00	18,568,900	
MS - Japan	10,700	933.00	9,983,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	74,700	4,175.00	311,872,500	
エル・ティー・エス	2,700	2,267.00	6,120,900	
ミダックホールディングス	11,700	2,066.00	24,172,200	
キュービーネットホールディングス	11,200	1,216.00	13,619,200	
オープングループ	31,100	365.00	11,351,500	
マネジメントソリューションズ	9,500	1,666.00	15,827,000	貸付有価証券 6,400株
プロレド・パートナーズ	5,000	610.00	3,050,000	
フロンティア・マネジメント	6,000	667.00	4,002,000	貸付有価証券 4,000株

アンビスホールディングス	41,500	491.00	20,376,500	
カーブスホールディングス	52,700	703.00	37,048,100	
フォーラムエンジニアリング	22,500	1,193.00	26,842,500	
Fast Fitness Japan	6,700	1,486.00	9,956,200	
Macbee Planet	7,200	2,661.00	19,159,200	
ダイレクトマーケティングミックス	23,900	248.00	5,927,200	
ポピンズ	3,700	1,213.00	4,488,100	
LITALICO	17,600	1,315.00	23,144,000	
リログループ	107,000	1,685.50	180,348,500	
東祥	16,300	628.00	10,236,400	
ビーウィズ	5,000	1,420.00	7,100,000	
サンウェルズ	10,100	640.00	6,464,000	貸付有価証券 6,800株
TREホールディングス	44,200	1,353.00	59,802,600	
人・夢・技術グループ	8,000	1,600.00	12,800,000	
NISSOホールディングス	16,900	652.00	11,018,800	
大栄環境	41,900	2,991.00	125,322,900	
GENOVA	8,900	708.00	6,301,200	
日本管財ホールディングス	20,200	2,704.00	54,620,800	
M&A総研ホールディングス	25,000	1,353.00	33,825,000	貸付有価証券 14,200株
エイチ・アイ・エス	61,500	1,352.00	83,148,000	貸付有価証券 41,500株
ラックランド	8,000	999.00	7,992,000	
共立メンテナンス	60,300	3,733.00	225,099,900	貸付有価証券 41,100株
イチネンホールディングス	18,800	1,640.00	30,832,000	
建設技術研究所	19,800	2,850.00	56,430,000	
スペース	14,100	1,173.00	16,539,300	
燦ホールディングス	16,200	1,576.00	25,531,200	
スバル興業	7,500	2,804.00	21,030,000	
タナベコンサルティンググループ	16,300	763.00	12,436,900	
ナガワ	5,200	6,080.00	31,616,000	貸付有価証券 2,700株
東京都競馬	14,100	4,935.00	69,583,500	
カナモト	29,800	3,315.00	98,787,000	
ニシオホールディングス	15,900	4,095.00	65,110,500	
トランス・コスモス	24,600	3,560.00	87,576,000	
乃村工藝社	84,000	928.00	77,952,000	
藤田観光	8,500	11,380.00	96,730,000	
KNT-CTホールディングス	11,500	1,041.00	11,971,500	
トーカイ	17,100	2,112.00	36,115,200	
セコム	391,300	5,215.00	2,040,629,500	
セントラル警備保障	10,400	2,369.00	24,637,600	

丹青社	40,700	1,333.00	54,253,100	
メイテックグループホールディングス	70,900	3,135.00	222,271,500	
応用地質	17,400	3,020.00	52,548,000	
船井総研ホールディングス	38,500	2,411.00	92,823,500	
学究社	7,700	2,373.00	18,272,100	
ナック	19,800	545.00	10,791,000	貸付有価証券 13,300株
ダイセキ	46,400	3,465.00	160,776,000	
ステップ	7,100	2,292.00	16,273,200	
合 計	356,763,600		742,288,474,850	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	31,708,034
株式	5,650,511,770
派生商品評価勘定	59,524
未収配当金	14,805,300
未収利息	405
前払金	50,550
差入委託証拠金	765,911
流動資産合計	5,697,901,494
資産合計	5,697,901,494
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	110,602
流動負債合計	110,602
負債合計	110,602
純資産の部	
元本等	
元本	3,221,030,945
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,476,759,947
元本等合計	5,697,790,892
純資産合計	5,697,790,892
負債純資産合計	5,697,901,494

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,221,030,945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 1.7689円 (1万口当たり純資産額) (17,689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

2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2025年 7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。 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	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	3,168,336,264円
期中追加設定元本額	150,551,825円
期中一部解約元本額	97,857,144円
期末元本額	3,221,030,945円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	671,130,251円
分散投資コア戦略ファンドS	2,549,900,694円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	78,071,970	
合計	78,071,970	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式最小分散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

(2025年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	16,937,550	-	16,887,000	50,550
合計		16,937,550	-	16,887,000	50,550

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
I N P E X	1,500	2,073.50	3,110,250	
大林組	10,600	2,159.00	22,885,400	
大和ハウス工業	17,200	4,929.00	84,778,800	
積水ハウス	23,700	3,172.00	75,176,400	
ヤクルト本社	4,500	2,614.50	11,765,250	
明治ホールディングス	17,200	3,094.00	53,216,800	
アサヒグループホールディングス	3,500	1,855.00	6,492,500	
麒麟ホールディングス	38,500	1,975.50	76,056,750	
サントリー食品インターナショナル	5,800	4,451.00	25,815,800	
味の素	6,700	3,950.00	26,465,000	
日清食品ホールディングス	3,100	2,897.50	8,982,250	
日本たばこ産業	19,000	4,155.00	78,945,000	
信越化学工業	12,400	4,650.00	57,660,000	
積水化学工業	7,200	2,555.00	18,396,000	
花王	13,500	6,566.00	88,641,000	
富士フイルムホールディングス	22,400	2,995.00	67,088,000	
ユニ・チャーム	51,100	1,028.50	52,556,350	
協和キリン	20,000	2,485.50	49,710,000	
武田薬品工業	20,700	4,336.00	89,755,200	
アステラス製薬	51,400	1,377.00	70,777,800	
塩野義製薬	37,100	2,468.00	91,562,800	
中外製薬	11,200	6,859.00	76,820,800	
小野薬品工業	23,200	1,591.00	36,911,200	
第一三共	15,500	3,210.00	49,755,000	
大塚ホールディングス	12,900	6,600.00	85,140,000	
出光興産	13,400	915.00	12,261,000	
ブリヂストン	13,900	6,003.00	83,441,700	
日本製鉄	29,800	2,799.50	83,425,100	
小松製作所	4,200	4,791.00	20,122,200	
ダイキン工業	800	18,110.00	14,488,000	
日立製作所	16,500	4,115.00	67,897,500	
三菱電機	3,800	3,096.00	11,764,800	
日本電気	11,300	3,866.00	43,685,800	
富士通	25,200	3,258.00	82,101,600	
ソニーグループ	16,900	3,607.00	60,958,300	
キーエンス	1,300	55,480.00	72,124,000	
シスメックス	1,200	2,444.00	2,932,800	
京セラ	26,800	1,627.50	43,617,000	
キヤノン	19,200	4,017.00	77,126,400	
東京エレクトロン	2,800	26,760.00	74,928,000	

デンソー	15,500	1,951.00	30,240,500
トヨタ自動車	31,900	2,473.50	78,904,650
本田技研工業	47,600	1,484.50	70,662,200
シマノ	900	20,260.00	18,234,000
テルモ	19,700	2,448.50	48,235,450
オリンパス	4,200	1,676.00	7,039,200
H O Y A	3,000	17,780.00	53,340,000
バンダイナムコホールディングス	2,800	4,631.00	12,966,800
大日本印刷	14,200	2,193.50	31,147,700
任天堂	7,400	12,680.00	93,832,000
中部電力	41,900	1,818.50	76,195,150
関西電力	15,800	1,719.50	27,168,100
東京瓦斯	6,500	4,756.00	30,914,000
大阪瓦斯	23,800	3,662.00	87,155,600
東急	18,300	1,684.00	30,817,200
東日本旅客鉄道	27,600	3,226.00	89,037,600
西日本旅客鉄道	12,900	3,272.00	42,208,800
東海旅客鉄道	28,300	3,328.00	94,182,400
阪急阪神ホールディングス	4,200	3,827.00	16,073,400
S Gホールディングス	23,200	1,628.50	37,781,200
日本郵船	5,000	5,100.00	25,500,000
商船三井	12,500	4,707.00	58,837,500
日本航空	12,600	2,929.00	36,905,400
A N Aホールディングス	29,700	2,945.00	87,466,500
T I S	600	4,628.00	2,776,800
野村総合研究所	10,800	5,331.00	57,574,800
オービック	16,200	5,501.00	89,116,200
L I N Eヤフー	104,400	532.70	55,613,880
トレンドマイクロ	400	9,513.00	3,805,200
日本オラクル	5,000	16,500.00	82,500,000
大塚商会	25,000	2,876.00	71,900,000
N T T	556,700	152.60	84,952,420
K D D I	33,600	2,433.50	81,765,600
ソフトバンク	389,700	217.60	84,798,720
東宝	4,800	8,296.00	39,820,800
S C S K	900	4,191.00	3,771,900
コナミグループ	900	20,150.00	18,135,000
ソフトバンクグループ	800	10,740.00	8,592,000
神戸物産	3,400	4,324.00	14,701,600
伊藤忠商事	11,300	7,590.00	85,767,000
三井物産	24,900	3,018.00	75,148,200
住友商事	7,900	3,705.00	29,269,500

三菱商事	29,400	2,873.00	84,466,200
Z O Z O	25,100	1,546.50	38,817,150
セブン&アイ・ホールディングス	22,800	2,164.50	49,350,600
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	12,600	4,994.00	62,924,400
ゼンショーホールディングス	900	7,987.00	7,188,300
イオン	19,200	4,320.00	82,944,000
ニトリホールディングス	4,800	13,445.00	64,536,000
ファーストリテイリング	1,800	46,740.00	84,132,000
ゆうちょ銀行	56,900	1,586.50	90,271,850
三菱UFJフィナンシャル・グループ	43,200	1,972.50	85,212,000
三井住友トラストグループ	2,900	3,879.00	11,249,100
三井住友フィナンシャルグループ	23,900	3,595.00	85,920,500
みずほフィナンシャルグループ	11,800	4,003.00	47,235,400
S O M P Oホールディングス	8,600	4,185.00	35,991,000
M S & A Dインシュアランスグループホール ディングス	12,500	3,098.00	38,725,000
東京海上ホールディングス	12,400	5,697.00	70,642,800
オリックス	10,700	3,296.00	35,267,200
三菱HCキャピタル	42,400	1,084.50	45,982,800
日本取引所グループ	7,900	1,476.00	11,660,400
大東建託	5,200	15,330.00	79,716,000
ヒューリック	5,400	1,465.00	7,911,000
三井不動産	52,000	1,376.00	71,552,000
三菱地所	12,500	2,722.50	34,031,250
オリエンタルランド	24,800	3,074.00	76,235,200
リクルートホールディングス	6,600	8,379.00	55,301,400
日本郵政	57,400	1,335.50	76,657,700
セコム	15,800	5,215.00	82,397,000
合 計	2,773,300		5,650,511,770

(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

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,665,980,435
国債証券	609,757,765,650
地方債証券	36,615,176,338
特殊債券	38,310,485,099
社債券	33,420,287,000
未収入金	894,008,600
未収利息	1,366,830,210
前払費用	97,202,196
流動資産合計	722,127,735,528
資産合計	722,127,735,528
負債の部	
流動負債	
未払金	2,501,571,100
未払解約金	138,830,684
流動負債合計	2,640,401,784
負債合計	2,640,401,784
純資産の部	
元本等	
元本	571,146,449,685
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	148,340,884,059
元本等合計	719,487,333,744
純資産合計	719,487,333,744
負債純資産合計	722,127,735,528

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7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 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	571,146,449,685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 98,169,000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 1.2597円 (1万口当たり純資産額) (12,597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

	2025年 7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。

2025年 7月10日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	513,531,434,925円
期中追加設定元本額	127,515,302,345円
期中一部解約元本額	69,900,287,585円
期末元本額	571,146,449,685円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,994,556,390円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,269,001円
S M T 国内債券インデックス・オープン	15,524,942,651円
世界経済インデックスファンド	10,709,528,637円
D C マイセクション 2 5	30,254,986,182円
D C マイセクション 5 0	39,359,568,688円
D C マイセクション 7 5	13,590,503,930円
D C 日本債券インデックス・オープン	392,356,214円
D C 日本債券インデックス・オープン S	85,634,070,874円
D C 日本債券インデックス・オープン P	60,545,687,405円
D C マイセクション S 2 5	24,826,602,005円
D C マイセクション S 5 0	29,349,614,753円
D C マイセクション S 7 5	8,811,312,519円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	115,521,651円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,382,217,175円

区分	2025年 7月10日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,456,727,251円
DC世界経済インデックスファンド	7,023,938,548円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,908,762円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	20,454,815円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	7,536,342円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,314,105円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	39,817,263円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	71,788,942円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	22,499,220円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	23,477,545円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,176,805,365円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	684,497,730円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,129,335,282円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	66,404,060円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	39,021,735円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	802,857,168円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	927,361,256円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,230,765,182円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	86,312,342円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	7,139,037,472円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,364,651,336円
分散投資コア戦略ファンドA	18,906,344,545円
分散投資コア戦略ファンドS	27,833,258,073円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	408,994,379円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,374,259,055円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,960,325円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	49,261,085円
SMT インデックスバランス・オープン	63,817,637円
SMT 世界経済インデックス・オープン	87,937,279円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	205,646,204円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	321,170,385円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	26,877,184円
グローバル経済コア	623,390,742円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	64,444,882円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	51,637,424円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	276,517,308円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	174,137,103円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	57,061,880円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	45,735,524円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,951,609,797円
10資産分散投資ファンド	516,235,406円
グローバル10資産バランスファンド	896,108,320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	257,002,249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	109,072,996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	67,250,961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	43,843,160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	22,426,375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	14,320,503円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	31,570,550円
DCマイセクションS50（2024-2026リスク抑制型）	13,809,593,774円
DCターゲット・イヤー ファンド2065	56,392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）	120,358,812,444円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	70,993,166円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	22,614,869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）	721,308,080円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	75,705円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	109,288円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	76,953円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	77,463円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	110,899円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	148,218円
国内債券インデックスファンドT（一般投資家私募/適格機関投資家転売制限付）	11,761,104,067円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7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	1,220,378,510
地方債証券	33,892,985
特殊債券	32,546,408
社債券	10,337,000
合計	1,208,694,933

(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463回利付国債(2年)	2,840,000,000	2,834,320,000	
	第464回利付国債(2年)	4,720,000,000	4,709,285,600	
	第465回利付国債(2年)	1,810,000,000	1,805,257,800	
	第466回利付国債(2年)	2,930,000,000	2,924,843,200	
	第467回利付国債(2年)	1,740,000,000	1,738,677,600	
	第468回利付国債(2年)	2,060,000,000	2,057,734,000	
	第469回利付国債(2年)	230,000,000	230,034,500	
	第470回利付国債(2年)	2,940,000,000	2,944,733,400	
	第471回利付国債(2年)	3,680,000,000	3,691,555,200	
	第472回利付国債(2年)	3,510,000,000	3,508,104,600	
	第473回利付国債(2年)	1,860,000,000	1,861,897,200	
	第149回利付国債(5年)	4,130,000,000	4,100,594,400	
	第150回利付国債(5年)	6,130,000,000	6,073,420,100	
	第151回利付国債(5年)	3,970,000,000	3,924,861,100	
	第152回利付国債(5年)	730,000,000	722,860,600	
	第153回利付国債(5年)	5,350,000,000	5,275,153,500	
	第154回利付国債(5年)	5,550,000,000	5,471,523,000	
	第155回利付国債(5年)	3,900,000,000	3,855,540,000	
	第156回利付国債(5年)	4,350,000,000	4,289,970,000	
	第157回利付国債(5年)	3,340,000,000	3,287,628,800	
第158回利付国債(5年)	3,430,000,000	3,367,196,700		
第159回利付国債(5年)	340,000,000	333,060,600		
第160回利付国債(5年)	2,490,000,000	2,446,325,400		

第161回利付国債(5年)	4,260,000,000	4,197,548,400	
第162回利付国債(5年)	630,000,000	619,510,500	
第163回利付国債(5年)	4,500,000,000	4,439,070,000	
第164回利付国債(5年)	1,600,000,000	1,564,416,000	
第165回利付国債(5年)	2,510,000,000	2,462,561,000	
第166回利付国債(5年)	3,180,000,000	3,130,519,200	
第167回利付国債(5年)	160,000,000	157,169,600	
第168回利付国債(5年)	5,230,000,000	5,174,875,800	
第169回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,104,185,600	
第170回利付国債(5年)	4,290,000,000	4,237,747,800	
第171回利付国債(5年)	2,480,000,000	2,430,474,400	
第172回利付国債(5年)	710,000,000	698,519,300	
第173回利付国債(5年)	260,000,000	256,328,800	
第174回利付国債(5年)	6,810,000,000	6,741,287,100	
第175回利付国債(5年)	4,510,000,000	4,496,515,100	
第177回利付国債(5年)	1,650,000,000	1,659,487,500	
第178回利付国債(5年)	6,220,000,000	6,221,368,400	
第1回利付国債(40年)	740,000,000	705,286,600	
第2回利付国債(40年)	1,230,000,000	1,116,138,900	
第3回利付国債(40年)	910,000,000	813,658,300	
第4回利付国債(40年)	1,030,000,000	903,886,800	
第5回利付国債(40年)	1,350,000,000	1,118,394,000	
第6回利付国債(40年)	1,530,000,000	1,221,842,700	
第7回利付国債(40年)	1,460,000,000	1,096,343,200	
第8回利付国債(40年)	1,480,000,000	1,014,910,000	
第9回利付国債(40年)	2,760,000,000	1,320,135,600	
第10回利付国債(40年)	2,450,000,000	1,388,562,000	
第11回利付国債(40年)	2,015,000,000	1,078,629,500	
第12回利付国債(40年)	1,730,000,000	798,585,300	
第13回利付国債(40年)	2,520,000,000	1,130,875,200	
第14回利付国債(40年)	2,670,000,000	1,273,509,900	
第15回利付国債(40年)	3,100,000,000	1,635,715,000	
第16回利付国債(40年)	2,900,000,000	1,680,173,000	
第17回利付国債(40年)	3,430,000,000	2,621,754,800	
第18回利付国債(40年)	90,000,000	86,019,300	
第344回利付国債(10年)	5,680,000,000	5,645,976,800	
第345回利付国債(10年)	4,880,000,000	4,841,594,400	
第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	5,694,225,000	
第347回利付国債(10年)	4,640,000,000	4,583,531,200	
第348回利付国債(10年)	4,480,000,000	4,416,652,800	
第349回利付国債(10年)	3,230,000,000	3,177,706,300	
第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	6,449,703,300	代用有価証券 100,000,000円

第351回利付国債(10年)	5,325,000,000	5,216,316,750	
第352回利付国債(10年)	5,780,000,000	5,647,811,400	
第353回利付国債(10年)	5,015,000,000	4,885,863,750	
第354回利付国債(10年)	4,420,000,000	4,293,676,400	
第355回利付国債(10年)	4,170,000,000	4,038,353,100	
第356回利付国債(10年)	4,290,000,000	4,141,222,800	
第357回利付国債(10年)	4,160,000,000	4,003,251,200	
第358回利付国債(10年)	4,090,000,000	3,922,432,700	
第359回利付国債(10年)	5,545,000,000	5,299,966,450	
第360回利付国債(10年)	6,140,000,000	5,851,174,400	
第361回利付国債(10年)	6,410,000,000	6,090,141,000	
第362回利付国債(10年)	5,220,000,000	4,943,079,000	
第363回利付国債(10年)	5,380,000,000	5,077,052,200	
第364回利付国債(10年)	5,900,000,000	5,548,183,000	
第365回利付国債(10年)	6,007,000,000	5,628,559,000	
第366回利付国債(10年)	6,200,000,000	5,826,822,000	
第367回利付国債(10年)	6,680,000,000	6,253,882,800	
第368回利付国債(10年)	6,620,000,000	6,173,348,600	
第369回利付国債(10年)	5,430,000,000	5,157,902,700	
第370回利付国債(10年)	6,430,000,000	6,087,345,300	
第371回利付国債(10年)	6,300,000,000	5,893,902,000	
第372回利付国債(10年)	6,640,000,000	6,391,730,400	
第373回利付国債(10年)	6,690,000,000	6,309,673,500	
第374回利付国債(10年)	5,870,000,000	5,607,963,200	
第375回利付国債(10年)	5,790,000,000	5,654,166,600	
第376回利付国債(10年)	5,740,000,000	5,490,539,600	
第377回利付国債(10年)	5,940,000,000	5,816,626,200	
第378回利付国債(10年)	6,560,000,000	6,521,033,600	
第1回利付国債(30年)	110,000,000	118,375,400	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	170,177,600	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	127,314,000	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	120,634,800	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	53,187,500	
第6回利付国債(30年)	580,000,000	625,756,200	
第7回利付国債(30年)	880,000,000	946,422,400	
第8回利付国債(30年)	850,000,000	886,014,500	
第9回利付国債(30年)	240,000,000	243,278,400	
第10回利付国債(30年)	160,000,000	158,481,600	
第11回利付国債(30年)	260,000,000	268,743,800	
第12回利付国債(30年)	190,000,000	202,078,300	
第13回利付国債(30年)	400,000,000	421,784,000	
第14回利付国債(30年)	750,000,000	814,732,500	

第15回利付国債(30年)	530,000,000	579,788,200
第16回利付国債(30年)	400,000,000	437,624,000
第17回利付国債(30年)	1,130,000,000	1,225,778,800
第18回利付国債(30年)	1,005,000,000	1,080,787,050
第19回利付国債(30年)	830,000,000	891,685,600
第20回利付国債(30年)	660,000,000	720,588,000
第21回利付国債(30年)	960,000,000	1,028,880,000
第22回利付国債(30年)	640,000,000	697,356,800
第23回利付国債(30年)	430,000,000	467,994,800
第24回利付国債(30年)	780,000,000	847,446,600
第25回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,064,100,000
第26回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,973,289,600
第27回利付国債(30年)	1,240,000,000	1,337,488,800
第28回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,954,625,400
第29回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,976,982,700
第30回利付国債(30年)	2,000,000,000	2,079,000,000
第31回利付国債(30年)	1,790,000,000	1,827,554,200
第32回利付国債(30年)	2,410,000,000	2,475,214,600
第33回利付国債(30年)	2,530,000,000	2,485,092,500
第34回利付国債(30年)	2,385,000,000	2,387,766,600
第35回利付国債(30年)	2,830,000,000	2,739,496,600
第36回利付国債(30年)	2,590,000,000	2,490,259,100
第37回利付国債(30年)	2,465,000,000	2,320,624,950
第38回利付国債(30年)	1,690,000,000	1,555,374,600
第39回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,675,566,000
第40回利付国債(30年)	1,700,000,000	1,552,134,000
第41回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,529,577,900
第42回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,389,507,600
第43回利付国債(30年)	1,390,000,000	1,233,569,400
第44回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,600,383,900
第45回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,428,403,200
第46回利付国債(30年)	2,020,000,000	1,709,465,400
第47回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,637,634,000
第48回利付国債(30年)	2,070,000,000	1,702,740,600
第49回利付国債(30年)	1,940,000,000	1,587,909,400
第50回利付国債(30年)	1,970,000,000	1,416,705,800
第51回利付国債(30年)	2,150,000,000	1,363,895,500
第52回利付国債(30年)	2,260,000,000	1,495,012,600
第53回利付国債(30年)	1,680,000,000	1,130,253,600
第54回利付国債(30年)	1,980,000,000	1,387,564,200
第55回利付国債(30年)	1,770,000,000	1,231,920,000
第56回利付国債(30年)	1,800,000,000	1,244,214,000
第57回利付国債(30年)	2,110,000,000	1,448,515,000

第58回利付国債(30年)	2,160,000,000	1,473,681,600	
第59回利付国債(30年)	1,710,000,000	1,129,472,100	
第60回利付国債(30年)	1,810,000,000	1,249,117,200	
第61回利付国債(30年)	1,530,000,000	996,290,100	
第62回利付国債(30年)	1,255,000,000	768,361,200	
第63回利付国債(30年)	1,760,000,000	1,038,452,800	
第64回利付国債(30年)	1,630,000,000	953,647,800	
第65回利付国債(30年)	1,655,000,000	960,148,250	
第66回利付国債(30年)	1,805,000,000	1,037,766,700	
第67回利付国債(30年)	1,705,000,000	1,030,075,750	
第68回利付国債(30年)	1,870,000,000	1,119,213,700	
第69回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,166,666,200	
第70回利付国債(30年)	2,100,000,000	1,273,587,000	
第71回利付国債(30年)	1,750,000,000	1,053,657,500	
第72回利付国債(30年)	1,920,000,000	1,147,680,000	
第73回利付国債(30年)	1,840,000,000	1,091,966,400	
第74回利付国債(30年)	2,230,000,000	1,436,878,200	
第75回利付国債(30年)	2,160,000,000	1,503,144,000	
第76回利付国債(30年)	2,310,000,000	1,642,109,700	
第77回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,355,863,600	
第78回利付国債(30年)	1,930,000,000	1,360,051,700	
第79回利付国債(30年)	1,740,000,000	1,156,665,000	
第80回利付国債(30年)	2,040,000,000	1,580,367,600	
第81回利付国債(30年)	2,140,000,000	1,570,503,200	
第82回利付国債(30年)	1,900,000,000	1,462,734,000	
第83回利付国債(30年)	1,880,000,000	1,587,960,800	
第84回利付国債(30年)	2,630,000,000	2,167,146,300	
第85回利付国債(30年)	1,560,000,000	1,344,096,000	
第86回利付国債(30年)	1,540,000,000	1,356,555,200	
第90回利付国債(20年)	630,000,000	641,951,100	
第91回利付国債(20年)	450,000,000	459,072,000	
第92回利付国債(20年)	880,000,000	898,312,800	
第93回利付国債(20年)	120,000,000	122,656,800	
第94回利付国債(20年)	610,000,000	624,524,100	
第95回利付国債(20年)	830,000,000	855,032,800	
第96回利付国債(20年)	1,590,000,000	1,631,864,700	
第97回利付国債(20年)	900,000,000	928,368,000	
第98回利付国債(20年)	440,000,000	452,918,400	
第99回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,455,331,500	
第100回利付国債(20年)	480,000,000	497,956,800	
第101回利付国債(20年)	715,000,000	745,616,300	
第102回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,234,622,200	

第103回利付国債(20年)	400,000,000	417,368,000
第104回利付国債(20年)	160,000,000	166,027,200
第105回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,227,200,000
第106回利付国債(20年)	1,580,000,000	1,648,129,600
第107回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,146,189,000
第108回利付国債(20年)	840,000,000	869,652,000
第109回利付国債(20年)	920,000,000	953,708,800
第110回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,148,169,000
第111回利付国債(20年)	970,000,000	1,018,005,300
第112回利付国債(20年)	990,000,000	1,035,223,200
第113回利付国債(20年)	2,020,000,000	2,115,828,800
第114回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,500,112,900
第115回利付国債(20年)	700,000,000	737,303,000
第116回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,751,200,400
第117回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,079,891,000
第118回利付国債(20年)	660,000,000	691,079,400
第119回利付国債(20年)	460,000,000	477,217,800
第120回利付国債(20年)	1,070,000,000	1,099,713,900
第121回利付国債(20年)	1,740,000,000	1,815,968,400
第122回利付国債(20年)	750,000,000	779,047,500
第123回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,900,260,000
第124回利付国債(20年)	760,000,000	798,410,400
第125回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,317,624,000
第126回利付国債(20年)	1,090,000,000	1,146,211,300
第127回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,066,838,400
第128回利付国債(20年)	2,120,000,000	2,220,170,000
第129回利付国債(20年)	740,000,000	770,606,400
第130回利付国債(20年)	2,055,000,000	2,141,515,500
第131回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,336,427,100
第132回利付国債(20年)	1,230,000,000	1,274,403,000
第133回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,886,798,300
第134回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,480,548,800
第135回利付国債(20年)	220,000,000	228,012,400
第136回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,277,038,800
第137回利付国債(20年)	700,000,000	725,214,000
第138回利付国債(20年)	1,330,000,000	1,360,363,900
第139回利付国債(20年)	480,000,000	494,203,200
第140回利付国債(20年)	2,490,000,000	2,578,419,900
第141回利付国債(20年)	2,300,000,000	2,380,201,000
第142回利付国債(20年)	1,315,000,000	1,370,308,900
第143回利付国債(20年)	1,880,000,000	1,930,891,600
第144回利付国債(20年)	1,410,000,000	1,437,748,800
第145回利付国債(20年)	2,795,000,000	2,888,995,850

第146回利付国債(20年)	3,030,000,000	3,127,838,700	
第147回利付国債(20年)	3,420,000,000	3,498,044,400	
第148回利付国債(20年)	3,520,000,000	3,563,824,000	
第149回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,788,566,000	
第150回利付国債(20年)	3,140,000,000	3,138,712,600	
第151回利付国債(20年)	2,635,000,000	2,580,271,050	
第152回利付国債(20年)	2,810,000,000	2,743,318,700	
第153回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,377,093,400	
第154回利付国債(20年)	2,515,000,000	2,438,569,150	
第155回利付国債(20年)	2,510,000,000	2,376,292,300	
第156回利付国債(20年)	1,940,000,000	1,714,940,600	
第157回利付国債(20年)	3,530,000,000	3,030,257,900	
第158回利付国債(20年)	3,260,000,000	2,878,547,400	
第159回利付国債(20年)	2,810,000,000	2,494,746,100	
第160回利付国債(20年)	2,550,000,000	2,276,869,500	
第161回利付国債(20年)	2,620,000,000	2,297,399,400	
第162回利付国債(20年)	2,470,000,000	2,152,086,300	
第163回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,354,622,400	
第164回利付国債(20年)	2,870,000,000	2,435,482,000	
第165回利付国債(20年)	2,830,000,000	2,384,954,200	
第166回利付国債(20年)	2,270,000,000	1,951,723,300	
第167回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,109,495,400	
第168回利付国債(20年)	2,280,000,000	1,852,089,600	
第169回利付国債(20年)	1,880,000,000	1,492,494,400	
第170回利付国債(20年)	2,480,000,000	1,953,396,800	
第171回利付国債(20年)	2,020,000,000	1,578,549,200	
第172回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,292,172,400	
第173回利付国債(20年)	3,200,000,000	2,501,600,000	
第174回利付国債(20年)	2,570,000,000	1,993,240,600	
第175回利付国債(20年)	2,790,000,000	2,182,868,100	
第176回利付国債(20年)	2,270,000,000	1,763,313,300	
第177回利付国債(20年)	2,360,000,000	1,788,927,200	
第178回利付国債(20年)	2,310,000,000	1,768,235,700	
第179回利付国債(20年)	3,155,000,000	2,397,326,750	
第180回利付国債(20年)	2,730,000,000	2,173,189,200	
第181回利付国債(20年)	2,970,000,000	2,391,622,200	
第182回利付国債(20年)	2,900,000,000	2,403,085,000	
第183回利付国債(20年)	2,830,000,000	2,453,355,300	
第184回利付国債(20年)	2,730,000,000	2,237,862,900	
第185回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,322,693,000	
第186回利付国債(20年)	2,300,000,000	1,998,608,000	
第187回利付国債(20年)	2,010,000,000	1,679,013,300	

	第188回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,049,535,800	
	第189回利付国債(20年)	2,160,000,000	1,981,929,600	
	第190回利付国債(20年)	1,880,000,000	1,690,665,200	
	第191回利付国債(20年)	2,050,000,000	1,899,714,500	
	第192回利付国債(20年)	2,790,000,000	2,749,545,000	
	国債証券合計	667,147,000,000	609,757,765,650	
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	99,016,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	58,483,000	
	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	98,078,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	102,981,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	98,715,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	93,182,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	88,503,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	206,832,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,683,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,150,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	60,069,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	205,668,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	204,536,000	
	第38回東京都公募公債(20年)	200,000,000	148,970,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	98,964,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	98,664,000	
	第774回東京都公募公債	130,000,000	127,713,300	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	293,121,000	
	第800回東京都公募公債	200,000,000	191,110,000	
	第830回東京都公募公債	300,000,000	279,453,000	
	平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,067,000	
	平成29年度第13回北海道公募公債	108,000,000	106,147,800	
	平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	194,504,000	
	令和2年度第21回北海道公募公債	300,000,000	283,833,000	
	令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	188,566,000	
	令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	95,171,000	
	第39回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	93,803,000	
	第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	214,052,000	
	第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,000,000	
	第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	207,844,000	
	第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,339,000	
	第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	102,617,000	
	第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	98,620,000	
	第43回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	76,846,000	
	第48回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	150,314,000	

第226回神奈川県公募公債	100,000,000	98,939,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	98,664,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	191,068,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	198,756,480	
第6回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	208,050,000	
第7回大阪府公募公債（20年）	300,000,000	310,743,000	
第10回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	102,633,000	
第18回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	151,818,000	
第19回大阪府公募公債（20年）	200,000,000	153,238,000	
第188回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,012,000	
第202回大阪府公募公債（5年）	112,000,000	109,364,640	
第211回大阪府公募公債（5年）	110,000,000	107,432,600	
第213回大阪府公募公債（5年）	172,000,000	168,761,240	
第214回大阪府公募公債（5年）	108,000,000	105,740,640	
第430回大阪府公募公債（10年）	147,000,000	144,098,220	
第439回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	194,494,000	
第440回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	97,167,000	
第458回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	94,799,000	
第465回大阪府公募公債（10年）	160,000,000	150,649,600	
第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	170,823,380	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	187,442,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	104,519,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	103,290,000	
平成26年度第9回京都府公募公債（15年）	100,000,000	99,302,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	85,352,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	86,200,000	
令和元年度第5回京都府公募公債（20年）	300,000,000	228,498,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	132,655,885	
令和6年度第4回京都府公募公債	145,440,000	140,420,865	
第2回兵庫県公募公債（20年）	300,000,000	309,504,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	101,160,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	100,401,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	200,372,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	419,580,000	
第13回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	206,962,000	
第15回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	408,636,000	
第22回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	98,680,000	
第34回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	85,323,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	83,717,000	

第41回兵庫県公募公債(20年)	200,000,000	152,642,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	287,145,000	
第9回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	82,867,000	
第12回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	66,557,000	
第15回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	102,493,000	
第18回静岡県公募公債(20年)	100,000,000	99,472,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	98,683,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	98,721,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	98,520,000	
平成30年度第6回静岡県公募公債	300,000,000	293,250,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	293,991,600	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	156,816,000	
令和7年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,581,000	
令和7年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	99,280,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	104,719,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	100,000,000	100,959,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	197,304,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	300,000,000	255,879,000	
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	97,922,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	65,340,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	190,774,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	95,011,000	
令和2年度第13回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	76,093,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	117,096,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	94,326,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	104,287,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	208,798,000	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	98,726,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	200,000,000	195,782,000	
令和2年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	151,704,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	368,830,800	
令和3年度第1回広島県公募公債	100,000,000	76,001,000	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	93,640,000	
第1回埼玉県公募公債(15年)	100,000,000	99,371,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	94,845,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	102,966,000	
第5回埼玉県公募公債(5年)	300,000,000	296,364,000	

第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	104,039,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	71,062,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	526,974,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	209,526,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	172,976,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	207,844,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	171,768,000	
第23回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	82,942,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,188,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	99,081,000	
第28回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	150,634,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	98,676,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	94,623,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	94,415,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	139,863,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,112,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	103,550,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	104,487,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	100,974,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	95,147,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	96,873,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	65,340,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	83,863,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	285,588,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	93,996,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	85,270,000	
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	94,619,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	94,384,000	
令和7年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	100,638,000	
令和7年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,003,000	
第5回千葉県公募公債(20年)	200,000,000	208,078,000	
第6回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	104,498,000	
第13回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	102,493,000	
第20回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	87,049,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,201,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	118,854,000	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	285,891,000	

令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	94,823,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	122,575,700	
令和6年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	94,736,000	
平成30年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	84,005,000	
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	283,047,000	
令和4年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	280,665,000	
令和6年度第1回長野県公募公債(10年)	300,000,000	288,135,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	94,499,000	
令和6年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	95,935,000	
第1回群馬県公募公債(20年)	200,000,000	206,762,000	
第3回群馬県公募公債(20年)	100,000,000	102,470,000	
第28回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	94,372,000	
第30回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	96,280,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	98,410,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	396,960,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,006,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,045,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,073,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,322,000	
第174回共同発行市場公募地方債	594,300,000	584,529,708	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,440,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	293,739,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,847,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	186,074,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	186,244,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	94,543,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	93,734,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	95,040,000	
第255回共同発行市場公募地方債	300,000,000	288,831,000	
第267回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,278,000	
第268回共同発行市場公募地方債	500,000,000	496,775,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債(10年)	100,000,000	93,745,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	94,599,630	
令和3年度第2回奈良県公募公債(20年)	200,000,000	150,926,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	98,384,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	200,000,000	193,978,000	
令和2年度第1回静岡市公募公債	200,000,000	189,228,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	208,860,000	
第15回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	58,294,000	
第19回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	95,665,000	
第19回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	83,774,000	
第21回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	92,761,000	

第22回大阪市公募公債(20年)	600,000,000	516,192,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	87,174,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	188,094,000	
第1回名古屋市公募公債(15年)	100,000,000	100,909,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	108,259,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	104,369,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	103,616,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	87,352,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	98,978,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	285,549,000	
第528回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	96,280,000	
平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	198,084,000	
令和2年度第1回京都市公募公債	200,000,000	189,696,000	
令和4年度第2回京都市公募公債	200,000,000	187,624,000	
令和5年度第7回京都市公募公債	100,000,000	98,014,000	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	208,132,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	104,938,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	102,475,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	59,698,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	58,447,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	312,573,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,042,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	98,722,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	97,984,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	97,769,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	196,702,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	285,678,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	94,042,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	101,074,000	
平成26年度第5回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	99,502,000	
平成26年度第10回札幌市公募公債(20年)	100,000,000	96,964,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債(10年)	200,000,000	187,950,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	103,376,000	
第13回川崎市公募公債(30年)	200,000,000	146,810,000	
第17回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	100,961,000	
第27回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	83,809,000	
第30回川崎市公募公債(20年)	400,000,000	306,444,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	99,102,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	94,616,000	

	第15回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	101,937,000	
	第17回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	99,994,000	
	平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	104,313,000	
	平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	100,156,000	
	2019年度第7回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	76,553,000	
	2023年度第8回福岡市公募公債(10年)	100,000,000	94,603,000	
	平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	104,051,850	
	平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	166,943,400	
	令和元年度第2回広島市公募公債(20年)	200,000,000	152,332,000	
	令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	524,975,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	190,594,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	279,297,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	93,402,000	
	令和4年度第5回千葉市公募公債	100,000,000	93,185,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	97,936,000	
	令和元年度第1回福井県公募公債	100,000,000	77,376,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	93,863,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債(10年)	100,000,000	96,781,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	103,317,000	
	地方債証券合計	38,808,240,000	36,615,176,338	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	75,283,000	
	第1回国立大学法人東京大学債券	100,000,000	46,436,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,066,000	
	第72回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	111,100,000	103,579,641	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	98,838,000	
	第109回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	47,403,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	38,055,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,880,000	
	第21回道路債券	100,000,000	109,919,000	
	第28回道路債券	200,000,000	221,102,000	
	第33回道路債券	200,000,000	222,328,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,729,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,007,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,107,000	

第46回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	191,446,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,834,000	
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	91,860,000	
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	208,442,000	
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	209,478,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,672,000	
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	99,786,000	
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	104,885,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,828,000	
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	103,413,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	74,833,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	191,588,000	
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	101,700,000	
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	102,219,000	
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	102,242,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	510,516,000	
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	102,885,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	56,045,000	
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	199,834,000	
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	99,222,000	
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	197,520,000	
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	96,168,000	
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	193,068,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	151,258,000	
第259回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	94,907,000	
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	63,622,000	
	247,000,000	244,500,360	

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	99,112,000	
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	110,909,120	
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	202,947,950	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,362,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	87,032,000	
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	98,893,000	
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	197,612,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	262,029,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	78,781,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	89,499,000	
第317回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	227,620,000	
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	98,497,000	
第328回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	85,520,000	
第331回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,177,000	
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	117,818,400	
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	195,612,000	
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	251,232,000	
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	208,864,000	
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	96,036,000	
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	95,459,000	
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	227,752,000	
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	113,829,600	
第415回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	150,062,000	
第419回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	73,734,000	
第436回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	82,923,000	
	300,000,000	270,612,000	

第474回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第477回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	282,570,000	
第479回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	92,440,000	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	320,979,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	100,396,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	328,668,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	217,804,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	107,143,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	208,040,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	205,280,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	113,662,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	516,560,000	
第22回公営企業債券（20年）	100,000,000	102,697,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	102,125,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	102,215,000	
第32回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	101,061,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	504,115,000	
第36回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	200,242,000	
第43回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	95,538,000	
第45回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	95,718,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,854,000	
第86回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	226,917,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,159,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,066,000	
第91回地方公共団体金融機構債券	190,000,000	188,151,300	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	248,088,400	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	359,000,000	354,192,990	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,622,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,541,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	108,026,600	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	152,535,240	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	97,642,000	

第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,855,000	
第119回政府保証地方公共団体金融機構債券	311,000,000	299,925,290	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	96,418,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	95,892,000	
F122回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,894,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,879,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	188,466,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	93,950,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,261,000	
F214回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,096,000	
F226回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,073,000	
F246回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,214,000	
F441回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,378,000	
第29回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	98,996,000	
第33回首都高速道路株式会社社債	200,000,000	196,362,000	
第35回首都高速道路株式会社社債	300,000,000	299,088,000	
第27回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	98,998,000	
第30回阪神高速道路株式会社社債	300,000,000	296,703,000	
第31回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	99,007,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	104,308,000	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	104,957,000	
第44回政府保証日本政策金融公庫債券	117,000,000	115,860,420	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,605,000	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	206,432,100	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	182,691,520	
第117回都市再生債券	200,000,000	195,464,000	
第159回都市再生債券	200,000,000	79,786,000	
第161回都市再生債券	100,000,000	44,870,000	
第171回都市再生債券	200,000,000	92,730,000	
第191回都市再生債券	100,000,000	64,807,000	
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	95,057,000	
第30回政府保証中部国際空港債券	240,000,000	224,064,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	62,277,000	61,246,315	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,356,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	44,462,000	43,792,846	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	102,272,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	77,487,000	76,098,432	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	90,306,000	88,114,273	
	32,466,000	31,741,358	

第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券			
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	117,072,000	113,676,912	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	78,940,000	76,637,320	
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,203,000	
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,597,000	11,775,129	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,234,000	11,383,299	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,673,000	12,922,531	
第28回政府保証住宅金融支援機構債券（グリーンボンド）	200,000,000	185,846,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,842,000	15,135,277	
第29回政府保証住宅金融支援機構債券	600,000,000	529,302,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,573,000	15,899,877	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,569,000	15,864,966	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,172,000	33,776,725	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,811,000	15,076,857	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,466,000	15,735,572	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,007,000	15,288,381	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,265,000	14,533,609	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,982,000	30,406,545	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,910,000	16,123,512	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,332,000	21,399,622	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,399,000	20,481,207	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,448,000	20,547,377	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,896,000	43,838,496	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,326,000	54,289,190	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,931,000	28,273,976	
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,553,000	88,189,107	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,293,000	29,851,933	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,048,000	25,799,502	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,728,000	24,315,536	
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,693,000	29,318,571	
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	156,709,500	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,893,000	75,585,050	
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,612,000	102,568,927	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,305,000	29,461,308	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,796,000	30,855,792	
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,991,000	31,818,169	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,368,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,781,000	97,976,426	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,074,000	33,603,697	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,674,000	70,440,730	

第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,232,000	39,823,931	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,651,000	41,851,382	
第96回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,657,000	
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,724,000	41,206,809	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,831,000	130,916,244	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,156,000	88,466,152	
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,060,000	43,170,195	
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,466,000	46,156,724	
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,888,000	50,118,122	
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,188,000	54,975,582	
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,227,000	53,869,437	
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,085,000	54,757,815	
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,379,000	55,243,555	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,767,000	55,356,203	
第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,526,000	110,766,999	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,933,000	57,049,333	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,360,000	227,885,817	
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,461,000	56,430,155	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,086,000	56,089,762	
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,200,000	57,021,798	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,442,000	116,286,737	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,044,000	113,632,647	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	131,944,000	117,125,369	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,998,000	58,433,969	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	130,814,000	115,345,244	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,012,000	58,294,537	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	133,764,000	117,578,556	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,974,000	116,834,945	
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	93,380,000	

第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,053,000	60,087,396	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,078,000	59,415,009	
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,377,000	58,988,563	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,376,000	121,243,182	
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,671,000	60,440,985	
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,923,000	59,934,751	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,760,000	122,810,940	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,568,000	61,432,539	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,275,000	185,185,655	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,228,000	125,345,502	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,071,000	64,841,825	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,089,000	65,460,888	
第158回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,335,000	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,860,000	134,326,382	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,482,000	67,530,621	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,882,000	136,520,947	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,724,000	137,709,930	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,444,000	68,311,512	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,770,000	138,036,486	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,044,000	137,064,119	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,542,000	70,120,412	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,908,000	69,893,734	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,097,000	209,070,191	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,256,000	70,212,076	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,831,000	71,806,281	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,463,000	72,311,508	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,259,000	73,733,688	

第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,229,000	73,739,278	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,756,000	149,833,273	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,728,000	77,410,309	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,378,000	157,491,234	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,466,000	78,422,890	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	83,418,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,376,000	78,247,829	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,992,000	79,529,480	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,072,000	163,049,903	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,632,000	82,820,666	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,159,000	82,920,049	
第206回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,199,000	88,233,289	
第208回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	197,436,000	
第211回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,565,000	90,802,769	
第212回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,598,000	273,780,135	
第213回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	195,194,000	184,376,348	
第214回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,120,000	190,636,723	
第218回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	197,902,000	
第263回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	60,151,000	
第299回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	45,307,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	57,651,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	261,135,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,017,000	
い第876号商工債	400,000,000	392,048,000	
い第878号商工債	100,000,000	97,728,000	
い第888号商工債	200,000,000	196,340,000	
第384回信金中金債(5年)	200,000,000	197,894,000	
第385回信金中金債(5年)	400,000,000	395,552,000	
第394回信金中金債(5年)	100,000,000	98,233,000	
第411回信金中金債(5年)	200,000,000	195,558,000	
第416回信金中金債(5年)	500,000,000	491,405,000	
第19回韓国輸出入銀行円貨債券	400,000,000	398,488,000	
	300,000,000	298,107,000	

	第20回アンデス開発公社円貨債券(2023)			
	第21回国際協力機構債券	100,000,000	101,887,000	
	第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	95,601,000	
	第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	191,440,000	
	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	475,195,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,875,000	
	第106回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,065,000	
	第111回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,141,000	
	第114回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,505,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,568,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,270,000	
	第101回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,218,000	
	第103回中日本高速道路株式会社社債	400,000,000	393,908,000	
	第104回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,089,000	
	第105回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,376,000	
	第107回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,470,000	
	第109回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	296,439,000	
	第111回中日本高速道路株式会社社債	500,000,000	501,030,000	
	第112回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,162,000	
	第113回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,204,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,608,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,700,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,516,000	
	第78回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,053,000	
	第80回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,321,000	
	第82回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,455,000	
	第85回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	97,980,000	
	第91回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,747,000	
	第93回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	294,255,000	
	第99回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,860,000	
	第100回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,416,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,224,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	178,882,000	
	特殊債券合計	41,119,691,000	38,310,485,099	
社債券	第41回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	200,000,000	199,102,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・イー円貨社債	100,000,000	98,405,000	
	第38回ビー・ピー・シー・イー・エス・イー円貨社債	200,000,000	199,448,000	
	第42回ビー・ピー・シー・イー・エス・イー円貨社債	100,000,000	99,606,000	

第27回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	100,000,000	99,850,000	
第30回クレディ・アグリコル・エス・エー 円貨社債	200,000,000	199,478,000	
第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債 (2023)	400,000,000	394,368,000	
第12回オーストラリア・ニュージーランド 銀行円貨社債	400,000,000	397,844,000	
第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	94,837,000	
第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,230,000	
第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,484,000	
第50回鹿島建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,570,000	
第11回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,305,000	
第9回五洋建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,922,000	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	93,316,000	
第26回積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	97,900,000	
第9回日揮ホールディングス株式会社無担保 社債	200,000,000	200,000,000	
第17回日本ハム株式会社無担保社債	100,000,000	97,905,000	
第27回麒麟ホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	100,454,000	
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	93,910,000	
第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	198,678,000	
第18回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,767,000	
第7回日鉄興和不動産株式会社無担保社債	100,000,000	98,527,000	
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	97,827,000	
第9回中央日本土地建物グループ株式会社無 担保社債	100,000,000	97,992,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	97,516,000	
第15回ヒューリック株式会社無担保社債	200,000,000	199,626,000	
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	97,931,000	
第46回東洋紡株式会社無担保社債	100,000,000	100,057,000	
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	95,877,000	
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	98,744,000	
第26回旭化成株式会社無担保社債	400,000,000	397,996,000	
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	97,326,000	
第4回株式会社レゾナック・ホールディング ス無担保社債	100,000,000	98,701,000	
第9回株式会社クレハ無担保社債	100,000,000	97,999,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	97,552,000	
第62回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	198,826,000	
	100,000,000	97,935,000	

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			
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	197,444,000	
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	72,534,000	
第22回UBE株式会社無担保社債	100,000,000	99,584,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	97,918,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	96,068,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	191,374,000	
第2回株式会社ADEKA無担保社債	100,000,000	98,085,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	276,069,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	198,798,000	
第10回テルモ株式会社無担保社債	300,000,000	297,831,000	
第10回関西ペイント株式会社無担保社債	200,000,000	198,764,000	
第23回株式会社オリエントランド無担保社債	100,000,000	96,859,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	94,785,000	
第27回LINEヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第13回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,632,000	
第2回サイグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,874,000	
第20回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,470,000	
第26回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,900,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	94,181,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,740,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	96,822,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	93,741,000	
第5回AGC株式会社無担保社債	100,000,000	99,635,000	
第20回住友大阪セメント株式会社無担保社債	100,000,000	98,673,000	
第72回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,517,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	98,234,000	
第17回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	98,642,000	
第10回住友重機械工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,016,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	94,812,000	
第59回日本精工株式会社無担保社債	100,000,000	95,827,000	
第22回THK株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,711,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	95,280,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	95,633,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	94,772,000	

第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	93,741,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,254,000	
第27回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	298,737,000	
第30回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,088,000	
第39回ソニーグループ株式会社無担保社債	500,000,000	495,515,000	
第14回TDK株式会社無担保社債	100,000,000	99,818,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	98,041,000	
第7回スタンレー電気株式会社無担保社債	100,000,000	97,867,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	98,561,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,607,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,117,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	97,768,000	
第29回J A三井リース株式会社無担保社債	200,000,000	198,664,000	
第31回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,156,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	198,000,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	187,856,000	
第32回マツダ株式会社無担保社債	100,000,000	96,541,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	96,862,000	
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	200,000,000	196,770,000	
第6回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,318,000	
第28回オリンパス株式会社無担保社債	100,000,000	100,051,000	
第9回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	86,759,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	76,170,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,723,000	
第119回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	97,819,000	
第10回長瀬産業株式会社無担保社債	100,000,000	97,060,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	103,251,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	192,902,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,589,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	97,750,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	186,926,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	96,918,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	198,032,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	97,688,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	97,525,000	
第106回株式会社クレディセゾン無担保社債	200,000,000	198,154,000	
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	95,473,000	
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	98,459,000	
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	105,171,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,277,000	

第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	100,000,000	98,298,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	96,917,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	378,408,000	
第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	96,212,000	
第26回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	186,170,000	
第30回NTTファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	286,602,000	
第34回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	96,772,000	
第38回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	95,443,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	97,180,000	
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	300,000,000	297,255,000	
第42回SBIホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,460,000	
第108回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	296,049,000	
第44回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,266,000	
第47回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	96,394,000	
第87回アコム株式会社無担保社債	200,000,000	197,714,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,854,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,874,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	98,730,000	
第42回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,050,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	95,594,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,734,000	
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	198,340,000	
第46回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,485,000	
第19回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	197,150,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,319,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	97,626,000	
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	98,348,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	98,778,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,070,000	
	200,000,000	197,678,000	

第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債			
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	198,982,000	
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	197,870,000	
第28回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	500,000,000	498,310,000	
第29回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	100,000,000	99,872,000	
第84回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	189,680,000	
第86回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	171,324,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	197,014,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	77,839,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	93,260,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	93,323,000	
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	81,735,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	93,636,000	
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	96,051,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	68,218,000	
第89回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,440,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	77,485,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	78,754,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	60,869,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	78,347,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	97,671,000	
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,953,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	208,418,000	
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,245,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	69,515,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	54,883,000	
第136回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	64,766,000	
第139回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	49,567,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	95,359,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	57,776,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	75,474,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	46,657,000	

第204回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	198,914,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,663,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	52,524,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	67,863,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	75,219,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,174,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	87,564,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	96,719,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	54,697,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	44,762,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	36,503,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	47,394,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	60,216,000	
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	122,288,000	
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,625,000	
第13回日本航空株式会社無担保社債	100,000,000	94,027,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	97,478,000	
第32回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,340,000	
第39回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	96,728,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	98,103,000	
第26回ソフトバンク株式会社無担保社債	200,000,000	197,026,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	161,112,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,865,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	89,506,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	86,177,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	75,265,000	
第545回中部電力株式会社社債	100,000,000	93,174,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,024,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	197,728,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,579,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,849,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,664,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	94,273,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	98,831,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,735,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	98,416,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	193,196,000	
第417回中国電力株式会社社債	100,000,000	78,126,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	94,912,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	280,908,000	

第457回中国電力株式会社社債	100,000,000	95,630,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	98,713,000	
第323回北陸電力株式会社社債	100,000,000	84,734,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	193,086,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	171,236,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,448,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,094,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	191,026,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	93,729,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	97,171,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,372,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	93,374,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,962,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,700,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	97,751,000	
第476回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,875,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	191,914,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,467,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	93,331,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	187,400,000	
第332回北海道電力株式会社社債	100,000,000	87,808,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,051,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	81,743,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	94,359,000	
第36回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	96,101,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	84,529,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,710,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	97,648,000	
第58回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	80,592,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,850,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,060,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	93,748,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	195,332,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,092,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	94,188,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	94,492,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	250,104,000	
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,095,000	
	100,000,000	86,347,000	

第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債			
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,809,000	
第75回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,846,000	
第82回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,957,000	
第83回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,768,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	93,296,000	
第22回株式会社JERA無担保社債	200,000,000	198,316,000	
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	97,331,000	
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	93,708,000	
第6回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	200,000,000	196,040,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	58,315,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	189,164,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	187,042,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	74,907,000	
第11回SCSK株式会社無担保社債	100,000,000	100,584,000	
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	196,282,000	
社債券合計	35,500,000,000	33,420,287,000	
合計		718,103,714,087	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	127,146,697
コール・ローン	528,150,175
国債証券	71,270,347,293
未収入金	5,923,859
未収利息	553,771,954
前払金	2,303,542
前払費用	93,291,526
差入委託証拠金	54,304,428
流動資産合計	72,635,239,474
資産合計	72,635,239,474

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	724,038,212
未払金	135,591
未払解約金	5,103,400
流動負債合計	729,277,203
負債合計	729,277,203
純資産の部	
元本等	
元本	87,974,930,397
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,068,968,126
元本等合計	71,905,962,271
純資産合計	71,905,962,271
負債純資産合計	72,635,239,474

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	87,974,930,397口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 16,068,968,126円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8173円 (1万口当たり純資産額) (8,173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

	2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い債券先物取引及び為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	96,079,020,933円
期中追加設定元本額	29,012,796,439円
期中一部解約元本額	37,116,886,975円
期末元本額	87,974,930,397円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,350,131,725円
分散投資コア戦略ファンドS	31,144,706,411円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	2,552,581,646円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	1,228,210,068円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	311,931,388円

区分	2025年 7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）2060	102,690,634円
10資産分散投資ファンド	799,236,142円
グローバル10資産バランスファンド	280,062,138円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	2,665,874,385円
私募外国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	6,456,837,417円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	403,271円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	325,706円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	321,857円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	326,332円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	306,152円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	383,520円
外国債券インデックスファンドT（為替ヘッジあり）（一般投資家私募/適格機関投資家転売制限付）	9,167,251,644円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,740,104,145円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,536,337,311円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,506,154,279円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	2,130,754,226円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7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		634,464,355
合計		634,464,355

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	436,924,566	-	434,621,024	2,303,542
合計		436,924,566	-	434,621,024	2,303,542

(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

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	71,601,767,547	-	72,323,502,217	721,734,670
	アメリカドル	32,605,142,027	-	32,962,401,164	357,259,137
	カナダドル	1,395,093,725	-	1,406,291,092	11,197,367

メキシコペソ	573,683,124	-	589,499,271	15,816,147
ユーロ	21,901,229,695	-	22,128,762,639	227,532,944
イギリスポンド	4,129,468,871	-	4,146,077,178	16,608,307
スウェーデンクローナ	137,194,858	-	139,019,856	1,824,998
ノルウェークローネ	121,898,135	-	123,613,382	1,715,247
デンマーククローネ	168,700,454	-	170,389,004	1,688,550
ポーランドズロチ	488,963,142	-	494,204,350	5,241,208
オーストラリアドル	879,525,106	-	888,326,939	8,801,833
ニュージーランドドル	205,215,577	-	205,270,732	55,155
シンガポールドル	282,491,135	-	284,270,569	1,779,434
マレーシアリングット	365,069,100	-	366,338,121	1,269,021
イスラエルシェケル	264,336,514	-	271,053,996	6,717,482
オフショア人民元	8,083,756,084	-	8,147,983,924	64,227,840
合計	71,601,767,547	-	72,323,502,217	721,734,670

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.375% 07/31/27	1,000,000.00	931,816.41	
		T 0.375% 09/30/27	1,650,000.00	1,529,504.88	
		T 0.5% 04/30/27	900,000.00	847,423.82	
		T 0.5% 05/31/27	240,000.00	225,403.12	
		T 0.5% 06/30/27	1,920,000.00	1,798,725.00	
		T 0.5% 08/31/27	1,700,000.00	1,584,220.70	
		T 0.5% 10/31/27	1,200,000.00	1,112,343.74	
		T 0.625% 03/31/27	2,260,000.00	2,138,039.46	
		T 0.625% 05/15/30	1,620,000.00	1,386,808.59	
		T 0.625% 07/31/26	1,000,000.00	964,435.75	
		T 0.625% 08/15/30	2,020,000.00	1,713,725.39	
		T 0.625% 11/30/27	1,090,000.00	1,011,017.57	

T 0.625% 12/31/27	1,370,000.00	1,267,383.79	
T 0.75% 01/31/28	1,970,000.00	1,823,481.25	
T 0.75% 08/31/26	2,050,000.00	1,975,126.94	
T 0.875% 06/30/26	2,750,000.00	2,666,075.14	
T 0.875% 11/15/30	30,000.00	25,583.20	
T 1.125% 02/15/31	1,130,000.00	971,976.56	
T 1.125% 02/28/27	800,000.00	764,765.62	
T 1.125% 02/29/28	740,000.00	690,252.34	
T 1.125% 05/15/40	440,000.00	270,711.72	
T 1.125% 08/15/40	830,000.00	505,716.41	
T 1.125% 08/31/28	2,450,000.00	2,255,244.13	
T 1.125% 10/31/26	2,290,000.00	2,206,719.13	
T 1.25% 03/31/28	670,000.00	625,730.27	
T 1.25% 04/30/28	1,920,000.00	1,789,574.99	
T 1.25% 05/15/50	650,000.00	308,089.84	
T 1.25% 05/31/28	960,000.00	892,987.49	
T 1.25% 06/30/28	590,000.00	547,708.98	
T 1.25% 08/15/31	1,660,000.00	1,411,259.37	
T 1.25% 09/30/28	1,840,000.00	1,697,076.56	
T 1.25% 11/30/26	1,600,000.00	1,541,562.49	
T 1.25% 12/31/26	1,300,000.00	1,249,980.47	
T 1.375% 08/15/50	1,740,000.00	846,754.67	
T 1.375% 08/31/26	440,000.00	426,989.06	
T 1.375% 10/31/28	1,650,000.00	1,524,735.34	
T 1.375% 11/15/31	4,230,000.00	3,596,078.32	
T 1.375% 11/15/40	490,000.00	309,245.50	
T 1.375% 12/31/28	1,500,000.00	1,380,791.01	
T 1.5% 01/31/27	600,000.00	577,992.18	
T 1.5% 02/15/30	3,350,000.00	3,016,112.29	
T 1.5% 08/15/26	1,880,000.00	1,828,557.03	
T 1.5% 11/30/28	930,000.00	861,321.67	
T 1.625% 05/15/31	2,010,000.00	1,761,812.11	
T 1.625% 08/15/29	870,000.00	797,698.24	
T 1.625% 09/30/26	330,000.00	320,667.18	
T 1.625% 10/31/26	260,000.00	252,235.54	
T 1.625% 11/15/50	700,000.00	364,013.67	
T 1.625% 11/30/26	400,000.00	387,492.18	
T 1.75% 01/31/29	1,800,000.00	1,675,371.09	
T 1.75% 08/15/41	490,000.00	322,318.55	
T 1.75% 11/15/29	360,000.00	329,976.56	
T 1.75% 12/31/26	900,000.00	871,822.26	
T 1.875% 02/15/32	3,340,000.00	2,914,737.09	

T 1.875% 02/15/41	1,520,000.00	1,035,589.05
T 1.875% 02/15/51	1,070,000.00	593,181.25
T 1.875% 02/28/27	910,000.00	880,656.05
T 1.875% 02/28/29	1,690,000.00	1,577,707.42
T 1.875% 06/30/26	100,000.00	97,890.15
T 1.875% 07/31/26	230,000.00	224,788.29
T 1.875% 11/15/51	1,190,000.00	652,780.08
T 1% 07/31/28	980,000.00	900,776.95
T 2.25% 02/15/27	410,000.00	399,381.63
T 2.25% 02/15/52	980,000.00	590,832.80
T 2.25% 05/15/41	900,000.00	647,296.87
T 2.25% 08/15/27	1,150,000.00	1,113,164.06
T 2.25% 08/15/46	630,000.00	408,367.96
T 2.25% 08/15/49	1,090,000.00	675,438.08
T 2.25% 11/15/27	640,000.00	617,400.00
T 2.375% 02/15/42	1,690,000.00	1,217,130.06
T 2.375% 03/31/29	1,330,000.00	1,262,097.26
T 2.375% 05/15/27	340,000.00	330,942.18
T 2.375% 05/15/29	790,000.00	748,370.70
T 2.375% 05/15/51	1,160,000.00	725,996.88
T 2.375% 11/15/49	360,000.00	228,810.93
T 2.5% 02/15/45	2,030,000.00	1,414,894.13
T 2.5% 02/15/46	320,000.00	219,606.24
T 2.5% 05/15/46	430,000.00	294,046.09
T 2.625% 02/15/29	1,150,000.00	1,103,168.94
T 2.625% 05/31/27	1,210,000.00	1,182,585.93
T 2.625% 07/31/29	1,620,000.00	1,544,885.15
T 2.75% 02/15/28	2,000,000.00	1,946,875.00
T 2.75% 05/31/29	910,000.00	873,777.73
T 2.75% 08/15/32	1,700,000.00	1,556,994.14
T 2.75% 08/15/42	560,000.00	423,653.12
T 2.75% 08/15/47	500,000.00	352,695.31
T 2.75% 11/15/42	840,000.00	632,723.43
T 2.75% 11/15/47	850,000.00	597,822.26
T 2.875% 04/30/29	380,000.00	366,863.28
T 2.875% 05/15/28	1,100,000.00	1,071,984.37
T 2.875% 05/15/32	1,650,000.00	1,528,828.12
T 2.875% 05/15/43	380,000.00	289,557.03
T 2.875% 05/15/49	730,000.00	517,943.54
T 2.875% 05/15/52	1,060,000.00	736,555.07
T 2.875% 08/15/28	2,090,000.00	2,031,626.94
T 2.875% 08/15/45	390,000.00	288,645.69
T 2.875% 11/15/46	190,000.00	138,410.54

T 2% 02/15/50	1,170,000.00	678,897.07	
T 2% 08/15/51	1,580,000.00	898,378.12	
T 2% 11/15/26	1,650,000.00	1,607,138.67	
T 2% 11/15/41	1,030,000.00	701,928.91	
T 3.125% 02/15/42	180,000.00	145,300.78	
T 3.125% 02/15/43	630,000.00	500,874.60	
T 3.125% 05/15/48	660,000.00	495,335.15	
T 3.125% 08/15/44	1,150,000.00	897,763.66	
T 3.125% 08/31/27	1,020,000.00	1,004,958.98	
T 3.125% 08/31/29	1,270,000.00	1,233,809.96	
T 3.125% 11/15/28	1,040,000.00	1,016,742.18	
T 3.125% 11/15/41	230,000.00	186,578.51	
T 3.25% 05/15/42	580,000.00	475,056.25	
T 3.25% 06/30/27	1,100,000.00	1,087,539.06	
T 3.25% 06/30/29	1,650,000.00	1,612,907.22	
T 3.375% 05/15/33	1,520,000.00	1,438,151.55	
T 3.375% 05/15/44	860,000.00	700,295.31	
T 3.375% 08/15/42	730,000.00	606,299.22	
T 3.375% 11/15/48	470,000.00	367,793.35	
T 3.5% 01/31/28	1,380,000.00	1,369,057.02	
T 3.5% 01/31/30	900,000.00	884,935.54	
T 3.5% 02/15/33	3,000,000.00	2,870,566.41	
T 3.5% 02/15/39	210,000.00	187,753.12	
T 3.5% 09/30/29	2,550,000.00	2,512,397.47	
T 3.625% 02/15/44	1,230,000.00	1,042,088.66	
T 3.625% 02/15/53	1,820,000.00	1,467,090.62	
T 3.625% 03/31/28	1,000,000.00	995,234.38	
T 3.625% 03/31/30	1,640,000.00	1,619,532.02	
T 3.625% 05/15/53	950,000.00	765,028.32	
T 3.625% 05/31/28	2,390,000.00	2,377,023.04	
T 3.625% 08/15/43	1,330,000.00	1,131,850.76	
T 3.75% 08/15/41	260,000.00	230,465.62	
T 3.75% 08/31/31	300,000.00	295,330.07	
T 3.75% 11/15/43	970,000.00	838,595.31	
T 3.75% 12/31/28	1,110,000.00	1,106,552.92	
T 3.875% 02/15/43	620,000.00	549,366.01	
T 3.875% 05/15/43	250,000.00	221,113.28	
T 3.875% 08/15/33	1,840,000.00	1,798,348.43	
T 3.875% 08/15/34	2,270,000.00	2,198,840.81	
T 3.875% 08/15/40	390,000.00	355,021.87	
T 3.875% 09/30/29	1,000,000.00	999,824.22	
T 3.875% 11/30/29	1,500,000.00	1,498,916.01	

T 3.875% 12/31/27	710,000.00	710,929.09
T 3.875% 12/31/29	1,000,000.00	999,101.56
T 3% 02/15/47	730,000.00	542,452.73
T 3% 02/15/48	270,000.00	198,450.00
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	728,574.22
T 3% 05/15/42	370,000.00	292,097.65
T 3% 05/15/45	330,000.00	250,219.92
T 3% 05/15/47	180,000.00	133,425.00
T 3% 08/15/48	790,000.00	578,088.66
T 3% 08/15/52	180,000.00	128,239.45
T 3% 11/15/44	720,000.00	548,929.68
T 3% 11/15/45	320,000.00	241,337.50
T 4.125% 02/15/27	770,000.00	772,195.70
T 4.125% 03/31/29	2,280,000.00	2,301,063.27
T 4.125% 03/31/31	1,900,000.00	1,912,654.30
T 4.125% 03/31/32	1,340,000.00	1,342,486.32
T 4.125% 07/31/31	1,260,000.00	1,266,447.65
T 4.125% 08/15/44	350,000.00	317,501.95
T 4.125% 08/15/53	580,000.00	511,623.44
T 4.125% 08/31/30	960,000.00	968,325.00
T 4.125% 10/31/27	2,800,000.00	2,817,445.31
T 4.125% 11/15/32	700,000.00	699,466.79
T 4.25% 01/31/30	1,210,000.00	1,227,511.91
T 4.25% 02/15/28	1,050,000.00	1,060,869.13
T 4.25% 02/15/54	2,000,000.00	1,801,757.82
T 4.25% 02/28/29	490,000.00	496,536.52
T 4.25% 05/15/39	150,000.00	144,580.07
T 4.25% 06/30/29	620,000.00	628,585.54
T 4.25% 08/15/54	1,160,000.00	1,046,129.69
T 4.25% 11/15/34	1,990,000.00	1,980,516.41
T 4.25% 11/15/40	200,000.00	189,750.00
T 4.25% 12/31/26	4,070,000.00	4,086,613.86
T 4.375% 01/31/32	2,150,000.00	2,186,071.28
T 4.375% 02/15/38	260,000.00	257,217.18
T 4.375% 05/15/34	2,570,000.00	2,589,827.13
T 4.375% 05/15/40	300,000.00	290,273.43
T 4.375% 05/15/41	150,000.00	143,865.23
T 4.375% 07/31/26	1,730,000.00	1,735,070.49
T 4.375% 08/15/26	1,390,000.00	1,394,506.64
T 4.375% 11/15/39	350,000.00	339,787.10
T 4.375% 11/30/30	1,710,000.00	1,743,932.81
T 4.5% 02/15/36	110,000.00	111,856.25
T 4.5% 02/15/44	100,000.00	95,656.25

T 4.5% 04/15/27	1,630,000.00	1,646,522.85	
T 4.5% 05/15/27	2,630,000.00	2,658,457.41	
T 4.5% 05/15/38	110,000.00	110,219.14	
T 4.5% 07/15/26	860,000.00	863,486.19	
T 4.5% 08/15/39	170,000.00	167,715.62	
T 4.5% 11/15/33	2,190,000.00	2,232,302.93	
T 4.5% 11/15/54	1,550,000.00	1,458,816.41	
T 4.5% 12/31/31	60,000.00	61,449.60	
T 4.625% 02/15/35	2,560,000.00	2,619,799.99	
T 4.625% 02/15/40	250,000.00	249,013.67	
T 4.625% 02/15/55	1,050,000.00	1,009,312.50	
T 4.625% 04/30/29	410,000.00	420,970.70	
T 4.625% 04/30/31	1,650,000.00	1,702,754.88	
T 4.625% 05/15/54	1,540,000.00	1,477,407.42	
T 4.625% 05/31/31	1,220,000.00	1,258,816.02	
T 4.625% 06/30/26	400,000.00	401,961.35	
T 4.625% 09/30/30	170,000.00	175,382.22	
T 4.625% 10/15/26	950,000.00	957,162.10	
T 4.625% 11/15/26	2,400,000.00	2,419,687.48	
T 4.75% 02/15/41	150,000.00	150,404.29	
T 4.75% 11/15/53	600,000.00	587,250.00	
T 4.875% 10/31/30	400,000.00	417,476.56	
T 4% 01/15/27	1,740,000.00	1,740,985.55	
T 4% 01/31/29	940,000.00	944,644.92	
T 4% 02/15/34	1,600,000.00	1,571,124.99	
T 4% 02/28/30	360,000.00	361,603.12	
T 4% 03/31/30	2,090,000.00	2,098,245.69	
T 4% 04/30/32	700,000.00	695,953.12	
T 4% 07/31/30	910,000.00	912,843.75	
T 4% 10/31/29	600,000.00	602,718.75	
T 4% 11/15/42	240,000.00	216,782.81	
T 4% 11/15/52	1,000,000.00	863,691.41	
T 5.0% 05/15/37	120,000.00	126,414.84	
T 5.25% 11/15/28	440,000.00	459,112.50	
T 5.375% 02/15/31	290,000.00	310,050.77	
T 6.125% 11/15/27	3,500,000.00	3,679,511.71	
T 6.25% 05/15/30	990,000.00	1,090,972.26	
アメリカドル 小計	243,360,000.00	222,643,609.27 (32,481,476,156)	
カナダドル			
CAN 0.5% 12/01/30	500,000.00	438,047.45	
CAN 1.25% 03/01/27	650,000.00	635,491.35	
CAN 1.25% 06/01/30	660,000.00	609,220.04	

	CAN 1.5% 06/01/31	760,000.00	696,796.65
	CAN 1.5% 12/01/31	600,000.00	544,601.75
	CAN 1.75% 12/01/53	560,000.00	370,418.50
	CAN 1% 06/01/27	100,000.00	96,978.82
	CAN 1% 09/01/26	390,000.00	382,781.85
	CAN 2.25% 06/01/29	30,000.00	29,374.74
	CAN 2.5% 12/01/32	140,000.00	133,647.21
	CAN 2.75% 03/01/30	460,000.00	456,750.79
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	309,291.30
	CAN 2.75% 09/01/27	260,000.00	260,394.72
	CAN 2.75% 09/01/30	150,000.00	148,451.47
	CAN 2.75% 12/01/48	200,000.00	171,593.91
	CAN 2.75% 12/01/55	510,000.00	423,939.54
	CAN 2.75% 12/01/64	120,000.00	97,448.58
	CAN 2% 06/01/28	180,000.00	176,425.10
	CAN 2% 06/01/32	400,000.00	371,606.86
	CAN 2% 12/01/51	710,000.00	508,470.34
	CAN 3.25% 06/01/35	500,000.00	494,956.10
	CAN 3.25% 09/01/28	190,000.00	192,792.42
	CAN 3.25% 11/01/26	320,000.00	322,443.56
	CAN 3.25% 12/01/33	280,000.00	279,696.72
	CAN 3.25% 12/01/34	650,000.00	645,236.91
	CAN 3.5% 03/01/28	400,000.00	407,864.27
	CAN 3.5% 03/01/34	50,000.00	50,797.65
	CAN 3.5% 09/01/29	490,000.00	502,020.27
	CAN 3.5% 12/01/45	140,000.00	137,754.97
	CAN 3.5% 12/01/57	110,000.00	106,117.72
	CAN 3% 06/01/34	680,000.00	664,013.90
	CAN 4.0% 06/01/41	160,000.00	168,528.82
	CAN 4% 03/01/29	490,000.00	509,886.91
	CAN 4% 08/01/26	990,000.00	1,003,952.56
	CAN 5.75% 06/01/29	220,000.00	243,369.33
	CAN 5.75% 06/01/33	250,000.00	293,198.15
	CAN 5% 06/01/37	100,000.00	114,976.48
	カナダドル 小計	13,720,000.00	12,999,337.71 (1,386,639,353)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	1,500,000.00	1,571,943.63
	MBONO 5.5% 03/04/27	6,380,000.00	6,121,804.71
	MBONO 7.5% 05/26/33	4,170,000.00	3,797,549.56
	MBONO 7.5% 06/03/27	7,200,000.00	7,113,767.47
	MBONO 7.75% 05/29/31	7,270,000.00	6,933,434.55
	MBONO 7.75% 11/13/42	7,700,000.00	6,336,016.14
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,440,000.00	7,650,849.02

	MBONO 7% 09/03/26	1,700,000.00	1,678,070.18
	MBONO 8.5% 02/28/30	4,100,000.00	4,074,150.51
	MBONO 8.5% 03/01/29	6,680,000.00	6,659,662.40
	MBONO 8.5% 03/02/28	1,900,000.00	1,905,548.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	7,140,000.00	7,114,050.80
	MBONO 8.5% 11/18/38	3,340,000.00	3,048,814.19
	MBONO 8% 07/31/53	7,090,000.00	5,811,607.77
	MBONO 8% 11/07/47	4,470,000.00	3,695,178.24
	メキシコペソ 小計	79,080,000.00	73,512,447.17 (576,690,445)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	290,000.00	257,928.90
	BGB 0.35% 06/22/32	370,000.00	312,727.70
	BGB 0.4% 06/22/40	200,000.00	125,822.50
	BGB 0.65% 06/22/71	150,000.00	45,611.59
	BGB 0.8% 06/22/27	380,000.00	371,601.43
	BGB 0.8% 06/22/28	380,000.00	365,594.96
	BGB 0.9% 06/22/29	270,000.00	255,643.99
	BGB 0% 10/22/27	230,000.00	219,762.47
	BGB 0% 10/22/31	260,000.00	219,786.44
	BGB 1.25% 04/22/33	140,000.00	124,222.14
	BGB 1.4% 06/22/53	210,000.00	118,468.87
	BGB 1.45% 06/22/37	120,000.00	97,126.20
	BGB 1.6% 06/22/47	200,000.00	132,984.00
	BGB 1.7% 06/22/50	190,000.00	122,280.39
	BGB 1.9% 06/22/38	210,000.00	175,459.20
	BGB 1% 06/22/31	340,000.00	309,270.37
	BGB 2.15% 06/22/66	120,000.00	73,506.70
	BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	107,570.71
	BGB 2.7% 10/22/29	130,000.00	131,632.15
	BGB 2.75% 04/22/39	110,000.00	100,580.15
	BGB 2.85% 10/22/34	360,000.00	351,728.00
	BGB 3.1% 06/22/35	130,000.00	128,720.80
	BGB 3.3% 06/22/54	180,000.00	157,269.06
	BGB 3.45% 06/22/42	50,000.00	48,102.08
	BGB 3.45% 06/22/43	80,000.00	76,695.92
	BGB 3.5% 06/22/55	110,000.00	99,163.51
	BGB 3.75% 06/22/45	190,000.00	188,182.47
	BGB 3% 06/22/33	340,000.00	341,092.55
	BGB 3% 06/22/34	130,000.00	129,224.71
	BGB 4.25% 03/28/41	300,000.00	320,602.50
	BGB 4% 03/28/32	150,000.00	161,118.67
	BGB 5.5% 03/28/28	280,000.00	304,827.65

BGB 5% 03/28/35	390,000.00	449,394.49
BKO 2.2% 03/11/27	530,000.00	533,050.94
BKO 2.7% 09/17/26	450,000.00	454,527.00
BKO 2% 12/10/26	600,000.00	601,350.40
BTPS 0.25% 03/15/28	130,000.00	123,658.43
BTPS 0.45% 02/15/29	180,000.00	168,420.12
BTPS 0.5% 07/15/28	130,000.00	123,581.98
BTPS 0.6% 08/01/31	110,000.00	96,298.28
BTPS 0.85% 01/15/27	140,000.00	137,836.42
BTPS 0.9% 04/01/31	410,000.00	369,081.82
BTPS 0.95% 03/01/37	340,000.00	254,578.89
BTPS 0.95% 06/01/32	450,000.00	393,125.23
BTPS 0.95% 09/15/27	570,000.00	557,275.61
BTPS 0.95% 12/01/31	90,000.00	79,773.57
BTPS 0% 08/01/26	650,000.00	637,498.61
BTPS 1.1% 04/01/27	230,000.00	226,567.33
BTPS 1.25% 12/01/26	80,000.00	79,320.92
BTPS 1.35% 04/01/30	990,000.00	937,280.14
BTPS 1.45% 03/01/36	100,000.00	81,776.82
BTPS 1.5% 04/30/45	220,000.00	145,120.08
BTPS 1.65% 03/01/32	510,000.00	470,440.80
BTPS 1.7% 09/01/51	300,000.00	184,955.05
BTPS 1.8% 03/01/41	210,000.00	158,232.18
BTPS 2.05% 08/01/27	470,000.00	470,449.55
BTPS 2.1% 07/15/26	350,000.00	350,741.96
BTPS 2.15% 03/01/72	100,000.00	58,818.11
BTPS 2.15% 09/01/52	170,000.00	114,070.26
BTPS 2.25% 09/01/36	210,000.00	185,028.39
BTPS 2.45% 09/01/33	450,000.00	427,068.67
BTPS 2.45% 09/01/50	310,000.00	227,204.85
BTPS 2.5% 12/01/32	420,000.00	404,309.45
BTPS 2.55% 02/25/27	300,000.00	302,318.01
BTPS 2.65% 12/01/27	440,000.00	445,682.86
BTPS 2.7% 03/01/47	330,000.00	264,508.57
BTPS 2.8% 03/01/67	200,000.00	142,260.50
BTPS 2.8% 06/15/29	670,000.00	679,216.98
BTPS 2.8% 12/01/28	150,000.00	152,664.69
BTPS 2.95% 02/15/27	500,000.00	507,283.70
BTPS 2.95% 09/01/38	250,000.00	229,965.83
BTPS 2% 02/01/28	160,000.00	159,630.98
BTPS 3.1% 03/01/40	310,000.00	284,253.08
BTPS 3.1% 08/28/26	410,000.00	415,184.24
BTPS 3.15% 11/15/31	800,000.00	808,618.64

BTPS 3.25% 03/01/38	210,000.00	200,204.72	
BTPS 3.25% 09/01/46	330,000.00	290,761.08	
BTPS 3.35% 03/01/35	370,000.00	368,914.72	
BTPS 3.35% 07/01/29	250,000.00	258,100.70	
BTPS 3.4% 04/01/28	710,000.00	732,563.87	
BTPS 3.45% 03/01/48	350,000.00	315,358.48	
BTPS 3.45% 07/15/27	650,000.00	667,769.44	
BTPS 3.45% 07/15/31	440,000.00	453,078.42	
BTPS 3.5% 02/15/31	1,120,000.00	1,159,041.39	
BTPS 3.65% 08/01/35	610,000.00	618,743.86	
BTPS 3.7% 06/15/30	330,000.00	345,599.46	
BTPS 3.8% 08/01/28	560,000.00	585,240.82	
BTPS 3.85% 02/01/35	770,000.00	796,805.77	
BTPS 3.85% 07/01/34	690,000.00	717,074.22	
BTPS 3.85% 09/01/49	330,000.00	314,270.29	
BTPS 3.85% 09/15/26	490,000.00	500,622.80	
BTPS 3.85% 10/01/40	260,000.00	257,396.84	
BTPS 3.85% 12/15/29	820,000.00	864,494.51	
BTPS 3% 08/01/29	70,000.00	71,568.09	
BTPS 3% 10/01/29	400,000.00	407,280.36	
BTPS 4.05% 10/30/37	220,000.00	228,413.57	
BTPS 4.1% 02/01/29	280,000.00	296,247.98	
BTPS 4.1% 04/30/46	50,000.00	50,226.53	
BTPS 4.15% 10/01/39	280,000.00	289,194.02	
BTPS 4.2% 03/01/34	210,000.00	224,463.79	
BTPS 4.3% 10/01/54	230,000.00	228,336.02	
BTPS 4.35% 11/01/33	400,000.00	432,131.04	
BTPS 4.4% 05/01/33	350,000.00	379,986.56	
BTPS 4.45% 09/01/43	260,000.00	273,177.06	
BTPS 4.5% 10/01/53	200,000.00	205,907.72	
BTPS 4.75% 09/01/28	240,000.00	257,988.81	
BTPS 4.75% 09/01/44	350,000.00	383,420.87	
BTPS 4% 02/01/37	650,000.00	676,957.97	
BTPS 4% 10/30/31	280,000.00	297,996.94	
BTPS 4% 11/15/30	700,000.00	743,428.14	
BTPS 5.0% 08/01/39	420,000.00	475,266.45	
BTPS 5.25% 11/01/29	140,000.00	155,976.75	
BTPS 5.75% 02/01/33	540,000.00	634,967.14	
BTPS 5% 08/01/34	50,000.00	56,602.16	
BTPS 5% 09/01/40	490,000.00	552,704.02	
BTPS 6.5% 11/01/27	460,000.00	505,429.50	
BTPS 6% 05/01/31	230,000.00	269,666.90	

DBR 0.25% 02/15/29	470,000.00	441,774.03
DBR 0.25% 08/15/28	620,000.00	588,772.15
DBR 0.5% 02/15/28	100,000.00	96,545.95
DBR 0.5% 08/15/27	400,000.00	389,077.60
DBR 0% 02/15/30	430,000.00	390,264.77
DBR 0% 02/15/31	230,000.00	203,280.26
DBR 0% 02/15/32	610,000.00	523,295.21
DBR 0% 05/15/35	410,000.00	316,162.89
DBR 0% 05/15/36	490,000.00	364,860.11
DBR 0% 08/15/26	10,000.00	9,806.45
DBR 0% 08/15/29	310,000.00	285,120.87
DBR 0% 08/15/30	580,000.00	519,678.11
DBR 0% 08/15/31	610,000.00	531,652.29
DBR 0% 08/15/50	930,000.00	434,851.70
DBR 0% 08/15/52	650,000.00	285,379.90
DBR 0% 11/15/27	580,000.00	555,427.83
DBR 0% 11/15/28	290,000.00	271,721.88
DBR 1.25% 08/15/48	680,000.00	477,667.36
DBR 1.7% 08/15/32	540,000.00	515,995.11
DBR 1.8% 08/15/53	730,000.00	550,978.45
DBR 1.8% 08/15/53	80,000.00	60,488.02
DBR 1% 05/15/38	510,000.00	408,400.86
DBR 2.1% 11/15/29	490,000.00	489,363.36
DBR 2.2% 02/15/34	500,000.00	486,506.25
DBR 2.3% 02/15/33	820,000.00	811,508.27
DBR 2.4% 11/15/30	570,000.00	574,542.33
DBR 2.5% 02/15/35	580,000.00	573,640.26
DBR 2.5% 07/04/44	580,000.00	535,805.74
DBR 2.5% 08/15/46	540,000.00	493,950.96
DBR 2.5% 08/15/54	360,000.00	316,792.08
DBR 2.6% 05/15/41	200,000.00	190,238.75
DBR 2.6% 08/15/33	490,000.00	493,488.80
DBR 2.6% 08/15/34	670,000.00	670,372.56
DBR 2.9% 08/15/56	190,000.00	180,398.92
DBR 3.25% 07/04/42	330,000.00	340,913.92
DBR 4.0% 01/04/37	470,000.00	526,383.17
DBR 4.25% 07/04/39	340,000.00	392,451.12
DBR 4.75% 07/04/28	180,000.00	194,488.65
DBR 4.75% 07/04/34	420,000.00	493,800.30
DBR 4.75% 07/04/40	390,000.00	475,012.47
DBR 5.5% 01/04/31	600,000.00	699,496.67
DBR 5.625% 01/04/28	330,000.00	359,841.57
DBR 6.25% 01/04/30	400,000.00	469,970.91

DBR 6.5% 07/04/27	70,000.00	76,308.22	
FRTR 0.25% 11/25/26	320,000.00	312,807.05	
FRTR 0.5% 05/25/29	900,000.00	837,104.91	
FRTR 0.5% 05/25/40	500,000.00	317,729.77	
FRTR 0.5% 05/25/72	270,000.00	71,276.00	
FRTR 0.5% 06/25/44	440,000.00	244,176.60	
FRTR 0.75% 02/25/28	600,000.00	578,893.55	
FRTR 0.75% 05/25/28	1,400,000.00	1,343,955.89	
FRTR 0.75% 05/25/52	650,000.00	303,213.66	
FRTR 0.75% 05/25/53	660,000.00	299,010.08	
FRTR 0.75% 11/25/28	1,270,000.00	1,206,144.33	
FRTR 0% 02/25/27	250,000.00	242,368.39	
FRTR 0% 05/25/32	720,000.00	590,117.85	
FRTR 0% 11/25/29	790,000.00	709,299.53	
FRTR 0% 11/25/30	1,170,000.00	1,015,305.66	
FRTR 0% 11/25/31	1,000,000.00	836,548.02	
FRTR 1.25% 05/25/34	1,050,000.00	891,875.89	
FRTR 1.25% 05/25/36	960,000.00	770,404.43	
FRTR 1.25% 05/25/38	480,000.00	363,892.76	
FRTR 1.5% 05/25/31	1,090,000.00	1,016,838.42	
FRTR 1.5% 05/25/50	610,000.00	370,576.57	
FRTR 1.75% 05/25/66	300,000.00	158,425.02	
FRTR 1.75% 06/25/39	670,000.00	533,307.83	
FRTR 1% 05/25/27	930,000.00	913,506.96	
FRTR 2.4% 09/24/28	160,000.00	160,572.76	
FRTR 2.5% 05/25/30	1,000,000.00	996,107.62	
FRTR 2.5% 05/25/43	390,000.00	322,909.83	
FRTR 2.5% 09/24/26	1,330,000.00	1,339,876.70	
FRTR 2.5% 09/24/27	920,000.00	928,820.85	
FRTR 2.7% 02/25/31	240,000.00	239,495.18	
FRTR 2.75% 02/25/29	1,020,000.00	1,033,663.92	
FRTR 2.75% 02/25/30	970,000.00	977,835.66	
FRTR 2.75% 10/25/27	720,000.00	730,883.52	
FRTR 2% 05/25/48	530,000.00	375,765.61	
FRTR 2% 11/25/32	980,000.00	915,145.08	
FRTR 3.2% 05/25/35	570,000.00	563,060.66	
FRTR 3.25% 05/25/45	570,000.00	521,377.05	
FRTR 3.25% 05/25/55	460,000.00	390,709.30	
FRTR 3.5% 11/25/33	920,000.00	943,961.30	
FRTR 3.6% 05/25/42	200,000.00	194,563.66	
FRTR 3.75% 05/25/56	140,000.00	130,007.77	
FRTR 3% 05/25/33	660,000.00	655,943.61	

FRTR 3% 05/25/54	460,000.00	373,924.40
FRTR 3% 06/25/49	250,000.00	212,745.06
FRTR 3% 11/25/34	760,000.00	742,669.48
FRTR 4.5% 04/25/41	670,000.00	729,592.48
FRTR 4.75% 04/25/35	640,000.00	715,839.04
FRTR 4% 04/25/55	320,000.00	313,878.87
FRTR 4% 04/25/60	330,000.00	319,752.70
FRTR 4% 10/25/38	450,000.00	467,930.07
FRTR 5.5% 04/25/29	930,000.00	1,034,059.00
FRTR 5.75% 10/25/32	610,000.00	720,143.18
IRISH 0.2% 05/15/27	180,000.00	174,619.98
IRISH 0.2% 10/18/30	130,000.00	115,767.49
IRISH 0.35% 10/18/32	10,000.00	8,469.97
IRISH 0.4% 05/15/35	110,000.00	85,702.59
IRISH 0.55% 04/22/41	70,000.00	46,158.07
IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	164,877.90
IRISH 0% 10/18/31	170,000.00	145,015.44
IRISH 1.1% 05/15/29	160,000.00	153,578.24
IRISH 1.3% 05/15/33	130,000.00	117,035.58
IRISH 1.35% 03/18/31	120,000.00	113,155.38
IRISH 1.5% 05/15/50	160,000.00	108,420.80
IRISH 1.7% 05/15/37	140,000.00	120,419.04
IRISH 2.4% 05/15/30	120,000.00	120,276.44
IRISH 2.6% 10/18/34	60,000.00	58,405.35
IRISH 2% 02/18/45	190,000.00	152,176.08
IRISH 3.15% 10/18/55	60,000.00	55,251.60
IRISH 3% 10/18/43	80,000.00	75,848.00
NETHER 0.25% 07/15/29	240,000.00	222,301.28
NETHER 0.5% 01/15/40	290,000.00	203,175.24
NETHER 0.5% 07/15/26	170,000.00	167,730.11
NETHER 0.5% 07/15/32	170,000.00	147,788.09
NETHER 0.75% 07/15/27	350,000.00	342,171.52
NETHER 0.75% 07/15/28	380,000.00	365,858.57
NETHER 0% 01/15/27	180,000.00	175,080.94
NETHER 0% 01/15/29	290,000.00	269,357.13
NETHER 0% 01/15/38	160,000.00	109,822.62
NETHER 0% 01/15/52	350,000.00	151,727.38
NETHER 0% 07/15/30	300,000.00	267,363.38
NETHER 0% 07/15/31	270,000.00	233,397.84
NETHER 2.5% 01/15/30	200,000.00	201,998.00
NETHER 2.5% 01/15/33	320,000.00	317,805.17
NETHER 2.5% 07/15/33	210,000.00	207,681.07
NETHER 2.5% 07/15/34	200,000.00	196,003.77

NETHER 2.5% 07/15/35	120,000.00	116,501.69	
NETHER 2.75% 01/15/47	380,000.00	353,488.05	
NETHER 2% 01/15/54	300,000.00	230,263.81	
NETHER 3.25% 01/15/44	180,000.00	181,860.73	
NETHER 3.75% 01/15/42	320,000.00	344,974.33	
NETHER 4% 01/15/37	350,000.00	386,204.49	
NETHER 5.5% 01/15/28	370,000.00	401,783.44	
OBL 0% 04/16/27	250,000.00	242,101.87	
OBL 0% 10/09/26	830,000.00	811,771.94	
OBL 1.3% 10/15/27	710,000.00	701,578.69	
OBL 2.1% 04/12/29	470,000.00	470,722.86	
OBL 2.2% 04/13/28	960,000.00	967,384.80	
OBL 2.4% 04/18/30	350,000.00	353,380.53	
OBL 2.4% 10/19/28	680,000.00	688,717.60	
OBL 2.5% 10/11/29	530,000.00	538,083.03	
PGB 0.3% 10/17/31	150,000.00	130,415.62	
PGB 0.475% 10/18/30	180,000.00	162,987.84	
PGB 0.7% 10/15/27	170,000.00	165,561.17	
PGB 0.9% 10/12/35	140,000.00	113,019.90	
PGB 1.15% 04/11/42	100,000.00	69,381.85	
PGB 1.65% 07/16/32	130,000.00	121,302.09	
PGB 1.95% 06/15/29	240,000.00	237,838.34	
PGB 1% 04/12/52	130,000.00	69,336.80	
PGB 2.125% 10/17/28	260,000.00	260,458.32	
PGB 2.25% 04/18/34	170,000.00	160,935.26	
PGB 2.875% 07/21/26	170,000.00	171,727.71	
PGB 2.875% 10/20/34	80,000.00	79,061.12	
PGB 3.375% 06/15/40	30,000.00	29,380.43	
PGB 3.5% 06/18/38	100,000.00	101,216.67	
PGB 3.625% 06/12/54	60,000.00	56,932.12	
PGB 3.875% 02/15/30	100,000.00	106,735.65	
PGB 3% 06/15/35	110,000.00	108,969.26	
PGB 4.1% 02/15/45	130,000.00	137,186.59	
PGB 4.1% 04/15/37	200,000.00	216,514.40	
PGB 4.125% 04/14/27	140,000.00	145,401.64	
RAGB 0.25% 10/20/36	150,000.00	108,681.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	290,000.00	272,824.32	
RAGB 0.5% 04/20/27	120,000.00	117,027.19	
RAGB 0.7% 04/20/71	90,000.00	31,569.30	
RAGB 0.75% 02/20/28	130,000.00	125,738.60	
RAGB 0.75% 03/20/51	200,000.00	106,668.20	
RAGB 0.75% 10/20/26	420,000.00	414,231.30	

RAGB 0.85% 06/30/20	120,000.00	37,723.80
RAGB 0.9% 02/20/32	280,000.00	250,195.40
RAGB 0% 02/20/30	90,000.00	80,787.55
RAGB 0% 02/20/31	280,000.00	243,317.80
RAGB 0% 10/20/28	250,000.00	233,094.46
RAGB 0% 10/20/40	130,000.00	77,649.15
RAGB 1.5% 02/20/47	200,000.00	139,004.16
RAGB 1.5% 11/02/86	60,000.00	28,455.60
RAGB 1.85% 05/23/49	130,000.00	94,650.68
RAGB 2.1% 09/20/17	90,000.00	53,619.52
RAGB 2.4% 05/23/34	210,000.00	201,522.19
RAGB 2.5% 10/20/29	120,000.00	120,855.96
RAGB 2.9% 02/20/33	300,000.00	302,078.85
RAGB 2.9% 02/20/34	180,000.00	179,922.42
RAGB 2.9% 05/23/29	170,000.00	174,052.57
RAGB 2.95% 02/20/35	150,000.00	149,129.32
RAGB 2% 07/15/26	110,000.00	110,167.76
RAGB 3.15% 06/20/44	160,000.00	152,955.48
RAGB 3.15% 10/20/53	120,000.00	109,505.07
RAGB 3.2% 07/15/39	90,000.00	88,566.20
RAGB 3.45% 10/20/30	160,000.00	167,673.28
RAGB 3.8% 01/26/62	90,000.00	91,943.01
RAGB 4.15% 03/15/37	300,000.00	328,066.74
RAGB 6.25% 07/15/27	210,000.00	227,704.86
RFGB 0.125% 04/15/36	110,000.00	79,851.65
RFGB 0.125% 04/15/52	60,000.00	25,114.28
RFGB 0.125% 09/15/31	90,000.00	77,344.99
RFGB 0.25% 09/15/40	90,000.00	56,701.43
RFGB 0.5% 04/15/43	90,000.00	54,930.75
RFGB 0.5% 09/15/27	60,000.00	58,161.09
RFGB 0.5% 09/15/28	170,000.00	161,559.09
RFGB 0.5% 09/15/29	170,000.00	157,952.30
RFGB 0.75% 04/15/31	100,000.00	90,512.12
RFGB 0% 09/15/26	80,000.00	78,299.71
RFGB 0% 09/15/30	50,000.00	44,066.47
RFGB 1.125% 04/15/34	150,000.00	129,173.32
RFGB 1.375% 04/15/27	90,000.00	89,148.65
RFGB 1.375% 04/15/47	100,000.00	67,436.84
RFGB 1.5% 09/15/32	100,000.00	91,961.06
RFGB 2.625% 07/04/42	110,000.00	98,956.65
RFGB 2.75% 04/15/38	80,000.00	75,707.68
RFGB 2.75% 07/04/28	210,000.00	214,098.73
RFGB 2.875% 04/15/29	60,000.00	61,316.94

RFGB 2.95% 04/15/55	110,000.00	96,287.81	
RFGB 3.2% 04/15/45	40,000.00	38,203.03	
RFGB 3% 09/15/33	160,000.00	161,671.64	
RFGB 3% 09/15/34	100,000.00	100,284.82	
RFGB 3% 09/15/35	60,000.00	59,676.31	
SPGB 0.1% 04/30/31	500,000.00	431,882.12	
SPGB 0.5% 04/30/30	330,000.00	300,354.45	
SPGB 0.5% 10/31/31	430,000.00	374,739.62	
SPGB 0.6% 10/31/29	450,000.00	416,911.16	
SPGB 0.7% 04/30/32	480,000.00	417,623.04	
SPGB 0.8% 07/30/27	20,000.00	19,530.35	
SPGB 0.8% 07/30/29	520,000.00	488,140.24	
SPGB 0.85% 07/30/37	350,000.00	260,613.80	
SPGB 0% 01/31/27	920,000.00	892,956.13	
SPGB 0% 01/31/28	600,000.00	569,028.60	
SPGB 1.2% 10/31/40	440,000.00	313,151.48	
SPGB 1.25% 10/31/30	520,000.00	485,895.43	
SPGB 1.3% 10/31/26	150,000.00	148,850.62	
SPGB 1.4% 04/30/28	660,000.00	647,156.23	
SPGB 1.4% 07/30/28	620,000.00	605,673.97	
SPGB 1.45% 04/30/29	300,000.00	290,445.37	
SPGB 1.45% 10/31/27	240,000.00	236,888.16	
SPGB 1.45% 10/31/71	100,000.00	45,179.71	
SPGB 1.5% 04/30/27	180,000.00	178,617.60	
SPGB 1.85% 07/30/35	470,000.00	414,891.09	
SPGB 1.9% 10/31/52	300,000.00	196,146.75	
SPGB 1.95% 07/30/30	430,000.00	418,172.95	
SPGB 1% 07/30/42	280,000.00	183,600.48	
SPGB 1% 10/31/50	450,000.00	240,943.43	
SPGB 2.35% 07/30/33	370,000.00	353,208.14	
SPGB 2.4% 05/31/28	160,000.00	160,933.12	
SPGB 2.5% 05/31/27	980,000.00	988,995.12	
SPGB 2.55% 10/31/32	410,000.00	401,112.47	
SPGB 2.7% 01/31/30	160,000.00	161,430.60	
SPGB 2.7% 10/31/48	360,000.00	293,558.73	
SPGB 2.9% 10/31/46	330,000.00	283,992.88	
SPGB 3.1% 07/30/31	420,000.00	428,835.98	
SPGB 3.15% 04/30/33	350,000.00	354,406.57	
SPGB 3.15% 04/30/35	410,000.00	407,426.22	
SPGB 3.2% 10/31/35	210,000.00	208,508.78	
SPGB 3.25% 04/30/34	400,000.00	404,118.19	
SPGB 3.45% 07/30/43	330,000.00	313,354.27	

	SPGB 3.45% 07/30/66	280,000.00	239,849.91	
	SPGB 3.45% 10/31/34	470,000.00	480,767.64	
	SPGB 3.5% 01/31/41	10,000.00	9,713.85	
	SPGB 3.5% 05/31/29	510,000.00	531,105.38	
	SPGB 3.55% 10/31/33	500,000.00	518,443.75	
	SPGB 3.9% 07/30/39	300,000.00	308,981.84	
	SPGB 4.2% 01/31/37	390,000.00	419,637.27	
	SPGB 4.7% 07/30/41	320,000.00	357,531.20	
	SPGB 4.9% 07/30/40	380,000.00	433,405.20	
	SPGB 4% 10/31/54	220,000.00	216,632.27	
	SPGB 5.15% 10/31/28	910,000.00	993,414.68	
	SPGB 5.15% 10/31/44	300,000.00	353,557.50	
	SPGB 5.75% 07/30/32	520,000.00	616,096.52	
	SPGB 5.9% 07/30/26	140,000.00	145,807.06	
	ユーロ 小計	135,820,000.00	127,232,242.12 (21,785,976,818)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/31/28	220,000.00	201,112.12	
	UKT 0.25% 07/31/31	630,000.00	503,061.93	
	UKT 0.375% 10/22/26	30,000.00	28,803.24	
	UKT 0.375% 10/22/30	370,000.00	307,556.95	
	UKT 0.5% 01/31/29	610,000.00	543,137.29	
	UKT 0.5% 10/22/61	490,000.00	124,753.51	
	UKT 0.625% 07/31/35	500,000.00	341,342.00	
	UKT 0.625% 10/22/50	400,000.00	142,820.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	310,000.00	139,882.85	
	UKT 0.875% 07/31/33	700,000.00	534,054.50	
	UKT 0.875% 10/22/29	160,000.00	141,526.88	
	UKT 1.125% 01/31/39	270,000.00	169,968.24	
	UKT 1.125% 10/22/73	180,000.00	56,898.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	310,000.00	294,987.94	
	UKT 1.25% 07/31/51	470,000.00	200,055.50	
	UKT 1.25% 10/22/41	420,000.00	242,596.62	
	UKT 1.5% 07/22/47	270,000.00	137,091.96	
	UKT 1.5% 07/31/53	50,000.00	22,101.75	
	UKT 1.625% 10/22/28	90,000.00	84,135.33	
	UKT 1.625% 10/22/54	300,000.00	135,674.70	
	UKT 1.625% 10/22/71	390,000.00	152,856.99	
	UKT 1.75% 01/22/49	200,000.00	104,648.40	
	UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	199,830.40	
	UKT 1.75% 09/07/37	430,000.00	310,278.11	
UKT 1% 01/31/32	370,000.00	303,067.00		
UKT 2.5% 07/22/65	230,000.00	124,381.70		
UKT 3.25% 01/22/44	380,000.00	290,112.14		

UKT 3.25% 01/31/33	580,000.00	539,156.40	
UKT 3.5% 01/22/45	310,000.00	242,902.36	
UKT 3.5% 07/22/68	270,000.00	189,002.16	
UKT 3.75% 01/29/38	540,000.00	483,807.06	
UKT 3.75% 03/07/27	720,000.00	718,585.92	
UKT 3.75% 07/22/52	290,000.00	222,664.61	
UKT 3.75% 10/22/53	720,000.00	547,143.12	
UKT 4.125% 01/29/27	970,000.00	973,429.92	
UKT 4.125% 07/22/29	890,000.00	895,998.60	
UKT 4.25% 03/07/36	310,000.00	298,719.72	
UKT 4.25% 06/07/32	270,000.00	270,988.74	
UKT 4.25% 07/31/34	810,000.00	793,278.36	
UKT 4.25% 09/07/39	270,000.00	250,001.37	
UKT 4.25% 12/07/27	720,000.00	728,921.52	
UKT 4.25% 12/07/40	290,000.00	264,915.29	
UKT 4.25% 12/07/46	330,000.00	284,557.02	
UKT 4.25% 12/07/49	260,000.00	220,544.22	
UKT 4.25% 12/07/55	350,000.00	290,286.15	
UKT 4.375% 01/31/40	370,000.00	345,178.18	
UKT 4.375% 03/07/28	440,000.00	445,317.84	
UKT 4.375% 03/07/30	350,000.00	354,991.00	
UKT 4.375% 07/31/54	500,000.00	424,429.00	
UKT 4.5% 03/07/35	310,000.00	307,533.95	
UKT 4.5% 06/07/28	380,000.00	386,686.86	
UKT 4.5% 09/07/34	240,000.00	240,068.88	
UKT 4.5% 12/07/42	370,000.00	341,340.91	
UKT 4.625% 01/31/34	560,000.00	566,227.20	
UKT 4.75% 10/22/43	580,000.00	545,909.92	
UKT 4.75% 12/07/30	450,000.00	466,798.05	
UKT 4.75% 12/07/38	400,000.00	394,360.00	
UKT 4% 01/22/60	190,000.00	149,434.05	
UKT 4% 10/22/31	720,000.00	712,131.84	
UKT 4% 10/22/63	310,000.00	241,254.71	
UKT 6.0% 12/07/28	420,000.00	450,035.04	
イギリスポンド 小計	24,710,000.00	20,423,336.02 (4,054,849,133)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	890,000.00	799,015.30
	SGB 0.75% 05/12/28	1,230,000.00	1,195,990.50
	SGB 0.75% 11/12/29	1,690,000.00	1,611,415.00
	SGB 1.75% 11/11/33	1,150,000.00	1,111,452.00
	SGB 1% 11/12/26	1,740,000.00	1,722,426.00
	SGB 2.25% 05/11/35	810,000.00	806,683.05

	SGB 2.25% 06/01/32	730,000.00	737,635.80
	SGB 3.5% 03/30/39	850,000.00	951,426.25
スウェーデンクローナ 小計		9,090,000.00	8,936,043.90 (137,168,273)
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	1,130,000.00	976,994.94
	NGB 1.375% 08/19/30	1,050,000.00	939,666.94
	NGB 1.75% 02/17/27	990,000.00	962,735.41
	NGB 1.75% 09/06/29	780,000.00	724,892.77
	NGB 2.125% 05/18/32	910,000.00	820,366.54
	NGB 2% 04/26/28	790,000.00	758,074.59
	NGB 3.5% 10/06/42	360,000.00	347,322.99
	NGB 3.625% 04/13/34	1,220,000.00	1,199,395.90
	NGB 3.625% 05/31/39	330,000.00	322,513.23
	NGB 3.75% 06/12/35	810,000.00	802,548.40
	NGB 3% 08/15/33	620,000.00	584,557.05
	ノルウェークローネ 小計		8,990,000.00
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	1,170,000.00	606,860.75
	DGB 0.5% 11/15/27	950,000.00	925,217.91
	DGB 0.5% 11/15/29	790,000.00	742,032.41
	DGB 0% 11/15/31	700,000.00	610,034.85
	DGB 2.25% 11/15/26	550,000.00	555,891.71
	DGB 2.25% 11/15/33	1,450,000.00	1,436,470.83
	DGB 2.25% 11/15/35	330,000.00	321,513.96
	DGB 4.5% 11/15/39	1,770,000.00	2,132,933.19
デンマーククローネ 小計		7,710,000.00	7,330,955.61 (168,245,431)
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	310,000.00	294,744.90
	POLGB 1.25% 10/25/30	1,280,000.00	1,073,412.97
	POLGB 1.75% 04/25/32	920,000.00	744,137.51
	POLGB 2.5% 07/25/26	740,000.00	727,345.76
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,010,000.00	973,803.01
	POLGB 2.75% 04/25/28	730,000.00	698,898.35
	POLGB 2.75% 10/25/29	950,000.00	881,733.28
	POLGB 3.75% 05/25/27	890,000.00	881,903.17
	POLGB 4.5% 07/25/30	80,000.00	78,863.82
	POLGB 4.75% 07/25/29	670,000.00	672,802.94
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,090,000.00	1,134,784.28
	POLGB 5% 01/25/30	710,000.00	717,684.54
	POLGB 5% 10/25/34	860,000.00	839,899.96
	POLGB 6% 10/25/33	1,060,000.00	1,114,197.16
	POLGB 7.5% 07/25/28	1,090,000.00	1,181,864.74
		12,390,000.00	12,016,076.39

ポーランドズロチ 小計			(485,089,003)
オーストラリアドル	ACGB 0.5% 09/21/26	690,000.00	666,436.50
	ACGB 1.25% 05/21/32	520,000.00	435,318.00
	ACGB 1.5% 06/21/31	450,000.00	394,762.50
	ACGB 1.75% 06/21/51	330,000.00	173,900.10
	ACGB 1.75% 11/21/32	460,000.00	392,771.00
	ACGB 1% 11/21/31	510,000.00	427,247.40
	ACGB 1% 12/21/30	390,000.00	338,036.40
	ACGB 2.25% 05/21/28	350,000.00	338,821.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	490,000.00	465,495.10
	ACGB 2.75% 05/21/41	260,000.00	204,110.40
	ACGB 2.75% 06/21/35	380,000.00	331,576.60
	ACGB 2.75% 11/21/27	300,000.00	295,533.00
	ACGB 2.75% 11/21/28	360,000.00	351,856.80
	ACGB 2.75% 11/21/29	350,000.00	338,467.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	490,000.00	485,452.80
	ACGB 3.25% 06/21/39	180,000.00	155,584.80
	ACGB 3.5% 12/21/34	520,000.00	488,332.00
	ACGB 3.75% 04/21/37	290,000.00	271,550.20
	ACGB 3.75% 05/21/34	590,000.00	569,037.30
	ACGB 3% 03/21/47	240,000.00	179,524.80
	ACGB 3% 11/21/33	370,000.00	339,319.60
	ACGB 4.25% 03/21/36	340,000.00	336,392.60
	ACGB 4.25% 06/21/34	70,000.00	70,081.20
	ACGB 4.25% 12/21/35	260,000.00	257,680.80
	ACGB 4.5% 04/21/33	430,000.00	441,403.60
	ACGB 4.75% 04/21/27	210,000.00	214,880.40
ACGB 4.75% 06/21/54	180,000.00	172,875.60	
オーストラリアドル 小計		10,010,000.00	9,136,448.00 (872,804,877)
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	200,000.00	182,450.84
	NZGB 1.5% 05/15/31	120,000.00	103,910.97
	NZGB 1.75% 05/15/41	100,000.00	64,136.00
	NZGB 2.75% 04/15/37	150,000.00	122,423.92
	NZGB 2.75% 05/15/51	120,000.00	77,724.91
	NZGB 2% 05/15/32	180,000.00	155,936.16
	NZGB 3.5% 04/14/33	180,000.00	169,554.47
	NZGB 3% 04/20/29	250,000.00	243,851.08
	NZGB 4.25% 05/15/34	200,000.00	196,274.94
	NZGB 4.25% 05/15/36	110,000.00	105,781.72
	NZGB 4.5% 04/15/27	290,000.00	295,922.43
	NZGB 4.5% 05/15/30	240,000.00	246,313.03
	NZGB 4.5% 05/15/35	260,000.00	257,847.28

	NZGB 5% 05/15/54	100,000.00	95,685.22	
ニュージーランドドル 小計		2,500,000.00	2,317,812.97	(203,156,306)
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 11/01/26	140,000.00	139,145.78	
	SIGB 1.625% 07/01/31	80,000.00	78,521.32	
	SIGB 1.875% 03/01/50	90,000.00	85,522.21	
	SIGB 1.875% 10/01/51	40,000.00	37,483.07	
	SIGB 2.25% 08/01/36	140,000.00	141,397.35	
	SIGB 2.375% 07/01/39	130,000.00	132,988.60	
	SIGB 2.625% 05/01/28	60,000.00	61,440.64	
	SIGB 2.625% 08/01/32	60,000.00	62,299.17	
	SIGB 2.75% 03/01/35	80,000.00	84,445.60	
	SIGB 2.75% 03/01/46	160,000.00	176,005.60	
	SIGB 2.75% 04/01/42	140,000.00	151,749.33	
	SIGB 2.875% 07/01/29	190,000.00	197,797.01	
	SIGB 2.875% 08/01/28	110,000.00	113,679.30	
	SIGB 2.875% 09/01/27	40,000.00	40,973.42	
	SIGB 2.875% 09/01/30	130,000.00	136,544.04	
	SIGB 3.25% 06/01/54	110,000.00	135,603.60	
	SIGB 3.375% 05/01/34	80,000.00	88,117.96	
	SIGB 3.375% 09/01/33	130,000.00	142,089.98	
	SIGB 3.5% 03/01/27	290,000.00	298,317.20	
	SIGB 3% 04/01/29	50,000.00	52,189.58	
SIGB 3% 08/01/72	110,000.00	133,523.39		
シンガポールドドル 小計		2,360,000.00	2,489,834.15	(284,015,381)
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	300,000.00	289,296.19	
	MGS 3.502% 05/31/27	210,000.00	211,980.67	
	MGS 3.519% 04/20/28	430,000.00	434,747.88	
	MGS 3.582% 07/15/32	110,000.00	111,582.88	
	MGS 3.733% 06/15/28	250,000.00	254,397.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	470,000.00	472,959.12	
	MGS 3.828% 07/05/34	500,000.00	513,131.60	
	MGS 3.844% 04/15/33	490,000.00	503,747.63	
	MGS 3.885% 08/15/29	710,000.00	728,837.57	
	MGS 3.892% 03/15/27	150,000.00	152,233.45	
	MGS 3.899% 11/16/27	700,000.00	713,408.36	
	MGS 3.9% 11/30/26	480,000.00	486,173.13	
	MGS 3.906% 07/15/26	140,000.00	141,377.16	
	MGS 4.054% 04/18/39	260,000.00	270,706.12	
	MGS 4.065% 06/15/50	520,000.00	527,756.52	
	MGS 4.232% 06/30/31	440,000.00	460,704.77	

	MGS 4.254% 05/31/35	270,000.00	286,879.40	
	MGS 4.457% 03/31/53	410,000.00	441,554.42	
	MGS 4.498% 04/15/30	500,000.00	528,798.70	
	MGS 4.504% 04/30/29	230,000.00	240,895.65	
	MGS 4.642% 11/07/33	380,000.00	412,787.92	
	MGS 4.696% 10/15/42	420,000.00	469,140.75	
	MGS 4.736% 03/15/46	100,000.00	111,540.53	
	MGS 4.762% 04/07/37	430,000.00	477,293.76	
	MGS 4.893% 06/08/38	460,000.00	515,875.37	
	MGS 4.921% 07/06/48	320,000.00	366,418.81	
	MGS 4.935% 09/30/43	440,000.00	505,101.30	
	マレーシアリングット 小計	10,120,000.00	10,629,327.26 (365,250,257)	
イスラエル シェケル	ILGOV 1.3% 04/30/32	580,000.00	488,282.84	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	680,000.00	509,163.67	
	ILGOV 1% 03/31/30	490,000.00	428,936.44	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	680,000.00	646,035.19	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	420,000.00	303,720.14	
	ILGOV 2% 03/31/27	590,000.00	571,456.44	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	640,000.00	636,004.54	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	470,000.00	423,175.46	
	ILGOV 3.75% 09/30/27	240,000.00	239,014.36	
	ILGOV 4.6% 08/31/29	260,000.00	267,573.07	
	ILGOV 4% 03/30/35	570,000.00	565,560.77	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	480,000.00	545,467.39	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	440,000.00	453,106.85	
		イスラエルシェケル 小計	6,540,000.00	6,077,497.16 (267,161,913)
オフショア 人民元	CGB 1.06% 12/15/26	2,560,000.00	2,548,695.60	
	CGB 1.35% 09/25/26	5,000,000.00	4,998,189.85	
	CGB 1.45% 02/25/28	3,850,000.00	3,855,915.52	
	CGB 1.46% 05/25/28	22,200,000.00	22,237,298.21	
	CGB 1.49% 12/25/31	6,740,000.00	6,692,954.18	
	CGB 1.59% 03/15/27	7,220,000.00	7,244,597.09	
	CGB 1.62% 08/15/27	1,390,000.00	1,396,690.62	
	CGB 1.65% 05/15/35	2,690,000.00	2,681,766.90	
	CGB 1.79% 03/25/32	2,700,000.00	2,734,763.04	
	CGB 1.85% 05/15/27	5,290,000.00	5,335,929.36	
	CGB 1.87% 09/15/31	4,100,000.00	4,168,832.44	
	CGB 1.91% 07/15/29	980,000.00	995,973.80	
	CGB 1.92% 01/15/55	1,180,000.00	1,184,422.40	
	CGB 2.04% 02/25/27	5,670,000.00	5,729,900.14	
	CGB 2.04% 11/25/34	10,300,000.00	10,629,422.84	

CGB 2.05% 04/15/29	9,720,000.00	9,921,944.65
CGB 2.11% 08/25/34	12,000,000.00	12,434,349.59
CGB 2.12% 06/25/31	6,430,000.00	6,627,125.15
CGB 2.18% 08/15/26	5,150,000.00	5,195,196.40
CGB 2.27% 05/25/34	3,140,000.00	3,291,796.70
CGB 2.28% 03/25/31	10,020,000.00	10,405,590.63
CGB 2.35% 02/25/34	6,600,000.00	6,955,332.76
CGB 2.37% 01/15/29	8,870,000.00	9,143,490.48
CGB 2.37% 01/20/27	8,330,000.00	8,454,407.71
CGB 2.39% 11/15/26	5,900,000.00	5,980,759.79
CGB 2.4% 07/15/28	9,890,000.00	10,174,752.88
CGB 2.44% 10/15/27	4,190,000.00	4,282,860.03
CGB 2.48% 04/15/27	3,860,000.00	3,934,048.69
CGB 2.48% 09/25/28	5,200,000.00	5,369,869.96
CGB 2.5% 07/25/27	8,710,000.00	8,888,173.49
CGB 2.52% 08/25/33	7,060,000.00	7,518,699.49
CGB 2.54% 12/25/30	7,000,000.00	7,361,412.78
CGB 2.55% 10/15/28	6,700,000.00	6,936,096.61
CGB 2.6% 09/01/32	1,610,000.00	1,718,820.38
CGB 2.6% 09/15/30	6,460,000.00	6,800,867.71
CGB 2.62% 04/15/28	5,190,000.00	5,361,208.23
CGB 2.62% 06/25/30	4,340,000.00	4,568,907.22
CGB 2.62% 09/25/29	9,310,000.00	9,735,933.43
CGB 2.64% 01/15/28	10,430,000.00	10,751,471.37
CGB 2.67% 05/25/33	8,090,000.00	8,695,013.88
CGB 2.67% 11/25/33	7,020,000.00	7,573,276.37
CGB 2.68% 05/21/30	6,910,000.00	7,286,639.22
CGB 2.69% 08/12/26	3,650,000.00	3,705,707.76
CGB 2.69% 08/15/32	4,550,000.00	4,877,222.35
CGB 2.74% 08/04/26	6,010,000.00	6,103,210.89
CGB 2.75% 02/17/32	5,380,000.00	5,768,264.90
CGB 2.75% 06/15/29	8,530,000.00	8,944,868.49
CGB 2.76% 05/15/32	2,940,000.00	3,164,794.75
CGB 2.79% 12/15/29	3,010,000.00	3,178,187.66
CGB 2.8% 03/24/29	4,890,000.00	5,128,713.17
CGB 2.8% 03/25/30	9,510,000.00	10,067,763.39
CGB 2.8% 11/15/32	2,250,000.00	2,436,700.05
CGB 2.85% 06/04/27	3,400,000.00	3,498,718.66
CGB 2.88% 02/25/33	4,280,000.00	4,667,721.77
CGB 2.89% 11/18/31	2,750,000.00	2,968,334.87
CGB 2.91% 10/14/28	2,690,000.00	2,819,408.63
CGB 3.01% 05/13/28	330,000.00	345,585.70
CGB 3.02% 05/27/31	2,180,000.00	2,364,139.36

	CGB 3.12% 10/25/52	2,060,000.00	2,581,144.56	
	CGB 3.12% 12/05/26	1,300,000.00	1,335,168.12	
	CGB 3.13% 11/21/29	2,050,000.00	2,201,648.13	
	CGB 3.19% 04/15/53	2,470,000.00	3,140,690.94	
	CGB 3.25% 11/22/28	460,000.00	489,680.62	
	CGB 3.27% 11/19/30	620,000.00	679,225.12	
	CGB 3.28% 12/03/27	1,270,000.00	1,331,792.61	
	CGB 3.32% 04/15/52	2,730,000.00	3,528,747.76	
	CGB 3.39% 03/16/50	4,350,000.00	5,595,172.27	
	CGB 3.53% 10/18/51	2,490,000.00	3,312,363.33	
	CGB 3.72% 04/12/51	2,170,000.00	2,965,858.56	
	CGB 3.81% 09/14/50	5,390,000.00	7,406,091.77	
	CGB 3.86% 07/22/49	3,690,000.00	5,069,230.10	
	CGB 3% 10/15/53	4,200,000.00	5,236,528.49	
	CGB 4.08% 10/22/48	3,550,000.00	4,985,998.42	
	オフショア人民元 小計	375,150,000.00	397,702,080.79 (8,079,795,013)	
	合計		71,270,347,293 (71,270,347,293)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 219銘柄	100.0%	45.6%
カナダドル	国債証券 37銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 386銘柄	100.0%	30.6%
イギリスポンド	国債証券 61銘柄	100.0%	5.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.2%
ニュージーランドドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券 21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 27銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券 73銘柄	100.0%	11.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,432,362,703
コール・ローン	1,300,390,546
株式	835,150,077,786
投資信託受益証券	139,634,629
投資証券	14,159,462,438
派生商品評価勘定	633,720,565
未収入金	217,583,813
未収配当金	486,213,229
未収利息	16,640
差入委託証拠金	6,123,564,168
流動資産合計	871,643,026,517
資産合計	871,643,026,517
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,923,247
前受金	621,092,787
未払解約金	1,861,906,091
流動負債合計	2,492,922,125
負債合計	2,492,922,125
純資産の部	
元本等	
元本	117,291,679,009
剰余金	
剰余金又は欠損金()	751,858,425,383
元本等合計	869,150,104,392
純資産合計	869,150,104,392
負債純資産合計	871,643,026,517

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券</p>

2025年 7月10日現在	
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,291,679,009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 7.4102円 (1万口当たり純資産額) (74,102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

2025年 7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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>

	2025年 7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

	2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	114,681,464,817円
期中追加設定元本額	17,086,924,191円
期中一部解約元本額	14,476,709,999円
期末元本額	117,291,679,009円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,253,883,227円
S B I 資産設計オープン（分配型）	4,784,362円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,845,868,356円
世界経済インデックスファンド	15,938,244,233円
外国株式インデックス・オープン	829,321,032円
D C マイセクション 2 5	491,333,057円
D C マイセクション 5 0	2,842,430,600円
D C マイセクション 7 5	3,824,726,740円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,899,867,505円
D C マイセクション S 2 5	416,060,392円
D C マイセクション S 5 0	2,071,089,867円
D C マイセクション S 7 5	2,449,825,253円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	3,510,781円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	106,596,714円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	91,460,280円
D C 世界経済インデックスファンド	8,832,090,218円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	607,349,031円
マイセクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,390,416円

区分	2025年 7月10日現在
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,278,910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）	11,601,263円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	3,755,677円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	15,445,213円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	4,137,687円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	14,802,167円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	61,894,344円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	85,333,661円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	708,872,686円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,052,402円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,435,480円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	72,905,168円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	24,868,987円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	681,408,435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）	577,447,211円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,050,716,819円
コア投資戦略ファンド（安定型）	38,289,748円
コア投資戦略ファンド（成長型）	96,146,509円
分散投資コア戦略ファンドA	1,205,130,404円
分散投資コア戦略ファンドS	5,940,445,804円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,633,572,591円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	951,907,372円
コア投資戦略ファンド（切替型）	39,609,333円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	392,266,532円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,086,670円
SMT インデックスバランス・オープン	89,533,663円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	21,629,878円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,136,481,251円
SMT 世界経済インデックス・オープン	290,887,256円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,452,750,148円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	207,813,005円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,040,180円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	4,266,454,754円
グローバル経済コア	994,533,274円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,766,569円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,505,353円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	34,295,194円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,545,646円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	212,599,601円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	232,626,017円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	113,354,020円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	145,318,258円
10資産分散投資ファンド	58,339,034円
グローバル10資産バランスファンド	25,461,152円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	22,894,933円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	27,489,102円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	14,221,520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	10,571,999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	6,905,430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	3,539,250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	1,068,972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	1,430,254円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	130,586,149円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	470,110,171円
DCターゲット・イヤー ファンド2065	18,255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）	48,559,365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）	742,352,994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）	808,971,993円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,510,223,876円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	108,975,789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）	50,842,844円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,561,371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）	96,689,310円

区分	2025年 7月10日現在
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	16,017円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	10,419円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	15,868円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	16,212円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	13,728円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	9,405円
外国株式インデックスファンドT（一般投資家私募/適格機関投資家転売制限付）	1,131,966,657円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	145,490,791円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	160,339,947円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	158,971,813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）	40,637,185円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	41,512,697,241
投資信託受益証券	7,743,935
投資証券	38,654,376
合計	41,481,786,800

(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

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	18,358,104,089	-	18,979,196,876	621,092,787
合計		18,358,104,089	-	18,979,196,876	621,092,787

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,044,468,990	-	1,041,764,459	2,704,531
	アメリカドル	774,700,000	-	772,958,230	1,741,770
	ユーロ	269,768,990	-	268,806,229	962,761
合計		1,044,468,990	-	1,041,764,459	2,704,531

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表 (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	77,332	39.33	3,041,467.56	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	235.96	4,270,640.04	
	CHEVRON CORP	135,622	153.02	20,752,878.44	
	CONOCOPHILLIPS	103,013	94.53	9,737,818.89	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	25.14	1,371,286.44	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	34.59	1,738,355.04	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	15,274	142.12	2,170,740.88	
	EOG RESOURCES INC	43,341	121.89	5,282,834.49	
	EQT CORPORATION	43,539	54.88	2,389,420.32	
	EXPAND ENERGY CORP	16,182	105.20	1,702,346.40	
	EXXON MOBIL	349,119	113.80	39,729,742.20	
	HALLIBURTON CO	70,302	22.04	1,549,456.08	
	HESS CORP	24,509	150.88	3,697,917.92	
	KINDER MORGAN INC	160,038	27.80	4,449,056.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	25,448	179.27	4,562,062.96	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	53,768	45.57	2,450,207.76	
	ONEOK INC	49,687	81.16	4,032,596.92	
	PHILLIPS 66	32,122	130.51	4,192,242.22	
	SCHLUMBERGER	110,422	36.25	4,002,797.50	
	TARGA RESOURCES CORP	18,784	170.69	3,206,240.96	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	1,047.55	1,675,032.45	
	VALERO ENERGY CORP	26,920	149.07	4,012,964.40	
	WILLIAMS COS	97,655	57.85	5,649,341.75	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	294.24	5,143,020.96	
	AMCOR PLC	181,292	9.80	1,776,661.60	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	183.52	1,218,205.76	
	BALL CORP	25,896	57.94	1,500,414.24	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,885	98.75	1,272,393.75	
	CORTEVA INC	58,239	76.20	4,437,811.80	
	CRH PLC	56,375	96.47	5,438,496.25	
CROWN HOLDINGS INC	9,940	107.96	1,073,122.40		
DOW INC	56,967	29.84	1,699,895.28		

DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	75.54	2,577,349.26
ECOLAB INC	20,345	268.21	5,456,732.45
FREEMPORT-MCMORAN INC	117,378	45.59	5,351,263.02
INT'L PAPER CO	39,891	51.36	2,048,801.76
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	76.55	1,477,950.85
LINDE PLC	38,036	471.27	17,925,225.72
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	64.84	1,280,265.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	567.02	2,844,739.34
NEWMONT CORPORATION	92,555	58.75	5,437,606.25
NUCOR CORP	18,727	139.70	2,616,161.90
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,847	204.08	1,601,415.76
PPG INDUSTRIES INC	17,128	118.19	2,024,358.32
RELIANCE INC	4,126	327.92	1,352,997.92
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	114.14	1,193,447.84
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,348	351.54	6,801,595.92
SMURFIT WESTROCK PLC	40,860	47.24	1,930,226.40
STEEL DYNAMICS INC	11,618	136.08	1,580,977.44
VULCAN MATERIALS CO	11,577	269.95	3,125,211.15
3 M COMPANY	43,663	155.98	6,810,554.74
AECOM	10,456	115.62	1,208,922.72
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	114.05	1,674,139.95
ALLEGION PLC	7,721	150.06	1,158,613.26
AMETEK INC	17,753	182.28	3,236,016.84
AXON ENTERPRISE INC	6,065	805.86	4,887,540.90
BOEING CO	60,226	226.60	13,647,211.60
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	133.00	1,266,426.00
CARLISLE COS INC	3,456	412.54	1,425,738.24
CARRIER GLOBAL CORP	61,321	75.89	4,653,650.69
CATERPILLAR	38,613	402.18	15,529,376.34
CNH INDUSTRIAL NV	57,961	13.69	793,486.09
CUMMINS INC	11,413	334.60	3,818,789.80
DEERE&CO	21,241	509.33	10,818,678.53
DOVER CORP	10,657	188.22	2,005,860.54
EATON CORP	32,123	359.78	11,557,212.94
EMCOR GROUP INC	3,640	546.28	1,988,459.20
EMERSON ELECTRIC CO	47,317	139.80	6,614,916.60
FASTENAL CO	88,022	43.40	3,820,154.80
FERGUSON ENTERPRISES INC	16,260	224.00	3,642,240.00
FORTIVE CORP	26,005	52.99	1,378,004.95
GE AEROSPACE	87,311	250.33	21,856,562.63
GE VERNOVA INC	22,026	535.77	11,800,870.02
GENERAL DYNAMICS CORP	18,059	299.96	5,416,977.64

GRACO INC	13,378	88.45	1,183,284.10
GRAINGER (WW) INC	3,706	1,045.29	3,873,844.74
HEICO CORP	3,640	316.85	1,153,334.00
HEICO CORP-CLASS A	5,700	246.01	1,402,257.00
HONEYWELL INTL INC	52,736	238.72	12,589,137.92
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	181.42	5,741,580.16
HUBBELL INC	4,458	417.71	1,862,151.18
IDEX CORP	5,916	184.38	1,090,792.08
ILLINOIS TOOL WORKS	22,905	259.75	5,949,573.75
INGERSOLL-RAND INC	31,562	87.70	2,767,987.40
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	49.50	628,650.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	106.50	5,766,016.50
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	259.05	3,803,372.10
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	602.38	1,521,611.88
LOCKHEED MARTIN CORP	17,459	463.06	8,084,564.54
MASCO CORP	18,934	66.89	1,266,495.26
NORDSON CORP	4,121	222.04	915,026.84
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,747	507.94	5,458,831.18
OTIS WORLDWIDE CORP	30,534	99.34	3,033,247.56
OWENS CORNING	6,460	147.29	951,493.40
PACCAR INC	43,301	98.67	4,272,509.67
PARKER HANNIFIN CORP	10,443	707.59	7,389,362.37
PENTAIR PLC	14,383	106.90	1,537,542.70
QUANTA SERVICES INC	11,573	382.12	4,422,274.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,710	340.26	3,303,924.60
RTX CORP	108,516	146.18	15,862,868.88
SNAP-ON INC	4,000	318.12	1,272,480.00
TEXTRON	13,876	82.47	1,144,353.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	433.61	7,804,980.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,495	1,526.44	6,861,347.80
UNITED RENTALS INC	5,364	803.99	4,312,602.36
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	128.37	3,723,371.85
WABTEC CORP	13,304	213.05	2,834,417.20
WATSCO INC	2,656	473.01	1,256,314.56
XYLEM INC	19,668	131.55	2,587,325.40
AUTOMATIC DATA PROCESS	33,190	308.41	10,236,127.90
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,202	107.02	1,198,838.04
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	238.76	2,301,646.40
CINTAS CORP	30,225	216.64	6,547,944.00
COPART INC	76,214	47.64	3,630,834.96
EQUIFAX INC	10,261	265.73	2,726,655.53
JACOBS SOLUTIONS INC	11,026	134.20	1,479,689.20

LEIDOS HOLDINGS	10,976	162.21	1,780,416.96
PAYCHEX INC	26,671	145.94	3,892,365.74
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	234.08	991,328.80
REPUBLIC SERVICES INC	18,062	240.51	4,344,091.62
ROLLINS INC	25,466	55.81	1,421,257.46
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,331	83.32	1,610,658.92
TRANSUNION	15,741	93.52	1,472,098.32
VERALTO CORP	20,685	102.37	2,117,523.45
VERISK ANALYTICS INC	10,892	303.72	3,308,118.24
WASTE CONNECTIONS INC	20,135	182.07	3,665,979.45
WASTE MANAGEMENT INC	32,252	225.75	7,280,889.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	99.12	829,337.04
CSX CORP	152,551	33.33	5,084,524.83
DELTA AIR LINES INC	15,193	50.70	770,285.10
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	117.27	1,440,075.60
FEDEX CORP	18,843	236.51	4,456,557.93
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	4.99	949,916.36
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	152.67	877,547.16
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	260.04	4,676,039.28
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,950	168.01	2,511,749.50
U-HAUL HOLDING CO	6,606	56.06	370,332.36
UBER TECHNOLOGIES INC	153,426	96.64	14,827,088.64
UNION PACIFIC CORP	48,392	236.49	11,444,224.08
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,611	80.18	530,069.98
UNITED PARCEL SERVICE B	58,139	102.15	5,938,898.85
APTIV PLC	21,031	70.92	1,491,518.52
FORD MOTOR COMPANY	320,913	11.83	3,796,400.79
GENERAL MOTORS CO	78,250	52.57	4,113,602.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	75,764	13.20	1,000,084.80
TESLA INC	234,426	295.88	69,361,964.88
DECKERS OUTDOOR CORP	12,618	104.91	1,323,754.38
DR HORTON INC	22,687	138.41	3,140,107.67
GARMIN LTD	11,636	217.11	2,526,291.96
LENNAR CORP-CL A	18,864	115.36	2,176,151.04
LULULEMON ATHLETICA INC	8,710	235.89	2,054,601.90
NIKE B	94,153	73.56	6,925,894.68
NVR INC	247	7,700.93	1,902,129.71
PULTE GROUP INC	16,747	113.77	1,905,306.19
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	136.85	4,766,074.95
BOOKING HOLDINGS INC	2,642	5,668.04	14,974,961.68
CARNIVAL CORPORATION	86,858	28.83	2,504,116.14
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	110,522	55.94	6,182,600.68

DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	215.83	1,987,146.81
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	463.48	1,319,991.04
DOORDASH INC - A	28,203	246.06	6,939,630.18
DRAFTKINGS INC	32,654	42.80	1,397,591.20
EXPEDIA GROUP INC	9,628	176.09	1,695,394.52
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	14,432	286.33	4,132,314.56
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	272.53	5,351,126.55
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	147.13	557,181.31
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	49.61	1,516,329.65
MARRIOTT INTL A	18,223	279.19	5,087,679.37
MCDONALD'S CORP	58,306	293.02	17,084,824.12
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,538	333.57	6,850,860.66
STARBUCKS CORP	92,980	95.25	8,856,345.00
YUM BRANDS INC	22,162	150.85	3,343,137.70
ALPHABET INC-CL A	472,356	176.62	83,427,516.72
ALPHABET INC-CL C	400,632	177.66	71,176,281.12
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	403.56	2,902,403.52
COMCAST CORP-CL A	300,899	35.62	10,718,022.38
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	152.68	3,012,834.44
FOX CORP - CLASS A	20,639	55.21	1,139,479.19
FOX CORP- CLASS B	10,345	50.61	523,560.45
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,344	101.44	1,556,495.36
LIVE NATION ENTERTAINMENT	14,157	143.56	2,032,378.92
META PLATFORMS INC-CLASS A	177,381	732.78	129,981,249.18
NETFLIX INC	34,640	1,288.28	44,626,019.20
NEWS CORP-CLASS A	33,479	29.39	983,947.81
OMNICOM GROUP	17,139	72.50	1,242,577.50
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	35.89	1,642,577.63
REDDIT INC-CL A	5,311	145.65	773,547.15
ROBLOX CORP -CLASS A	45,835	106.68	4,889,677.80
SEA LTD-ADR	30,978	152.74	4,731,579.72
SNAP INC - A	69,220	9.12	631,286.40
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	12,442	722.12	8,984,617.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	14,644	242.23	3,547,216.12
THE WALT DISNEY CO	146,591	120.61	17,680,340.51
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,780	75.63	2,781,671.40
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	11.49	2,038,475.37
AMAZON.COM	773,449	222.54	172,123,340.46
AUTOZONE INC	1,387	3,742.18	5,190,403.66
BEST BUY COMPANY INC	15,285	72.46	1,107,551.10
BURLINGTON STORES INC	5,108	253.36	1,294,162.88
CARVANA CO	9,400	351.09	3,300,246.00

DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	210.31	1,041,034.50
EBAY	36,732	76.32	2,803,386.24
GENUINE PARTS CO	12,631	125.25	1,582,032.75
HOME DEPOT	80,488	371.04	29,864,267.52
LKQ CORP	19,286	38.85	749,261.10
LOWES COMPANIES	46,040	225.57	10,385,242.80
MERCADOLIBRE INC	3,728	2,477.08	9,234,554.24
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	68,700	92.58	6,360,246.00
POOL CORP	2,664	308.46	821,737.44
ROSS STORES INC	27,919	131.21	3,663,251.99
TJX COMPANIES INC	91,893	125.45	11,527,976.85
TRACTOR SUPPLY COMPANY	39,591	57.21	2,265,001.11
ULTA BEAUTY INC	3,920	475.57	1,864,234.40
WILLIAMS-SONOMA INC	10,460	173.73	1,817,215.80
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.33	558,250.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,929	982.09	35,285,511.61
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	112.35	1,829,844.45
DOLLAR TREE INC	16,318	104.75	1,709,310.50
KROGER CO	50,844	70.26	3,572,299.44
SYSCO CORP	40,090	76.33	3,060,069.70
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,356	102.43	3,826,375.08
WALMART INC	357,062	96.81	34,567,172.22
ALTRIA GROUP INC	133,908	57.75	7,733,187.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	54.00	2,193,372.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	28.32	398,802.24
BUNGE GLOBAL SA	11,604	75.64	877,726.56
COCA-COLA CO	331,077	69.48	23,003,229.96
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	20,741	95.86	1,988,232.26
CONAGRA BRANDS INC	33,324	20.38	679,143.12
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	169.04	2,218,819.04
GENERAL MILLS INC	43,531	51.20	2,228,787.20
HERSHEY FOODS CORPORATION	13,329	161.95	2,158,631.55
HORMEL FOODS CORP	23,338	31.27	729,779.26
JM SMUCKER CO	7,850	104.17	817,734.50
KELLANOVA	23,448	79.22	1,857,550.56
KEURIG DR PEPPER INC	104,376	33.65	3,512,252.40
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	26.45	1,824,097.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	22,741	72.21	1,642,127.61
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	49.55	726,848.95
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,013	66.85	7,020,119.05
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	59.57	3,475,790.36
PEPSICO INC	111,834	134.48	15,039,436.32

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	126,044	177.98	22,433,311.12
THE CAMPBELL'S COMPANY	15,869	30.74	487,813.06
TYSON FOODS INC	23,306	55.08	1,283,694.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	98.39	1,903,452.94
CLOROX COMPANY	9,570	126.00	1,205,820.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	91.58	5,672,282.04
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	86.61	1,628,268.00
KENVUE INC	164,183	20.76	3,408,439.08
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	131.49	3,534,056.73
PROCTER & GAMBLE CO	189,886	157.52	29,910,842.72
ABBOTT LABORATORIES	141,028	133.22	18,787,750.16
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	200.48	1,053,121.44
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	29.81	1,239,380.56
BECTON DICKINSON & CO	23,549	175.50	4,132,849.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	120,350	102.96	12,391,236.00
CARDINAL HEALTH	19,151	164.26	3,145,743.26
CENCORA INC	14,918	300.16	4,477,786.88
CENTENE CORP	40,934	33.09	1,354,506.06
COOPER COS INC/THE	16,443	74.95	1,232,402.85
CVS HEALTH CORP	105,311	66.66	7,020,031.26
DAVITA INC	2,586	141.84	366,798.24
DEXCOM INC	33,277	84.87	2,824,218.99
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	49,293	77.19	3,804,926.67
ELEVANCE HEALTH INC	18,351	346.36	6,356,052.36
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	36,836	75.51	2,781,486.36
HCA HEALTHCARE INC	15,457	378.44	5,849,547.08
HOLOGIC INC	18,875	65.85	1,242,918.75
HUMANA INC	9,955	236.70	2,356,348.50
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	540.64	3,592,012.16
INSULET CORP	5,246	297.46	1,560,475.16
INTUITIVE SURGICAL INC	29,120	528.13	15,379,145.60
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	259.07	1,696,390.36
MCKESSON CORP	10,179	727.23	7,402,474.17
MEDTRONIC PLC	102,632	89.00	9,134,248.00
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	237.22	1,078,164.90
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	173.62	1,506,847.98
RESMED INC	12,254	255.98	3,136,778.92
SOLVENTUM CORP	10,915	74.19	809,783.85
STERIS PLC	8,172	231.28	1,890,020.16
STRYKER CORP	27,317	392.05	10,709,629.85
THE CIGNA GROUP	21,912	309.78	6,787,899.36
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,327	302.91	22,514,391.57

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	182.56	852,920.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	284.36	3,551,940.76
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	95.20	1,452,180.80
ABBVIE INC	143,252	190.62	27,306,696.24
AGILENT TECHNOLOGIES	21,530	121.30	2,611,589.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,039	320.87	3,542,083.93
AMGEN	42,902	296.52	12,721,301.04
AVANTOR INC	49,647	13.57	673,709.79
BIOGEN INC	12,520	133.02	1,665,410.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	59.67	882,101.61
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	162,165	47.66	7,728,783.90
DANAHER CORP	52,038	200.96	10,457,556.48
ELI LILLY & CO	65,253	786.92	51,348,890.76
GILEAD SCIENCES INC	101,404	113.24	11,482,988.96
ILLUMINA INC	13,628	97.44	1,327,912.32
INCYTE CORP	11,198	68.72	769,526.56
IQVIA HOLDINGS INC	13,493	162.02	2,186,135.86
JOHNSON & JOHNSON	195,149	156.28	30,497,885.72
MERCK & CO	205,386	83.71	17,192,862.06
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,218.65	1,982,743.55
NATERA INC	10,084	161.75	1,631,087.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,925	133.51	1,191,576.75
PFIZER	465,817	25.56	11,906,282.52
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,604	552.58	4,754,398.32
REVVITY INC	8,524	100.13	853,508.12
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	35.87	1,079,077.21
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	16.71	1,539,676.11
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,201	419.88	12,680,795.88
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	300.56	1,087,426.08
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,565	478.96	9,849,915.22
WATERS CORP	4,749	349.21	1,658,398.29
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	226.18	1,304,380.06
ZOETIS INC	35,994	158.27	5,696,770.38
BANK OF AMERICA CORP	585,035	46.84	27,403,039.40
CITIGROUP	152,078	85.79	13,046,771.62
CITIZENS FINANCIAL GROUP	32,562	47.38	1,542,787.56
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	43.43	2,363,460.60
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	2,097.23	1,606,478.18
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	17.42	1,987,831.04
JPMORGAN CHASE & CO	226,428	283.16	64,115,352.48
KEY CORP	71,223	18.46	1,314,776.58
M & T BANK CORP	13,791	200.38	2,763,440.58

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	196.14	6,184,882.62
REGIONS FINL CORP	70,810	24.63	1,744,050.30
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	45.16	4,802,404.72
US BANCORP	124,604	47.30	5,893,769.20
WELLS FARGO & CO	265,348	81.79	21,702,812.92
AMERICAN EXPRESS	45,083	317.35	14,307,090.05
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	539.47	4,216,497.52
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	32,488	146.65	4,764,365.20
ARES MANAGEMENT CORP - A	17,123	176.97	3,030,257.31
BANK NEW YORK CO	56,752	93.05	5,280,773.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	108,505	478.91	51,964,129.55
BLACKROCK INC	12,032	1,088.75	13,099,840.00
BLACKSTONE INC	60,460	158.68	9,593,792.80
BLOCK INC	42,921	69.01	2,961,978.21
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51,334	218.03	11,192,352.02
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	56.87	891,096.03
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	232.06	2,042,824.18
CME GROUP INC	29,582	275.64	8,153,982.48
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	15,866	373.85	5,931,504.10
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	34.23	658,893.27
CORPAY INC	4,988	331.19	1,651,975.72
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	53.18	1,488,135.94
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	447.81	1,409,705.88
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	41,835	80.02	3,347,636.70
FISERV INC	44,901	170.95	7,675,825.95
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	142.40	614,598.40
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	80.65	1,673,406.85
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,124	696.56	17,500,373.44
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	35,016	57.84	2,025,325.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,196	182.16	8,415,063.36
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	179.76	937,088.88
KKR & CO INC	50,197	139.22	6,988,426.34
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,365	380.90	2,424,428.50
MASTERCARD INC-CLASS A	65,950	565.11	37,269,004.50
MOODY'S CORP	13,270	502.22	6,664,459.40
MORGAN STANLEY	97,076	141.55	13,741,107.80
MSCI INC	5,981	581.81	3,479,805.61
NASDAQ INC	34,296	89.83	3,080,809.68
NORTHERN TRUST CORP	15,902	127.00	2,019,554.00
PAYPAL HOLDINGS INC	75,007	74.83	5,612,773.81
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	101.45	1,853,998.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	158.66	2,457,008.76

ROBINHOOD MARKETS INC - A	59,215	94.54	5,598,186.10
S&P GLOBAL INC	25,389	528.73	13,423,925.97
SCHWAB (CHARLES) CORP	137,842	92.32	12,725,573.44
STATE STREET CORP	22,335	109.40	2,443,449.00
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	70.16	2,048,391.36
TOAST INC-CLASS A	40,481	44.64	1,807,071.84
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	136.62	1,237,913.82
VISA INC-CLASS A SHARES	139,558	357.76	49,928,270.08
AFLAC	43,196	101.91	4,402,104.36
ALLSTATE CORP	20,722	194.09	4,021,932.98
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	126.22	797,584.18
AMERICAN INT'L GROUP	46,081	83.07	3,827,948.67
AON PLC	16,320	356.92	5,824,934.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	87.92	2,614,477.04
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,082	315.25	6,646,100.50
BROWN & BROWN INC	23,755	108.13	2,568,628.15
CHUBB LTD	31,288	280.00	8,760,640.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,094	146.71	2,067,730.74
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	344.48	746,143.68
EVEREST GROUP LTD	3,288	340.19	1,118,544.72
FNF GROUP	20,461	55.12	1,127,810.32
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	22,068	121.87	2,689,427.16
LOEWS CORP	16,402	90.97	1,492,089.94
MARKEL GROUP INC	1,007	1,997.85	2,011,834.95
MARSH & MCLENNAN COS	40,107	214.17	8,589,716.19
METLIFE INC	45,055	78.24	3,525,103.20
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	80.86	1,498,820.96
PROGRESSIVE CORP	47,984	250.41	12,015,673.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,466	106.60	3,141,075.60
TRAVELERS COS INC/THE	18,877	255.32	4,819,675.64
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	308.51	2,386,941.87
WR BERKLEY CORP	22,485	69.75	1,568,328.75
WEYERHAEUSER CO	63,311	26.15	1,655,582.65
ACCENTURE PLC-CL A	50,746	297.40	15,091,860.40
ADOBE INC	34,754	373.38	12,976,448.52
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	80.63	925,954.92
ANSYS INC	6,794	366.87	2,492,514.78
APPLOVIN CORP-CLASS A	18,783	352.74	6,625,515.42
ATLASSIAN CORP-CL A	13,277	220.89	2,932,756.53
AUTODESK INC	17,030	307.27	5,232,808.10
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	56.02	829,824.26
CADENCE DESIGN SYSTEMS	22,421	322.91	7,239,965.11

CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	231.23	1,632,021.34
CLOUDFLARE INC - CLASS A	25,155	193.49	4,867,240.95
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,121	79.95	3,367,573.95
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19,805	513.51	10,170,065.55
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,148	405.31	1,681,225.88
DATADOG INC - CLASS A	23,325	142.75	3,329,643.75
DOCUSIGN INC	14,969	79.58	1,191,233.02
DYNATRACE INC	22,028	56.19	1,237,753.32
FAIR ISAAC CORP	2,084	1,591.73	3,317,165.32
FORTINET INC	53,845	107.65	5,796,414.25
GARTNER INC	6,665	394.44	2,628,942.60
GEN DIGITAL INC	43,555	30.16	1,313,618.80
GODADDY INC - CLASS A	11,388	175.13	1,994,380.44
HUBSPOT INC	4,107	560.55	2,302,178.85
INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,090	290.14	21,786,612.60
INTUIT INC	22,648	769.59	17,429,674.32
MICROSOFT CORP	571,903	503.51	287,958,879.53
MICROSTRATEGY INC-CL A	20,042	415.41	8,325,647.22
MONDAY.COM LTD	2,838	309.62	878,701.56
MONGODB INC	6,399	217.12	1,389,350.88
NUTANIX INC - A	20,171	76.55	1,544,090.05
OKTA INC	14,591	99.15	1,446,697.65
ORACLE CORP	136,252	235.81	32,129,584.12
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	173,464	143.13	24,827,902.32
PALO ALTO NETWORKS INC	54,625	206.06	11,256,027.50
PTC INC	9,741	210.47	2,050,188.27
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	558.64	4,723,859.84
SALESFORCE INC	77,822	270.92	21,083,536.24
SAMSARA INC-CL A	19,395	39.28	761,835.60
SERVICENOW INC	16,763	1,013.71	16,992,820.73
SNOWFLAKE INC	25,703	221.90	5,703,495.70
SYNOPSYS INC	12,529	550.95	6,902,852.55
TWILIO INC - A	12,842	121.49	1,560,174.58
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	578.98	1,933,214.22
VERISIGN INC	6,723	289.76	1,948,056.48
WIX.COM LTD	3,465	158.00	547,470.00
WORKDAY INC-CLASS A	17,601	240.17	4,227,232.17
ZOOM COMMUNICATIONS INC	20,869	77.38	1,614,843.22
ZSCALER INC	8,789	316.50	2,781,718.50
AMPHENOL CORPORATION	96,707	98.21	9,497,594.47
APPLE INC	1,216,486	211.14	256,848,854.04
ARISTA NETWORKS INC	85,964	106.28	9,136,253.92

CDW CORP/DE	11,273	180.75	2,037,594.75
CISCO SYSTEMS	322,162	69.27	22,316,161.74
CORNING	66,604	52.57	3,501,372.28
DELL TECHNOLOGIES -C	25,710	126.63	3,255,657.30
F5 INC	4,851	302.28	1,466,360.28
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	112,780	20.80	2,345,824.00
HP INC	77,024	25.62	1,973,354.88
JABIL INC	9,340	221.26	2,066,568.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	163.90	2,268,048.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	417.88	5,498,882.92
NETAPP INC	15,047	106.67	1,605,063.49
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	58.21	1,389,763.75
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,836	142.01	2,532,890.36
SUPER MICRO COMPUTER INC	42,160	50.02	2,108,843.20
TE CONNECTIVITY PLC	23,252	172.65	4,014,457.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,444	519.86	1,790,397.84
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	79.62	1,410,707.16
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	64.64	1,667,065.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	321.78	1,339,248.36
AT&T INC	583,361	28.10	16,392,444.10
T-MOBILE US INC	36,984	232.31	8,591,753.04
VERIZON COMMUNICATIONS	342,893	42.61	14,610,670.73
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	61.72	1,282,418.16
AMEREN CORPORATION	20,898	95.20	1,989,489.60
AMERICAN ELECTRIC POWER	45,027	104.74	4,716,127.98
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,116	141.80	2,427,048.80
ATMOS ENERGY CORP	11,814	153.10	1,808,723.40
CENTERPOINT ENERGY INC	57,629	36.07	2,078,678.03
CMS ENERGY CORP	23,697	69.76	1,653,102.72
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	99.97	2,766,669.75
CONSTELLATION ENERGY	25,537	317.11	8,098,038.07
DOMINION ENERGY INC	71,304	57.15	4,075,023.60
DTE ENERGY COMPANY	15,851	131.42	2,083,138.42
DUKE ENERGY CORP	63,733	117.17	7,467,595.61
EDISON INTL	30,900	50.63	1,564,467.00
ENERGY CORP	37,180	81.46	3,028,682.80
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.35	761,902.65
EVERGY INC	18,475	68.81	1,271,264.75
EVERSOURCE ENERGY	27,450	65.11	1,787,269.50
EXELON CORP	81,573	43.14	3,519,059.22
FIRSTENERGY CORP	47,081	40.15	1,890,302.15
NEXTERA ENERGY INC	164,785	73.65	12,136,415.25

	NISOURCE INC	40,714	39.34	1,601,688.76	
	NRG ENERGY INC	17,078	150.27	2,566,311.06	
	PG&E CORP	189,959	13.52	2,568,245.68	
	PPL CORPORATION	58,459	33.76	1,973,575.84	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	81.57	3,284,497.62	
	SEMPRA	54,659	74.49	4,071,548.91	
	SOUTHERN CO	87,096	91.96	8,009,348.16	
	VISTRA CORP	26,531	197.01	5,226,872.31	
	WEC ENERGY GROUP INC	26,668	104.22	2,779,338.96	
	XCEL ENERGY INC	46,610	67.84	3,162,022.40	
	ADVANCED MICRO DEVICES	131,563	138.41	18,209,634.83	
	ANALOG DEVICES	39,357	242.72	9,552,731.04	
	APPLIED MATERIALS	67,001	195.39	13,091,325.39	
	BROADCOM INC	361,725	277.90	100,523,377.50	
	ENTEGRIS INC	12,389	86.99	1,077,719.11	
	FIRST SOLAR INC	7,921	165.99	1,314,806.79	
	INTEL CORP	344,792	23.44	8,081,924.48	
	KLA CORP	10,710	923.18	9,887,257.80	
	LAM RESEARCH CORP	102,391	99.81	10,219,645.71	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,769	72.26	5,113,767.94	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,977	74.68	3,358,882.36	
	MICRON TECHNOLOGY	92,752	122.24	11,338,004.48	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	751.14	2,937,708.54	
	NVIDIA CORP	1,975,909	162.88	321,836,057.92	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,641	230.42	4,756,099.22	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	36,454	57.77	2,105,947.58	
	QUALCOMM	88,396	159.35	14,085,902.60	
	TERADYNE INC	12,318	92.78	1,142,864.04	
	TEXAS INSTRUMENTS	74,759	216.39	16,177,100.01	
	CBRE GROUP INC-A	23,219	139.75	3,244,855.25	
	COSTAR GROUP INC	33,027	84.50	2,790,781.50	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	6.25	616,875.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	75.51	891,697.59	
	アメリカドル 小計	29,414,051		4,363,251,235.01 (636,554,722,675)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	40,448	27.93	1,129,712.64	
	CAMECO CORP	37,878	97.95	3,710,150.10	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	163,918	43.78	7,176,330.04	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	19.81	2,204,714.33	
	ENBRIDGE	175,303	59.95	10,509,414.85	
	IMPERIAL OIL	16,202	109.39	1,772,336.78	
	KEYERA CORP	18,607	42.10	783,354.70	

PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	49.91	2,292,915.31
SUNCOR ENERGY	98,973	53.71	5,315,839.83
TC ENERGY CORP	82,559	63.77	5,264,787.43
TOURMALINE OIL CORP	25,009	63.25	1,581,819.25
WHITECAP RESOURCES INC	98,000	9.43	924,140.00
AGNICO EAGLE MINES	40,306	161.06	6,491,684.36
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	34,053	36.25	1,234,421.25
BARRICK MINING CORP	133,727	28.59	3,823,254.93
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	80.05	746,226.10
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	23.58	1,538,995.86
FRANCO-NEVADA CORP	15,641	217.89	3,408,017.49
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	10.70	554,762.90
KINROSS GOLD CORP	108,451	20.98	2,275,301.98
LUNDIN GOLD INC	8,772	71.65	628,513.80
LUNDIN MINING CORP	54,579	14.11	770,109.69
NUTRIEN LTD	37,152	85.04	3,159,406.08
PAN AMERICAN SILVER CORP	37,635	39.45	1,484,700.75
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	52.61	1,861,657.46
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	103.60	363,118.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	121.60	4,498,105.60
CAE INC	25,999	40.45	1,051,659.55
STANTEC INC	9,001	150.43	1,354,020.43
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	126.26	658,193.38
WSP GLOBAL INC	9,951	280.34	2,789,663.34
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	34.58	1,126,581.82
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	20,393	64.89	1,323,301.77
RB GLOBAL INC	14,445	144.88	2,092,791.60
THOMSON REUTERS CORP	13,471	273.73	3,687,416.83
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	143.42	6,057,630.54
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	78,202	111.45	8,715,612.90
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	127.93	746,727.41
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	57.78	1,170,276.12
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	69.16	679,151.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	92.00	2,122,716.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	189.05	853,182.65
DOLLARAMA INC	22,000	192.21	4,228,620.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,541	69.41	4,410,380.81
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	56.60	392,238.00
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	225.66	2,913,947.58
METRO INC	18,840	105.92	1,995,532.80
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	270.73	1,414,834.98
SAPUTO INC	20,898	27.87	582,427.26

	BANK MONTREAL	59,527	154.75	9,211,803.25	
	BANK NOVA SCOTIA	104,510	75.02	7,840,340.20	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	77,158	99.56	7,681,850.48	
	NATIONAL BANK OF CANADA	31,446	141.27	4,442,376.42	
	ROYAL BANK OF CANADA	115,208	181.29	20,886,058.32	
	TORONTO-DOMINION BANK	142,581	101.44	14,463,416.64	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	35,600	76.48	2,722,688.00	
	BROOKFIELD CORP	111,490	85.61	9,544,658.90	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	42.50	326,612.50	
	TMX GROUP LTD	23,425	55.17	1,292,357.25	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,542	2,459.09	3,791,916.78	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	51.46	1,224,130.48	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	144.15	1,005,734.55	
	INTACT FINANCIAL CORP	14,911	308.81	4,604,665.91	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	139,940	41.73	5,839,696.20	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	52.58	2,291,278.66	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	84.30	3,676,660.20	
	CGI INC - CL A	16,084	140.70	2,263,018.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,662	4,956.28	8,237,337.36	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	140.78	983,207.52	
	OPEN TEXT CORP	20,463	39.50	808,288.50	
	SHOPIFY INC - CLASS A	98,618	156.49	15,432,730.82	
	CELESTICA INC	9,356	220.31	2,061,220.36	
	BCE INC	6,203	32.60	202,217.80	
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	41.48	630,496.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	44.00	1,226,764.00	
	TELUS CORP	32,908	22.65	745,366.20	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	38.53	939,939.35	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	11,295	46.00	519,570.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	37.86	390,866.64	
	EMERA INC	25,484	62.38	1,589,691.92	
	FORTIS INC	37,737	64.09	2,418,564.33	
	HYDRO ONE LTD	29,579	49.07	1,451,441.53	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	243.29	654,450.10	
	カナダドル 小計	3,411,943		267,272,114.45 (28,509,916,448)	
ユーロ	ENI	191,928	14.25	2,735,741.71	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	16.52	655,414.55	
	NESTE OIL OYJ	32,766	12.29	402,857.97	
	OMV AG	12,549	46.80	587,293.20	
	REPSOL SA	89,536	12.78	1,144,270.08	
	TENARIS SA	40,648	16.51	671,301.72	

TOTALENERGIES SE	172,328	53.28	9,181,635.84
AIR LIQUIDE	46,418	176.92	8,212,272.56
AKZO NOBEL	12,357	60.60	748,834.20
ARCELORMITTAL	43,717	28.59	1,249,869.03
ARKEMA	4,369	64.70	282,674.30
BASF SE	70,406	43.52	3,064,069.12
COVESTRO AG-TEND	14,454	60.40	873,021.60
DSM-FIRMENICH AG	16,194	90.04	1,458,107.76
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.79	285,298.23
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	204.90	2,205,748.50
STORA ENSO OYJ R	42,169	9.26	390,569.27
SYENSQO SA	5,356	69.16	370,420.96
SYMRISE AG	10,018	90.76	909,233.68
UPM KYMMENE OYJ	42,324	23.88	1,010,697.12
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	12,228	56.70	693,327.60
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	12,228	1.61	19,696.86
AIRBUS SE	49,913	182.36	9,102,134.68
ALSTOM	24,388	20.18	492,149.84
BOUYGUES ORD	16,606	39.35	653,446.10
BRENTAG SE	9,500	56.92	540,740.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	41.92	1,646,533.76
DASSAULT AVIATION SA	1,214	294.80	357,887.20
EIFFAGE	5,924	118.95	704,659.80
FERROVIAL SE	43,886	44.99	1,974,431.14
GEA GROUP AG	13,382	59.10	790,876.20
IMCD NV	4,641	112.90	523,968.90
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	72.20	895,135.60
KNORR-BREMSE AG	5,022	84.75	425,614.50
KONE OYJ-B	26,369	54.80	1,445,021.20
LEGRAND SA	22,132	113.75	2,517,515.00
LEONARDO SPA	31,340	46.95	1,471,413.00
METSO CORPORATION	51,970	11.41	593,237.55
MTU AERO ENGINES AG	3,962	384.00	1,521,408.00
PRYSMIAN SPA	21,155	61.12	1,292,993.60
RATIONAL AG	483	726.00	350,658.00
REXEL SA	17,411	26.26	457,212.86
RHEINMETALL AG	3,572	1,860.50	6,645,706.00
SAFRAN SA	29,570	279.60	8,267,772.00
SAINT-GOBAIN	36,177	101.55	3,673,774.35
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,466	227.70	9,897,208.20
SIEMENS	61,849	225.50	13,946,949.50
SIEMENS ENERGY AG	55,019	92.40	5,083,755.60

THALES SA	7,942	247.90	1,968,821.80
VINCI S.A.	39,327	127.05	4,996,495.35
WARTSILA OYJ	41,917	19.84	831,633.28
BUREAU VERITAS SA	25,073	27.90	699,536.70
RANDSTAD NV	10,680	41.38	441,938.40
TELEPERFORMANCE	4,734	88.76	420,189.84
WOLTERS KLUWER	19,155	138.85	2,659,671.75
ADP	2,382	105.70	251,777.40
AENA SME SA	55,720	23.43	1,305,798.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.41	336,173.00
DHL GROUP	82,402	39.89	3,287,015.78
GETLINK	21,115	16.11	340,162.65
INPOST SA	15,470	13.21	204,358.70
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	100,647	4.20	422,818.04
RYANAIR HOLDINGS PLC	80,416	24.34	1,957,325.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	82.00	2,018,594.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	75.70	377,818.70
CONTINENTAL AG	8,168	77.58	633,673.44
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	43.21	443,075.34
FERRARI NV	10,026	418.00	4,190,868.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	58,663	52.26	3,065,728.38
MICHELIN	57,385	32.22	1,848,944.70
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	34.06	400,034.70
RENAULT SA	17,081	41.18	703,395.58
STELLANTIS NV	166,407	8.70	1,448,739.34
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	92.68	1,420,599.04
ADIDAS AG	14,066	212.30	2,986,211.80
HERMES INTERNATIONAL	2,556	2,434.00	6,221,304.00
KERING	5,534	199.80	1,105,693.20
LVMH	21,802	487.85	10,636,105.70
MONCLER SPA	18,908	51.26	969,224.08
ACCOR	14,436	47.55	686,431.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	71.24	2,619,637.28
DELIVERY HERO SE	13,414	25.18	337,764.52
FDJ UNITED	8,108	30.26	245,348.08
SODEXO	6,173	52.00	320,996.00
BOLLORE SE	81,810	5.31	434,411.10
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	106.50	514,075.50
PUBLICIS GROUPE	17,217	88.84	1,529,558.28
SCOUT24 SE	7,536	119.80	902,812.80
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	89,096	26.73	2,381,536.08
D' IETEREN GROUP	2,217	186.40	413,248.80

INDITEX	87,257	43.53	3,798,297.21
PROSUS	105,994	47.59	5,044,254.46
ZALANDO SE	17,664	28.91	510,666.24
CARREFOUR	39,746	12.47	495,632.62
JERONIMO MARTINS	21,861	22.76	497,556.36
KESKO OYJ-B SHS	20,083	20.92	420,136.36
KONINKLIJKE AHOLD NV	71,081	35.19	2,501,340.39
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	80,045	57.66	4,615,394.70
DANONE (GROUPE)	51,810	67.94	3,519,971.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	78,177	6.09	476,566.99
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	64.15	610,194.80
HEINEKEN NV	23,160	75.04	1,737,926.40
JDE PEET'S BV	7,000	24.42	170,940.00
KERRY GROUP PLC-A	13,413	90.85	1,218,571.05
LOTUS BAKERIES	38	7,900.00	300,200.00
PERNOD-RICARD	15,339	92.68	1,421,618.52
BEIERSDORF AG	7,430	109.30	812,099.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	62.35	547,433.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,575	67.94	786,405.50
LOREAL	19,298	374.35	7,224,206.30
BIOMERIEUX	3,044	119.70	364,366.80
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	89.82	185,927.40
ESSILORLUXOTTICA	23,609	252.90	5,970,716.10
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	46.85	795,747.25
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	42.28	1,424,370.92
KONINKLIJKE PHILIPS	69,465	20.53	1,426,116.45
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,637	47.40	1,357,393.80
ARGENX SE	4,935	465.00	2,294,775.00
BAYER	78,462	27.33	2,144,366.46
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	59.70	610,134.00
GRIFOLS SA	27,685	11.36	314,501.60
IPSEN	3,532	104.80	370,153.60
MERCK KGAA	10,703	111.30	1,191,243.90
ORION OYJ-CLASS B	10,139	65.65	665,625.35
QIAGEN N.V.	16,066	40.65	653,163.23
RECORDATI SPA	11,597	53.90	625,078.30
SANOFI	90,135	83.32	7,510,048.20
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	218.10	397,814.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	200.40	517,432.80
UCB (GROUPE)	9,389	170.30	1,598,946.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	45,808	24.72	1,132,373.76
AIB GROUP PLC	150,470	7.02	1,056,299.40

BANCO BILBAO VIZCAYA	479,190	13.60	6,516,984.00
BANCO BPM SPA	84,059	10.73	901,953.07
BANCO DE SABADELL SA	420,800	3.04	1,282,177.60
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	7.55	9,233,884.05
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	12.50	1,105,166.89
BANKINTER SA	51,888	11.61	602,419.68
BNP PARIBAS	81,615	78.87	6,436,975.05
BPER BANCA SPA	79,669	7.68	612,495.27
CAIXABANK	330,541	7.77	2,570,286.81
COMMERZBANK AG	69,006	30.08	2,075,700.48
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	16.40	1,429,456.80
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	74.50	1,890,512.00
FINECOBANK SPA	41,585	18.95	788,035.75
ING GROEP NV-CVA	256,546	19.79	5,078,584.61
INTESA SANPAOLO	1,198,681	5.06	6,074,915.30
KBC GROEP NV	18,057	91.12	1,645,353.84
MEDIOBANCA	33,860	18.90	639,954.00
NORDEA BANK ABP	247,239	12.93	3,198,036.46
SOCIETE GENERALE	61,760	52.00	3,211,520.00
UNICREDIT SPA	115,475	61.12	7,057,832.00
ADYEN NV	2,044	1,575.60	3,220,526.40
AMUNDI SA	4,626	70.00	323,820.00
BANCA MEDIOLANUM SPA	22,661	14.88	337,195.68
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	15,281	17.30	264,361.30
DEUTSCHE BANK NAMEN	156,236	25.83	4,035,575.88
DEUTSCHE BOERSE	15,743	271.80	4,278,947.40
EDENRED	20,131	27.37	550,985.47
EURAZEO SA	3,357	60.05	201,587.85
EURONEXT NV	6,480	148.20	960,336.00
EXOR NV	7,825	88.55	692,903.75
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,138	73.10	667,987.80
NEXI SPA	48,458	5.25	254,404.50
SOFINA	1,238	264.20	327,079.60
AEGON LTD	101,846	6.06	617,797.83
AGEAS	11,086	56.75	629,130.50
ALLIANZ SE-REG	31,353	356.20	11,167,938.60
ASR NEDERLAND NV	11,959	56.74	678,553.66
AXA SA	146,148	42.05	6,145,523.40
GENERALI	72,151	31.27	2,256,161.77
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	268.40	1,195,722.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,616	576.80	6,123,308.80
NN GROUP NV	22,941	56.34	1,292,495.94

POSTE ITALIANE SPA	42,677	18.13	773,734.01
SAMPO OYJ-A SHS	201,580	9.25	1,865,421.32
TALANX AG	5,053	112.70	569,473.10
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	31,592	16.62	525,217.00
CAPGEMINI SA	12,235	145.25	1,777,133.75
DASSAULT SYSTEMES SA	49,764	31.69	1,577,021.16
NEMETSCHKE SE	5,455	129.30	705,331.50
SAP SE	84,562	265.50	22,451,211.00
NOKIA OYJ	479,272	4.34	2,080,040.48
CELLNEX TELECOM SA	42,906	32.35	1,388,009.10
DEUTSCHE TELEKOM	286,677	31.12	8,921,388.24
ELISA A	10,227	46.92	479,850.84
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	10.29	312,558.75
KPN (KON.)	290,883	4.08	1,188,257.05
ORANGE	153,281	13.10	2,008,747.50
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.41	357,560.30
TELEFONICA	297,657	4.51	1,344,814.32
ACCIONA SA	2,181	154.70	337,400.70
E.ON SE	193,108	16.05	3,100,348.94
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	10.25	222,958.00
EDP SA	235,657	3.82	901,623.68
ELIA GROUP SA/NV	3,975	97.65	388,158.75
ENDESA	25,972	26.51	688,517.72
ENEL	640,374	8.11	5,199,196.50
ENGIE	146,393	19.78	2,895,653.54
FORTUM OYJ	32,550	15.46	503,385.75
IBERDROLA SA	468,801	15.65	7,339,079.65
IBERDROLA SA-RTS	468,801	0.40	187,520.40
REDEIA CORP SA	30,678	17.67	542,080.26
RWE STAMM	52,507	36.17	1,899,178.19
SNAM SPA	147,559	5.01	739,565.70
TERNA SPA	95,819	8.47	811,586.93
VEOLIA ENVIRONNEMENT	59,881	30.61	1,832,957.41
VERBUND AG	6,430	63.95	411,198.50
ASM INTERNATIONAL NV	3,856	515.20	1,986,611.20
ASML HOLDING NV	31,892	679.80	21,680,181.60
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	121.95	775,236.15
INFINEON TECHNOLOGIES	105,817	37.91	4,011,522.47
STMICROELECTRONICS NV	50,286	27.09	1,362,247.74
LEG IMMOBILIEN SE	5,275	72.15	380,591.25
VONOVIA SE	61,810	28.60	1,767,766.00
	15,685,023		467,585,035.97

ユーロ 小計				(80,064,585,709)
イギリスポンド	BP PLC	1,260,858	3.84	4,847,999.01
	SHELL PLC-NEW	485,509	26.27	12,754,321.43
	ANGLO AMERICAN PLC	89,631	21.70	1,944,992.70
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	18.64	556,515.84
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	30.06	328,375.44
	GLENCORE PLC	854,615	2.98	2,548,461.93
	MONDI PLC	37,918	11.86	449,897.07
	RIO TINTO PLC REG	93,321	42.76	3,990,872.56
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	47.40	1,579,225.80
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	18.76	4,504,481.95
	BUNZL PLC	29,337	23.06	676,511.22
	DCC PLC	6,622	47.66	315,604.52
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.32	538,139.35
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	686,376	9.84	6,756,685.34
	SMITHS GROUP PLC	26,476	22.64	599,416.64
	SPIRAX GROUP PLC	5,514	61.90	341,316.60
	EXPERIAN PLC	70,884	38.75	2,746,755.00
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	48.34	671,442.60
	RELX PLC	146,201	39.35	5,753,009.35
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	3.35	609,507.56
	BARRATT REDROW PLC	118,831	4.23	503,249.28
	COMPASS GROUP PLC	142,673	25.10	3,581,092.30
	ENTAIN PLC	49,630	9.36	464,834.58
	INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	87.64	1,212,324.12
	PEARSON	55,305	10.50	580,702.50
	WHITBREAD PLC	17,434	29.82	519,881.88
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.12	588,536.36
	INFORMA PLC	110,598	8.23	910,442.73
	WPP PLC	85,821	4.28	367,828.80
	JD SPORTS FASHION PLC	206,825	0.89	184,074.25
	KINGFISHER PLC	153,717	2.83	436,095.12
	NEXT PLC	8,464	121.80	1,030,915.20
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	179,339	3.29	591,639.36
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.83	419,788.05	
TESCO PLC	525,585	4.02	2,116,530.79	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	20.56	529,214.40	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	35.99	5,685,700.20	
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	39.24	704,750.40	
DIAGEO	174,682	19.15	3,345,160.30	
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	28.68	1,963,949.04	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	50.30	2,848,036.30	

	UNILEVER PLC	207,200	44.45	9,210,040.00
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.15	764,834.25
	ASTRAZENECA	127,882	103.62	13,251,132.84
	GSK PLC	335,128	14.25	4,775,574.00
	HALEON PLC	789,439	3.67	2,898,820.00
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.73	353,364.30
	BARCLAYS	1,134,161	3.39	3,852,177.83
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,418,422	9.06	12,852,321.74
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.75	3,648,396.46
	NATWEST GROUP PLC	631,942	4.97	3,144,543.39
	STANDARD CHARTERED PLC	161,358	12.58	2,029,883.64
	3I GROUP PLC	75,987	41.76	3,173,217.12
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37,924	108.40	4,110,961.60
	M&G PLC	131,539	2.57	338,581.38
	SCHRODERS PLC	39,932	3.78	151,182.55
	WISE PLC - A	49,048	10.98	538,547.04
	ADMIRAL GROUP PLC	24,854	32.80	815,211.20
	AVIVA PLC	247,334	6.15	1,521,104.10
	LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.50	1,249,983.80
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	6.36	324,621.36
	PRUDENTIAL	212,226	9.12	1,936,350.02
	THE SAGE GROUP PLC	76,660	12.38	949,050.80
	HALMA PLC	31,069	32.14	998,557.66
	BT GROUP PLC	464,863	1.97	915,780.11
	VODAFONE GROUP PLC	1,570,550	0.80	1,264,920.97
	CENTRICA PLC	453,631	1.57	712,881.11
	NATIONAL GRID PLC	397,706	10.33	4,110,291.51
	SEVERN TRENT PLC	17,468	26.61	464,823.48
	SSE PLC	81,692	18.86	1,540,711.12
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.98	555,621.30
	イギリスポンド 小計	21,027,336		163,551,764.55 (32,471,567,333)
スイスフラン	AMRIZE LTD	42,259	39.98	1,689,726.11
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	614.50	352,723.00
	GIVAUDAN-REG	742	3,832.00	2,843,344.00
	HOLCIM LTD	42,259	62.56	2,643,723.04
	SIG GROUP AG	26,203	14.88	389,900.64
	SIKA AG-BR	12,257	206.70	2,533,521.90
	ABB LTD	131,508	47.25	6,213,753.00
	GEBERIT AG-REG	2,530	613.60	1,552,408.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	282.50	578,560.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	291.60	901,627.20

VAT GROUP AG	1,956	333.10	651,543.60
SGS SA	12,959	82.14	1,064,452.26
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	171.50	648,441.50
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	43,028	150.15	6,460,654.20
SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	133.65	331,852.95
AVOLTA AG	7,820	44.20	345,644.00
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	953.00	266,840.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	130,400.00	1,043,200.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	13,110.00	1,075,020.00
NESTLE SA - REGISTERED	212,167	78.06	16,561,756.02
ALCON INC	38,943	68.62	2,672,268.66
SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	231.20	898,674.40
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	105.80	903,532.00
GALDERMA GROUP AG	9,692	126.30	1,224,099.60
LONZA GROUP AG-REG	5,661	562.60	3,184,878.60
NOVARTIS	153,006	97.55	14,925,735.30
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	276.00	611,340.00
ROCHE HOLDING GENUSS	56,949	260.00	14,806,740.00
SANDOZ GROUP AG	38,109	44.30	1,688,228.70
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	95.85	238,378.95
JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	54.32	830,498.48
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,056.50	1,928,112.50
UBS GROUP AG	273,597	28.39	7,767,418.83
BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	195.40	833,185.60
HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	194.80	575,634.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,514	810.20	2,036,842.80
SWISS RE LTD	24,330	141.55	3,443,911.50
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,065	557.40	6,725,031.00
TEMENOS AG - REG	5,150	58.25	299,987.50
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	74.78	897,808.68
SWISSCOM	1,927	562.50	1,083,937.50
BKW AG	1,744	175.80	306,595.20
SWISS PRIME SITE-REG	5,679	115.50	655,924.50
スイスフラン 小計	1,230,870		116,687,455.72 (21,475,159,350)
スウェーデンク ローナ			
BOLIDEN AB	22,252	299.60	6,666,699.20
HOLMEN AB-B SHARES	5,383	374.20	2,014,318.60
SCA SV CELLULOSA B	59,490	123.45	7,344,040.50
ADDTECH AB-B SHARES	20,615	323.80	6,675,137.00
ALFA LAVAL AB	25,134	415.70	10,448,203.80
ASSA ABLOY AB-B	75,977	300.80	22,853,881.60
ATLAS COPCO A	207,097	160.00	33,135,520.00

ATLAS COPCO B	135,444	138.40	18,745,449.60	
BEIJER REF AB	52,981	154.85	8,204,107.85	
EPIROC AB-A	53,479	212.30	11,353,591.70	
EPIROC AB-B	28,804	185.70	5,348,902.80	
INDUTRADE AB	22,644	271.40	6,145,581.60	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	253.20	3,545,306.40	
LIFCO AB-B SHS	17,970	393.20	7,065,804.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	42.96	5,277,550.08	
SAAB AB-B	25,552	495.00	12,648,240.00	
SANDVIK AB	87,594	226.60	19,848,800.40	
SKANSKA B	25,507	223.30	5,695,713.10	
SKF AB-B	21,050	220.20	4,635,210.00	
TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	368.80	6,141,626.40	
VOLVO B	124,872	270.40	33,765,388.80	
SECURITAS B	29,769	143.80	4,280,782.20	
EVOLUTION AB	13,186	766.40	10,105,750.40	
HENNES & MAURITZ B	40,961	136.15	5,576,840.15	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	264.10	13,066,083.40	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	283.60	4,065,406.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	139,205	167.40	23,302,917.00	
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	127.60	15,405,913.60	
SWEDBANK AB-A	71,421	254.80	18,198,070.80	
EQT AB	31,471	328.90	10,350,811.90	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	360.20	4,256,843.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	360.50	4,026,064.00	
INVESTOR AB-B SHS	139,947	286.20	40,052,831.40	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	483.20	3,517,696.00	
ERICSSON (LM) B	214,689	78.08	16,762,917.12	
HEXAGON AB-B SHS	172,099	97.56	16,789,978.44	
TELE2 AB-B SHS	46,762	138.50	6,476,537.00	
TELIA CO AB	146,953	33.59	4,936,151.27	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	68.40	3,878,280.00	
SAGAX AB-B	17,402	214.20	3,727,508.40	
スウェーデンクローナ 小計	2,500,724		446,336,456.11 (6,851,264,601)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	29,320	263.40	7,722,888.00
	EQUINOR ASA	66,436	264.90	17,598,896.40
	NORSK HYDRO	100,517	60.08	6,039,061.36
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	390.40	4,879,219.20
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	39,970	324.50	12,970,265.00
	MOWI ASA	31,968	192.40	6,150,643.20
	ORKLA	73,335	106.80	7,832,178.00

	SALMAR ASA	5,423	424.80	2,303,690.40	
	DNB BANK ASA	71,795	281.80	20,231,831.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	260.00	4,829,240.00	
	TELENOR ASA	51,193	156.30	8,001,465.90	
	ノルウェークローネ 小計	501,029		98,559,378.46 (1,425,168,612)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	456.50	13,746,128.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	7,550	292.90	2,211,395.00	
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	83,415	107.35	8,954,600.25	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,340.00	2,702,460.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,480.00	3,818,880.00	
	DSV A/S	16,193	1,551.00	25,115,343.00	
	PANDORA A/S	6,512	1,076.50	7,010,168.00	
	CARLSBERG AS-B	6,817	905.60	6,173,475.20	
	COLOPLAST-B	9,737	602.80	5,869,463.60	
	DEMANT A/S	8,512	266.00	2,264,192.00	
	GENMAB A/S	4,878	1,371.50	6,690,177.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	254,057	443.05	112,559,953.85	
	DANSKE BANK A/S	53,617	263.00	14,101,271.00	
	TRYG A/S	29,772	161.50	4,808,178.00	
ORSTED A/S	11,780	279.40	3,291,332.00		
	デンマーククローネ 小計	523,477		219,317,016.90 (5,033,325,537)	
オーストラリアドル	SANTOS	292,069	7.73	2,257,693.37	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	159,719	24.00	3,833,256.00	
	BHP GROUP LTD	417,456	37.85	15,800,709.60	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	24.58	854,646.60	
	EVOLUTION MINING LTD	162,152	7.29	1,182,088.08	
	FORTESCUE LTD	137,312	16.20	2,224,454.40	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,778	42.47	1,689,371.66	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	107,682	16.37	1,762,754.34	
	RIO TINTO LTD	28,272	107.59	3,041,784.48	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.02	1,047,254.46	
	REECE LTD	16,814	13.95	234,555.30	
	SGH LTD	12,630	50.58	638,825.40	
	BRAMBLES LTD	108,007	23.14	2,499,281.98	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	39.77	1,764,833.52	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	10.83	920,550.00	
	TRANSURBAN GROUP	261,181	13.41	3,502,437.21	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	68.00	3,142,280.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.37	977,409.81	
CAR GROUP LTD	29,334	37.22	1,091,811.48		

	REA GROUP LTD	3,586	235.02	842,781.72
	WESFARMERS LTD	90,005	82.93	7,464,114.65
	COLES GROUP LTD	108,486	20.30	2,202,265.80
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	30.86	2,841,311.06
	COCHLEAR LIMITED	4,783	303.07	1,449,583.81
	PRO MEDICUS LTD	5,485	314.68	1,726,019.80
	SIGMA HEALTHCARE LTD	373,923	2.89	1,080,637.47
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	26.98	1,128,546.42
	CSL LIMITED	39,224	243.71	9,559,281.04
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	30.06	7,166,995.38
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	135,517	178.90	24,243,991.30
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	254,446	39.30	9,999,727.80
	WESTPAC BANKING	276,117	33.70	9,305,142.90
	ASX LTD	14,549	71.18	1,035,597.82
	MACQUARIE GROUP LIMITED	28,049	223.23	6,261,378.27
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	41.75	576,651.00
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	8.45	1,408,293.90
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	5.02	1,165,558.66
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	22.68	2,898,934.92
	SUNCORP GROUP LTD	80,738	20.81	1,680,157.78
	WISETECH GLOBAL LTD	19,625	112.41	2,206,046.25
	XERO LTD	11,340	177.67	2,014,777.80
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.87	1,502,234.29
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	11.63	1,808,872.05
	オーストラリアドル 小計	5,334,222		150,034,899.58 (14,332,833,956)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	157,673	7.50	1,182,547.50
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,686	36.82	1,461,238.52
	INFRATIL LTD	73,511	10.82	795,389.02
	CONTACT ENERGY LTD	68,904	9.09	626,337.36
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.86	647,787.84
	ニュージーランドドル 小計	450,318		4,713,300.24 (413,120,766)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	237,496	47.75	11,340,434.00
	SWIRE PACIFIC A	44,500	69.00	3,070,500.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	85.55	9,153,850.00
	MTR CORP	125,000	27.60	3,450,000.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	24.35	2,922,000.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	38.65	6,725,100.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	19.06	3,773,880.00
	WH GROUP LTD	658,301	7.42	4,884,593.42
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	35.75	10,063,625.00

	HANG SENG BANK	59,400	120.60	7,163,640.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	411.60	39,637,080.00	
	AIA GROUP LTD	861,800	68.50	59,033,300.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	51.35	1,925,625.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	65.60	8,954,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.65	6,015,969.05	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	50.10	5,611,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	213,996	34.65	7,414,961.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	25.90	3,243,405.20	
	SINO LAND CO	315,400	8.65	2,728,210.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	89.85	9,434,250.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	23.95	2,011,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	23.50	2,890,500.00	
	香港ドル 小計	5,120,578		211,448,323.07 (3,928,709,842)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	7.77	876,456.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	8.24	1,214,576.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	206,800	2.28	471,504.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.24	784,323.68	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.74	216,672.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	2.97	530,442.00	
	DBS GROUP	173,360	45.65	7,913,884.00	
	OCBC BANK	258,600	16.67	4,310,862.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	95,400	36.56	3,487,824.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	15.41	1,017,060.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	3.96	2,463,686.28	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	84,100	7.44	625,704.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.69	699,669.00	
	シンガポールドル 小計	2,606,435		24,612,662.96 (2,807,566,463)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	23.69	1,407,825.63	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	1,500.00	3,219,000.00	
	BANK HAPOLIM BM	98,310	64.87	6,377,369.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	63.03	7,091,631.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	34.57	3,439,715.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	227.00	2,838,181.00	
	NICE LTD	4,991	575.00	2,869,825.00	
	AZRIELI GROUP	5,718	336.30	1,922,963.40	
	イスラエルシェケル 小計	395,107		29,166,511.09 (1,282,136,494)	
	合 計	88,201,113		835,150,077,786 (835,150,077,786)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	-	
	カナダドル 小計		1,490.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	694,638.60	
	オーストラリアドル 小計		83,290	694,638.60 (66,358,825)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,943,800.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,943,800.00 (73,275,804)	
投資信託受益証券合計			398,290	139,634,629 (139,634,629)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	963,606.21	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	886,826.74	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,765	8,377,409.95	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	58,442	1,152,476.24	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,341,953.99	
		BXP INC	11,259	777,208.77	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	875,714.49	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,488,536.35	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,829	4,763,768.22	
		EQUINIX INC	8,139	6,223,974.69	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	874,143.60	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,722,129.05	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,482,279.90	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,564	2,611,942.44	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	24,610	1,167,744.50	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,000,008.90	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,452,408.16	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,315,105.50	
		KIMCO REALTY CORP	48,189	1,019,197.35	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,381,364.85	
		PROLOGIS INC	73,867	7,858,710.13	
		PUBLIC STORAGE	12,826	3,706,585.74	
		REALTY INCOME CORP	76,326	4,344,475.92	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	863,509.22	
SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	2,092,733.91			
SIMON PROPERTY GROUP	25,979	4,232,758.47			

	SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,386,950.40	
	UDR INC	23,815	969,746.80	
	VENTAS INC	38,069	2,389,210.44	
	VICI PROPERTIES INC	83,762	2,759,957.90	
	WELLTOWER INC	53,013	8,071,229.25	
	WP CAREY INC	16,024	990,283.20	
	アメリカドル 小計	937,920	84,543,951.28 (12,334,117,052)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	260,008.80	
	GECINA SA	3,139	282,510.00	
	KLEPIERRE	17,225	560,501.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	842,045.70	
	ユーロ 小計	35,781	1,945,066.00 (333,053,651)	
イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	51,818	308,576.19	
	SEGRO PLC	103,047	688,766.14	
	イギリスポンド 小計	154,865	997,342.33 (198,012,346)	
オーストラ リアドル	GOODMAN GROUP	172,354	5,865,206.62	
	SCENTRE GROUP	381,283	1,414,559.93	
	STOCKLAND	207,412	1,128,321.28	
	VICINITY CENTERS	305,149	765,923.99	
	オーストラリアドル 小計	1,066,198	9,174,011.82 (876,393,349)	
香港ドル	LINK REIT	246,000	10,455,000.00	
	香港ドル 小計	246,000	10,455,000.00 (194,253,900)	
シンガポー ルドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	767,172.60	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	549,912	1,193,309.04	
	シンガポールドル 小計	834,050	1,960,481.64 (223,632,140)	
	投資証券合計	3,274,814	14,159,462,438 (14,159,462,438)	
	合計		14,299,097,067 (14,299,097,067)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 527銘柄	98.1%				74.9%
	投資証券 32銘柄				1.9%	1.5%
カナダドル	株式 83銘柄	100.0%				3.4%
	新株予約権 証券 1銘柄					
ユーロ	株式 215銘柄	99.6%				9.4%
	投資証券 4銘柄				0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式 71銘柄	99.4%				3.8%
	投資証券 2銘柄				0.6%	0.0%
スイスフラン	株式 43銘柄	100.0%				2.5%
スウェーデン クローナ	株式 40銘柄	100.0%				0.8%
ノルウェー クローネ	株式 11銘柄	100.0%				0.2%
デンマーク クローネ	株式 15銘柄	100.0%				0.6%
オーストラ リアドル	株式 43銘柄	93.8%				1.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄			0.4%		0.0%
	投資証券 4銘柄				5.7%	0.1%
ニュージー ランドドル	株式 5銘柄	100.0%				0.0%
香港ドル	株式 22銘柄	93.6%				0.5%
	投資信託受 益証券 1銘柄			1.7%		0.0%
	投資証券 1銘柄				4.6%	0.0%
シンガポ ールドル	株式 13銘柄	92.6%				0.3%
	投資証券 2銘柄				7.4%	0.0%
イスラエル シェケル	株式 8銘柄	100.0%				0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	810,309,862

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	4,628,820
株式	17,824,171,114
投資信託受益証券	30,473,429
投資証券	281,241,713
派生商品評価勘定	18,702,903
未収配当金	13,438,767
未収利息	59
差入委託証拠金	210,951,167
流動資産合計	19,193,917,834
資産合計	19,193,917,834
負債の部	
流動負債	
前受金	18,702,903
流動負債合計	18,702,903
負債合計	18,702,903
純資産の部	
元本等	
元本	7,662,147,449
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,513,067,482
元本等合計	19,175,214,931
純資産合計	19,175,214,931
負債純資産合計	19,193,917,834

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

2025年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,662,147,449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 2.5026円 (1万口当たり純資産額) (25,026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

2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

2025年 7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	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	8,531,672,487円
期中追加設定元本額	676,376,252円
期中一部解約元本額	1,545,901,290円
期末元本額	7,662,147,449円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	992,309,611円
分散投資コア戦略ファンドS	4,881,919,021円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	1,787,918,817円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	83,921,604	
投資信託受益証券	2,628,698	
投資証券	3,726,699	
合計	90,277,001	

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式最小分散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

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	715,376,276	-	734,079,179	18,702,903
合計		715,376,276	-	734,079,179	18,702,903

(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。

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	EXXON MOBIL	4,653	113.80	529,511.40	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,565	179.27	280,557.55	
	WILLIAMS COS	4,505	57.85	260,614.25	
	LINDE PLC	1,232	471.27	580,604.64	
	NEWMONT CORPORATION	12,537	58.75	736,548.75	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	544	133.00	72,352.00	
	GENERAL DYNAMICS CORP	791	299.96	237,268.36	
	GRAINGER (WW) INC	331	1,045.29	345,990.99	
	LOCKHEED MARTIN CORP	1,299	463.06	601,514.94	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	1,788	507.94	908,196.72	
	RTX CORP	484	146.18	70,751.12	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,238	107.02	132,490.76	
	LEIDOS HOLDINGS	417	162.21	67,641.57	
	REPUBLIC SERVICES INC	7,407	240.51	1,781,457.57	
	ROLLINS INC	2,176	55.81	121,442.56	
	WASTE CONNECTIONS INC	8,919	182.07	1,623,882.33	
	WASTE MANAGEMENT INC	6,278	225.75	1,417,258.50	
	DR HORTON INC	930	138.41	128,721.30	
	NVR INC	108	7,700.93	831,700.44	
	DOMINO'S PIZZA INC	127	463.48	58,861.96	
	MCDONALD'S CORP	4,748	293.02	1,391,258.96	
	YUM BRANDS INC	4,804	150.85	724,683.40	
	ELECTRONIC ARTS INC	1,649	152.68	251,769.32	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	4,491	101.44	455,567.04	
	AUTOZONE INC	297	3,742.18	1,111,427.46	
	GENUINE PARTS CO	919	125.25	115,104.75	
	MERCADOLIBRE INC	71	2,477.08	175,872.68	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,670	92.58	802,668.60	
	ROSS STORES INC	405	131.21	53,140.05	
	TJX COMPANIES INC	6,837	125.45	857,701.65	
	KROGER CO	9,862	70.26	692,904.12	
	WALMART INC	8,283	96.81	801,877.23	
COCA-COLA CO	8,242	69.48	572,654.16		
CONAGRA BRANDS INC	1,970	20.38	40,148.60		
GENERAL MILLS INC	19,663	51.20	1,006,745.60		

HERSHEY FOODS CORPORATION	2,563	161.95	415,077.85
HORMEL FOODS CORP	10,447	31.27	326,677.69
JM SMUCKER CO	1,115	104.17	116,149.55
KELLANOVA	8,833	79.22	699,750.26
KEURIG DR PEPPER INC	21,041	33.65	708,029.65
KRAFT HEINZ CO/THE	17,694	26.45	468,006.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	13,324	66.85	890,709.40
MONSTER BEVERAGE CORP	991	59.57	59,033.87
PEPSICO INC	8,087	134.48	1,087,539.76
THE CAMPBELL'S COMPANY	6,861	30.74	210,907.14
TYSON FOODS INC	9,693	55.08	533,890.44
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,272	98.39	715,492.08
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,503	91.58	961,864.74
KIMBERLY-CLARK CORP	2,207	131.49	290,198.43
PROCTER & GAMBLE CO	7,822	157.52	1,232,121.44
ABBOTT LABORATORIES	5,718	133.22	761,751.96
BECTON DICKINSON & CO	477	175.50	83,713.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,050	102.96	314,028.00
CARDINAL HEALTH	2,216	164.26	364,000.16
CENCORA INC	6,391	300.16	1,918,322.56
CENTENE CORP	1,007	33.09	33,321.63
ELEVANCE HEALTH INC	3,088	346.36	1,069,559.68
HCA HEALTHCARE INC	1,162	378.44	439,747.28
HOLOGIC INC	1,932	65.85	127,222.20
MCKESSON CORP	2,534	727.23	1,842,800.82
MOLINA HEALTHCARE INC	1,102	237.22	261,416.44
QUEST DIAGNOSTICS	625	173.62	108,512.50
THE CIGNA GROUP	1,554	309.78	481,398.12
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,805	302.91	849,662.55
ABBVIE INC	5,047	190.62	962,059.14
AMGEN	1,029	296.52	305,119.08
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	3,208	59.67	191,421.36
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,411	47.66	162,568.26
ELI LILLY & CO	495	786.92	389,525.40
GILEAD SCIENCES INC	1,916	113.24	216,967.84
INCYTE CORP	956	68.72	65,696.32
JOHNSON & JOHNSON	8,423	156.28	1,316,346.44
MERCK & CO	15,298	83.71	1,280,595.58
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,283	133.51	438,313.33
PFIZER	4,962	25.56	126,828.72
REGENERON PHARMACEUTICALS	696	552.58	384,595.68
UNITED THERAPEUTICS CORP	826	300.56	248,262.56

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,302	478.96	623,612.43
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	103	2,097.23	216,014.69
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,691	478.91	1,767,656.81
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,584	232.06	831,703.04
CME GROUP INC	1,802	275.64	496,703.28
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	930	179.76	167,176.80
MASTERCARD INC-CLASS A	437	565.11	246,953.07
VISA INC-CLASS A SHARES	2,029	357.76	725,895.04
ALLSTATE CORP	625	194.09	121,306.25
AON PLC	1,532	356.92	546,801.44
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,230	87.92	283,981.60
CHUBB LTD	2,534	280.00	709,520.00
LOEWS CORP	2,289	90.97	208,230.33
MARSH & MCLENNAN COS	6,228	214.17	1,333,850.76
PROGRESSIVE CORP	4,689	250.41	1,174,172.49
WILLIS TOWERS WATSON PLC	241	308.51	74,350.91
ACCENTURE PLC-CL A	2,226	297.40	662,012.40
ADOBE INC	112	373.38	41,818.56
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	2,447	80.63	197,301.61
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	1,659	56.02	92,937.18
CADENCE DESIGN SYSTEMS	228	322.91	73,623.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2,855	231.23	660,161.65
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,956	79.95	476,182.20
DYNATRACE INC	5,691	56.19	319,777.29
FAIR ISAAC CORP	99	1,591.73	157,581.27
FORTINET INC	2,067	107.65	222,512.55
GARTNER INC	2,690	394.44	1,061,043.60
GEN DIGITAL INC	12,903	30.16	389,154.48
GODADDY INC - CLASS A	4,814	175.13	843,075.82
INTL BUSINESS MACHINES CORP	5,859	290.14	1,699,930.26
INTUIT INC	282	769.59	217,024.38
MICROSOFT CORP	4,008	503.51	2,018,068.08
ORACLE CORP	2,035	235.81	479,873.35
PTC INC	4,287	210.47	902,284.89
ROPER TECHNOLOGIES INC	2,849	558.64	1,591,565.36
SALESFORCE INC	367	270.92	99,427.64
SERVICENOW INC	423	1,013.71	428,799.33
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,068	578.98	618,350.64
VERISIGN INC	3,119	289.76	903,761.44
WORKDAY INC-CLASS A	1,040	240.17	249,776.80
AMPHENOL CORPORATION	7,088	98.21	696,112.48
APPLE INC	564	211.14	119,082.96

	CDW CORP/DE	1,433	180.75	259,014.75
	CISCO SYSTEMS	18,457	69.27	1,278,516.39
	F5 INC	1,326	302.28	400,823.28
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,664	417.88	1,531,112.32
	TE CONNECTIVITY PLC	651	172.65	112,395.15
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,603	519.86	833,335.58
	AT&T INC	48,110	28.10	1,351,891.00
	T-MOBILE US INC	7,323	232.31	1,701,206.13
	VERIZON COMMUNICATIONS	28,719	42.61	1,223,716.59
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	2,367	61.72	146,091.24
	AMEREN CORPORATION	4,495	95.20	427,924.00
	AMERICAN ELECTRIC POWER	4,365	104.74	457,190.10
	CENTERPOINT ENERGY INC	2,651	36.07	95,621.57
	CMS ENERGY CORP	3,685	69.76	257,065.60
	CONSOLIDATED EDISON INC	12,152	99.97	1,214,835.44
	DOMINION ENERGY INC	5,530	57.15	316,039.50
	DTE ENERGY COMPANY	561	131.42	73,726.62
	DUKE ENERGY CORP	10,332	117.17	1,210,600.44
	EVERGY INC	1,604	68.81	110,371.24
	NEXTERA ENERGY INC	1,720	73.65	126,678.00
	PG&E CORP	30,730	13.52	415,469.60
	SOUTHERN CO	14,273	91.96	1,312,545.08
	WEC ENERGY GROUP INC	10,619	104.22	1,106,712.18
	XCEL ENERGY INC	7,500	67.84	508,800.00
	ANALOG DEVICES	808	242.72	196,117.76
	FIRST SOLAR INC	1,045	165.99	173,459.55
	NVIDIA CORP	3,913	162.88	637,349.44
	TEXAS INSTRUMENTS	1,171	216.39	253,392.69
	アメリカドル 小計	692,693		85,781,266.92 (12,514,629,030)
カナダドル	AGNICO EAGLE MINES	12,615	161.06	2,031,771.90
	BARRICK MINING CORP	21,266	28.59	607,994.94
	FRANCO-NEVADA CORP	1,647	217.89	358,864.83
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,777	121.60	702,483.20
	THOMSON REUTERS CORP	1,358	273.73	371,725.34
	INTACT FINANCIAL CORP	1,007	308.81	310,971.67
	CGI INC - CL A	7,266	140.70	1,022,326.20
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	253	4,956.28	1,253,938.84
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	2,995	140.78	421,636.10
	カナダドル 小計	54,184		7,081,713.02 (755,406,327)
ユーロ	ENI	10,917	14.25	155,610.91

COVESTRO AG-TEND	6,547	60.40	395,438.80	
SYMRISE AG	1,400	90.76	127,064.00	
UPM KYMMENE OYJ	1,940	23.88	46,327.20	
WOLTERS KLUWER	2,923	138.85	405,858.55	
AENA SME SA	8,500	23.43	199,197.50	
GETLINK	6,012	16.11	96,853.32	
FERRARI NV	456	418.00	190,608.00	
SODEXO	1,150	52.00	59,800.00	
BOLLORE SE	10,376	5.31	55,096.56	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	1,029	106.50	109,588.50	
SCOUT24 SE	2,438	119.80	292,072.40	
INDITEX	5,186	43.53	225,746.58	
KONINKLIJKE AHOLD NV	4,559	35.19	160,431.21	
LOTUS BAKERIES	11	7,900.00	86,900.00	
BEIERSDORF AG	3,617	109.30	395,338.10	
ARGENX SE	948	465.00	440,820.00	
SANOFI	3,679	83.32	306,534.28	
UCB (GROUPE)	549	170.30	93,494.70	
AIB GROUP PLC	44,255	7.02	310,670.10	
NORDEA BANK ABP	6,239	12.93	80,701.46	
DEUTSCHE BOERSE	1,106	271.80	300,610.80	
EXOR NV	3,223	88.55	285,396.65	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,431	73.10	104,606.10	
SAMPO OYJ-A SHS	51,937	9.25	480,624.99	
DASSAULT SYSTEMES SA	6,846	31.69	216,949.74	
NEMETSCHKE SE	547	129.30	70,727.10	
SAP SE	6,257	265.50	1,661,233.50	
NOKIA OYJ	9,401	4.34	40,800.34	
DEUTSCHE TELEKOM	49,299	31.12	1,534,184.88	
ELISA A	5,218	46.92	244,828.56	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	10,456	10.29	107,592.24	
KPN (KON.)	141,798	4.08	579,244.83	
ORANGE	67,737	13.10	887,693.38	
TELEFONICA	135,196	4.51	610,815.52	
E.ON SE	23,690	16.05	380,342.95	
ENGIE	6,930	19.78	137,075.40	
IBERDROLA SA	7,901	15.65	123,690.15	
IBERDROLA SA-RTS	7,901	0.40	3,160.40	
VERBUND AG	751	63.95	48,026.45	
ASML HOLDING NV	284	679.80	193,063.20	
ユーロ 小計	660,640		12,244,819.35 (2,096,680,417)	

イギリスポンド	COMPASS GROUP PLC	12,316	25.10	309,131.60	
	THE SAGE GROUP PLC	29,073	12.38	359,923.74	
	VODAFONE GROUP PLC	60,056	0.80	48,369.10	
	SEVERN TRENT PLC	7,664	26.61	203,939.04	
イギリスポンド 小計		109,109		921,363.48	(182,927,505)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	231	614.50	141,949.50	
	GIVAUDAN-REG	55	3,832.00	210,760.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	655	282.50	185,037.50	
	SGS SA	3,695	82.14	303,507.30	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	674	171.50	115,591.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	130,400.00	130,400.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	11,097	78.06	866,231.82	
	NOVARTIS	14,924	97.55	1,455,836.20	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	959	95.85	91,920.15	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,250	194.80	243,500.00	
	SWISS RE LTD	4,962	141.55	702,371.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,403	557.40	782,032.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	3,067	74.78	229,350.26	
	SWISSCOM	944	562.50	531,000.00	
	BKW AG	816	175.80	143,452.80	
SWISS PRIME SITE-REG	2,732	115.50	315,546.00		
スイスフラン 小計		47,465		6,448,485.83	(1,186,779,332)
スウェーデンクローナ	TELIA CO AB	83,375	33.59	2,800,566.25	
	スウェーデンクローナ 小計		83,375		2,800,566.25
デンマーククローネ	NOVO NORDISK A/S-B	7,536	443.05	3,338,824.80	
	TRYG A/S	5,035	161.50	813,152.50	
デンマーククローネ 小計		12,571		4,151,977.30	(95,287,879)
オーストラリアドル	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,520	16.37	810,642.40	
	TRANSURBAN GROUP	109,645	13.41	1,470,339.45	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	92,614	5.02	464,922.28	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,033	112.41	116,119.53	
	TELSTRA GROUP LTD	139,896	4.87	681,293.52	
オーストラリアドル 小計		392,708		3,543,317.18	(338,493,090)
ニュージーランドドル	INFRATIL LTD	28,763	10.82	311,215.66	
	ニュージーランドドル 小計		28,763		311,215.66

香港ドル	SWIRE PACIFIC A	13,000	69.00	897,000.00	
	MTR CORP	51,500	27.60	1,421,400.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	47,000	24.35	1,144,450.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	117,500	35.75	4,200,625.00	
	HANG SENG BANK	11,400	120.60	1,374,840.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	281,505	6.65	1,872,008.25	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	23,500	50.10	1,177,350.00	
	SINO LAND CO	132,000	8.65	1,141,800.00	
	WHARF HOLDINGS	38,402	23.95	919,727.90	
香港ドル 小計		715,807		14,149,201.15	(262,892,157)
シンガポールドル	KEPPEL LTD	53,100	7.77	412,587.00	
	SINGAPORE AIRLINES	49,500	7.24	358,380.00	
	OCBC BANK	29,800	16.67	496,766.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	253,400	3.96	1,003,464.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	12,700	7.44	94,488.00	
シンガポールドル 小計		398,500		2,365,685.00	(269,853,687)
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	12,446	64.87	807,372.02	
	AZRIELI GROUP	1,046	336.30	351,769.80	
イスラエルシェケル 小計		13,492		1,159,141.82	(50,954,947)
合 計		3,209,307		17,824,171,114	(17,824,171,114)

(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	654.00	-	
	カナダドル 小計		654.00	-	(-)
新株予約権証券合計				-	(-)
投資信託受益証券	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	131,000	1,640,120.00	
	香港ドル 小計		131,000	1,640,120.00	(30,473,429)
投資信託受益証券合計			131,000	30,473,429	(30,473,429)
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,347	298,805.01	
		REALTY INCOME CORP	9,531	542,504.52	
		WELLTOWER INC	7,136	1,086,456.00	
	アメリカドル 小計		18,014	1,927,765.53	(281,241,713)
			18,014	281,241,713	

投資証券合計		(281,241,713)	
合計		311,715,142	(311,715,142)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 147銘柄	97.8%				69.0%
	投資証券 3銘柄				2.2%	1.6%
カナダドル	株式 9銘柄	100.0%				4.2%
	新株予約権 1銘柄 証券					
ユーロ	株式 41銘柄	100.0%				11.6%
イギリスポンド	株式 4銘柄	100.0%				1.0%
スイスフラン	株式 16銘柄	100.0%				6.5%
スウェーデンクローナ	株式 1銘柄	100.0%				0.2%
デンマーククローネ	株式 2銘柄	100.0%				0.5%
オーストラリアドル	株式 5銘柄	100.0%				1.9%
ニュージーランドドル	株式 1銘柄	100.0%				0.2%
香港ドル	株式 9銘柄	89.6%				1.4%
	投資信託受 1銘柄 益証券			10.4%		0.2%
シンガポールドル	株式 5銘柄	100.0%				1.5%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%				0.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	499,777,475
コール・ローン	2,432,808,354
国債証券	391,588,965,158
派生商品評価勘定	34,215,811
未収入金	26,868,758
未収利息	3,161,749,686
前払金	5,611,932
前払費用	293,006,807
差入委託証拠金	246,956,866
流動資産合計	398,289,960,847
資産合計	398,289,960,847
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,903,144
未払解約金	184,094,294
流動負債合計	191,997,438
負債合計	191,997,438
純資産の部	
元本等	
元本	108,512,612,904
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	289,585,350,505
元本等合計	398,097,963,409
純資産合計	398,097,963,409
負債純資産合計	398,289,960,847

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

	2025年 7月10日現在
	(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2025年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	108,512,612,904口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	1口当たり純資産額 3.6687円 (1万口当たり純資産額) (36,687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

	2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2025年 7月10日現在
期首	2024年 7月11日
期首元本額	97,281,872,398円
期中追加設定元本額	19,740,637,505円
期中一部解約元本額	8,509,896,999円
期末元本額	108,512,612,904円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,021,059,807円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	441,822,449円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	295,418,218円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,311,995,467円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,682,780円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	7,737,335,387円
世界経済インデックスファンド	28,961,359,243円
D C マイセレクション 2 5	1,771,645,696円
D C マイセレクション 5 0	1,716,607,348円
D C マイセレクション 7 5	1,373,405,277円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,202,186,045円
D C マイセレクション S 2 5	1,461,408,959円
D C マイセレクション S 5 0	1,235,344,242円
D C マイセレクション S 7 5	874,827,390円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	3,477,451円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	102,904,135円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	59,340,947円
D C 世界経済インデックスファンド	16,597,714,667円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	751,056,025円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	895,349円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	800,389円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	6,690,978円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	16,209,099円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	30,354,951円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	39,191,970円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	46,737,672円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	407,222,020円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	305,402,537円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,353,237,078円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	48,188,432円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	21,627,358円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	275,432,315円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	106,796,854円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	143,195,456円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	571,315,524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）	807,545,379円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	672,073,924円
外国債券ファンド・シリーズ 1	818,177,305円
分散投資コア戦略ファンド A	860,374,363円
分散投資コア戦略ファンド S	1,730,938,568円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	940,204,154円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,829,430,178円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	225,539,621円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,121,949円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,290,390,485円
S M T インデックスバランス・オープン	154,592,922円
S M T 世界経済インデックス・オープン	563,033,657円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	834,424,766円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,249,542,639円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	10,888,890円
グローバル経済コア	1,750,369,585円
S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型）	27,808,629円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	3,179,863円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 3 0	84,138,109円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 4 0	143,242,820円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型） 2 0 5 0	79,529,740円

区分	2025年 7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）2060	111,546,357円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	1,290,459,755円
10資産分散投資ファンド	36,874,899円
グローバル10資産バランスファンド	46,547,793円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	32,176,499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	15,161,384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	10,405,892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	6,792,184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	3,478,294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	1,525,061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	2,816,581円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	803,903,322円
DCターゲット・イヤー ファンド2065	7,024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）	15,561,119,324円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	267,529,323円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	141,506,606円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	4,932円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	17,712円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	17,345円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	10,629円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	3,464円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	4,855円
外国債券インデックスファンドT（一般投資家私募/適格機関投資家転売制限付）	701,266,608円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7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		1,368,525,764
合計		1,368,525,764

(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

（2025年 7月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,871,820,831	-	1,866,208,899	5,611,932
合計		1,871,820,831	-	1,866,208,899	5,611,932

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2025年 7月10日現在）

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

市場取引以外の取引	買建	2,198,832,542	-	2,230,757,141	31,924,599
	アメリカドル	1,025,776,099	-	1,039,612,466	13,836,367
	カナダドル	84,349,682	-	85,308,160	958,478
	ユーロ	670,656,060	-	683,056,479	12,400,419
	イギリスポンド	141,532,085	-	142,872,408	1,340,323
	オフショア人民元	276,518,616	-	279,907,628	3,389,012
	合計	2,198,832,542	-	2,230,757,141	31,924,599

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.375% 07/31/27	16,100,000.00	15,002,244.20	
		T 0.375% 09/30/27	8,260,000.00	7,656,794.17	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,768,251.16	
		T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,287,128.91	
		T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,520,378.14	
		T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,342,628.50	
		T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,952,148.40	
		T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	7,095,263.70	
		T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,790,097.67	
		T 0.625% 07/31/26	10,800,000.00	10,415,906.10	
		T 0.625% 08/15/30	6,900,000.00	5,853,814.47	
		T 0.625% 11/30/27	15,500,000.00	14,376,855.43	
		T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,880,937.53	
		T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,867,812.50	
		T 0.75% 08/31/26	9,630,000.00	9,278,279.27	
		T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,755,854.96	
		T 0.875% 09/30/26	17,160,000.00	16,520,521.96	
		T 0.875% 11/15/30	3,210,000.00	2,737,402.74	
		T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,509,437.50	
		T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,462,187.52	
		T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,052,084.18	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,168,343.77			
T 1.125% 08/31/28	12,030,000.00	11,073,708.95			

T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,919,690.61	
T 1.25% 04/30/28	9,500,000.00	8,854,667.94	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,630,613.30	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,581,171.86	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	8,354,882.79	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,846,942.18	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,762,080.09	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,744,335.92	
T 1.25% 12/31/26	19,030,000.00	18,297,791.06	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,773,851.53	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,252,768.74	
T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,694,719.93	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,786,679.68	
T 1.375% 12/31/28	8,680,000.00	7,990,177.31	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,779,921.86	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,825,148.23	
T 1.5% 08/15/26	12,500,000.00	12,157,959.00	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,946,142.55	
T 1.625% 05/15/31	10,980,000.00	9,624,227.37	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	6,189,038.07	
T 1.625% 10/31/26	12,300,000.00	11,932,681.65	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,588,134.75	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,630,531.64	
T 1.75% 01/31/29	10,200,000.00	9,493,769.54	
T 1.75% 08/15/41	7,080,000.00	4,657,174.22	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,749,804.68	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,227,760.14	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,382,337.86	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,658,875.00	
T 1.875% 02/28/27	6,500,000.00	6,290,400.41	
T 1.875% 02/28/29	8,470,000.00	7,907,208.22	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	5,072,396.67	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,810,230.47	
T 1% 07/31/28	10,120,000.00	9,301,900.81	
T 2.25% 02/15/27	7,250,000.00	7,062,236.31	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,592,429.66	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,646,153.12	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,288,804.68	
T 2.25% 08/15/46	2,740,000.00	1,776,076.54	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,408,173.83	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,379,859.37	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	3,961,074.20	

T 2.375% 03/31/29	9,900,000.00	9,394,558.56
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	11,378,571.15
T 2.375% 05/15/29	6,010,000.00	5,693,301.18
T 2.375% 05/15/51	7,450,000.00	4,662,652.38
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	2,605,902.35
T 2.5% 02/15/45	6,810,000.00	4,746,516.81
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,681,360.34
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,935,535.17
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	991,550.77
T 2.625% 02/15/29	7,740,000.00	7,424,806.61
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,345,625.00
T 2.625% 07/31/29	15,200,000.00	14,495,218.71
T 2.75% 02/15/28	8,550,000.00	8,322,890.62
T 2.75% 04/30/27	5,450,000.00	5,342,596.68
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,473,113.26
T 2.75% 08/15/32	8,900,000.00	8,151,322.29
T 2.75% 08/15/42	7,100,000.00	5,371,316.42
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	2,856,832.01
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,534,517.98
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,145,126.94
T 2.875% 04/30/29	11,300,000.00	10,909,355.49
T 2.875% 05/15/28	8,960,000.00	8,731,800.00
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,358,281.25
T 2.875% 05/15/43	5,050,000.00	3,848,060.55
T 2.875% 05/15/49	5,080,000.00	3,604,319.53
T 2.875% 05/15/52	8,100,000.00	5,628,392.56
T 2.875% 08/15/28	2,220,000.00	2,157,996.08
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,702,269.53
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	684,767.96
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,595,698.25
T 2% 08/15/51	9,850,000.00	5,600,648.43
T 2% 11/15/26	6,320,000.00	6,155,828.14
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,225,203.15
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	847,587.88
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,021,148.42
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,587,427.33
T 3.125% 08/15/44	5,040,000.00	3,934,546.86
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	6,059,311.54
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,946,252.95
T 3.125% 11/15/28	10,410,000.00	10,177,198.25
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,399,109.37
T 3.25% 06/30/29	6,500,000.00	6,353,876.94
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,896,056.39

T 3.375% 05/15/44	7,110,000.00	5,789,650.81	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,910,257.82	
T 3.375% 09/15/27	9,000,000.00	8,914,570.29	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,147,457.01	
T 3.5% 01/31/30	9,000,000.00	8,849,355.48	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,716,781.26	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	688,428.12	
T 3.5% 04/30/30	5,380,000.00	5,282,067.21	
T 3.625% 02/15/44	4,890,000.00	4,142,937.87	
T 3.625% 02/15/53	9,550,000.00	7,698,195.31	
T 3.625% 03/31/30	12,000,000.00	11,850,234.36	
T 3.625% 05/15/53	3,400,000.00	2,737,996.09	
T 3.625% 05/31/28	13,000,000.00	12,929,414.03	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	3,999,773.41	
T 3.75% 06/30/30	3,000,000.00	2,976,093.75	
T 3.75% 08/31/31	8,000,000.00	7,875,468.72	
T 3.75% 11/15/43	6,130,000.00	5,299,576.56	
T 3.75% 12/31/30	6,160,000.00	6,093,948.41	
T 3.875% 02/15/43	2,500,000.00	2,215,185.55	
T 3.875% 08/15/33	11,070,000.00	10,819,411.50	
T 3.875% 08/15/34	13,770,000.00	13,338,342.72	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,319,953.12	
T 3.875% 09/30/29	8,540,000.00	8,538,498.83	
T 3.875% 10/15/27	11,000,000.00	11,008,378.92	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,124,124.77	
T 3.875% 12/31/29	7,500,000.00	7,493,261.70	
T 3% 02/15/47	3,920,000.00	2,912,896.88	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	735,000.00	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	728,574.22	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	1,934,160.14	
T 3% 05/15/45	2,750,000.00	2,085,166.01	
T 3% 05/15/47	4,310,000.00	3,194,787.50	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,378,212.88	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	3,704,695.33	
T 3% 11/15/44	4,900,000.00	3,735,771.46	
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,734,613.28	
T 4.125% 03/31/29	3,350,000.00	3,380,948.23	
T 4.125% 03/31/31	6,800,000.00	6,845,289.08	
T 4.125% 03/31/32	10,000,000.00	10,018,554.70	
T 4.125% 07/31/31	5,950,000.00	5,980,447.27	
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	3,793,070.33	
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,279,781.29	

T 4.125% 10/31/27	8,860,000.00	8,915,201.95
T 4.125% 10/31/31	5,000,000.00	5,018,750.00
T 4.125% 11/15/32	8,000,000.00	7,993,906.24
T 4.25% 02/15/54	7,900,000.00	7,116,943.38
T 4.25% 02/28/31	9,000,000.00	9,119,355.48
T 4.25% 05/15/35	4,810,000.00	4,775,803.88
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	867,480.47
T 4.25% 06/30/31	7,830,000.00	7,924,663.44
T 4.25% 08/15/54	5,400,000.00	4,869,914.07
T 4.25% 11/15/34	10,180,000.00	10,131,485.98
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	702,075.00
T 4.375% 01/31/32	7,460,000.00	7,585,158.95
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	989,296.88
T 4.375% 05/15/34	9,830,000.00	9,905,836.87
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,838,398.42
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	623,416.01
T 4.375% 07/15/27	12,800,000.00	12,926,499.96
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,019,453.14
T 4.375% 08/15/43	1,500,000.00	1,415,332.03
T 4.375% 08/31/28	10,420,000.00	10,586,068.75
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	931,987.49
T 4.375% 11/30/30	4,500,000.00	4,589,296.87
T 4.375% 12/15/26	13,000,000.00	13,074,140.56
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,108,393.75
T 4.5% 04/15/27	9,150,000.00	9,242,750.98
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	551,095.70
T 4.5% 05/31/29	11,000,000.00	11,249,433.58
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,040,537.10
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,677,156.25
T 4.5% 11/15/33	9,270,000.00	9,449,063.12
T 4.5% 11/15/54	5,350,000.00	5,035,269.55
T 4.625% 02/15/35	10,990,000.00	11,246,719.58
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,374,555.47
T 4.625% 02/15/55	7,600,000.00	7,305,500.00
T 4.625% 04/30/31	7,070,000.00	7,296,046.70
T 4.625% 05/15/54	9,450,000.00	9,065,909.19
T 4.625% 09/15/26	4,000,000.00	4,026,953.12
T 4.625% 09/30/30	3,010,000.00	3,105,297.08
T 4.625% 10/15/26	9,520,000.00	9,591,771.85
T 4.75% 02/15/41	750,000.00	752,021.48
T 4.75% 11/15/53	3,880,000.00	3,797,550.00
T 4.875% 10/31/30	4,960,000.00	5,176,709.39
T 4% 01/15/27	7,200,000.00	7,204,078.15

	T 4% 02/15/34	11,600,000.00	11,390,656.19
	T 4% 02/28/30	10,350,000.00	10,396,089.79
	T 4% 07/31/30	3,980,000.00	3,992,437.50
	T 4% 10/31/29	9,550,000.00	9,593,273.43
	T 4% 11/15/52	6,650,000.00	5,743,547.87
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	421,382.81
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,356,468.75
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,084,824.20
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,524,369.13
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,157,091.79
	アメリカドル 小計	1,341,120,000.00	1,223,256,109.14 (178,460,833,762)
カナダドル	CAN 0.5% 12/01/30	2,320,000.00	2,032,540.19
	CAN 1.25% 03/01/27	5,750,000.00	5,621,654.29
	CAN 1.25% 06/01/30	3,950,000.00	3,646,089.68
	CAN 1.5% 06/01/31	3,500,000.00	3,208,931.98
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,285,763.91
	CAN 1.75% 12/01/53	2,920,000.00	1,931,467.90
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	785,528.45
	CAN 1% 09/01/26	2,040,000.00	2,002,243.53
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	234,997.97
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,195,632.83
	CAN 2.75% 03/01/30	2,560,000.00	2,541,917.47
	CAN 2.75% 06/01/33	1,200,000.00	1,159,842.40
	CAN 2.75% 09/01/27	2,350,000.00	2,353,567.74
	CAN 2.75% 12/01/48	980,000.00	840,810.17
	CAN 2.75% 12/01/55	2,600,000.00	2,161,260.40
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	503,484.33
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	401,857.17
	CAN 2% 06/01/32	1,420,000.00	1,319,204.38
	CAN 2% 12/01/51	3,750,000.00	2,685,582.82
	CAN 3.25% 06/01/35	2,680,000.00	2,652,964.74
	CAN 3.25% 09/01/28	3,240,000.00	3,287,618.14
	CAN 3.25% 11/01/26	2,050,000.00	2,065,654.10
	CAN 3.25% 12/01/33	1,810,000.00	1,808,039.53
	CAN 3.25% 12/01/34	2,860,000.00	2,839,042.43
	CAN 3.5% 03/01/28	1,600,000.00	1,631,457.11
	CAN 3.5% 09/01/29	3,600,000.00	3,688,312.20
	CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	944,605.51
	CAN 3.5% 12/01/57	1,030,000.00	993,647.84
	CAN 3% 06/01/34	4,000,000.00	3,905,964.16
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	779,445.79

	CAN 4% 03/01/29	2,180,000.00	2,268,476.47
	CAN 4% 08/01/26	1,490,000.00	1,510,999.31
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,648,274.16
	CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,899,924.01
	CAN 5% 06/01/37	490,000.00	563,384.76
	カナダドル 小計	75,180,000.00	71,400,187.87 (7,616,258,040)
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	16,220,000.00	16,997,950.45
	MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	31,913,985.09
	MBONO 7.5% 05/26/33	30,430,000.00	27,712,094.34
	MBONO 7.5% 06/03/27	53,140,000.00	52,503,556.03
	MBONO 7.75% 05/29/31	43,580,000.00	41,562,459.10
	MBONO 7.75% 11/13/42	41,240,000.00	33,934,715.05
	MBONO 7.75% 11/23/34	34,230,000.00	31,029,450.50
	MBONO 7% 09/03/26	12,380,000.00	12,220,299.36
	MBONO 8.5% 03/01/29	38,390,000.00	38,273,119.72
	MBONO 8.5% 05/31/29	48,130,000.00	47,955,079.21
	MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	19,561,703.02
	MBONO 8% 07/31/53	38,290,000.00	31,385,960.72
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	20,335,880.28
		メキシコペソ 小計	435,320,000.00
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,420,000.00	1,262,962.20
	BGB 0.35% 06/22/32	1,810,000.00	1,529,830.10
	BGB 0.4% 06/22/40	1,020,000.00	641,694.75
	BGB 0.65% 06/22/71	530,000.00	161,160.96
	BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,476,626.73
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,539,347.20
	BGB 0.9% 06/22/29	1,790,000.00	1,694,825.01
	BGB 0% 10/22/27	900,000.00	859,940.10
	BGB 0% 10/22/31	1,460,000.00	1,234,185.44
	BGB 1.25% 04/22/33	1,310,000.00	1,162,364.31
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	592,344.37
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	647,508.00
	BGB 1.6% 06/22/47	950,000.00	631,674.00
	BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	707,939.10
	BGB 1.9% 06/22/38	950,000.00	793,744.00
	BGB 1% 06/22/31	1,670,000.00	1,519,063.31
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	539,049.13
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	450,452.34
	BGB 2.6% 10/22/30	540,000.00	540,587.25
	BGB 2.7% 10/22/29	840,000.00	850,546.20
BGB 2.75% 04/22/39	730,000.00	667,486.45	

BGB 2.85% 10/22/34	1,430,000.00	1,397,141.81
BGB 3.1% 06/22/35	1,040,000.00	1,029,766.40
BGB 3.3% 06/22/54	1,020,000.00	891,191.34
BGB 3.45% 06/22/42	540,000.00	519,502.46
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	421,827.56
BGB 3.5% 06/22/55	690,000.00	622,025.68
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	921,103.68
BGB 3% 06/22/33	1,450,000.00	1,454,659.43
BGB 3% 06/22/34	1,220,000.00	1,212,724.22
BGB 4.25% 03/28/41	1,580,000.00	1,688,506.50
BGB 4% 03/28/32	880,000.00	945,229.56
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,220,887.20
BGB 5% 03/28/35	2,080,000.00	2,396,770.68
BKO 2.2% 03/11/27	1,490,000.00	1,498,577.18
BKO 2.7% 09/17/26	2,650,000.00	2,676,659.00
BTPS 0.25% 03/15/28	2,030,000.00	1,930,974.06
BTPS 0.45% 02/15/29	1,640,000.00	1,534,494.43
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,235,819.84
BTPS 0.6% 08/01/31	1,960,000.00	1,715,860.26
BTPS 0.85% 01/15/27	2,340,000.00	2,303,837.38
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,628,582.74
BTPS 0.95% 03/01/37	2,420,000.00	1,812,002.75
BTPS 0.95% 06/01/32	2,090,000.00	1,825,848.32
BTPS 0.95% 08/01/30	1,180,000.00	1,085,443.92
BTPS 0.95% 09/15/27	2,040,000.00	1,994,460.10
BTPS 0.95% 12/01/31	1,630,000.00	1,444,788.15
BTPS 0% 08/01/26	3,010,000.00	2,952,109.02
BTPS 1.1% 04/01/27	2,350,000.00	2,314,927.14
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,655,824.30
BTPS 1.35% 04/01/30	2,250,000.00	2,130,182.16
BTPS 1.45% 03/01/36	1,730,000.00	1,414,738.98
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	824,545.93
BTPS 1.65% 03/01/32	2,670,000.00	2,462,896.00
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,403,729.30
BTPS 1.7% 09/01/51	1,520,000.00	937,105.61
BTPS 1.8% 03/01/41	1,210,000.00	911,718.76
BTPS 2.05% 08/01/27	1,280,000.00	1,281,224.32
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,443,052.65
BTPS 2.15% 03/01/72	690,000.00	405,845.02
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	684,421.60
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,289,880.83
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,453,794.50
BTPS 2.45% 09/01/33	2,310,000.00	2,192,285.84

BTPS 2.45% 09/01/50	1,530,000.00	1,121,365.88	
BTPS 2.5% 12/01/32	2,520,000.00	2,425,856.73	
BTPS 2.65% 12/01/27	2,860,000.00	2,896,938.61	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,470,000.00	1,178,265.49	
BTPS 2.7% 10/15/27	1,720,000.00	1,742,164.78	
BTPS 2.8% 03/01/67	1,050,000.00	746,867.66	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,645,904.98	
BTPS 2.8% 12/01/28	2,070,000.00	2,106,772.72	
BTPS 2.95% 02/15/27	2,920,000.00	2,962,536.80	
BTPS 2.95% 07/01/30	1,760,000.00	1,780,338.56	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,380,000.00	1,269,411.45	
BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,254,787.64	
BTPS 3.1% 03/01/40	1,040,000.00	953,623.25	
BTPS 3.1% 08/28/26	1,210,000.00	1,225,299.84	
BTPS 3.15% 11/15/31	2,170,000.00	2,193,378.06	
BTPS 3.25% 03/01/38	2,080,000.00	1,982,980.12	
BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	2,000,083.83	
BTPS 3.35% 03/01/35	2,330,000.00	2,323,165.69	
BTPS 3.35% 07/01/29	2,620,000.00	2,704,895.33	
BTPS 3.4% 04/01/28	2,150,000.00	2,218,327.21	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,639,864.13	
BTPS 3.45% 07/15/31	2,670,000.00	2,749,362.27	
BTPS 3.5% 02/15/31	2,490,000.00	2,576,797.40	
BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,460,898.02	
BTPS 3.65% 08/01/35	2,260,000.00	2,292,395.29	
BTPS 3.7% 06/15/30	2,030,000.00	2,125,960.33	
BTPS 3.8% 08/01/28	2,260,000.00	2,361,864.75	
BTPS 3.85% 02/01/35	1,230,000.00	1,272,819.62	
BTPS 3.85% 07/01/34	1,480,000.00	1,538,072.24	
BTPS 3.85% 09/01/49	1,940,000.00	1,847,528.38	
BTPS 3.85% 09/15/26	860,000.00	878,644.11	
BTPS 3.85% 10/01/40	1,300,000.00	1,286,984.25	
BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	3,015,188.17	
BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,175,761.49	
BTPS 3% 10/01/29	630,000.00	641,466.56	
BTPS 4.1% 02/01/29	2,070,000.00	2,190,118.99	
BTPS 4.15% 10/01/39	1,790,000.00	1,848,776.07	
BTPS 4.2% 03/01/34	2,980,000.00	3,185,248.09	
BTPS 4.3% 10/01/54	1,220,000.00	1,211,173.69	
BTPS 4.35% 11/01/33	2,090,000.00	2,257,884.68	
BTPS 4.4% 05/01/33	2,310,000.00	2,507,911.32	
BTPS 4.45% 09/01/43	1,490,000.00	1,565,514.69	

BTPS 4.5% 10/01/53	1,290,000.00	1,328,104.79
BTPS 4.75% 09/01/28	780,000.00	838,463.65
BTPS 4.75% 09/01/44	1,850,000.00	2,026,653.17
BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,197,324.56
BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	927,871.38
BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,330,343.50
BTPS 4% 11/15/30	2,310,000.00	2,453,312.86
BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	3,032,652.62
BTPS 5.25% 11/01/29	2,930,000.00	3,264,370.72
BTPS 5.75% 02/01/33	2,180,000.00	2,563,385.91
BTPS 5% 08/01/34	2,830,000.00	3,203,682.25
BTPS 5% 09/01/40	2,640,000.00	2,977,833.93
BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	2,966,651.46
BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,336,609.87
BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,496,659.50
DBR 0.25% 02/15/27	2,490,000.00	2,429,807.36
DBR 0.25% 02/15/29	1,970,000.00	1,851,691.15
DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,984,731.92
DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,313,024.92
DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	340,442.90
DBR 0% 02/15/30	3,500,000.00	3,176,573.74
DBR 0% 02/15/31	1,660,000.00	1,467,153.22
DBR 0% 02/15/32	3,620,000.00	3,105,456.82
DBR 0% 05/15/35	2,260,000.00	1,742,751.54
DBR 0% 05/15/36	2,430,000.00	1,809,408.37
DBR 0% 08/15/26	2,920,000.00	2,863,483.40
DBR 0% 08/15/29	2,360,000.00	2,170,597.70
DBR 0% 08/15/30	3,050,000.00	2,732,790.08
DBR 0% 08/15/30	1,280,000.00	1,147,327.18
DBR 0% 08/15/31	3,490,000.00	3,041,748.42
DBR 0% 08/15/50	5,240,000.00	2,450,132.28
DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,325,918.92
DBR 0% 11/15/27	3,340,000.00	3,198,498.24
DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,864,574.28
DBR 1.25% 08/15/48	3,680,000.00	2,585,023.36
DBR 1.7% 08/15/32	2,600,000.00	2,484,420.90
DBR 1.8% 08/15/53	4,240,000.00	3,200,203.60
DBR 1% 05/15/38	3,040,000.00	2,434,389.44
DBR 2.1% 11/15/29	2,680,000.00	2,676,518.00
DBR 2.2% 02/15/34	3,210,000.00	3,123,370.12
DBR 2.3% 02/15/33	4,320,000.00	4,275,263.16
DBR 2.4% 11/15/30	3,220,000.00	3,245,660.18
DBR 2.5% 02/15/35	2,940,000.00	2,907,762.83

DBR 2.5% 07/04/44	2,930,000.00	2,706,742.79
DBR 2.5% 08/15/46	3,120,000.00	2,853,938.88
DBR 2.5% 08/15/54	2,270,000.00	1,997,550.06
DBR 2.6% 05/15/41	1,030,000.00	979,729.56
DBR 2.6% 08/15/33	2,890,000.00	2,910,576.80
DBR 2.6% 08/15/34	3,560,000.00	3,561,979.70
DBR 2.9% 08/15/56	1,250,000.00	1,186,835.00
DBR 3.25% 07/04/42	1,950,000.00	2,014,491.37
DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	2,878,307.99
DBR 4.25% 07/04/39	1,810,000.00	2,089,225.08
DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,545,104.27
DBR 4.75% 07/04/34	2,500,000.00	2,939,287.50
DBR 4.75% 07/04/40	2,060,000.00	2,509,040.24
DBR 5.5% 01/04/31	1,850,000.00	2,156,781.43
DBR 5.625% 01/04/28	2,510,000.00	2,736,976.79
DBR 6.25% 01/04/30	1,850,000.00	2,173,615.50
DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	2,932,416.07
FRTR 0.25% 11/25/26	3,700,000.00	3,616,831.62
FRTR 0.5% 05/25/29	5,230,000.00	4,864,509.66
FRTR 0.5% 05/25/40	3,140,000.00	1,995,342.95
FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	340,540.89
FRTR 0.5% 06/25/44	2,030,000.00	1,126,542.06
FRTR 0.75% 02/25/28	5,200,000.00	5,017,077.52
FRTR 0.75% 05/25/28	5,290,000.00	5,078,233.36
FRTR 0.75% 05/25/52	2,950,000.00	1,376,123.55
FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,377,258.56
FRTR 0.75% 11/25/28	5,220,000.00	4,957,538.13
FRTR 0% 02/25/27	5,200,000.00	5,041,262.60
FRTR 0% 05/25/32	4,890,000.00	4,007,883.78
FRTR 0% 11/25/29	4,820,000.00	4,327,625.03
FRTR 0% 11/25/30	6,360,000.00	5,519,097.48
FRTR 0% 11/25/31	5,540,000.00	4,634,476.10
FRTR 1.25% 05/25/34	5,510,000.00	4,680,224.91
FRTR 1.25% 05/25/36	4,950,000.00	3,972,397.91
FRTR 1.25% 05/25/38	3,080,000.00	2,334,978.55
FRTR 1.5% 05/25/31	5,970,000.00	5,569,289.36
FRTR 1.5% 05/25/50	3,050,000.00	1,852,882.89
FRTR 1.75% 05/25/66	1,760,000.00	929,426.83
FRTR 1.75% 06/25/39	3,570,000.00	2,841,655.16
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,881,859.78
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,548,319.44
FRTR 2.5% 05/25/43	2,410,000.00	1,995,417.19

FRTR 2.5% 09/24/26	3,690,000.00	3,717,402.30
FRTR 2.5% 09/24/27	4,040,000.00	4,078,735.11
FRTR 2.75% 02/25/29	6,270,000.00	6,353,992.92
FRTR 2.75% 02/25/30	5,090,000.00	5,131,117.02
FRTR 2.75% 10/25/27	4,380,000.00	4,446,208.08
FRTR 2% 05/25/48	2,610,000.00	1,850,468.38
FRTR 2% 11/25/32	3,660,000.00	3,417,786.76
FRTR 3.2% 05/25/35	3,430,000.00	3,388,242.24
FRTR 3.25% 05/25/45	2,980,000.00	2,725,795.80
FRTR 3.25% 05/25/55	2,040,000.00	1,732,710.82
FRTR 3.5% 11/25/33	4,970,000.00	5,099,443.15
FRTR 3.6% 05/25/42	1,050,000.00	1,021,459.24
FRTR 3.75% 05/25/56	1,480,000.00	1,374,367.91
FRTR 3% 05/25/33	4,210,000.00	4,184,125.17
FRTR 3% 05/25/54	2,450,000.00	1,991,553.91
FRTR 3% 06/25/49	1,830,000.00	1,557,293.83
FRTR 3% 11/25/34	4,450,000.00	4,348,525.40
FRTR 4.5% 04/25/41	3,710,000.00	4,039,982.24
FRTR 4.75% 04/25/35	2,960,000.00	3,310,755.56
FRTR 4% 04/25/55	2,340,000.00	2,295,239.23
FRTR 4% 04/25/60	1,970,000.00	1,908,826.87
FRTR 4% 10/25/38	2,490,000.00	2,589,213.05
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,582,397.08
FRTR 5.75% 10/25/32	4,370,000.00	5,159,058.56
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	649,974.37
IRISH 0.2% 10/18/30	910,000.00	810,372.44
IRISH 0.35% 10/18/32	600,000.00	508,198.20
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	537,589.00
IRISH 0.55% 04/22/41	410,000.00	270,354.41
IRISH 0.9% 05/15/28	840,000.00	814,690.80
IRISH 0% 10/18/31	950,000.00	810,380.40
IRISH 1.1% 05/15/29	980,000.00	940,666.72
IRISH 1.3% 05/15/33	610,000.00	549,166.98
IRISH 1.35% 03/18/31	370,000.00	348,895.75
IRISH 1.5% 05/15/50	900,000.00	609,867.00
IRISH 1.7% 05/15/37	740,000.00	636,500.64
IRISH 2.4% 05/15/30	930,000.00	932,142.44
IRISH 2.6% 10/18/34	200,000.00	194,684.50
IRISH 2% 02/18/45	1,010,000.00	808,936.01
IRISH 3.15% 10/18/55	280,000.00	257,840.80
IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	350,797.00
NETHER 0.25% 07/15/29	1,390,000.00	1,287,494.94
NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,029,888.29

NETHER 0.5% 07/15/26	1,750,000.00	1,726,633.58	
NETHER 0.5% 07/15/32	1,300,000.00	1,130,144.27	
NETHER 0.75% 07/15/27	1,060,000.00	1,036,290.94	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,540,000.00	1,482,690.05	
NETHER 0% 01/15/27	1,640,000.00	1,595,181.89	
NETHER 0% 01/15/29	1,770,000.00	1,644,007.35	
NETHER 0% 01/15/38	1,340,000.00	919,764.49	
NETHER 0% 01/15/52	1,810,000.00	784,647.49	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,203,135.26	
NETHER 0% 07/15/31	1,610,000.00	1,391,742.76	
NETHER 2.5% 01/15/30	1,080,000.00	1,090,789.20	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,430,000.00	1,420,191.86	
NETHER 2.5% 07/15/33	1,170,000.00	1,157,080.28	
NETHER 2.5% 07/15/34	1,260,000.00	1,234,823.89	
NETHER 2.5% 07/15/35	1,090,000.00	1,058,223.75	
NETHER 2.75% 01/15/47	2,160,000.00	2,009,300.57	
NETHER 2% 01/15/54	1,690,000.00	1,297,152.85	
NETHER 3.25% 01/15/44	840,000.00	848,683.41	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,832,676.16	
NETHER 4% 01/15/37	1,660,000.00	1,831,712.72	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,600,000.00	1,737,441.92	
OBL 0% 04/16/27	2,920,000.00	2,827,749.89	
OBL 0% 10/09/26	2,680,000.00	2,621,143.17	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,507,893.45	
OBL 2.1% 04/12/29	3,360,000.00	3,365,167.68	
OBL 2.2% 04/13/28	3,490,000.00	3,516,846.82	
OBL 2.4% 04/18/30	1,090,000.00	1,100,527.98	
OBL 2.4% 10/19/28	4,270,000.00	4,324,741.40	
OBL 2.5% 10/11/29	2,090,000.00	2,121,874.59	
PGB 0.3% 10/17/31	840,000.00	730,327.50	
PGB 0.475% 10/18/30	1,000,000.00	905,488.00	
PGB 0.7% 10/15/27	700,000.00	681,722.47	
PGB 0.9% 10/12/35	640,000.00	516,662.40	
PGB 1.15% 04/11/42	470,000.00	326,094.69	
PGB 1.65% 07/16/32	780,000.00	727,812.54	
PGB 1.95% 06/15/29	1,250,000.00	1,238,741.37	
PGB 1% 04/12/52	640,000.00	341,350.40	
PGB 2.125% 10/17/28	1,450,000.00	1,452,556.06	
PGB 2.25% 04/18/34	790,000.00	747,875.62	
PGB 2.875% 07/21/26	950,000.00	959,654.85	
PGB 2.875% 10/20/34	810,000.00	800,493.84	
PGB 3.375% 06/15/40	420,000.00	411,326.07	

PGB 3.5% 06/18/38	440,000.00	445,353.34
PGB 3.625% 06/12/54	290,000.00	275,171.93
PGB 3.875% 02/15/30	700,000.00	747,149.55
PGB 3% 06/15/35	470,000.00	465,595.96
PGB 4.1% 02/15/45	800,000.00	844,225.19
PGB 4.1% 04/15/37	980,000.00	1,060,920.56
PGB 4.125% 04/14/27	800,000.00	830,866.56
RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	521,672.68
RAGB 0.5% 02/20/29	1,800,000.00	1,693,392.33
RAGB 0.5% 04/20/27	1,760,000.00	1,716,398.81
RAGB 0.7% 04/20/71	540,000.00	189,415.80
RAGB 0.75% 02/20/28	1,310,000.00	1,267,058.20
RAGB 0.75% 03/20/51	930,000.00	496,007.13
RAGB 0.75% 10/20/26	1,480,000.00	1,459,672.20
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	72,303.95
RAGB 0.9% 02/20/32	1,740,000.00	1,554,785.70
RAGB 0% 02/20/30	1,790,000.00	1,606,774.59
RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,451,216.97
RAGB 0% 10/20/28	1,340,000.00	1,249,386.33
RAGB 0% 10/20/40	650,000.00	388,245.75
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	750,622.49
RAGB 1.5% 11/02/86	440,000.00	208,674.40
RAGB 1.85% 05/23/49	660,000.00	480,534.28
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	387,252.12
RAGB 2.4% 05/23/34	710,000.00	681,336.94
RAGB 2.9% 02/20/33	1,650,000.00	1,661,433.67
RAGB 2.9% 02/20/34	1,240,000.00	1,239,465.56
RAGB 2.9% 05/23/29	350,000.00	358,343.54
RAGB 2.95% 02/20/35	860,000.00	855,008.13
RAGB 3.15% 06/20/44	960,000.00	917,732.88
RAGB 3.15% 10/20/53	760,000.00	693,532.23
RAGB 3.2% 07/15/39	840,000.00	826,617.89
RAGB 3.45% 10/20/30	330,000.00	345,826.14
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	429,067.38
RAGB 4.15% 03/15/37	1,550,000.00	1,695,011.49
RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,279,484.50
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	319,406.62
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	192,542.88
RFGB 0.125% 09/15/31	710,000.00	610,166.04
RFGB 0.25% 09/15/40	350,000.00	220,505.57
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	299,067.46
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	523,449.83
RFGB 0.5% 09/15/28	780,000.00	741,271.12

RFGB 0.5% 09/15/29	610,000.00	566,770.03
RFGB 0.75% 04/15/31	510,000.00	461,611.81
RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	450,223.39
RFGB 0% 09/15/30	560,000.00	493,544.44
RFGB 1.125% 04/15/34	640,000.00	551,139.52
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	346,689.22
RFGB 1.375% 04/15/47	570,000.00	384,390.03
RFGB 1.5% 09/15/32	490,000.00	450,609.23
RFGB 2.5% 04/15/30	460,000.00	461,749.88
RFGB 2.625% 07/04/42	540,000.00	485,787.20
RFGB 2.75% 04/15/38	470,000.00	444,782.65
RFGB 2.75% 07/04/28	680,000.00	693,272.10
RFGB 2.875% 04/15/29	520,000.00	531,413.53
RFGB 2.95% 04/15/55	500,000.00	437,671.91
RFGB 3.2% 04/15/45	270,000.00	257,870.45
RFGB 3% 09/15/33	790,000.00	798,253.75
RFGB 3% 09/15/34	710,000.00	712,022.21
RFGB 3% 09/15/35	490,000.00	487,356.55
SPGB 0.1% 04/30/31	3,160,000.00	2,729,495.03
SPGB 0.5% 04/30/30	2,930,000.00	2,666,783.45
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,239,722.87
SPGB 0.6% 10/31/29	2,930,000.00	2,714,554.95
SPGB 0.7% 04/30/32	2,560,000.00	2,227,322.88
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,382,702.89
SPGB 0.8% 07/30/29	2,810,000.00	2,637,834.81
SPGB 0.85% 07/30/37	1,940,000.00	1,444,545.08
SPGB 0% 01/31/27	3,280,000.00	3,183,582.74
SPGB 0% 01/31/28	3,050,000.00	2,892,562.05
SPGB 1.2% 10/31/40	1,810,000.00	1,288,191.38
SPGB 1.25% 10/31/30	2,760,000.00	2,578,983.44
SPGB 1.3% 10/31/26	1,870,000.00	1,855,671.12
SPGB 1.4% 04/30/28	3,580,000.00	3,510,332.30
SPGB 1.4% 07/30/28	2,550,000.00	2,491,078.42
SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,604,326.86
SPGB 1.45% 10/31/27	2,610,000.00	2,576,158.74
SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	298,186.16
SPGB 1.5% 04/30/27	1,400,000.00	1,389,248.00
SPGB 1.85% 07/30/35	2,190,000.00	1,933,215.93
SPGB 1.9% 10/31/52	1,890,000.00	1,235,724.52
SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,964,440.40
SPGB 1% 07/30/42	1,550,000.00	1,016,359.80
SPGB 1% 10/31/50	2,290,000.00	1,226,134.35

	SPGB 2.35% 07/30/33	2,180,000.00	2,081,064.22
	SPGB 2.5% 05/31/27	2,330,000.00	2,351,386.37
	SPGB 2.55% 10/31/32	2,500,000.00	2,445,807.77
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,860,000.00	1,516,720.16
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,930,000.00	1,660,928.13
	SPGB 3.1% 07/30/31	1,890,000.00	1,929,761.99
	SPGB 3.15% 04/30/33	2,170,000.00	2,197,320.73
	SPGB 3.15% 04/30/35	1,980,000.00	1,967,570.55
	SPGB 3.2% 10/31/35	1,200,000.00	1,191,478.77
	SPGB 3.25% 04/30/34	2,700,000.00	2,727,797.84
	SPGB 3.45% 07/30/43	1,690,000.00	1,604,753.71
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,580,000.00	1,353,438.88
	SPGB 3.45% 10/31/34	2,610,000.00	2,669,794.83
	SPGB 3.5% 01/31/41	700,000.00	679,969.50
	SPGB 3.5% 05/31/29	2,500,000.00	2,603,457.75
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,270,000.00	2,353,734.62
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,550,000.00	1,596,406.22
	SPGB 4.2% 01/31/37	2,320,000.00	2,496,303.76
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,990,000.00	2,223,397.15
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,880,000.00	2,144,215.20
	SPGB 4% 10/31/54	1,210,000.00	1,191,477.59
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,660,000.00	3,995,492.06
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,640,000.00	1,932,781.00
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,250,000.00	2,665,802.25
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,405,816.49
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,025,005.07
	ユーロ 小計	746,640,000.00	699,463,007.44 (119,769,050,763)
イギリスボ ンド	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,380,360.46
	UKT 0.25% 07/31/31	2,490,000.00	1,988,292.39
	UKT 0.375% 10/22/26	2,930,000.00	2,813,116.44
	UKT 0.375% 10/22/30	780,000.00	648,363.30
	UKT 0.5% 01/31/29	2,990,000.00	2,662,263.11
	UKT 0.5% 10/22/61	2,420,000.00	616,129.58
	UKT 0.625% 07/31/35	2,250,000.00	1,536,039.00
	UKT 0.625% 10/22/50	1,850,000.00	660,542.50
	UKT 0.875% 01/31/46	1,530,000.00	690,389.55
	UKT 0.875% 07/31/33	2,790,000.00	2,128,588.65
	UKT 0.875% 10/22/29	1,460,000.00	1,291,432.78
	UKT 1.125% 01/31/39	2,030,000.00	1,277,909.36
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	331,905.00
	UKT 1.25% 07/22/27	1,250,000.00	1,189,467.50
	UKT 1.25% 07/31/51	2,460,000.00	1,047,099.00

UKT 1.25% 10/22/41	2,580,000.00	1,490,236.38
UKT 1.5% 07/22/26	1,400,000.00	1,368,518.20
UKT 1.5% 07/22/47	1,740,000.00	883,481.52
UKT 1.5% 07/31/53	1,680,000.00	742,618.80
UKT 1.625% 10/22/28	1,460,000.00	1,364,862.02
UKT 1.625% 10/22/54	1,640,000.00	741,688.36
UKT 1.625% 10/22/71	1,930,000.00	756,446.13
UKT 1.75% 01/22/49	1,230,000.00	643,587.66
UKT 1.75% 07/22/57	1,900,000.00	862,904.00
UKT 1.75% 09/07/37	2,400,000.00	1,731,784.80
UKT 1% 01/31/32	3,700,000.00	3,030,670.00
UKT 2.5% 07/22/65	1,590,000.00	859,856.10
UKT 3.25% 01/22/44	2,430,000.00	1,855,190.79
UKT 3.25% 01/31/33	3,760,000.00	3,495,220.80
UKT 3.5% 01/22/45	2,000,000.00	1,567,112.00
UKT 3.5% 07/22/68	1,600,000.00	1,120,012.80
UKT 3.75% 01/29/38	2,780,000.00	2,490,710.42
UKT 3.75% 03/07/27	2,540,000.00	2,535,011.44
UKT 3.75% 07/22/52	1,400,000.00	1,074,932.60
UKT 3.75% 10/22/53	3,260,000.00	2,477,342.46
UKT 4.125% 01/29/27	3,630,000.00	3,642,835.68
UKT 4.125% 07/22/29	3,410,000.00	3,432,983.40
UKT 4.25% 03/07/36	2,160,000.00	2,081,401.92
UKT 4.25% 06/07/32	1,910,000.00	1,916,994.42
UKT 4.25% 07/31/34	3,390,000.00	3,320,016.84
UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,175,932.37
UKT 4.25% 12/07/27	2,860,000.00	2,895,438.26
UKT 4.25% 12/07/40	1,500,000.00	1,370,251.50
UKT 4.25% 12/07/46	1,830,000.00	1,577,998.02
UKT 4.25% 12/07/49	1,370,000.00	1,162,098.39
UKT 4.25% 12/07/55	2,150,000.00	1,783,186.35
UKT 4.375% 01/31/40	2,260,000.00	2,108,385.64
UKT 4.375% 03/07/28	3,420,000.00	3,461,334.12
UKT 4.375% 03/07/30	2,000,000.00	2,028,520.00
UKT 4.375% 07/31/54	2,870,000.00	2,436,222.46
UKT 4.5% 03/07/35	2,740,000.00	2,718,203.30
UKT 4.5% 06/07/28	2,570,000.00	2,615,224.29
UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,390,398.93
UKT 4.5% 12/07/42	1,940,000.00	1,789,733.42
UKT 4.625% 01/31/34	3,290,000.00	3,326,584.80
UKT 4.75% 10/22/43	2,700,000.00	2,541,304.80
UKT 4.75% 12/07/30	3,260,000.00	3,381,692.54

	UKT 4.75% 12/07/38	1,800,000.00	1,774,620.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	983,118.75	
	UKT 4% 10/22/31	2,660,000.00	2,630,931.52	
	UKT 4% 10/22/63	1,610,000.00	1,252,968.01	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,010,000.00	2,153,739.12	
イギリスポンド 小計		136,060,000.00	112,306,204.75 (22,297,273,891)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	5,280,000.00	4,740,225.60	
	SGB 0.75% 05/12/28	7,340,000.00	7,137,049.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	8,250,000.00	7,866,375.00	
	SGB 1.75% 11/11/33	5,050,000.00	4,880,724.00	
	SGB 1% 11/12/26	8,340,000.00	8,255,766.00	
	SGB 2.25% 05/11/35	4,300,000.00	4,282,391.50	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,300,000.00	5,355,438.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,270,000.00	4,779,517.75	
スウェーデンクローナ 小計		48,130,000.00	47,297,486.85 (726,016,423)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	4,780,000.00	4,132,775.09	
	NGB 1.375% 08/19/30	4,830,000.00	4,322,467.99	
	NGB 1.75% 02/17/27	5,340,000.00	5,192,936.50	
	NGB 1.75% 09/06/29	5,350,000.00	4,972,021.00	
	NGB 2.125% 05/18/32	4,480,000.00	4,038,727.61	
	NGB 2% 04/26/28	4,330,000.00	4,155,016.42	
	NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,794,502.16	
	NGB 3.625% 04/13/34	4,500,000.00	4,424,001.30	
	NGB 3.625% 05/31/39	2,150,000.00	2,101,222.55	
	NGB 3.75% 06/12/35	5,070,000.00	5,023,358.53	
	NGB 3% 08/15/33	5,180,000.00	4,883,879.91	
ノルウェークローネ 小計		47,870,000.00	45,040,909.06 (651,291,545)	
デンマーク クローネ	DGB 0.25% 11/15/52	6,290,000.00	3,262,524.92	
	DGB 0.5% 11/15/27	5,760,000.00	5,609,742.27	
	DGB 0.5% 11/15/29	4,560,000.00	4,283,123.82	
	DGB 0% 11/15/31	4,160,000.00	3,625,350.04	
	DGB 2.25% 11/15/26	2,280,000.00	2,304,423.80	
	DGB 2.25% 11/15/33	6,800,000.00	6,736,552.93	
	DGB 2.25% 11/15/35	2,060,000.00	2,007,026.54	
	DGB 4.5% 11/15/39	9,430,000.00	11,363,593.21	
デンマーククローネ 小計		41,340,000.00	39,192,337.53 (899,464,146)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	4,500,000.00	4,278,555.00	
	POLGB 0% 01/25/27	950,000.00	890,802.43	
	POLGB 1.25% 10/25/30	6,680,000.00	5,601,873.97	

	POLGB 1.75% 04/25/32	5,590,000.00	4,521,444.21	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,650,000.00	4,570,483.55	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,530,000.00	4,367,651.18	
	POLGB 2.75% 04/25/28	3,100,000.00	2,967,924.50	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,568,841.86	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,510,000.00	2,487,165.12	
	POLGB 4.75% 07/25/29	5,020,000.00	5,041,001.16	
	POLGB 5.75% 04/25/29	7,310,000.00	7,610,342.31	
	POLGB 5% 01/25/30	2,210,000.00	2,233,919.49	
	POLGB 5% 10/25/34	4,720,000.00	4,609,683.67	
	POLGB 6% 10/25/33	6,370,000.00	6,695,694.27	
	POLGB 7.5% 07/25/28	4,470,000.00	4,846,729.81	
	ポーランドズロチ 小計	68,610,000.00	66,292,112.53 (2,676,212,582)	
オーストラリアドル	ACGB 0.5% 09/21/26	2,390,000.00	2,308,381.50	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,590,000.00	2,168,218.50	
	ACGB 1.5% 06/21/31	3,070,000.00	2,693,157.50	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,860,000.00	980,164.20	
	ACGB 1.75% 11/21/32	2,760,000.00	2,356,626.00	
	ACGB 1% 11/21/31	2,550,000.00	2,136,237.00	
	ACGB 1% 12/21/30	1,890,000.00	1,638,176.40	
	ACGB 2.25% 05/21/28	2,040,000.00	1,974,842.40	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,222,976.60	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,410,000.00	1,106,906.40	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,950,000.00	1,701,511.50	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,530,000.00	1,507,218.30	
	ACGB 2.75% 11/21/28	2,130,000.00	2,081,819.40	
	ACGB 2.75% 11/21/29	2,160,000.00	2,088,828.00	
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,110,000.00	2,090,419.20	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	812,498.40	
	ACGB 3.5% 12/21/34	2,690,000.00	2,526,179.00	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,440,000.00	1,348,387.20	
	ACGB 3.75% 05/21/34	2,340,000.00	2,256,859.80	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,009,827.00	
	ACGB 3% 11/21/33	2,330,000.00	2,136,796.40	
	ACGB 4.25% 03/21/36	1,710,000.00	1,691,856.90	
	ACGB 4.25% 06/21/34	960,000.00	961,113.60	
ACGB 4.25% 12/21/35	1,890,000.00	1,873,141.20		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,720,000.00	2,792,134.40		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,840,000.00	2,906,001.60		
ACGB 4.75% 06/21/54	960,000.00	922,003.20		
	オーストラリアドル 小計	54,950,000.00	50,292,281.60 (4,804,421,661)	

ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	1,340,000.00	1,222,420.68	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	865,924.77	
	NZGB 1.75% 05/15/41	560,000.00	359,161.61	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	514,180.47	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	388,624.58	
	NZGB 2% 05/15/32	1,240,000.00	1,074,226.93	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,810,000.00	1,704,964.41	
	NZGB 3% 04/20/29	1,180,000.00	1,150,977.13	
	NZGB 4.25% 05/15/34	750,000.00	736,031.03	
	NZGB 4.25% 05/15/36	760,000.00	730,855.54	
	NZGB 4.5% 04/15/27	930,000.00	948,992.64	
	NZGB 4.5% 05/15/30	1,210,000.00	1,241,828.20	
	NZGB 4.5% 05/15/35	1,240,000.00	1,229,733.22	
	NZGB 5% 05/15/54	380,000.00	363,603.87	
ニュージーランドドル 小計		13,630,000.00	12,531,525.08 (1,098,388,173)	
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 11/01/26	870,000.00	864,691.68	
	SIGB 1.625% 07/01/31	450,000.00	441,682.46	
	SIGB 1.875% 03/01/50	690,000.00	655,670.28	
	SIGB 1.875% 10/01/51	480,000.00	449,796.93	
	SIGB 2.25% 08/01/36	760,000.00	767,585.63	
	SIGB 2.375% 07/01/39	560,000.00	572,874.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	737,287.70	
	SIGB 2.625% 08/01/32	660,000.00	685,290.93	
	SIGB 2.75% 03/01/35	190,000.00	200,558.30	
	SIGB 2.75% 03/01/46	820,000.00	902,028.70	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	682,871.99	
	SIGB 2.875% 07/01/29	1,340,000.00	1,394,989.44	
	SIGB 2.875% 08/01/28	610,000.00	630,403.40	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	430,220.91	
	SIGB 2.875% 09/01/30	840,000.00	882,284.59	
	SIGB 3.25% 06/01/54	410,000.00	505,431.60	
	SIGB 3.375% 05/01/34	160,000.00	176,235.93	
	SIGB 3.375% 09/01/33	880,000.00	961,839.91	
	SIGB 3.5% 03/01/27	800,000.00	822,944.00	
	SIGB 3% 04/01/29	150,000.00	156,568.75	
SIGB 3% 08/01/72	620,000.00	752,586.44		
シンガポールドドル 小計		13,060,000.00	13,673,843.57 (1,559,775,336)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,591,129.08	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,930,000.00	1,948,203.36	
	MGS 3.519% 04/20/28	2,340,000.00	2,365,837.33	

	MGS 3.582% 07/15/32	1,570,000.00	1,592,592.13
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,981,539.87
	MGS 3.757% 05/22/40	2,950,000.00	2,968,573.20
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,816,485.86
	MGS 3.844% 04/15/33	1,830,000.00	1,881,343.21
	MGS 3.885% 08/15/29	2,460,000.00	2,525,268.22
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,146,825.36
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	2,007,734.95
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,501,765.92
	MGS 3.906% 07/15/26	1,210,000.00	1,221,902.64
	MGS 4.054% 04/18/39	1,640,000.00	1,707,530.93
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	3,115,793.34
	MGS 4.18% 05/16/44	810,000.00	854,492.57
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,607,170.18
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,859,403.52
	MGS 4.457% 03/31/53	2,090,000.00	2,250,850.58
	MGS 4.498% 04/15/30	2,930,000.00	3,098,760.38
	MGS 4.504% 04/30/29	940,000.00	984,530.05
	MGS 4.642% 11/07/33	3,210,000.00	3,486,971.64
	MGS 4.696% 10/15/42	2,320,000.00	2,591,444.17
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,093,097.19
	MGS 4.762% 04/07/37	2,410,000.00	2,675,065.05
	MGS 4.893% 06/08/38	2,130,000.00	2,388,727.26
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,923,698.78
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,182,396.22
	マレーシアリングット 小計	55,690,000.00	58,369,132.99 (2,005,709,332)
イスラエル シェケル	ILGOV 1.3% 04/30/32	3,970,000.00	3,342,211.87
	ILGOV 1.5% 05/31/37	3,470,000.00	2,598,232.27
	ILGOV 1% 03/31/30	3,530,000.00	3,090,093.12
	ILGOV 2.25% 09/28/28	3,790,000.00	3,600,696.16
	ILGOV 2.8% 11/29/52	2,260,000.00	1,634,303.68
	ILGOV 2% 03/31/27	3,040,000.00	2,944,453.52
	ILGOV 3.75% 02/28/29	2,940,000.00	2,921,645.87
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,313,959.45
	ILGOV 3.75% 09/30/27	2,690,000.00	2,678,952.69
	ILGOV 4.6% 08/31/29	1,120,000.00	1,152,622.45
	ILGOV 4% 03/30/35	2,960,000.00	2,936,947.22
	ILGOV 5.5% 01/31/42	2,490,000.00	2,829,612.09
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,379,916.32
	イスラエルシェケル 小計	36,170,000.00	33,423,646.71 (1,469,276,770)
	CGB 1.06% 12/15/26	37,470,000.00	37,304,540.71

オフショア
人民元

CGB 1.35% 09/25/26	40,940,000.00	40,925,178.48
CGB 1.43% 01/25/30	10,000,000.00	9,974,216.20
CGB 1.45% 02/25/28	27,600,000.00	27,642,407.40
CGB 1.46% 05/25/28	6,000,000.00	6,010,080.60
CGB 1.49% 12/25/31	30,690,000.00	30,475,781.02
CGB 1.61% 02/15/35	41,300,000.00	41,052,958.67
CGB 1.62% 08/15/27	29,950,000.00	30,094,161.32
CGB 1.65% 05/15/35	21,000,000.00	20,935,726.77
CGB 1.74% 10/15/29	36,760,000.00	37,147,450.40
CGB 1.85% 05/15/27	42,700,000.00	43,070,734.21
CGB 1.87% 09/15/31	27,620,000.00	28,083,695.60
CGB 1.91% 07/15/29	23,000,000.00	23,374,895.40
CGB 1.92% 01/15/55	6,850,000.00	6,875,672.43
CGB 2.04% 02/25/27	38,210,000.00	38,613,665.72
CGB 2.04% 11/25/34	46,000,000.00	47,471,208.80
CGB 2.05% 04/15/29	36,880,000.00	37,646,226.25
CGB 2.11% 08/25/34	27,200,000.00	28,184,525.76
CGB 2.12% 06/25/31	32,000,000.00	32,981,027.20
CGB 2.18% 08/15/26	35,600,000.00	35,912,425.60
CGB 2.27% 05/25/34	38,000,000.00	39,837,030.20
CGB 2.28% 03/25/31	50,700,000.00	52,651,042.47
CGB 2.35% 02/25/34	36,110,000.00	38,054,101.01
CGB 2.37% 01/15/29	39,430,000.00	40,645,753.07
CGB 2.37% 01/20/27	43,880,000.00	44,535,343.41
CGB 2.39% 11/15/26	46,200,000.00	46,832,390.21
CGB 2.4% 07/15/28	38,310,000.00	39,413,021.52
CGB 2.44% 10/15/27	39,500,000.00	40,375,410.85
CGB 2.48% 04/15/27	26,800,000.00	27,314,120.48
CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	27,365,683.45
CGB 2.5% 07/25/27	26,760,000.00	27,307,407.91
CGB 2.52% 08/25/33	31,870,000.00	33,940,644.89
CGB 2.54% 12/25/30	30,500,000.00	32,074,727.20
CGB 2.55% 10/15/28	22,250,000.00	23,034,052.17
CGB 2.6% 09/01/32	27,890,000.00	29,775,093.46
CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	32,109,359.95
CGB 2.62% 04/15/28	34,000,000.00	35,121,595.40
CGB 2.62% 06/25/30	44,530,000.00	46,878,672.50
CGB 2.62% 09/25/29	20,940,000.00	21,898,007.09
CGB 2.64% 01/15/28	38,220,000.00	39,398,009.19
CGB 2.67% 05/25/33	34,280,000.00	36,843,643.51
CGB 2.67% 11/25/33	23,400,000.00	25,244,254.62
CGB 2.68% 05/21/30	30,700,000.00	32,373,346.48

CGB 2.69% 08/12/26	39,900,000.00	40,508,969.76	
CGB 2.69% 08/15/32	19,420,000.00	20,816,628.14	
CGB 2.75% 02/17/32	39,430,000.00	42,275,592.12	
CGB 2.75% 06/15/29	28,340,000.00	29,718,355.57	
CGB 2.76% 05/15/32	13,150,000.00	14,155,459.52	
CGB 2.79% 12/15/29	30,300,000.00	31,993,051.89	
CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	24,206,687.12	
CGB 2.8% 03/25/30	39,490,000.00	41,806,096.39	
CGB 2.8% 11/15/32	24,600,000.00	26,641,253.88	
CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,930,952.94	
CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	12,323,657.96	
CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	26,132,140.84	
CGB 2.91% 10/14/28	24,320,000.00	25,489,969.53	
CGB 3.01% 05/13/28	62,590,000.00	65,546,088.14	
CGB 3.02% 05/27/31	14,560,000.00	15,789,848.25	
CGB 3.12% 10/25/52	12,970,000.00	16,251,186.91	
CGB 3.19% 04/15/53	18,360,000.00	23,345,378.92	
CGB 3.27% 11/19/30	16,450,000.00	18,021,376.38	
CGB 3.28% 12/03/27	27,290,000.00	28,617,811.31	
CGB 3.29% 05/23/29	27,000,000.00	29,031,021.00	
CGB 3.32% 04/15/52	15,490,000.00	20,022,088.98	
CGB 3.39% 03/16/50	25,610,000.00	32,940,772.86	
CGB 3.53% 10/18/51	12,850,000.00	17,093,923.24	
CGB 3.72% 04/12/51	15,140,000.00	20,692,672.21	
CGB 3.81% 09/14/50	26,020,000.00	35,752,598.86	
CGB 3.86% 07/22/49	19,160,000.00	26,321,530.91	
CGB 3% 10/15/53	18,270,000.00	22,778,898.97	
CGB 4.08% 10/22/48	19,370,000.00	27,205,292.84	
オフショア人民元 小計	2,058,740,000.00	2,184,208,595.02 (44,374,818,658)	
合計		391,588,965,158 (391,588,965,158)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 203銘柄	100.0%	45.6%
カナダドル	国債証券 35銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 387銘柄	100.0%	30.6%

イギリスポンド	国債証券	62銘柄	100.0%	5.7%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	11銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.0%	1.2%
ニュージーランドドル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券	21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	13銘柄	100.0%	0.4%
オフショア人民元	国債証券	71銘柄	100.0%	11.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,542,590,619
コール・ローン	502,905,112
株式	249,743,919,876
投資信託受益証券	542,523,980
投資証券	250,039,611
派生商品評価勘定	172,889,133
未収入金	8,209,738
未収配当金	1,063,974,605
未収利息	6,435
差入委託証拠金	1,832,897,906
流動資産合計	258,659,957,015
資産合計	258,659,957,015
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,336,429
前受金	170,552,704
未払金	323,714
未払解約金	511,145,489
流動負債合計	684,358,336
負債合計	684,358,336
純資産の部	
元本等	
元本	50,833,427,807
剰余金	
剰余金又は欠損金()	207,142,170,872
元本等合計	257,975,598,679
純資産合計	257,975,598,679

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	258,659,957,015

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2025年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		50,833,427,807口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.0749円 (50,749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

		2025年 7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。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制		運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	45,973,691,996円
期中追加設定元本額	7,412,838,305円
期中一部解約元本額	2,553,102,494円
期末元本額	50,833,427,807円
期末元本額の内訳	

区分	2025年 7月10日現在
S M T 新興国株式インデックス・オープン	6,577,322,073円
世界経済インデックスファンド	15,031,887,698円
D C 新興国株式インデックス・オープン	6,704,738,381円
D C 世界経済インデックスファンド	8,043,275,537円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	91,770,990円
コア投資戦略ファンド（安定型）	56,616,568円
コア投資戦略ファンド（成長型）	141,879,599円
分散投資コア戦略ファンドA	266,005,185円
分散投資コア戦略ファンドS	1,256,430,541円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,549,767,035円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	851,716,134円
コア投資戦略ファンド（切替型）	57,834,036円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	370,989,104円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,219,386円
S M T インデックスバランス・オープン	83,377,277円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	31,574,177円
外国株式 S M T B セレクション（S M A 専用）	3,092,830,880円
S M T 世界経済インデックス・オープン	326,492,154円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,672,956,263円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	240,446,023円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	8,943,587円
グローバル経済コア	902,265,471円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	796,665,905円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	49,116,176円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	17,066,187円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	155,118,071円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	169,781,972円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	82,810,438円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	106,284,448円
1 0 資産分散投資ファンド	18,452,071円
グローバル1 0 資産バランスファンド	37,071,336円
D C 世界経済インデックスファンド（株式特化型）	21,602,047円
D C 全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	84,064,411円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,678,689,849円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	118,138,977円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,310,953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）	15,638,199円
F O F s 用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,196,200円
グローバル1 0 資産バランス・アクティブ型ファンドN 1（適格機関投資家専用）	6,734円
グローバル1 0 資産バランス・アクティブ型ファンドN 2（適格機関投資家専用）	13,155円
グローバル1 0 資産バランス・アクティブ型ファンドN 3（適格機関投資家専用）	13,090円
グローバル1 0 資産バランス・アクティブ型ファンドN 4（適格機関投資家専用）	23,402円
グローバル1 0 資産バランス・アクティブ型ファンドN 5（適格機関投資家専用）	13,155円
グローバル1 0 資産バランス・アクティブ型ファンドN 6（適格機関投資家専用）	12,932円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,133,516,485
投資信託受益証券	40,966,512
投資証券	30,131,298
合計	15,204,614,295

(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

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,171,028,916	-	7,341,581,620	170,552,704
合計		7,171,028,916	-	7,341,581,620	170,552,704

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	239,400	2.00	479,518.20	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	16.40	605,652.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	-	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	-	
	SOUTHERN COPPER CORP	16,377	99.92	1,636,389.84	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	33.57	1,370,528.82	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	10.54	835,484.72	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	47.20	3,136,534.40	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	26.76	328,693.08	
	KANZHUN LTD	57,608	18.84	1,085,334.72	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	20.35	3,226,431.45	
	VK CO LTD	19,368	0.00	-	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	134,681	105.00	14,141,505.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	15.07	823,967.32	
	JBS NV-A	88,000	13.21	1,162,480.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	39.45	583,460.54	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	488,730	1.68	823,021.32	
	CREDICORP LTD	13,321	224.62	2,992,163.02	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	590,000	13.64	8,047,600.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	43.68	906,491.04	
XP INC - CLASS A	60,000	19.19	1,151,400.00		
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	168,912	1.37	232,254.00		
アメリカドル 小計		2,399,697		43,568,909.47 (6,356,268,202)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,824,261	13.71	38,720,618.31	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	604,092	111.35	67,265,644.20	

	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	499.95	17,498,250.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	135.59	13,830,180.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	564.89	18,966,181.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	259.53	13,781,043.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	74,980	425.92	31,935,481.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	209.31	8,934,397.35	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	54,300	150.48	8,171,064.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	1,060,980	58.29	61,844,524.20	
	ALFA S.A.B. -A	691,623	13.76	9,516,732.48	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	106,875	183.97	19,661,793.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	348,140	190.85	66,442,519.00	
	GRUMA S.A.B. -B	25,960	322.77	8,379,109.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	50.63	14,156,148.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	34.28	6,232,104.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	513,300	172.37	88,477,521.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	371,700	51.31	19,071,927.00	
	QUALITAS CONTROLADORA SAB CV	46,700	195.08	9,110,236.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	16.45	57,926,043.00	
	メキシコペソ 小計	10,972,011		579,921,517.84 (4,549,368,323)	
ブラジルリアル	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	766,100	35.27	27,020,347.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	32.32	27,208,268.80	
	PRIO SA	178,800	42.57	7,611,516.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	17.64	2,679,516.00	
	GERDAU SA-PREF	312,408	16.79	5,245,330.32	
	SUZANO SA	162,779	50.00	8,138,950.00	
	VALE SA	694,587	54.04	37,535,481.48	
	EMBRAER SA	156,200	78.21	12,216,402.00	
	WEG SA	314,144	40.11	12,600,315.84	
	LOCALIZA RENT A CAR	192,040	37.33	7,168,853.20	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOB	248,600	13.44	3,341,184.00	
	RUMO SA	244,300	17.46	4,265,478.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	21.79	3,769,670.00	
	RAIA DROGASIL SA	259,280	13.81	3,580,656.80	
	AMBEV SA	906,200	13.31	12,061,522.00	
	BRF SA	119,300	22.50	2,684,250.00	
	NATURA COSMETICOS SA	200,308	10.17	2,037,132.36	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	145,700	34.03	4,958,171.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	326,023	14.06	4,583,883.38	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	1,046,482	16.36	17,120,445.52	
	BANCO DO BRASIL S.A.	313,000	21.45	6,713,850.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,054,629	36.37	38,356,856.73	

	ITAUSA SA	1,049,268	10.70	11,227,167.60	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	14.48	15,288,114.32	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	35.22	3,835,458.00	
	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	14.46	2,053,320.00	
	TOTVS SA	124,500	42.11	5,242,695.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	178,800	31.68	5,664,384.00	
	TIM SA	222,800	21.53	4,796,884.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	43.61	1,613,570.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	221,600	39.70	8,797,520.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	10.64	2,929,990.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	85,500	113.50	9,704,250.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	12.01	2,457,246.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	38.64	1,051,008.00	
	ENEVA SA	154,000	13.40	2,063,600.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	42.40	1,961,000.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	225,100	34.70	7,810,970.00	
	ブラジルリアル 小計	12,966,322		337,395,257.35	(8,828,250,564)
チリペソ	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,368.00	186,000,120.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	30,645	36,501.00	1,118,573,145.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	19.64	832,080,652.48	
	EMPRESAS COPEC SA	90,423	6,360.00	575,090,280.00	
	FALABELLA SA	214,533	4,989.00	1,070,305,137.00	
	CENCOSUD SA	306,432	3,184.00	975,679,488.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	138.50	1,050,273,615.50	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	14,760	38,500.00	568,260,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	58.50	675,684,886.50	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	92.99	324,657,381.85	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	67.79	173,629,035.62	
	チリペソ 小計	68,345,355		7,550,233,741.95	(1,159,074,132)
コロンビアペソ	GRUPO CIBEST SA	50,698	51,300.00	2,600,807,400.00	
	GRUPO CIBEST SA-PREF	84,565	44,800.00	3,788,512,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	85,511	19,800.00	1,693,117,800.00	
	コロンビアペソ 小計	220,774		8,082,437,200.00	(294,055,230)
ユーロ	METLEN ENERGY & METALS SA	20,295	47.00	953,865.00	
	OPAP SA	44,643	19.49	870,092.07	
	JUMBO SA	19,341	30.00	580,230.00	
	ALPHA BANK SA	511,806	3.31	1,694,077.86	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	3.11	1,330,453.37	
	NATIONAL BANK OF GREECE	161,569	11.70	1,891,165.14	

	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	193,059	6.41	1,237,894.30	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.70	411,449.90	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	14.69	821,053.48	
	ユーロ 小計	1,460,473		9,790,281.12 (1,676,389,836)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	180,590	146.00	26,366,140.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	517,736	26.90	13,927,098.40	
	SASA POLYESTER SANAYI	2,951,032	3.08	9,089,178.56	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	291,229	149.70	43,596,981.30	
	KOC HOLDING AS	139,884	160.30	22,423,405.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	35.30	10,545,804.40	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	256.25	8,993,606.25	
	TURK HAVA YOLLARI AO	103,615	286.75	29,711,601.25	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	163,700	94.80	15,518,760.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	493.00	40,045,404.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	223,014	50.05	11,161,850.70	
	AKBANK T.A.S.	586,183	69.30	40,622,481.90	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	92.60	19,573,047.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	14.36	26,949,885.88	
	YAPI VE KREDI BANKASI	611,127	33.70	20,594,979.90	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	223,091	95.25	21,249,417.75		
	トルコリラ 小計	8,494,379		360,369,642.69 (1,313,871,680)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	1,032.00	13,728,696.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	145.00	8,802,950.00	
	CEZ AS	30,283	1,213.00	36,733,279.00	
	チェココルナ 小計	104,296		59,264,925.00 (411,891,228)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	3,012.00	289,206,216.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	10,250.00	294,595,250.00	
	OTP BANK NYRT	44,199	28,020.00	1,238,455,980.00	
	ハンガリーフォリント 小計	168,958		1,822,257,446.00 (783,570,701)	
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	114,979	85.85	9,870,947.15	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	27,186	130.00	3,534,180.00	
	BUDIMEX	2,800	539.00	1,509,200.00	
	LPP SA	230	14,600.00	3,358,000.00	
	CD PROJEKT SA	15,492	269.40	4,173,544.80	
	ALLEGRO.EU SA	113,795	35.20	4,005,584.00	
	CCC SA	12,000	202.80	2,433,600.00	
	DINO POLSKA SA	9,471	544.00	5,152,224.00	
	ZABKA GROUP SA	55,000	21.20	1,166,000.00	

	BANK MILLENNIUM SA	130,000	14.45	1,878,500.00
	BANK PEKAO SA	33,684	191.50	6,450,486.00
	M BANK SA	2,923	791.80	2,314,431.40
	PKO BANK POLSKI SA	176,233	79.38	13,989,375.54
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	516.00	3,788,988.00
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	116,529	61.04	7,112,930.16
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	169,800	11.85	2,012,979.00
	ポーランドズロチ 小計	987,465		72,750,970.05 (2,936,956,660)
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	39,690	0.00	-
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	-
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	151,214	0.00	0.01
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	-
	ロシアルーブル 小計	5,353,071		0.48 (-)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	9.33	3,069,570.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	442,000	6.66	2,943,720.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,869,400	4.18	20,354,092.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	625,500	30.70	19,202,850.00
	PETROCHINA CO LTD-H	4,050,000	6.91	27,985,500.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	557,700	8.10	4,517,370.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	5.22	5,846,400.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	21.45	5,094,375.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	17.90	9,943,450.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.18	3,043,040.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	8.04	6,512,400.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	15.08	3,528,720.00
	MMG LIMITED	1,176,000	3.70	4,351,200.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	26.40	6,468,000.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	19.68	6,317,280.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,185,000	20.00	23,700,000.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	875,000	4.41	3,858,750.00

BOC AVIATION LTD	68,800	71.45	4,915,760.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	4.44	2,424,240.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.72	2,626,320.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	11.46	5,065,320.00
CITIC LTD	1,038,000	10.86	11,272,680.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-H	17,000	385.00	6,545,000.00
CRRCCORP LTD-H	936,000	4.92	4,605,120.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.78	1,376,640.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	178,000	20.35	3,622,300.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	23.00	3,829,500.00
WEICHAIPOWER CO LTD-H	408,800	15.68	6,409,984.00
ZHUZHOU CRRCCORP TIMES ELECTRIC	132,300	30.80	4,074,840.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	14.80	5,706,095.60
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	13.54	7,014,397.00
J&T GLOBAL EXPRESS LTD	450,000	8.39	3,775,500.00
JD LOGISTICS INC	326,200	12.78	4,168,836.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	10.16	3,271,520.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	32,500	133.60	4,342,000.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	7.41	2,297,100.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	90,831	138.60	12,589,176.60
BYD CO LTD-H	720,000	121.30	87,336,000.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	56.70	8,164,800.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,118,000	17.00	19,006,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	12.82	6,329,875.00
LI AUTO INC-CLASS A	234,842	105.50	24,775,831.00
NIO INC-CLASS A	294,271	27.40	8,063,025.40
XPENG INC - CLASS A SHARES	257,162	69.50	17,872,759.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	12.76	2,985,840.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	59.30	5,141,310.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	90.10	21,642,020.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	738,000	4.38	3,232,440.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	23.35	10,755,010.00
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	99,000	22.70	2,247,300.00
LI NING CO LTD	430,000	16.42	7,060,600.00
MIDEA GROUP CO LTD	67,000	76.05	5,095,350.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	57.55	9,138,940.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	314,000	14.54	4,565,560.00
MEITUAN-CLASS B	964,050	119.20	114,914,760.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	274,500	41.85	11,487,825.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	236,800	20.75	4,913,600.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	179,000	11.68	2,090,720.00
TRIP.COM GROUP LTD	119,857	478.60	57,363,560.20

BAIDU INC-CLASS A	429,500	87.95	37,774,525.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	173.80	7,230,080.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	30.60	1,578,960.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	3.00	3,804,000.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	33.95	5,812,240.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	544,300	64.75	35,243,425.00
NETEASE INC	362,630	205.80	74,629,254.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,251,700	497.60	622,845,920.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3,350,288	102.90	344,744,635.20
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	382,000	13.98	5,340,360.00
JD.COM INC - CL A	468,311	125.30	58,679,368.30
MINISO GROUP HOLDING LTD	72,904	35.45	2,584,446.80
POP MART INTERNATIONAL GROUP	106,800	266.80	28,494,240.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	162,000	11.64	1,885,680.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	1,184,000	4.25	5,032,000.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	43.65	8,444,092.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	108.52	1,649,504.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.58	2,583,120.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	15.80	9,116,600.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	396,000	26.35	10,434,600.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	-	-
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	38.65	13,473,390.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	450,000	19.26	8,667,000.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	11.28	4,692,480.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	52.05	6,037,800.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	5.42	5,289,920.00
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	57.80	5,236,680.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	23.55	2,060,625.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	5.95	2,375,240.00
SINOPHARM GROUP CO-H	291,200	18.42	5,363,904.00
AKESO INC	132,000	109.80	14,493,600.00
BEONE MEDICINES LTD	173,905	150.40	26,155,312.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,558,160	8.09	12,605,514.40
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.22	1,769,580.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	15.36	3,409,920.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	31.95	8,690,400.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	253,000	82.25	20,809,250.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	5.91	11,648,610.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	63,688	78.75	5,015,430.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	728,000	25.90	18,855,200.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	5.45	27,985,750.00
BANK OF CHINA LTD-H	14,349,200	4.65	66,723,780.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,771,475	7.34	13,002,626.50
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	7.72	12,083,344.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	18,851,620	8.22	154,960,316.40
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	4.00	1,500,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	51.25	37,177,928.75
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	5.03	9,234,577.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	400,000	6.93	2,772,000.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	13,241,515	6.10	80,773,241.50
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	5.76	10,656,000.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	733,000	9.09	6,662,970.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	18.14	6,370,768.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	24.75	7,072,931.25
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	7.82	1,876,800.00
GUOTAI HAITONG SECURITIES-H	221,464	13.58	3,007,481.12
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	16.00	4,256,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,460,000	18.06	26,367,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	506,600	26.75	13,551,550.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	14.98	2,756,679.52
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	309,600	43.15	13,359,240.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	5.64	10,591,920.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,337,288	14.78	19,765,116.64
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,318,000	49.50	65,241,000.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	773,000	15.00	11,595,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	39.75	8,804,625.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	32.15	5,160,075.00
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	9.60	15,244,800.00
SUNNY OPTICAL TECH	132,500	71.10	9,420,750.00
XIAOMI CORP-CLASS B	3,369,200	57.40	193,392,080.00
ZTE CORP-H	132,908	24.25	3,223,019.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	708,200	11.18	7,917,676.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	119,500	32.40	3,871,800.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.42	1,476,200.00
CGN POWER CO LTD-H	2,028,000	2.74	5,556,720.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.74	3,609,936.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	702,000	7.19	5,047,380.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.07	2,044,620.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	20.35	4,004,880.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	407,400	19.18	7,813,932.00
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	157,000	63.95	10,040,150.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	646,000	6.50	4,199,000.00
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.94	3,477,760.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	748,000	7.74	5,789,520.00

	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	-	-
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,999,000	1.22	4,878,780.00
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	125,000	34.15	4,268,750.00
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	2.84	2,544,603.08
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	99,844	16.64	1,661,404.16
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	884,540	13.36	11,817,454.40
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	621,111	28.70	17,825,885.70
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	37.65	4,480,350.00
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	5.10	1,609,050.00
	KE HOLDINGS INC-CL A	393,144	47.25	18,576,054.00
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	9.79	3,362,865.00
	香港ドル 小計	146,677,814		3,115,873,818.02 (57,892,935,538)
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.84	1,930,656.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	3.30	1,374,120.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	5.14	3,894,064.00
	GAMUDA BHD	828,204	4.97	4,116,173.88
	SIME DARBY BERHAD	336,346	1.68	565,061.28
	SUNWAY BHD	454,600	4.80	2,182,080.00
	MISC BHD	217,540	7.60	1,653,304.00
	GENTING BHD	271,600	3.18	863,688.00
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.67	506,761.50
	IOI CORPORATION BHD	570,340	3.90	2,224,326.00
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	21.00	2,447,802.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	78.40	1,426,880.00
	PPB GROUP BERHAD	163,480	10.20	1,667,496.00
	QL RESOURCES BHD	187,200	4.56	853,632.00
	SD GUTHRIE BHD	546,246	4.75	2,594,668.50
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.67	3,144,238.00
	AMMB HOLDINGS BHD	662,600	5.09	3,372,634.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,503,202	6.57	9,876,037.14
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.36	2,348,213.12
	MALAYAN BANKING BHD	991,505	9.70	9,617,598.50
	PUBLIC BANK BERHAD	2,966,200	4.26	12,636,012.00
	RHB BANK BHD	219,347	6.31	1,384,079.57
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.34	1,266,148.26
	CELCOMDIGI BHD	638,000	3.87	2,469,060.00
	MAXIS BHD	427,900	3.56	1,523,324.00
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.60	1,792,243.20
	PETRONAS GAS BHD	148,400	18.00	2,671,200.00
	TENAGA NATIONAL BHD	581,775	14.00	8,144,850.00
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	2.49	2,023,623.00

	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	599,280	4.20	2,516,976.00	
	マレーシアリングット 小計	16,232,410		93,086,949.95 (3,198,700,317)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	308,100	108.00	33,274,800.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	30.25	50,959,150.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	170.50	22,233,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	804,900	30.50	24,549,450.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	24.10	20,459,405.80	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	6.40	5,376,864.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	11.00	8,716,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	1,076,400	44.50	47,899,800.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	234,477	18.90	4,431,615.30	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	21.90	12,185,160.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	20.00	37,762,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	112,700	136.00	15,327,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	157.50	20,979,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	658,650	21.60	14,226,840.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	117.50	17,766,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.88	16,407,136.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	636,300	106.00	67,447,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	284.00	57,879,200.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	11.00	22,171,798.00	
GULF DEVELOPMENT PCL-NVDR	921,078	39.75	36,612,850.50		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	48.25	18,257,800.00		
	タイバーツ 小計	23,102,996		554,923,469.60 (2,486,057,143)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	595.00	32,373,950.00	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	905.00	32,837,925.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	185,130	441.00	81,642,330.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	101,010	229.00	23,131,290.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	334,802	123.00	41,180,646.00	
	BDO UNIBANK INC	467,498	153.40	71,714,193.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	73.80	40,226,682.60	
	PLDT INC	20,460	1,235.00	25,268,100.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	545.00	28,983,100.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	28.30	36,249,470.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,953,350	24.60	48,052,410.00	
	フィリピンペソ 小計	5,032,102		461,660,096.80 (1,190,621,389)	
インドネシアルピア	ALAMTRI RESOURCES INDONESIA	2,162,300	1,740.00	3,762,402,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	300,900	21,975.00	6,612,277,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	8,750.00	9,656,500,000.00	

	BARITO PACIFIC TBK PT	2,895,911	1,740.00	5,038,885,140.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK	1,670,900	10,050.00	16,792,545,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,877,300	4,720.00	18,300,856,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	184,639,904	59.00	10,893,754,336.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,370.00	7,438,719,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,553,300	4,860.00	7,549,038,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	10,525.00	6,308,685,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	8,175.00	11,476,065,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,510.00	6,324,635,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	10,195,000	8,500.00	86,657,500,000.00	
	BANK MANDIRI	6,951,792	4,710.00	32,742,940,320.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	4,000.00	10,338,400,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	13,230,502	3,680.00	48,688,247,360.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	2,670.00	23,758,995,000.00	
	インドネシアルピア 小計	249,394,909		312,340,444,656.00 (2,811,064,001)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	8,180	136,200.00	1,114,116,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	63,500.00	405,574,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	14,044	116,500.00	1,636,126,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	918	853,000.00	783,054,000.00	
	LG CHEM LTD	9,272	260,000.00	2,410,720,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	15,252	312,000.00	4,758,624,000.00	
	SKC CO LTD	5,899	101,400.00	598,158,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	56,600.00	684,746,800.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	64,400.00	5,280,993,200.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	100,800.00	829,785,600.00	
	ECOPRO CO LTD	15,978	44,800.00	715,814,400.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	6,696	850,000.00	5,691,600,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	20,849	78,100.00	1,628,306,900.00	
	HANWHA SYSTEMS CO LTD	15,000	55,600.00	834,000,000.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	4,767	452,000.00	2,154,684,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	4,937	395,000.00	1,950,115,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	9,215	327,500.00	3,017,912,500.00	
	HYUNDAI ROTEM COMPANY	14,500	195,700.00	2,837,650,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	86,900.00	1,165,850,400.00	
	LG CORP	16,658	82,200.00	1,369,287,600.00	
	LG ENERGY SOLUTION	8,760	305,000.00	2,671,800,000.00	
	LS ELECTRIC CO LTD	3,284	272,500.00	894,890,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	123,200.00	586,185,600.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD-RIGHTS	564	37,200.00	20,980,800.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	50,800.00	439,267,600.00	
	SAMSUNG C&T CORP	15,406	170,700.00	2,629,804,200.00	

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	122,169	17,770.00	2,170,943,130.00	
SK INC	6,394	224,000.00	1,432,256,000.00	
SK SQUARE CO LTD	19,731	181,200.00	3,575,257,200.00	
HMM CO LTD	49,545	24,750.00	1,226,238,750.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5,586	142,100.00	793,770,600.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	23,850.00	639,704,700.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	18,150	43,600.00	791,340,000.00	
HYUNDAI MOBIS	11,968	309,500.00	3,704,096,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	27,902	209,500.00	5,845,469,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	161,400.00	975,178,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	158,000.00	544,942,000.00	
KIA CORP	45,204	99,600.00	4,502,318,400.00	
COWAY CO LTD	9,036	100,200.00	905,407,200.00	
LG ELECTRONICS INC	23,622	73,700.00	1,740,941,400.00	
HANJIN KAL CORP	7,812	122,500.00	956,970,000.00	
HYBE CO LTD	4,975	277,000.00	1,378,075,000.00	
KAKAO CORP	57,020	60,500.00	3,449,710,000.00	
KRAFTON INC	6,265	360,000.00	2,255,400,000.00	
NAVER CORP	29,113	254,000.00	7,394,702,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	254,000.00	467,106,000.00	
KT&G CORP	19,456	137,400.00	2,673,254,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	121,600.00	382,067,200.00	
SAMYANG FOODS CO LTD	800	1,479,000.00	1,183,200,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	7,343	134,700.00	989,102,100.00	
LG H&H CO LTD	1,321	322,000.00	425,362,000.00	
HLB INC	23,903	49,400.00	1,180,808,200.00	
ALTEOGEN INC	7,824	423,500.00	3,313,464,000.00	
CELLTRION INC	30,352	176,100.00	5,344,987,200.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	1,018,000.00	3,422,516,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	8,337	93,800.00	782,010,600.00	
YUHAN CORPORATION	13,854	109,200.00	1,512,856,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	57,891	94,100.00	5,447,543,100.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	51,330	20,150.00	1,034,299,500.00	
KAKAObANK CORP	35,459	30,250.00	1,072,634,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	71,042	118,400.00	8,411,372,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	69,800.00	5,621,901,400.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	130,814	24,900.00	3,257,268,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	12,058	151,800.00	1,830,404,400.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	117,000.00	1,986,075,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	22,100.00	685,431,500.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	21,850.00	264,537,950.00	
DB INSURANCE CO LTD	10,074	133,400.00	1,343,871,600.00	

	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	478,500.00	2,939,904,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	15,131	133,000.00	2,012,423,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	166,500.00	1,212,786,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	51,846	9,280.00	481,130,880.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	148,600.00	400,625,600.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	11,233	135,400.00	1,520,948,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	922,794	60,400.00	55,736,757,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	165,389	50,500.00	8,352,144,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	11,714	170,100.00	1,992,551,400.00	
	LG UPLUS CORP	44,125	14,790.00	652,608,750.00	
	SK TELECOM	9,563	55,000.00	525,965,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	37,550.00	1,661,212,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	94,600.00	684,714,800.00	
	SK HYNIX INC	107,496	281,000.00	30,206,376,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,844,259		252,404,990,710.00 (26,881,131,510)	
新台幣ドル	ASIA CEMENT CORP	454,176	41.05	18,643,924.80	
	CHINA STEEL	2,373,261	18.90	44,854,632.90	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	22.70	12,304,784.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	797,824	34.20	27,285,580.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	950,752	27.45	26,098,142.40	
	TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	24.10	30,568,897.90	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	852.00	26,886,564.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	667,028	32.25	21,511,653.00	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	22,000	575.00	12,650,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	16,000	1,290.00	20,640,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	22.00	10,230,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	566,000	38.00	21,508,000.00	
	EVERGREEN MARINE	220,215	198.00	43,602,570.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	28.70	13,546,400.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	151,635	91.40	13,859,439.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	337,000	64.60	21,770,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	39.60	18,337,215.60	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	417.50	16,673,697.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	120.00	9,468,120.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	406.00	12,586,000.00	
	POU CHEN	273,780	28.70	7,857,486.00	
	INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	44,000	842.00	37,048,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	562.00	30,381,720.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	128,544	261.50	33,614,256.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	896,395	83.50	74,848,982.50	
	PHARMAESSENTIA CORP	44,000	522.00	22,968,000.00	

CHANG HWA COMMERCIAL BANK	1,227,846	19.85	24,372,743.10
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,317,237	43.90	145,626,704.30
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,917,109	34.20	99,765,127.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,240,618	29.40	65,874,169.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,052,544	28.00	57,471,232.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,421,069	41.95	101,563,844.55
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,381,230	24.65	58,697,319.50
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,080,677	16.25	33,811,001.25
TAIWAN BUSINESS BANK	1,732,572	15.95	27,634,523.40
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,139,268	25.20	53,909,553.60
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	45.95	31,704,810.75
CHAILEASE HOLDING CO LTD	297,253	128.50	38,197,010.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,958,218	31.40	61,488,045.20
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,882,057	61.10	114,993,682.70
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,578,623	80.30	126,763,426.90
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	3,176,226	14.85	47,166,956.10
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,157,158	11.15	35,202,311.70
ACCTON TECHNOLOGY CORP	98,000	796.00	78,008,000.00
ACER INC	617,803	29.75	18,379,639.25
ADVANTECH CO LTD	98,261	342.00	33,605,262.00
ASIA VITAL COMPONENTS	55,000	811.00	44,605,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	142,092	641.00	91,080,972.00
AUO CORP	1,268,072	12.50	15,850,900.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	209.50	24,867,650.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	29.10	23,447,616.00
DELTA ELECTRONICS INC	377,903	451.00	170,434,253.00
E INK HOLDINGS INC	174,000	220.00	38,280,000.00
ELITE MATERIAL CO LTD	60,000	957.00	57,420,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	99,000	278.50	27,571,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,443,248	161.00	393,362,928.00
INNOLUX CORP	1,562,106	11.65	18,198,534.90
INVENTEC CO LTD	455,511	44.00	20,042,484.00
LARGAN PRECISION CO LTD	20,040	2,185.00	43,787,400.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	423,452	116.50	49,332,158.00
LOTES CO LTD	17,000	1,410.00	23,970,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	133,000	142.00	18,886,000.00
PEGATRON CORP	340,474	78.60	26,761,256.40
QUANTA COMPUTER INC	533,270	276.00	147,182,520.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	67.50	13,641,750.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	252,000	122.50	30,870,000.00
WISTRON CORP	507,000	120.50	61,093,500.00
WIWYNN CORP	21,000	2,560.00	53,760,000.00

	WPG HOLDINGS LTD	260,692	72.10	18,795,893.20	
	YAGEO CORPORATION	77,172	490.50	37,852,866.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	113.50	15,654,147.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	734,315	128.00	93,992,320.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	336,000	80.70	27,115,200.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	345,200	106.50	36,763,800.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	17,000	3,365.00	57,205,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	638,315	146.50	93,513,147.50	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,450.00	29,400,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,225.00	15,925,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	307.50	12,915,000.00	
	JENTECH PRECISION INDUSTRIAL	17,000	1,465.00	24,905,000.00	
	MEDIATEK INC	297,804	1,355.00	403,524,420.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	106,045	509.00	53,976,905.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	574.00	49,331,856.00	
	SILERGY CORP	53,000	343.50	18,205,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,804,389	1,090.00	5,236,784,010.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,196,000	43.90	96,404,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	205,205	91.70	18,817,298.50	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	29.65	8,274,633.05	
	新台湾ドル 小計	68,121,168		9,627,782,449.45 (48,160,093,368)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	348.65	104,561,529.60	
	COAL INDIA LTD	345,479	387.55	133,890,386.45	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	445.05	83,771,316.45	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	150.10	89,615,103.60	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	655,148	243.35	159,430,265.80	
	OIL INDIA LTD	92,949	445.30	41,390,189.70	
	PETRONET LNG LTD	170,856	305.60	52,213,593.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,185,776	1,519.05	1,801,253,032.80	
	AMBUJA CEMENTS LTD	115,533	590.75	68,251,119.75	
	APL APOLLO TUBES LTD	35,431	1,707.90	60,512,604.90	
	ASIAN PAINTS LTD	73,203	2,498.75	182,915,996.25	
	COROMANDEL INTERNATIONAL LTD	25,000	2,302.40	57,560,000.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	53,343	2,798.95	149,304,389.85	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	673.60	166,305,104.00	
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	680.85	37,018,495.35	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	945.10	65,943,407.40	
	JSW STEEL LTD	113,332	1,040.55	117,927,612.60	
	NMDC LTD	438,783	67.89	29,788,977.87	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	4,168.25	53,341,095.25	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	3,049.60	88,926,336.00	

SHREE CEMENT LTD	1,387	31,627.95	43,867,966.65
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	6,135	16,501.35	101,235,782.25
SRF LTD	33,773	3,279.05	110,743,355.65
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	4,195.05	42,000,840.60
TATA STEEL LTD	1,529,624	159.00	243,210,216.00
ULTRATECH CEMENT LTD	23,740	12,564.40	298,278,856.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	84,651	664.95	56,288,682.45
VEDANTA LTD	252,749	440.80	111,411,759.20
ABB LTD INDIA	11,720	5,899.40	69,140,968.00
ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	2,582.35	86,896,077.50
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	250.90	60,711,025.70
ASTRAL LTD	19,918	1,491.55	29,708,692.90
BHARAT ELECTRONICS LTD	719,275	417.80	300,513,095.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	262.00	39,772,386.00
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	117,125	671.65	78,667,006.25
CUMMINS INDIA LTD	26,968	3,520.95	94,952,979.60
HAVELLS INDIA LTD	45,666	1,524.25	69,606,400.50
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	41,849	5,006.75	209,527,480.75
LARSEN & TOUBRO LTD	128,675	3,578.10	460,412,017.50
POLYCAB INDIA LTD	9,354	6,713.45	62,797,611.30
RAIL VIKAS NIGAM LTD	120,000	385.20	46,224,000.00
SIEMENS INDIA LTD	16,262	3,218.75	52,343,312.50
SUZLON ENERGY LTD	1,850,000	65.92	121,952,000.00
THERMAX LTD	7,627	3,425.55	26,126,669.85
VOLTAS LTD	40,000	1,367.40	54,696,000.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	52,993	785.60	41,631,300.80
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,443.05	150,917,055.10
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	33,068	615.30	20,346,740.40
GMR AIRPORTS LTD	394,498	92.80	36,609,414.40
INTERGLOBE AVIATION LTD	38,959	5,846.55	227,775,741.45
BAJAJ AUTO LTD	13,012	8,358.00	108,754,296.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	14,831	2,620.60	38,866,118.60
BHARAT FORGE LTD	51,953	1,261.45	65,536,111.85
BOSCH LTD	1,235	35,810.50	44,225,967.50
EICHER MOTORS LTD	26,253	5,695.70	149,529,212.10
HERO MOTOCORP LTD	21,431	4,334.80	92,899,098.80
HYUNDAI MOTOR INDIA LTD	30,000	2,091.65	62,749,500.00
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	185,509	3,177.05	589,371,368.45
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,468.60	303,610,410.00
MRF LTD	432	150,879.30	65,179,857.60
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	709,401	154.80	109,815,274.80
SONA BLW PRECISION FORGINGS	99,289	456.15	45,290,677.35

TATA MOTORS LTD	414,915	692.85	287,473,857.75
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,896.80	61,273,113.60
TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,839.00	117,120,106.00
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	7,886	15,711.65	123,902,071.90
KALYAN JEWELLERS INDIA LTD	82,000	578.85	47,465,700.00
PAGE INDUSTRIES LTD	886	48,656.00	43,109,216.00
TITAN CO LTD	68,531	3,431.45	235,160,699.95
ETERNAL LTD	934,742	264.50	247,239,259.00
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	750.05	123,380,974.85
JUBILANT FOODWORKS LTD	68,930	683.10	47,086,083.00
INFO EDGE INDIA LTD	71,780	1,446.00	103,793,880.00
FSN E-COMMERCE VENTURES LTD	220,000	213.50	46,970,000.00
TRENT LTD	37,950	5,406.20	205,165,290.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	35,422	4,189.55	148,402,240.10
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,883.55	130,355,933.80
ITC LTD	555,447	419.35	232,926,699.45
MARICO LTD	81,711	729.80	59,632,687.80
NESTLE INDIA LIMITED	69,268	2,427.00	168,113,436.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	110,239	1,097.45	120,981,790.55
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,370.90	80,307,322.00
VARUN BEVERAGES LTD	260,895	465.65	121,485,756.75
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,437.65	63,378,900.00
DABUR INDIA LTD	144,837	522.15	75,626,639.55
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	85,458	1,293.55	110,544,195.90
HINDUSTAN UNILEVER LTD	159,060	2,422.65	385,346,709.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	19,562	7,464.40	146,018,592.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	161,282	1,247.20	201,150,910.40
ALKEM LABORATORIES LTD	8,000	4,805.95	38,447,600.00
AUROBINDO PHARMA LTD	47,415	1,143.90	54,238,018.50
CIPLA LTD	109,546	1,491.80	163,420,722.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	6,991.75	153,343,061.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	107,605	1,269.55	136,609,927.75
LUPIN LTD	48,134	1,913.15	92,087,562.10
MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,525.30	46,200,363.50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	186,480	1,667.15	310,890,132.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	22,220	3,354.45	74,535,879.00
ZYDUS LIFESCIENCES LTD	70,000	978.30	68,481,000.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	825.50	76,034,328.50
AXIS BANK LTD	446,633	1,164.70	520,193,455.10
BANK OF BARODA	248,313	241.20	59,893,095.60
CANARA BANK	305,000	113.90	34,739,500.00
HDFC BANK LTD	1,101,464	2,010.60	2,214,603,518.40

ICICI BANK LTD	1,023,868	1,432.00	1,466,178,976.00
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	77.45	41,128,118.60
INDUSIND BANK LTD	108,365	840.80	91,113,292.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	214,844	2,228.35	478,747,627.40
PUNJAB NATIONAL BANK	573,845	111.00	63,696,795.00
STATE BANK OF INDIA	349,786	810.85	283,623,978.10
UNION BANK OF INDIA	238,889	144.60	34,543,349.40
YES BANK LTD	2,352,478	19.91	46,837,836.98
BAJAJ FINANCE LTD	524,760	940.40	493,484,304.00
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	2,025.95	155,108,757.95
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	6,545	13,854.25	90,676,066.25
BSE LTD	39,000	2,523.80	98,428,200.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,562.80	131,272,074.40
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	20,001	5,138.70	102,779,138.70
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	578,315	329.80	190,728,287.00
MUTHOOT FINANCE LTD	22,423	2,644.10	59,288,654.30
POWER FINANCE CORPORATION	265,755	417.70	111,005,863.50
REC LTD	246,323	391.55	96,447,770.65
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	934.35	56,710,373.25
SHRIRAM FINANCE LTD	273,475	680.65	186,140,758.75
SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	5,023.80	56,085,703.20
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	207,570	786.25	163,201,912.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	45,631	2,021.20	92,229,377.20
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	67,316	680.75	45,825,367.00
PB FINTECH LTD	74,767	1,854.35	138,644,186.45
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	84,736	1,814.80	153,778,892.80
HCL TECHNOLOGIES LTD	187,324	1,674.05	313,589,742.20
INFOSYS LTD	651,722	1,633.90	1,064,848,575.80
LTIMINDTREE LTD	15,699	5,328.60	83,653,691.40
MPHASIS LTD	19,317	2,863.00	55,304,571.00
ORACLE FINANCIAL SERVICES	4,194	8,937.90	37,485,552.60
PERSISTENT SYSTEMS LTD	23,160	5,721.40	132,507,624.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	174,114	3,384.35	589,262,715.90
TATA ELXSI LTD	7,679	6,149.20	47,219,706.80
TECH MAHINDRA LTD	109,797	1,615.20	177,344,114.40
WIPRO LTD	494,016	267.70	132,248,083.20
BHARTI AIRTEL LTD	502,386	2,018.00	1,013,814,948.00
INDUS TOWERS LTD	220,428	405.15	89,306,404.20
TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,760.25	34,895,196.00
VODAFONE IDEA LTD	4,326,724	7.26	31,412,016.24
ADANI POWER LTD	167,705	602.20	100,991,951.00
GAIL INDIA LTD	504,548	185.05	93,366,607.40

	JSW ENERGY LTD	63,163	515.50	32,560,526.50
	NHPC LTD	546,313	88.28	48,228,511.64
	NTPC LTD	848,361	343.80	291,666,511.80
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	900,980	299.60	269,933,608.00
	TATA POWER CO LTD	285,870	400.45	114,476,641.50
	TORRENT POWER LTD	28,990	1,426.95	41,367,280.50
	DLF LTD	162,687	829.75	134,989,538.25
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,254.45	67,096,940.90
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	54,942	1,391.25	76,438,057.50
	OBEROI REALTY LTD	25,000	1,832.75	45,818,750.00
	PHOENIX MILLS LTD	34,560	1,519.50	52,513,920.00
	PRESTIGE ESTATES PROJECTS	28,897	1,649.35	47,661,266.95
	インドルピー 小計	37,406,610		26,492,952,830.03 (45,302,949,339)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	109,914	15.37	1,689,378.18
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	4.85	2,278,660.23
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.34	1,762,221.52
	INDUSTRIES QATAR	282,919	12.59	3,561,950.21
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.57	2,430,582.43
	DUKHAN BANK	319,751	3.67	1,175,084.92
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.32	2,651,994.32
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	11.05	2,370,589.65
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	22.77	7,634,803.77
	QATAR NATIONAL BANK	919,483	17.48	16,072,562.84
	OOREDOO QSC	192,800	12.61	2,431,208.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	16.16	1,559,633.92
	BARWA REAL ESTATE CO	507,490	2.74	1,393,060.05
	カタールリアル 小計	6,430,211		47,011,730.04 (1,887,991,078)
南アフリカランド	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	97,443	820.71	79,972,444.53
	GOLD FIELDS LTD	176,906	425.08	75,199,202.48
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	253.15	25,279,812.15
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	169.79	25,612,312.13
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	297.64	5,261,977.56
	SASOL LTD	88,115	92.26	8,129,489.90
	VALTERRA PLATINUM LIMITED	41,391	826.12	34,193,932.92
	BIDVEST GROUP LTD	68,303	239.87	16,383,840.61
	NASPERS LTD-N SHS	32,598	5,468.47	178,261,185.06
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	28.00	13,316,184.00
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	50.93	8,979,773.88
	BID CORP LTD	58,066	454.90	26,414,223.40
	CLICKS GROUP LTD	35,422	366.75	12,991,018.50

	SHOPRITE HOLDINGS LTD	106,002	279.88	29,667,839.76	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	117.14	6,581,159.48	
	ABSA GROUP LTD	165,135	177.62	29,331,278.70	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	17,205	3,528.47	60,707,326.35	
	NEDBANK GROUP LTD	88,111	240.00	21,146,640.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	227.48	55,266,038.52	
	FIRSTSTRAND LTD	984,111	75.64	74,438,156.04	
	REINET INVESTMENTS SCA	26,187	528.55	13,841,138.85	
	REMGRO LTD	94,679	173.24	16,402,189.96	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	220.80	21,810,403.20	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.21	11,900,549.76	
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	79.00	18,791,256.00	
	SANLAM LTD	307,490	88.02	27,065,269.80	
	MTN GROUP LTD	350,498	143.64	50,345,532.72	
	VODACOM GROUP	166,454	140.57	23,398,438.78	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	114,897	135.69	15,590,373.93	
	南アフリカランド 小計	5,549,724		986,278,988.97 (8,097,350,499)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	ADNOC DRILLING CO PJSC	650,000	5.80	3,770,000.00	
	ADNOC GAS PLC	1,340,000	3.39	4,542,600.00	
	MULTIPLY GROUP	519,646	2.37	1,231,561.02	
	SALIK CO PJSC	450,000	6.04	2,718,000.00	
	AMERICANA RESTAURANTS INTL-FOREIGN CO	431,446	2.23	962,124.58	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	714,022	3.69	2,634,741.18	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	531,430	14.00	7,440,020.00	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	280,781	22.40	6,289,494.40	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	9.30	4,883,839.20	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	24.35	8,709,970.65	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	839,207	16.80	14,098,677.60	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	692,138	17.90	12,389,270.20	
	DUBAI ELECTRICITY & WATER AU	1,295,919	2.83	3,667,450.77	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	9.25	6,713,936.75	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	230,000	13.90	3,197,000.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,316,221	14.00	18,427,094.00	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	10,899,484		101,675,780.35 (4,046,696,057)	
クウェートディ ナル	BOUBYAN BANK K.S.C	295,857	0.71	212,721.18	
	GULF BANK	381,082	0.35	134,140.86	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	2,263,737	0.80	1,824,572.02	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,569,200	1.02	1,600,584.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.49	147,227.68	
	MABANEE CO KPSC	159,354	0.88	141,346.99	

	クウェートディナール 小計	4,966,060		4,060,592.73 (1,949,977,840)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.12	897,804.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	37.50	3,337,500.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	10.26	656,640.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	5.99	536,105.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	400,000	8.58	3,432,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	19.18	1,845,116.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	6.77	538,892.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	10.82	107,118.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	40,365	12.33	497,700.45	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	33.95	950,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	6.98	1,146,814.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	22.42	660,044.80	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	7.05	2,604,975.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	12.27	1,131,294.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	24.55	510,640.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	34.53	386,736.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	18.35	455,557.10	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	207,100	14.08	2,915,968.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	49.00	1,097,600.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.82	839,020.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	5.47	328,200.00	
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	8.48	189,104.00	
	LB GROUP CO LTD-A	15,300	16.56	253,368.00	
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	15.94	1,262,448.00	
	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	17.43	829,668.00	
	RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	328,450	8.50	2,791,825.00	
	SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	17.35	962,491.25	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	77,252	31.40	2,425,712.80	
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	21.27	381,583.80	
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.85	1,103,410.00	
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	18.48	300,115.20	
	TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	33.18	378,252.00	
	TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.33	1,104,228.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	54.44	2,193,932.00		
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	50.31	829,360.35		
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	28.89	118,449.00		
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	41.56	1,554,344.00		
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	27.55	3,564,970.00		
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	21.62	753,413.76		
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	18.90	5,085,990.00		

AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	36.82	419,748.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	38.21	592,255.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	26.80	225,120.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	32.52	1,795,591.80
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.27	1,369,037.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	7.70	1,771,770.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.98	3,363,152.00
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	33.06	476,725.20
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	270.80	14,834,424.00
CRRC CORP LTD-A	185,800	7.23	1,343,334.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	17.20	743,040.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	45.03	1,777,469.19
GEM CO LTD-A	289,800	6.29	1,822,842.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	10.20	205,132.20
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	30.04	174,232.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	71.03	813,719.68
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	14.29	587,319.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	39.46	1,898,026.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.03	1,002,627.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	22.09	1,855,118.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	11,642	54.59	635,536.78
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	50.81	636,852.54
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.98	812,736.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	191,900	19.11	3,667,209.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	7.33	3,567,511.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	62.64	1,778,537.52
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	9.48	237,568.80
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	14,000	73.35	1,026,900.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	19.51	794,057.00
TBEA CO LTD-A	29,274	12.46	364,754.04
WEICHAJ POWER CO LTD-A	43,200	15.16	654,912.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	8.24	1,643,056.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	23.10	729,960.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	38.38	284,395.80
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	25.47	185,931.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.31	585,531.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	29.84	328,240.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.52	1,698,768.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	817,100	5.74	4,690,154.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.82	152,800.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	15.23	2,794,705.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	6.68	1,072,140.00

S F HOLDING CO LTD-A	53,100	47.67	2,531,277.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	31.69	168,559.11
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	12.70	707,390.00
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	49.07	741,938.40
BYD CO LTD -A	20,300	325.80	6,613,740.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	122.05	1,098,450.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	12.76	553,171.52
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	56.80	1,050,800.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.29	627,347.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	102.48	860,832.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	66,265	43.91	2,909,696.15
SAIC MOTOR CORP LTD-A	87,536	17.23	1,508,245.28
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	58.20	162,960.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	46.20	2,009,700.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	71.80	3,647,440.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	57.46	442,442.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	25.29	2,556,819.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	52.30	418,400.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	18.90	463,050.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.78	1,084,532.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	21.64	352,732.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	61.18	1,267,649.60
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	17,035	24.44	416,335.40
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	34.25	366,475.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	137.29	219,664.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	40.22	736,026.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	55.33	437,107.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	38.60	2,086,600.20
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	57.20	972,400.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	24.62	1,934,639.60
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	94,302	27.69	2,611,222.38
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	38.90	672,970.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	65.37	594,867.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	15,000	1,418.88	21,283,200.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	114.36	2,104,224.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	93,558	45.10	4,219,465.80
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	9.62	257,816.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	178.28	1,672,266.40
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	17.50	667,800.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	121.60	5,046,400.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	29.52	298,152.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	12.31	1,129,430.19

GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	26.50	424,000.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	39.61	385,009.20
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	214.48	3,195,752.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	99,816	19.69	1,965,377.04
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	35.57	1,010,188.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	60.41	633,519.67
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	101.51	223,322.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	17,238	31.13	536,618.94
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	20.00	297,000.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	51.00	1,131,843.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	57.58	460,640.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	15.79	297,641.50
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	171.35	498,971.20
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	57.19	6,811,443.38
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.92	443,572.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	45.29	317,030.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	33.44	375,598.08
WUXI APPTec CO LTD-A	36,464	69.70	2,541,540.80
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	56.04	557,037.60
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	198.12	772,668.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	6.20	6,399,020.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	308,000	7.25	2,233,000.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	20.49	3,225,126.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	8.22	4,207,818.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	17.30	1,949,710.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	12.32	2,830,396.80
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	11.80	1,740,500.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	28.10	1,638,230.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	195,500	11.23	2,195,465.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	9.82	1,226,518.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	4.43	3,700,379.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	280,400	47.13	13,215,252.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	5.27	1,441,872.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	3.78	1,516,460.40
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	8.44	1,007,736.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	678,600	7.85	5,327,010.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	25.08	5,153,940.00
PING AN BANK CO LTD-A	269,400	12.84	3,459,096.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.76	815,040.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	14.17	6,196,541.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.77	855,138.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	8.00	458,640.00

CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.98	138,902.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.51	397,417.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	118,630	17.46	2,071,279.80
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	27.81	3,923,434.80
CSC FINANCIAL CO LTD-A	123,800	24.16	2,991,008.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	177,427	22.93	4,068,401.11
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	17.84	64,224.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	17.18	1,041,108.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	11.67	2,626,917.00
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO	182,300	19.28	3,514,744.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	7.95	1,208,797.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	272.23	1,470,042.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	18.02	567,630.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.23	711,902.10
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.74	395,210.24
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	5.06	1,048,432.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	8.92	2,743,792.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	4.44	506,160.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.92	477,204.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.59	2,074,532.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	37.10	3,717,420.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	148,200	55.90	8,284,380.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	86,900	10.02	870,738.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	269.96	1,302,017.08
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	45.11	1,455,519.26
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	33.78	559,464.36
IFLYTEK CO LTD - A	25,800	46.82	1,207,956.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	23.57	269,570.09
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	12.99	171,078.30
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	38.32	1,452,328.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	3.98	2,446,108.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	31.89	892,920.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.33	498,684.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	26.60	4,391,660.00
GOERTEK INC -A	26,900	22.59	607,671.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	8.92	446,000.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	51.28	1,010,831.36
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	56,800	22.69	1,288,792.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	125,050	35.30	4,414,265.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	70.85	122,428.80
NINESTAR CORP-A	18,543	23.99	444,846.57
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	32.83	797,769.00

SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	6,188	118.09	730,740.92
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	77.36	696,936.24
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	46.42	1,322,970.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	712,200	4.37	3,112,314.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	23.98	439,793.20
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	34.55	145,110.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	10.09	541,933.90
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	34.63	545,422.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	15.83	479,649.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	145.30	1,769,754.00
ZTE CORP-A	76,400	32.86	2,510,504.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	5.43	2,295,804.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	293,800	9.47	2,782,286.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.32	1,042,416.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	29.98	9,889,802.40
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	19.20	1,067,520.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.87	1,537,459.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	14.88	2,632,272.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	92,300	16.16	1,491,568.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	182.36	1,294,208.92
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	71.65	726,387.70
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	4,422	535.00	2,365,770.00
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	46.50	977,988.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	119.47	749,315.84
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	14.21	421,113.35
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	102,500	24.76	2,537,900.00
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	135.39	5,567,913.75
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	66.57	499,275.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	10.74	367,329.48
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	33.18	988,764.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	122,986	5.48	673,963.28
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	16.37	1,642,565.80
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	81.00	1,705,455.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	8,235	331.15	2,727,020.25
OMNIVISION INTEGRATED CIRCUITS-A	15,290	123.50	1,888,315.00
SG MICRO CORP-A	5,323	69.72	371,119.56
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	8.17	301,268.75
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.76	319,640.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	24.96	560,751.36
TONGWEI CO LTD-A	66,600	20.27	1,349,982.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	15.61	396,774.98
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	65.19	447,138.21

	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	27.84	473,892.48	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	8.98	491,206.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	414,800	6.54	2,712,792.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.64	1,902,992.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	8.15	666,670.00	
	オフショア人民元 小計	27,286,079		428,403,172.14 (8,703,524,525)	
サウジアラビア リアル	ADES HOLDING CO	80,157	13.15	1,054,064.55	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	1,182,457	24.88	29,419,530.16	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	46,413	112.10	5,202,897.30	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	80,241	19.27	1,546,244.07	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	257,844	55.20	14,232,988.80	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	104.70	978,840.30	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	184,537	56.00	10,334,072.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	76,790	16.89	1,296,983.10	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	4.93	509,914.83	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	30.04	1,534,413.16	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	186.30	1,147,421.70	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	193.90	815,737.30	
	JARIR MARKETING CO	125,000	12.67	1,583,750.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	129.60	833,457.60	
	ALMARAI CO	102,845	49.00	5,039,405.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	129.50	884,873.50	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	267.00	4,378,533.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	78.20	1,245,256.80	
	AL RAJHI BANK	382,348	96.25	36,800,995.00	
	ALINMA BANK	250,177	26.68	6,674,722.36	
	ARAB NATIONAL BANK	195,935	21.84	4,279,220.40	
	BANK AL-JAZIRA	152,958	12.66	1,936,448.28	
	BANK ALBILAD	134,552	26.88	3,616,757.76	
	BANQUE SAUDI FRANSI	196,694	17.99	3,538,525.06	
	RIYAD BANK	293,961	28.56	8,395,526.16	
	SAUDI AWWAL BANK	191,132	33.86	6,471,729.52	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	14.62	1,290,946.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	563,249	37.06	20,874,007.94	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	183.50	2,010,609.50	
	AL RAJHI CO FOR CO-OPERATIVE	7,596	121.70	924,433.20	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	178.00	2,531,694.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	155.50	2,589,852.50	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	263.60	1,164,321.20		
ELM CO	5,241	964.00	5,052,324.00		
ETIHAD ETISALAT CO	71,844	59.55	4,278,310.20		

	SAUDI TELECOM CO	397,711	42.70	16,982,259.70	
	ACWA POWER CO	27,153	249.00	6,761,097.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	14.99	2,430,013.91	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	20.03	2,022,849.73	
	JABAL OMAR DEVELOPMENT CO	102,723	20.86	2,142,801.78	
	MAKKAH CONSTRUCTION & DEVEPL	16,801	91.40	1,535,611.40	
	サウジアラビアリアル 小計	5,743,823		226,343,439.77	(8,825,130,716)
	合 計	721,160,450		249,743,919,876	(249,743,919,876)

(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	マレーシア リンギット	YTL CORPORATION BERHAD-WRT 991231	162,540.00	-	
		マレーシアリンギット 小計	162,540.00	-	(-)
新株予約権証券合計				-	(-)
投資信託受益証券	メキシコペ ソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	16,311,694.40	
		メキシコペソ 小計	97,360	16,311,694.40	(127,961,980)
	ブラジルレ アル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	246,400	10,141,824.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,744,336.00	
		KLABIN SA-UNIT	213,800	3,957,438.00	
ブラジルリアル 小計	497,600	15,843,598.00	(414,562,000)		
投資信託受益証券合計			594,960	542,523,980	(542,523,980)
投資証券	メキシコペ ソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	16,398,064.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	216,346	15,475,229.38	
	メキシコペソ 小計	830,046	31,873,293.38	(250,039,611)	
投資証券合計			830,046	250,039,611	(250,039,611)
合計				792,563,591	(792,563,591)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 22銘柄	100.0%				2.5%
メキシコペソ	株式 20銘柄	92.3%				1.8%
	投資信託受益証券 1銘柄			2.6%		0.1%
	投資証券 2銘柄				5.1%	0.1%
ブラジルレアル	株式 38銘柄	95.5%				3.5%
	投資信託受益証券 3銘柄			4.5%		0.2%
チリペソ	株式 11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 9銘柄	100.0%				0.7%
トルコリラ	株式 16銘柄	100.0%				0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%				0.2%
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 16銘柄	100.0%				1.2%
ロシアルーブル	株式 14銘柄					
香港ドル	株式 154銘柄	100.0%				23.1%
マレーシアリンギット	株式 30銘柄	100.0%				1.3%
	新株予約権証券 1銘柄					
タイバーツ	株式 21銘柄	100.0%				1.0%
フィリピンペソ	株式 11銘柄	100.0%				0.5%
インドネシアルピア	株式 17銘柄	100.0%				1.1%
韓国ウォン	株式 82銘柄	100.0%				10.7%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%				19.2%
インドルピー	株式 158銘柄	100.0%				18.1%
カタールリアル	株式 13銘柄	100.0%				0.8%
南アフリカランド	株式 29銘柄	100.0%				3.2%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式 16銘柄	100.0%				1.6%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%				0.8%
オフショア人民元	株式 255銘柄	100.0%				3.5%
サウジアラビアリアル	株式 41銘柄	100.0%				3.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,836,832,057
コール・ローン	900,638,924
国債証券	169,050,436,861
派生商品評価勘定	15,981,601
未収入金	11,080,772
未収利息	2,619,101,137
前払費用	236,849,033
流動資産合計	174,670,920,385
資産合計	174,670,920,385
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,729,001
未払金	1,003,527,978
未払解約金	52,588,547
流動負債合計	1,073,845,526
負債合計	1,073,845,526
純資産の部	
元本等	
元本	71,055,447,890
剰余金	
剰余金又は欠損金()	102,541,626,969
元本等合計	173,597,074,859
純資産合計	173,597,074,859
負債純資産合計	174,670,920,385

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 7月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2025年 7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。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	71,055,447,890口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,4431円 (24,431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

2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	64,719,230,900円
期中追加設定元本額	10,309,117,269円
期中一部解約元本額	3,972,900,279円
期末元本額	71,055,447,890円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	3,324,840,765円
世界経済インデックスファンド	29,464,481,852円
D C 新興国債券インデックス・オープン	6,268,540,531円
D C 世界経済インデックスファンド	16,538,768,073円
新興国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	2,309,515円
分散投資コア戦略ファンドA	650,842,343円
分散投資コア戦略ファンドS	1,312,489,912円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	959,979,759円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,948,624,501円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	234,368,879円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	106,587,073円
S M T インデックスバランス・オープン	160,950,571円
S M T 世界経済インデックス・オープン	668,039,184円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	984,710,037円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,458,585,100円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	17,266,153円
グローバル経済コア	1,727,454,724円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	168,007,379円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	161,500,092円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,576,810円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	91,244,880円
M y S M T 新興国債券インデックス（ノーロード）	481,136,852円
10資産分散投資ファンド	59,385,196円
グローバル10資産バランスファンド	72,175,304円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	307,741,065円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	168,149,104円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	47,895円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	26,640円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	26,684円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	37,399円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	26,640円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	34,749円
S M T A M 海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	215,702,463円
S M T A M 海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	214,309,330円
S M T A M 海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	212,480,436円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7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	2,857,476,504
合計	2,857,476,504

(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

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,128,484,858	-	2,120,394,130	8,090,728
	メキシコペソ	184,322,244	-	184,609,092	286,848
	ブラジルリアル	535,618,988	-	523,030,482	12,588,506
	トルコリラ	24,340,757	-	24,299,594	41,163
	チェココルナ	91,959,493	-	91,904,841	54,652
	ハンガリーフォロント	41,341,572	-	41,385,131	43,559
	ポーランドズロチ	139,333,553	-	139,180,245	153,308
	マレーシアリングット	181,356,757	-	180,678,370	678,387
	タイバーツ	157,617,318	-	157,464,060	153,258
	南アフリカランド	134,592,615	-	134,273,288	319,327
	オフショア人民元	638,001,561	-	643,569,027	5,567,466
	売建	1,369,452,076	-	1,363,108,748	6,343,328
	アメリカドル	1,369,452,076	-	1,363,108,748	6,343,328
合計		3,497,936,934	-	3,483,502,878	1,747,400

(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。

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	63,800,000.00	66,860,002.39	
		MBONO 5.5% 03/04/27	195,000,000.00	187,108,451.40	
		MBONO 5.75% 03/05/26	100,300,000.00	98,650,568.50	
		MBONO 7.5% 05/26/33	152,000,000.00	138,423,869.20	
		MBONO 7.5% 06/03/27	159,000,000.00	157,095,698.34	
		MBONO 7.75% 05/29/31	221,800,000.00	211,531,744.60	
		MBONO 7.75% 11/13/42	183,000,000.00	150,583,240.92	
		MBONO 7.75% 11/23/34	176,100,000.00	159,634,421.07	
		MBONO 7% 09/03/26	180,600,000.00	178,270,279.86	
		MBONO 8.5% 02/28/30	93,000,000.00	92,413,658.25	
		MBONO 8.5% 03/01/29	204,000,000.00	203,378,911.80	

	MBONO 8.5% 05/31/29	154,600,000.00	154,038,131.03	
	MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	89,730,070.34	
	MBONO 8% 05/24/35	20,000,000.00	18,723,467.80	
	MBONO 8% 07/31/53	167,500,000.00	137,298,209.00	
	MBONO 8% 11/07/47	175,700,000.00	145,244,478.26	
	メキシコペソ 小計	2,344,700,000.00	2,188,985,202.76 (17,172,151,118)	
ブラジルレアル	BLTN 0% 01/01/28	11,400,000.00	8,349,352.93	
	BLTN 0% 01/01/29	69,000,000.00	44,654,876.28	
	BLTN 0% 01/01/30	38,200,000.00	21,774,994.34	
	BLTN 0% 01/01/32	19,000,000.00	8,321,116.31	
	BLTN 0% 07/01/26	90,000,000.00	78,778,560.60	
	BLTN 0% 07/01/27	59,500,000.00	46,225,188.24	
	BLTN 0% 07/01/28	23,000,000.00	15,876,729.57	
	BNTNF 10% 01/01/27	53,800,000.00	51,053,224.91	
	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000.00	46,895,040.88	
	BNTNF 10% 01/01/31	49,850,000.00	43,306,457.74	
	BNTNF 10% 01/01/33	40,900,000.00	34,385,486.89	
	BNTNF 10% 01/01/35	20,000,000.00	16,278,408.81	
	ブラジルレアル 小計	526,050,000.00	415,899,437.50 (10,882,383,091)	
チリペソ	BTPCL 0% 04/01/29	1,700,000,000.00	1,415,105,908.00	
	BTPCL 0% 05/06/27	3,800,000,000.00	3,474,636,780.00	
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,290,000,000.00	2,224,005,651.03	
	BTPCL 5.3% 11/01/37	1,200,000,000.00	1,171,847,491.20	
	BTPCL 5.8% 10/01/29	670,000,000.00	683,640,924.63	
	BTPCL 5% 03/01/35	2,660,000,000.00	2,552,737,667.90	
	BTPCL 5% 10/01/28	840,000,000.00	838,531,150.80	
	BTPCL 6.2% 10/01/40	1,100,000,000.00	1,169,700,068.90	
	BTPCL 6% 01/01/43	2,000,000,000.00	2,089,341,096.00	
	BTPCL 6% 04/01/33	1,900,000,000.00	1,958,417,711.60	
	BTPCL 7% 05/01/34	1,320,000,000.00	1,451,241,452.76	
	チリペソ 小計	19,480,000,000.00	19,029,205,902.82 (2,921,268,544)	
コロンビアペソ	COLTES 11.5% 07/25/46	9,300,000,000.00	8,565,930,912.00	
	COLTES 13.25% 02/09/33	12,000,000,000.00	12,589,103,520.00	
	COLTES 5.75% 11/03/27	25,000,000,000.00	23,078,587,750.00	
	COLTES 6.25% 07/09/36	12,000,000,000.00	7,802,524,920.00	
	COLTES 6% 04/28/28	35,000,000,000.00	31,623,491,550.00	
	COLTES 7.25% 10/18/34	24,600,000,000.00	18,056,952,762.00	
	COLTES 7.25% 10/26/50	54,110,000,000.00	32,985,919,181.60	
	COLTES 7.75% 09/18/30	7,000,000,000.00	6,075,877,220.00	
	COLTES 7% 03/26/31	13,700,000,000.00	11,149,732,670.00	

	COLTES 7% 06/30/32	10,000,000,000.00	7,703,321,200.00	
	COLTES 9.25% 05/28/42	7,500,000,000.00	5,841,282,375.00	
コロンビアペソ 小計		210,210,000,000.00	165,472,724,060.60 (6,020,228,646)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	5,850,000.00	5,029,872.76	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	9,250,000.00	8,784,331.78	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,200,000.00	9,711,727.64	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	9,700,000.00	10,099,946.90	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	1,750,000.00	1,866,376.22	
	PERUGB 6.85% 08/12/35	4,000,000.00	4,134,018.04	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	9,450,000.00	9,623,722.46	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	9,600,000.00	10,555,515.74	
	PERUGB 7.3% 08/12/33	8,300,000.00	9,077,194.15	
	PERUGB 7.6% 08/12/39	7,800,000.00	8,315,314.64	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	1,750,000.00	1,825,931.55	
	ペルーソル 小計		76,650,000.00	79,023,951.88 (3,246,359,259)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	24,500,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	14,000,000.00	13,859,263.88	
	URUGUA 9.75% 07/20/33	31,000,000.00	32,782,500.00	
ウルグアイペソ 小計		70,000,000.00	71,141,763.88 (256,366,460)	
ドミニカペソ	DOMREP 10.75% 06/01/36	112,000,000.00	117,292,000.00	
	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	43,060,000.00	
	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	37,416,932.48	
ドミニカペソ 小計		184,000,000.00	197,768,932.48 (479,016,131)	
トルコリラ	TURKGB 17.3% 07/19/28	298,000,000.00	211,898,264.00	
	TURKGB 17.8% 07/13/33	165,000,000.00	110,805,827.55	
	TURKGB 26.2% 10/05/33	60,000,000.00	55,159,800.00	
	TURKGB 30% 09/12/29	82,000,000.00	76,137,820.00	
	TURKGB 31.08% 11/08/28	135,000,000.00	128,112,609.15	
トルコリラ 小計		740,000,000.00	582,114,320.70 (2,122,330,601)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	41,100,000.00	35,064,484.31	
	CZGB 0.25% 02/10/27	95,200,000.00	90,561,049.65	
	CZGB 0.95% 05/15/30	98,900,000.00	86,589,532.27	
	CZGB 1.2% 03/13/31	78,000,000.00	67,601,057.16	
	CZGB 1.5% 04/24/40	43,700,000.00	29,253,796.02	
	CZGB 1.75% 06/23/32	89,500,000.00	77,740,663.02	
	CZGB 1.95% 07/30/37	47,000,000.00	36,252,512.35	
	CZGB 1% 06/26/26	68,800,000.00	67,284,341.50	

	CZGB 2.5% 08/25/28	89,700,000.00	86,762,174.30	
	CZGB 2.75% 07/23/29	78,500,000.00	75,764,823.71	
	CZGB 2% 10/13/33	102,500,000.00	87,466,560.75	
	CZGB 3.5% 05/30/35	65,000,000.00	61,234,820.40	
	CZGB 3.6% 06/03/36	17,000,000.00	15,956,141.01	
	CZGB 3% 03/03/33	28,000,000.00	26,079,812.08	
	CZGB 4.2% 12/04/36	45,000,000.00	44,259,921.00	
	CZGB 4.5% 11/11/32	73,000,000.00	75,194,657.40	
	CZGB 4.9% 04/14/34	47,500,000.00	50,009,187.50	
	CZGB 5.5% 12/12/28	69,000,000.00	73,153,289.40	
	CZGB 5.75% 03/29/29	18,000,000.00	19,299,855.60	
	CZGB 5% 09/30/30	60,000,000.00	63,372,318.00	
	CZGB 6.2% 06/16/31	27,000,000.00	30,342,902.40	
	CZGB 6% 02/26/26	36,000,000.00	36,605,646.00	
	チェココルナ 小計	1,318,400,000.00	1,235,849,545.83	(8,589,154,343)
ハンガリー フォロント	HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	590,880,459.18	
	HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	489,672,410.84	
	HGB 2.25% 04/20/33	872,000,000.00	639,526,099.28	
	HGB 2.25% 06/22/34	291,000,000.00	203,013,952.95	
	HGB 2.75% 12/22/26	485,500,000.00	463,651,596.97	
	HGB 2% 05/23/29	1,013,000,000.00	864,815,624.90	
	HGB 3.25% 10/22/31	982,000,000.00	817,794,830.72	
	HGB 3% 04/25/41	236,000,000.00	143,496,621.08	
	HGB 3% 08/21/30	835,000,000.00	714,499,889.15	
	HGB 3% 10/27/27	772,000,000.00	719,742,316.40	
	HGB 3% 10/27/38	320,000,000.00	208,400,182.40	
	HGB 4.5% 03/23/28	603,000,000.00	577,005,140.34	
	HGB 4.75% 11/24/32	873,000,000.00	774,517,734.27	
	HGB 6.75% 10/22/28	947,000,000.00	957,692,955.80	
	HGB 7% 10/24/35	425,000,000.00	424,526,324.75	
HGB 9.5% 10/21/26	290,000,000.00	301,438,615.00		
	ハンガリーフォロント 小計	10,069,000,000.00	8,890,674,754.03	(3,822,990,144)
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	21,500,000.00	20,441,985.00	
	POLGB 1.25% 10/25/30	28,000,000.00	23,480,908.92	
	POLGB 1.75% 04/25/32	26,700,000.00	21,596,164.70	
	POLGB 2.5% 07/25/26	13,300,000.00	13,072,565.87	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	22,850,625.41	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	20,105,295.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	36,900,000.00	34,248,377.43	
	POLGB 3.75% 05/25/27	19,600,000.00	19,421,687.82	
	POLGB 4.5% 07/25/30	14,500,000.00	14,294,067.52	

	POLGB 4.75% 07/25/29	22,200,000.00	22,292,873.70	
	POLGB 5% 01/25/30	18,500,000.00	18,700,231.05	
	POLGB 5% 10/25/34	25,900,000.00	25,294,662.61	
	POLGB 6% 10/25/33	30,100,000.00	31,638,994.94	
	POLGB 7.5% 07/25/28	28,500,000.00	30,901,968.60	
	ポーランドズロチ 小計	330,400,000.00	318,340,408.57 (12,851,402,293)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,791,985.30	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	11,100,000.00	10,758,831.06	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	7,800,000.00	6,469,213.45	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	7,000,000.00	6,545,844.34	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,437,049.32	
	ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,241,931.99	
	ROMGB 4.75% 10/11/34	10,200,000.00	8,608,458.81	
	ROMGB 4.85% 04/22/26	7,300,000.00	7,202,058.38	
	ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,182,147.64	
	ROMGB 5.8% 07/26/27	7,300,000.00	7,138,410.63	
	ROMGB 5% 02/12/29	7,700,000.00	7,185,304.81	
	ROMGB 6.3% 04/25/29	5,500,000.00	5,341,266.26	
	ROMGB 6.3% 04/26/28	1,000,000.00	979,662.48	
	ROMGB 6.7% 02/25/32	7,600,000.00	7,407,183.97	
	ROMGB 6.85% 07/29/30	1,000,000.00	984,168.36	
	ROMGB 7.1% 07/31/34	3,500,000.00	3,486,547.54	
	ROMGB 7.2% 05/31/27	5,800,000.00	5,812,702.00	
	ROMGB 7.2% 10/28/26	5,300,000.00	5,320,193.00	
	ROMGB 7.2% 10/30/33	9,300,000.00	9,321,190.05	
	ROMGB 7.35% 04/28/31	8,200,000.00	8,244,662.94	
ROMGB 7.9% 02/24/38	8,000,000.00	8,585,187.20		
ROMGB 8.25% 09/29/32	10,200,000.00	10,781,515.26		
ROMGB 8.75% 10/30/28	9,100,000.00	9,518,954.90		
ROMGB 8% 04/29/30	7,700,000.00	7,940,205.35		
	ルーマニアレイ 小計	169,900,000.00	163,284,675.04 (5,509,224,935)	
マレーシア リングgit	MGS 2.632% 04/15/31	50,600,000.00	48,794,625.39	
	MGS 3.502% 05/31/27	24,950,000.00	25,185,323.41	
	MGS 3.519% 04/20/28	1,000,000.00	1,011,041.60	
	MGS 3.582% 07/15/32	23,500,000.00	23,838,162.65	
	MGS 3.733% 06/15/28	29,000,000.00	29,510,121.60	
	MGS 3.757% 05/22/40	20,450,000.00	20,578,753.20	
	MGS 3.828% 07/05/34	28,200,000.00	28,940,622.24	
	MGS 3.885% 08/15/29	24,800,000.00	25,457,988.64	
	MGS 3.899% 11/16/27	7,500,000.00	7,643,661.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,713,001.31	

	MGS 3.906% 07/15/26	51,600,000.00	52,107,584.04	
	MGS 4.054% 04/18/39	5,000,000.00	5,205,887.00	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,750,000.00	13,955,100.50	
	MGS 4.18% 05/16/44	4,000,000.00	4,219,716.40	
	MGS 4.254% 05/31/35	10,150,000.00	10,784,540.44	
	MGS 4.457% 03/31/53	16,600,000.00	17,877,569.20	
	MGS 4.504% 04/30/29	18,400,000.00	19,271,652.16	
	MGS 4.642% 11/07/33	21,500,000.00	23,355,106.00	
	MGS 4.696% 10/15/42	29,200,000.00	32,616,452.56	
	MGS 4.762% 04/07/37	13,500,000.00	14,984,804.25	
	MGS 4.893% 06/08/38	43,700,000.00	49,008,160.34	
	MGS 4.921% 07/06/48	15,400,000.00	17,633,905.52	
	マレーシアリングット 小計	473,250,000.00	492,693,779.45 (16,930,189,996)	
タイバーツ	THAIGB 1.585% 12/17/35	70,800,000.00	71,020,811.04	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	65,438,344.23	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	108,100,000.00	109,023,963.13	
	THAIGB 1.66% 03/17/30	70,000,000.00	70,916,657.00	
	THAIGB 1% 06/17/27	203,000,000.00	201,639,942.63	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	205,236,774.48	
	THAIGB 2.25% 03/17/27	83,000,000.00	84,205,591.60	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	42,000,000.00	42,395,887.80	
	THAIGB 2.4% 03/17/29	163,000,000.00	168,939,524.40	
	THAIGB 2.4% 11/17/27	56,000,000.00	57,346,884.00	
	THAIGB 2.41% 03/17/35	15,000,000.00	16,181,586.00	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	209,000,000.00	216,759,375.80	
	THAIGB 2.7% 06/17/40	37,000,000.00	41,988,946.80	
	THAIGB 2.8% 06/17/34	118,000,000.00	130,533,287.40	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	98,100,000.00	111,223,023.39	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	106,079,784.90	
	THAIGB 2.98% 06/17/45	28,000,000.00	32,415,171.60	
	THAIGB 2% 06/17/42	108,600,000.00	110,954,589.18	
	THAIGB 2% 12/17/31	173,000,000.00	178,684,434.00	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	176,737,741.88	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	157,000,000.00	178,372,676.90	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	133,000,000.00	158,267,858.70	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	115,200,000.00	135,541,923.84	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	151,000,000.00	183,840,808.80	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	107,500,000.00	121,105,221.50	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	115,000,000.00	132,381,307.00	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	188,500,000.00	213,625,202.70	
	タイバーツ 小計	3,067,700,000.00	3,320,857,320.70	

			(14,877,440,796)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,586,698,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	105,000,000,000.00	103,545,750,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	101,000,000,000.00	100,749,520,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	45,000,000,000.00	45,127,350,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	37,800,000,000.00	36,652,392,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	97,000,000,000.00	96,733,250,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	26,100,000,000.00	25,369,200,000.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	100,500,000,000.00	101,348,220,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	118,500,000,000.00	119,354,385,000.00	
	INDOGB 6.5% 07/15/30	40,000,000,000.00	40,466,400,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	104,000,000,000.00	104,557,273,600.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	40,000,000,000.00	40,201,200,000.00	
	INDOGB 6.75% 07/15/35	58,000,000,000.00	58,646,990,000.00	
	INDOGB 6.875% 04/15/29	81,000,000,000.00	82,871,213,400.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	39,000,000,000.00	40,240,590,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	62,800,000,000.00	63,945,472,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	35,500,000,000.00	36,196,155,000.00	
	INDOGB 7.125% 08/15/40	23,000,000,000.00	23,484,150,000.00	
	INDOGB 7.125% 08/15/45	17,000,000,000.00	17,256,360,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	63,000,000,000.00	66,244,500,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	36,649,793,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	69,700,000,000.00	74,486,299,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,424,512,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	77,000,000,000.00	79,104,410,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,332,628,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	73,000,000,000.00	75,392,210,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	40,200,000,000.00	43,071,084,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,808,030,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,692,430,000.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	71,000,000,000.00	79,345,340,000.00	
INDOGB 8.375% 04/15/39	42,200,000,000.00	47,765,336,000.00		
INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,245,256,000.00		
INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	43,042,527,000.00		
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,091,418,000.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,365,656,000.00		
インドネシアルピア 小計		1,832,300,000,000.00	1,887,393,998,000.00	(16,986,545,982)
インドル ピー	IGB 5.77% 08/03/30	185,000,000.00	182,859,209.60	
	IGB 5.79% 05/11/30	330,000,000.00	326,854,905.30	
	IGB 5.85% 12/01/30	220,000,000.00	217,970,502.20	
	IGB 6.1% 07/12/31	400,000,000.00	399,317,512.00	
	IGB 6.33% 05/05/35	190,000,000.00	190,686,413.00	

	IGB 6.45% 10/07/29	200,000,000.00	203,900,000.00	
	IGB 6.54% 01/17/32	430,000,000.00	437,890,500.00	
	IGB 6.67% 12/17/50	200,000,000.00	192,426,400.00	
	IGB 6.75% 12/23/29	300,000,000.00	309,063,300.00	
	IGB 6.79% 10/07/34	490,000,000.00	505,410,990.00	
	IGB 6.79% 12/30/31	70,000,000.00	72,225,076.00	
	IGB 6.99% 12/15/51	400,000,000.00	400,585,080.00	
	IGB 7.02% 06/18/31	250,000,000.00	260,151,500.00	
	IGB 7.04% 06/03/29	260,000,000.00	269,631,960.00	
	IGB 7.06% 04/10/28	290,000,000.00	299,772,507.00	
	IGB 7.1% 04/08/34	440,000,000.00	460,328,000.00	
	IGB 7.1% 04/18/29	165,000,000.00	171,278,415.00	
	IGB 7.16% 09/20/50	220,000,000.00	224,967,226.00	
	IGB 7.17% 04/17/30	320,000,000.00	334,870,080.00	
	IGB 7.18% 07/24/37	410,000,000.00	429,595,458.00	
	IGB 7.18% 08/14/33	320,000,000.00	335,876,480.00	
	IGB 7.26% 02/06/33	420,000,000.00	443,415,000.00	
	IGB 7.26% 08/22/32	300,000,000.00	316,752,270.00	
	IGB 7.3% 06/19/53	380,000,000.00	394,881,256.00	
	IGB 7.32% 11/13/30	200,000,000.00	211,672,720.00	
	IGB 7.36% 09/12/52	250,000,000.00	260,932,500.00	
	IGB 7.37% 01/23/54	200,000,000.00	208,591,000.00	
	IGB 7.37% 10/23/28	360,000,000.00	376,254,000.00	
	IGB 7.38% 06/20/27	360,000,000.00	371,985,876.00	
	IGB 7.41% 12/19/36	430,000,000.00	458,810,860.00	
	IGB 7.54% 05/23/36	330,000,000.00	355,574,010.00	
	IGB 7.72% 06/15/49	340,000,000.00	370,893,420.00	
	インドルピー 小計	9,660,000,000.00	9,995,424,426.10 (17,092,175,768)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	179,700,000.00	186,468,292.68	
	SAGB 11.625% 03/31/53	42,500,000.00	44,676,531.25	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	54,305,473.31	
	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	76,715,705.11	
	SAGB 7% 02/28/31	112,700,000.00	104,313,002.36	
	SAGB 8.25% 03/31/32	151,000,000.00	145,393,315.64	
	SAGB 8.5% 01/31/37	159,200,000.00	139,265,273.70	
	SAGB 8.75% 01/31/44	137,000,000.00	111,849,881.13	
	SAGB 8.75% 02/28/48	174,700,000.00	140,729,817.35	
	SAGB 8.875% 02/28/35	191,000,000.00	179,925,957.52	
	SAGB 8% 01/31/30	169,600,000.00	167,551,114.97	
	SAGB 9% 01/31/40	161,300,000.00	139,705,857.65	
		南アフリカランド 小計	1,664,000,000.00	1,490,900,222.67

			(12,240,290,828)	
オフショア 人民元	CGB 1.42% 11/15/27	6,000,000.00	6,004,393.20	
	CGB 1.43% 01/25/30	4,000,000.00	3,989,686.48	
	CGB 1.49% 12/25/31	16,000,000.00	15,888,318.56	
	CGB 1.61% 02/15/35	6,000,000.00	5,964,110.22	
	CGB 1.62% 08/15/27	2,000,000.00	2,009,626.80	
	CGB 1.65% 05/15/35	9,000,000.00	8,972,454.33	
	CGB 1.79% 03/25/32	14,800,000.00	14,990,552.96	
	CGB 1.92% 01/15/55	8,000,000.00	8,029,982.40	
	CGB 2.04% 02/25/27	26,000,000.00	26,274,674.40	
	CGB 2.04% 11/25/34	11,000,000.00	11,351,810.80	
	CGB 2.05% 04/15/29	7,000,000.00	7,145,433.40	
	CGB 2.11% 08/25/34	3,600,000.00	3,730,304.88	
	CGB 2.17% 08/29/34	17,000,000.00	17,696,112.60	
	CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,429,838.40	
	CGB 2.19% 09/25/54	13,000,000.00	13,870,451.40	
	CGB 2.25% 08/29/39	6,000,000.00	6,263,319.60	
	CGB 2.27% 05/25/34	11,000,000.00	11,531,771.90	
	CGB 2.28% 03/25/31	13,000,000.00	13,500,267.30	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,114,326.80	
	CGB 2.35% 02/25/34	8,400,000.00	8,852,241.72	
	CGB 2.39% 11/15/26	2,000,000.00	2,027,376.20	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,287,920.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	16,600,000.00	16,967,894.18	
	CGB 2.46% 02/15/26	15,600,000.00	15,707,449.68	
	CGB 2.47% 07/25/54	6,300,000.00	7,076,462.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,503,591.44	
	CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,163,336.50	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,122,737.20	
	CGB 2.52% 08/25/33	15,700,000.00	16,720,054.12	
	CGB 2.54% 12/25/30	17,800,000.00	18,719,021.12	
	CGB 2.57% 05/20/54	5,500,000.00	6,303,101.75	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	18,042,276.07	
	CGB 2.62% 04/15/28	13,100,000.00	13,532,144.11	
	CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,790,089.80	
CGB 2.62% 09/25/29	25,000,000.00	26,143,752.50		
CGB 2.64% 01/15/28	16,200,000.00	16,699,313.16		
CGB 2.67% 05/25/33	16,700,000.00	17,948,916.18		
CGB 2.67% 11/25/33	7,300,000.00	7,875,344.39		
CGB 2.68% 05/21/30	18,300,000.00	19,297,467.12		
CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,152,624.00		
CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,719,170.00		
CGB 2.75% 02/17/32	10,700,000.00	11,472,199.74		

CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,430,136.76	
CGB 2.76% 05/15/32	10,000,000.00	10,764,608.00	
CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,670,515.60	
CGB 2.8% 03/24/29	19,000,000.00	19,927,515.40	
CGB 2.8% 03/25/30	16,500,000.00	17,467,728.30	
CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,721,480.22	
CGB 2.85% 06/04/27	9,400,000.00	9,672,928.06	
CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	18,758,134.24	
CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,635,156.00	
CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,481,073.00	
CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,262,848.12	
CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	9,217,974.60	
CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,744,834.20	
CGB 3.12% 10/25/52	5,600,000.00	7,016,703.68	
CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,405,786.00	
CGB 3.13% 11/21/29	14,300,000.00	15,357,838.21	
CGB 3.19% 04/15/53	6,200,000.00	7,883,515.76	
CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,423,673.80	
CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,964,587.93	
CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	24,101,536.80	
CGB 3.28% 12/03/27	15,900,000.00	16,673,624.04	
CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	15,268,166.60	
CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	5,170,326.40	
CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	11,706,344.32	
CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	11,617,418.35	
CGB 3.81% 09/14/50	14,800,000.00	20,335,836.40	
CGB 3% 10/15/53	11,000,000.00	13,714,717.50	
オフショア人民元 小計	788,100,000.00	839,276,928.10 (17,050,917,926)	
合計		169,050,436,861 (169,050,436,861)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルレアル	国債証券 12銘柄	100.0%	6.4%
チリペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	1.7%
コロンビアペソ	国債証券 11銘柄	100.0%	3.6%
ペルーソル	国債証券 11銘柄	100.0%	1.9%

ウルグアイペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券	5銘柄	100.0%	1.3%
チェココルナ	国債証券	22銘柄	100.0%	5.1%
ハンガリーフォリント	国債証券	16銘柄	100.0%	2.3%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	7.6%
ルーマニアレイ	国債証券	24銘柄	100.0%	3.3%
マレーシアリンギット	国債証券	22銘柄	100.0%	10.0%
タイバーツ	国債証券	27銘柄	100.0%	8.8%
インドネシアルピア	国債証券	35銘柄	100.0%	10.0%
インドルピー	国債証券	32銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	7.2%
オフショア人民元	国債証券	69銘柄	100.0%	10.1%

(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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	601,410,740
投資証券	98,226,682,400
派生商品評価勘定	26,153,540
未収入金	34,064,206
未収配当金	972,363,417
未収利息	7,695
差入委託証拠金	61,862,748
流動資産合計	99,922,544,746
資産合計	99,922,544,746
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	481,920
前受金	25,850,920
未払金	33,600
未払解約金	191,325,368
流動負債合計	217,691,808
負債合計	217,691,808
純資産の部	
元本等	
元本	44,725,322,251
剰余金	
剰余金又は欠損金()	54,979,530,687
元本等合計	99,704,852,938
純資産合計	99,704,852,938

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	99,922,544,746

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	44,725,322,251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 2.2293円 (1万口当たり純資産額) (22,293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

	2025年 7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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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

	2025年 7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	<p>(1) 有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

2025年 7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	<p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	60,803,527,157円
期中追加設定元本額	8,513,031,865円
期中一部解約元本額	24,591,236,771円
期末元本額	44,725,322,251円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,784,555,349円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,747,045円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	14,134,578,462円
J リートインデックス・オープン（SMA専用）	20,596,541,369円
コア投資戦略ファンド（安定型）	533,662,855円
コア投資戦略ファンド（成長型）	935,313,191円
分散投資コア戦略ファンドA	1,066,487,955円
分散投資コア戦略ファンドS	2,183,883,081円
コア投資戦略ファンド（切替型）	384,918,372円
S M T インデックスバランス・オープン	20,500,311円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	116,450,806円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	18,617,550円
グローバル経済コア	745,422,853円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	22,249,441円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	269,248,257円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,615,565円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	1,151,395,857円
10 資産分散投資ファンド	34,302,357円
グローバル10 資産バランスファンド	77,705,070円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	177,632,636円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	13,756,587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）	62,573,221円
グローバル10 資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	29,380円
グローバル10 資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	33,607円
グローバル10 資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	29,312円
グローバル10 資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	17,311円
グローバル10 資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	34,588円
グローバル10 資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	28,967円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2015 - 04（適格機関投資家専用）	219,067,483円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	94,923,413円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	6,236,968,483	
合計	6,236,968,483	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2025年 7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	不動産投信指数先物取引					
	買建	1,415,884,080	-	-	1,441,735,000	25,850,920
合計		1,415,884,080	-	-	1,441,735,000	25,850,920

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	2,100	260,400,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,040	278,160,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	4,735	546,419,000	
	東海道リート投資法人	1,845	204,610,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人	16,384	1,939,865,600	
	森ヒルズリート投資法人	11,159	1,498,653,700	
	産業ファンド投資法人	17,375	2,118,012,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,653	2,868,831,400	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	13,838	1,713,144,400	
	G L P 投資法人	31,225	4,034,270,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,805	1,403,060,000	
	日本プロロジスリート投資法人	48,851	3,883,654,500	
	星野リゾート・リート投資法人	4,013	990,007,100	
	O n e リート投資法人	1,655	424,838,500	

イオンリート投資法人	11,523	1,447,288,800	
ヒューリックリート投資法人	8,385	1,327,345,500	
日本リート投資法人	12,115	1,090,350,000	
積水ハウス・リート投資法人	28,346	2,134,453,800	
トーセイ・リート投資法人	2,063	280,568,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	2,340	270,036,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	2,586	250,324,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	30,240	4,545,072,000	
いちごホテルリート投資法人	1,570	202,844,000	
ラサールロジポート投資法人	11,784	1,625,013,600	
スターアジア不動産投資法人	17,488	1,007,308,800	
マリモ地方創生リート投資法人	1,723	184,877,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	20,686	2,122,383,600	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	2,001	148,674,300	
投資法人みらい	13,068	577,605,600	
三菱地所物流リート投資法人	9,830	1,166,821,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	4,062	607,675,200	
ザイマックス・リート投資法人	1,625	183,462,500	
タカラレーベン不動産投資法人	6,197	562,687,600	
日本ビルファンド投資法人	56,251	7,307,004,900	
ジャパンリアルエステイト投資法人	48,739	5,692,715,200	
日本都市ファンド投資法人	49,208	5,220,968,800	
オリックス不動産投資法人	18,908	3,630,336,000	
日本プライムリアルティ投資法人	25,960	2,466,200,000	
N T T 都市開発リート投資法人	9,556	1,227,946,000	
東急リアル・エステート投資法人	6,362	1,262,857,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,841	952,267,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,981	3,312,899,900	
森トラストリート投資法人	18,292	1,269,464,800	
インヴィンシブル投資法人	52,285	3,309,640,500	
フロンティア不動産投資法人	17,605	1,454,173,000	
平和不動産リート投資法人	7,272	995,536,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	18,923	1,771,192,800	
福岡リート投資法人	5,354	929,989,800	
K D X 不動産投資法人	26,288	4,043,094,400	
いちごオフィスリート投資法人	6,924	639,085,200	
大和証券オフィス投資法人	3,877	1,250,332,500	
阪急阪神リート投資法人	4,525	714,950,000	
スターツプロシード投資法人	1,586	285,004,200	
大和ハウスリート投資法人	14,152	3,409,216,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	34,863	2,722,800,300	
大和証券リビング投資法人	14,016	1,370,764,800	

ジャパンエクセレント投資法人	8,149	1,089,521,300	
合計	844,227	98,226,682,400	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2025年 7月10日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		323,871,785
コール・ローン		195,515,579
投資証券		136,679,097,929
派生商品評価勘定		1,434,829
未収入金		1
未収配当金		590,598,513
未収利息		2,501
前払金		634,622
差入委託証拠金		172,467,522
流動資産合計		137,963,623,281
資産合計		137,963,623,281
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,791,257
未払解約金		80,952,656
流動負債合計		83,743,913
負債合計		83,743,913
純資産の部		
元本等		
元本		44,973,888,461
剰余金		
剰余金又は欠損金()		92,905,990,907
元本等合計		137,879,879,368
純資産合計		137,879,879,368
負債純資産合計		137,963,623,281

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

2025年 7月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	44,973,888,461口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.0658円 (30,658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

2025年 7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。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、不動産投信指数先物取引及び為替予約取引を行っております。不動産投信指数先物取引に係る主要なリスクは、リートの価格の変動による価格変動リスクであります。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

2025年 7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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p>

	2025年 7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	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	40,061,173,784円
期中追加設定元本額	9,322,677,636円
期中一部解約元本額	4,409,962,959円
期末元本額	44,973,888,461円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	43,953,883円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	67,756,498円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,478,965,307円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,523,691円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,572,349,339円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	21,498,356,021円
コア投資戦略ファンド（安定型）	381,626,231円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,099,111,025円
分散投資コア戦略ファンドA	1,398,631,227円
分散投資コア戦略ファンドS	3,899,032,670円
コア投資戦略ファンド（切替型）	455,108,700円
SMT インデックスバランス・オープン	98,173,506円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	141,074,151円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,008,256円
グローバル経済コア	564,066,542円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	17,979,764円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	321,997,285円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	110,701,304円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	596,809,440円
10資産分散投資ファンド	18,113,207円
グローバル10資産バランスファンド	56,779,361円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	1,434,573,602円
FOfs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	176,732,729円
FOfs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	108,913,037円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	52,017,804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）	58,220,160円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	21,567円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	19,201円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	27,156円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	21,681円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	29,648円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	20,530円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	83,939,351円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	89,711,719円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	88,946,558円

区分	2025年 7月10日現在
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	41,576,310円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	8,448,975,703	
合計	8,448,975,703	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2025年 7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	不動産投信指数先物取引					
	買建	1,065,385,067	-	1,064,750,445	634,622	
合計		1,065,385,067	-	1,064,750,445	634,622	

(注)1.時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、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.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2025年 7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	108,669,000	-	107,946,464	722,536	
	アメリカドル	108,669,000	-	107,946,464	722,536	
	売建	17,120,700	-	17,119,970	730	
	ユーロ	17,120,700	-	17,119,970	730	
合計		125,789,700	-	125,066,434	721,806	

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ACADIA REALTY TRUST	81,486	1,482,230.34	
		AGREE REALTY CORP	70,233	4,985,138.34	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	43,493	776,350.05	
		ALEXANDER'S INC	1,336	307,934.64	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	99,257	7,649,736.99	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	82,821.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	28,846	591,631.46	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	104,619	3,770,468.76	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	202,569	7,193,225.19	
		AMERICOLD REALTY TRUST	164,247	2,670,656.22	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	80,107	687,318.06	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	142,553	1,746,274.25	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES	44,991	315,386.91	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	90,691	18,195,335.33	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	73,472.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	107,083	444,394.45	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	196,706	5,021,904.18	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	123,420	1,957,441.20	
		BRT APARTMENTS CORP	5,000	79,250.00	
		BXP INC	93,442	6,450,301.26	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	68,085	7,694,285.85	
		CARETRUST REIT INC	120,272	3,724,823.84	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,284	186,324.72	
		CENTERSPACE	10,538	631,120.82	
		CHATHAM LODGING TRUST	25,562	184,302.02	
		CITY OFFICE REIT INC	17,639	99,483.96	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,980	249,716.60	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	71,191	2,007,586.20	
		COUSINS PROPERTIES INC	108,021	3,115,325.64	
		CTO REALTY GROWTH INC	17,709	305,303.16	
		CUBESMART	145,434	6,175,127.64	
		CURLINE PROPERTIES CORP	59,878	1,332,285.50	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	137,584	1,096,544.48			
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	508,800	267,120.00			
DIGITAL REALTY TRUST INC	203,038	34,756,044.84			
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	156,800	573,888.00			
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	111,006	1,739,464.02			
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	0.02			

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	26,979	617,009.73	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	33,296	5,555,104.64	
ELME COMMUNITIES	56,755	914,890.60	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	85,931	696,900.41	
EPR PROPERTIES	47,754	2,816,053.38	
EQUINIX INC	62,684	47,935,081.64	
EQUITY COMMONWEALTH	64,832	-	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	122,634	7,608,213.36	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	219,111	14,577,454.83	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	124,624	3,858,359.04	
ESSEX PROPERTY TRUST	41,182	11,727,809.96	
EXTRA SPACE STORAGE INC	135,314	20,122,544.94	
FARMLAND PARTNERS INC	28,000	313,040.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	49,631	4,697,077.84	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	85,466	4,124,589.16	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	63,010	1,676,066.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	79,533.29	
FRONTVIEW REIT INC	9,181	109,437.52	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	174,961	8,301,899.45	
GETTY REALTY CORP	30,825	840,597.75	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	27,780	393,920.40	
GLADSTONE LAND CORP	24,504	256,556.88	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	37,791	268,694.01	
GLOBAL NET LEASE INC	122,132	924,539.24	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	226,639	3,657,953.46	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	446,713	8,156,979.38	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	69,006	2,137,805.88	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	443,702	7,165,787.30	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	215,587	595,020.12	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	145,808	2,558,930.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	155,880.20	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	18,973	1,057,744.75	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	51,471	1,376,334.54	
INVITATION HOMES INC	364,812	11,772,483.24	
IRON MOUNTAIN INC	188,711	18,729,566.75	
JBG SMITH PROPERTIES	46,457	832,044.87	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	342,700	71,967.00	
KILROY REALTY CORPORATION	69,617	2,468,618.82	
KIMCO REALTY CORP	434,672	9,193,312.80	
KITE REALTY GROUP TRUST	138,842	3,085,069.24	
LAMAR ADVERTISING CO-A	56,376	7,017,684.48	

LINEAGE INC	37,898	1,624,308.28
LTC PROPERTIES INC	28,053	998,967.33
LXP INDUSTRIAL TRUST	195,619	1,631,462.46
MACERICH CO/THE	161,820	2,642,520.60
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	55,120.82
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	377,529	1,566,745.35
MID-AMERICA APARTMENT COMM	74,893	11,251,175.39
MILLROSE PROPERTIES	78,861	2,283,814.56
MODIV INDUSTRIAL INC	6,921	100,908.18
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,767	1,427,619.63
NATL HEALTH INVESTORS INC	28,852	2,027,718.56
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,552	277,854.48
NETSTREIT CORP	56,292	946,831.44
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	18,000	85,140.00
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,856	469,441.28
NNN REIT INC	119,388	5,119,357.44
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	183,273	6,667,471.74
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	206,719.96
ORION PROPERTIES INC	34,844	82,580.28
OUTFRONT MEDIA INC	91,853	1,571,604.83
PARAMOUNT GROUP INC	121,051	767,463.34
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	127,396	1,379,698.68
PEAKSTONE REALTY TRUST	27,000	363,690.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,170	759,383.90
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	79,176	2,737,114.32
PIEDMONT REALTY TRUST INC	85,893	646,774.29
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	28,688	458,147.36
POSTAL REALTY TRUST INC- A	13,280	195,481.60
PRIME US REIT	324,500	50,946.50
PROLOGIS INC	594,379	63,235,981.81
PUBLIC STORAGE	100,876	29,152,155.24
REALTY INCOME CORP	579,253	32,971,080.76
REGENCY CENTERS CORP	104,284	7,197,681.68
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	149,491	5,490,804.43
RLJ LODGING TRUST	100,534	766,069.08
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	38,626	3,945,259.64
SABRA HEALTH CARE REIT INC	151,898	2,810,113.00
SAFEHOLD INC	27,407	424,260.36
SAUL CENTERS INC	6,846	236,666.22
SERVICE PROPERTIES TRUST	89,989	241,170.52
SILA REALTY TRUST INC	37,448	876,283.20

	SIMON PROPERTY GROUP	196,251	31,975,175.43
	SITE CENTERS CORP	27,882	317,854.80
	SL GREEN REALTY CORP	45,737	2,846,213.51
	STAG INDUSTRIAL INC	120,477	4,352,834.01
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	67,952	365,581.76
	SUN COMMUNITIES INC	77,083	9,817,290.88
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	125,016	1,120,143.36
	TANGER INC	72,762	2,298,551.58
	TERRENO REALTY CORP	66,086	3,701,476.86
	UDR INC	192,152	7,824,429.44
	UMH PROPERTIES INC	50,010	854,170.80
	UNITI GROUP INC	162,514	718,311.88
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,811	319,548.01
	URBAN EDGE PROPERTIES	79,834	1,491,299.12
	VENTAS INC	290,113	18,207,491.88
	VERIS RESIDENTIAL INC	55,199	805,353.41
	VICI PROPERTIES INC	675,950	22,272,552.50
	VORNADO REALTY TRUST	107,263	4,063,122.44
	WELLTOWER INC	397,985	60,593,216.25
	WHITESTONE REIT	25,954	327,539.48
	WP CAREY INC	139,460	8,618,628.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,467	819,358.97
	アメリカドル 小計	17,118,079	726,522,308.15 (105,992,339,536)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	37,679	668,048.67
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	228,384.90
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,841	1,033,230.42
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	49,417	2,199,550.67
	CHOICE PROPERTIES REIT	108,232	1,592,092.72
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,196	593,292.96
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	34,070	537,624.60
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	82,960	974,780.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,669	44,278.71
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	68,393	1,243,384.74
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,753	1,338,401.61
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	76,841	959,744.09
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	42,842	572,369.12
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,557	676,649.71
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	162,837.00
		12,956	241,629.40

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL			
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	126,198.20	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	97,414	485,121.72	
	PRIMARIS REIT	30,375	460,485.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	97,997	1,717,887.41	
	SLATE GROCERY REIT	16,578	233,418.24	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	43,580	1,113,469.00	
	カナダドル 小計	968,795	17,202,878.89 (1,835,031,091)	
ユーロ	AEDIFICA	29,671	1,922,680.80	
	ALTAREA	3,735	369,391.50	
	CARE PROPERTY INVEST	22,887	282,883.32	
	CARMILA	38,492	645,125.92	
	COFINIMMO	24,394	1,855,163.70	
	COVIVIO(FP)	33,671	1,764,360.40	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	28,470	748,761.00	
	GECINA SA	33,894	3,050,460.00	
	HAMBORNER REIT AG	52,807	309,977.09	
	ICADE	21,096	449,766.72	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	106,438.50	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	218,188	1,313,491.76	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	363,595	367,958.14	
	KLEPIERRE	139,643	4,543,983.22	
	MERCIALYS	53,414	582,212.60	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	249,398	2,803,233.52	
	MONTEA NV	13,208	873,048.80	
	NSI NV	11,864	286,515.60	
	RETAIL ESTATES	9,104	570,820.80	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	20,778	766,708.20	
	STONEWEG EUROPE STAPLED TRUS	233,500	357,255.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	65,732	5,294,055.28	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	111,258	2,271,888.36	
	WERELDHAVE NV	22,533	390,722.22	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	24,024	733,933.20	
	ユーロ 小計	1,859,146	32,660,835.65 (5,592,514,888)	
イギリスポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	233,848	12,300.40	
	AEW UK REIT PLC	68,000	73,712.00	
	ASSURA PLC	1,814,839	906,693.56	
	BIG YELLOW GROUP PLC	129,959	1,237,209.68	
	BRITISH LAND CO PLC	649,942	2,337,191.43	

	CLS HOLDINGS PLC	75,636	52,264.47
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	191,169.21
	DERWENT LONDON PLC	72,360	1,430,557.20
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	421,108	419,844.67
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	263,355	908,574.75
	HAMMERSON PLC	283,307	829,522.89
	HELICAL PLC	65,400	144,207.00
	HOME REIT PLC	374,236	33,681.24
	INTU PROPERTIES PLC	521,960	9,270.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	467,979	2,786,814.94
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	77,144.96
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,475,538	2,869,921.41
	NEWRIVER REIT PL	316,000	226,256.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	348,000	275,964.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	812,946	785,305.83
	PRS REIT PLC/THE	340,013	363,813.91
	REGIONAL REIT LTD	91,200	107,798.40
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	131,866	905,260.09
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	345,000	186,990.00
	SEGR0 PLC	865,227	5,783,177.26
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,268,922	1,965,560.17
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	203,286	144,536.34
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	855,140	701,214.80
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	451,355	456,771.26
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,569,664	2,247,758.84
	UNITE GROUP PLC	261,825	2,133,873.75
	WAREHOUSE REIT PLC	237,876	267,372.62
	WORKSPACE GROUP PLC	97,321	387,824.18
	イギリスポンド 小計	15,524,322	31,259,557.26 (6,206,272,498)
オーストラリアドル	ABACUS GROUP	224,474	254,777.99
	ABACUS STORAGE KING	347,779	528,624.08
	ARENA REIT	286,441	1,034,052.01
	BWP TRUST	354,985	1,249,547.20
	CENTURIA CAPITAL GROUP	570,045	994,728.52
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	316,821	988,481.52
	CENTURIA OFFICE REIT	203,929	235,537.99
	CHARTER HALL GROUP	307,806	5,885,250.72
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	406,059	1,668,902.49
	CHARTER HALL RETAIL REIT	355,847	1,370,010.95
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	210,134	598,881.90
	CROMWELL PROPERTY GROUP	941,759	329,615.65

	DEXUS	676,942	4,630,283.28	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	308,490.00	
	DIGICO INFRASTRUCTURE REIT	235,000	740,250.00	
	GOODMAN GROUP	1,301,104	44,276,569.12	
	GPT GROUP	1,225,210	6,138,302.10	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	146,378	349,843.42	
	HEALTHCO REIT	300,321	220,735.93	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	1,115,956	1,383,785.44	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	241,409	1,255,326.80	
	MIRVAC GROUP	2,564,303	5,590,180.54	
	NATIONAL STORAGE REIT	924,170	2,134,832.70	
	REGION GROUP	772,407	1,730,191.68	
	RURAL FUNDS GROUP	222,079	400,852.59	
	SCENTRE GROUP	3,330,116	12,354,730.36	
	STOCKLAND	1,532,735	8,338,078.40	
	VICINITY CENTERS	2,489,573	6,248,828.23	
	WAYPOINT REIT LTD	398,821	977,111.45	
	オーストラリアドル 小計	22,115,603	112,216,803.06 (10,720,071,196)	
ニュージーランドドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	699,950	1,413,899.00	
	ニュージーランドドル 小計	699,950	1,413,899.00 (123,928,247)	
香港ドル	CHAMPION REIT	1,167,000	2,532,390.00	
	FORTUNE REIT	1,036,000	5,076,400.00	
	LINK REIT	1,647,600	70,023,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	1,262,250.00	
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,306,660	1,123,727.60	
	香港ドル 小計	5,718,260	80,017,767.60 (1,486,730,122)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	379,900	501,468.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,249,718	6,074,238.60	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,771,077	1,567,403.14	
	CAPITALAND CHINA TRUST	898,421	651,355.22	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	3,565,696	7,737,560.32	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	316,330.50	
	EC WORLD REIT	180,000	46,704.60	
	ESR-REIT	420,346	1,013,033.86	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	640,000	371,200.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	902,207	1,975,833.33	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,969,896	1,635,013.68	

	KEPPEL DC REIT	1,142,562	2,525,062.02	
	KEPPEL REIT	1,534,100	1,357,678.50	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,057,450	544,586.75	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,287,963	2,588,805.63	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	2,149,685	2,472,137.75	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,540,773	1,895,150.79	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250,000	375,000.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	282,000	1,139,280.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	192,270.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	863,000	448,760.00	
	SUNTEC REIT	1,480,800	1,643,688.00	
	シンガポールドル 小計	26,259,294	37,072,560.69 (4,228,866,997)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	135,171	585,290,430.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	46,000	216,660,000.00	
	JR REIT XXVII	117,405	307,014,075.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	27,961	125,824,500.00	
	LOTTE REIT CO LTD	86,202	334,463,760.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	62,917	355,481,050.00	
	SK REITS CO LTD	114,614	550,720,270.00	
	韓国ウォン 小計	590,270	2,475,454,085.00 (263,635,860)	
イスラエルシェケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	559,717	1,245,370.32	
	REIT 1 LTD	103,500	2,380,500.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	155,000	1,599,600.00	
	イスラエルシェケル 小計	818,217	5,225,470.32 (229,707,494)	
	合計	91,671,936	136,679,097,929 (136,679,097,929)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 142銘柄	100.0%	77.5%
カナダドル	投資証券 22銘柄	100.0%	1.3%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100.0%	4.1%
イギリスポンド	投資証券 33銘柄	100.0%	4.5%
オーストラリアドル	投資証券 29銘柄	100.0%	7.8%
ニュージーランドドル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

香港ドル	投資証券	5銘柄	100.0%	1.1%
シンガポールドル	投資証券	22銘柄	100.0%	3.1%
韓国ウォン	投資証券	7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

2025年 7月10日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	101,101,771
コール・ローン	175,140,882
投資信託受益証券	48,738,255,717
未収入金	4,229,511
未収利息	2,241
流動資産合計	49,018,730,122
資産合計	
49,018,730,122	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	419,881,452
未払金	91,224,110
未払解約金	133,518,535
流動負債合計	644,624,097
負債合計	
644,624,097	
純資産の部	
元本等	
元本	25,485,442,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,888,663,443
元本等合計	48,374,106,025
純資産合計	
48,374,106,025	
負債純資産合計	
49,018,730,122	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2025年 7月10日現在	
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

2025年 7月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,485,442,582口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8981円 (18,981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

2025年 7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。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する組入外貨建資産の投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、当該規定に従い為替ヘッジを目的とした為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2025年 7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 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

2025年 7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。 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	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	21,536,876,050円
期中追加設定元本額	8,477,132,339円
期中一部解約元本額	4,528,565,807円
期末元本額	25,485,442,582円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,029,742,003円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,811,002,132円
分散投資コア戦略ファンドA	3,010,680,362円
分散投資コア戦略ファンドS	10,218,627,046円
コア投資戦略ファンド（切替型）	742,783,068円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	187,090,760円
グローバル経済コア	3,309,452,416円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	4,162,746,318円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	526,420,419円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	145,898,055円
グローバル10資産バランスファンド	86,040,308円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	188,914,256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）	65,784,113円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	32,496円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	46,982円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	48,741円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	46,302円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	52,882円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	33,923円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7月10日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		11,827,163,036
合計		11,827,163,036

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 7月10日現在）

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

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	47,513,834,400	-	47,933,715,852	419,881,452
	アメリカドル	47,513,834,400	-	47,933,715,852	419,881,452
合計		47,513,834,400	-	47,933,715,852	419,881,452

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GOLD TRUST	5,343,496	334,075,369.92	
		アメリカドル 小計	5,343,496	334,075,369.92 (48,738,255,717)	
合計			5,343,496	48,738,255,717 (48,738,255,717)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

HFリターン・ターゲット・マザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	110,373,182
コール・ローン	788,787,064
国債証券	1,198,639,200
投資信託受益証券	404,463,218
派生商品評価勘定	51,257,248
未収利息	10,093
差入委託証拠金	814,538,342
流動資産合計	3,368,068,347
資産合計	3,368,068,347
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,998,643
前受金	41,196,278
未払金	126,971,404
流動負債合計	170,166,325
負債合計	170,166,325
純資産の部	
元本等	
元本	3,426,449,500
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	228,547,478
元本等合計	3,197,902,022
純資産合計	3,197,902,022
負債純資産合計	3,368,068,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 7月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引及び債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

2025年 7月10日現在	
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,426,449,500口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 228,547,478円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9333円 (1万口当たり純資産額) (9,333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

2025年 7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。これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ること及び組入外貨建資産の為替リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従って株価指数先物取引、債券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。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

2025年 7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	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

	2025年 7月10日現在
--	---------------

（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	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	7,238,144,458円
期中追加設定元本額	30,587,722円
期中一部解約元本額	3,842,282,680円
期末元本額	3,426,449,500円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,058,847,884円
分散投資コア戦略ファンドS	2,367,601,616円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2025年 7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	2,187,600
投資信託受益証券	5,355,464
合計	7,543,064

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 7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	1,193,532,722	-	1,233,728,674	40,195,952
	売建	266,806,469	-	264,597,988	2,208,481
合計		1,460,339,191	-	1,498,326,662	42,404,433

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

債券関連

（2025年 7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 売建	161,117,272	-	162,325,427	1,208,155
合計		161,117,272	-	162,325,427	1,208,155

(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。

- 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。
- 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2025年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	1,212,350,254	-	1,204,287,927	8,062,327
	アメリカドル	795,926,617	-	789,942,668	5,983,949
	カナダドル	7,509,222	-	7,449,883	59,339
	ユーロ	186,620,976	-	185,496,808	1,124,168
	イギリスポンド	98,114,542	-	97,515,054	599,488
	スイスフラン	120,683,143	-	120,404,081	279,062
	スウェーデンクローナ	3,495,754	-	3,479,433	16,321
	合計	1,212,350,254	-	1,204,287,927	8,062,327

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	円	第1263回国庫短期証券	1,200,000,000	1,198,639,200	
国債証券合計			1,200,000,000	1,198,639,200	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES GSCI COMMODITY DYNAM	29,151	769,586.40	
		ISHARES JP MORGAN USD EMERGI	21,680	2,002,798.40	
	アメリカドル 小計		50,831	2,772,384.80	(404,463,218)
投資信託受益証券合計			50,831	404,463,218	(404,463,218)

合計		1,603,102,418	
		(404,463,218)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入投資信託 受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券2銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

貸借対照表

	2025年 7月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,271,203,737
国債証券	11,665,250,800
派生商品評価勘定	138,042,401
未収入金	60,239,550
未収利息	118,638
前払金	69,717,378
差入委託証拠金	2,107,325,444
流動資産合計	23,311,897,948
資産合計	23,311,897,948
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	388,440,022
未払金	155,821,297
未払解約金	42,080,000
流動負債合計	586,341,319
負債合計	586,341,319
純資産の部	
元本等	
元本	21,206,036,229
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,519,520,400
元本等合計	22,725,556,629
純資産合計	22,725,556,629
負債純資産合計	23,311,897,948

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2025年 7月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段（外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場）によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2025年 7月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,206,036,229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 1.0717円 (1万口当たり純資産額) (10,717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

2025年 7月10日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2025年 7月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>

2025年 7月10日現在	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(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	2025年 7月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	17,508,251,506円
期中追加設定元本額	9,139,472,739円
期中一部解約元本額	5,441,688,016円
期末元本額	21,206,036,229円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	557,838,252円
コア投資戦略ファンド(成長型)	643,408,736円
分散投資コア戦略ファンドA	2,532,180,367円
分散投資コア戦略ファンドS	7,116,174,312円
コア投資戦略ファンド(切替型)	261,385,186円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	216,654,717円
ヘッジファンドSMTBセクション(SMA専用)	9,336,179,913円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	134,065,315円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	32,173,083円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)	155,457,944円
FOFs用GBCAファンドS(ミドルリスク型)(適格機関投資家専用)	220,518,404円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年 7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		16,802,800
合計		16,802,800

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

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2025年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	20,521,510,276	-	20,404,435,615	117,074,661
	売建	11,788,518,959	-	11,741,161,676	47,357,283
合計		32,310,029,235	-	32,145,597,291	69,717,378

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2025年 7月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	11,497,783,969	-	11,587,569,721	89,785,752
	アメリカドル	3,433,976,508	-	3,474,609,400	40,632,892
	ユーロ	2,273,868,062	-	2,296,370,828	22,502,766
	ノルウェークローネ	2,990,959,969	-	3,017,747,829	26,787,860
	オーストラリアドル	2,798,979,430	-	2,798,841,664	137,766
	売建	12,947,041,037	-	13,217,494,162	270,453,125
	カナダドル	1,377,172,374	-	1,377,300,243	127,869
	イギリスポンド	894,696,972	-	894,738,455	41,483
	スイスフラン	4,291,147,009	-	4,462,086,375	170,939,366
	スウェーデンクローナ	5,550,185,705	-	5,649,200,006	99,014,301
	ニュージーランドドル	833,838,977	-	834,169,083	330,106
	合計	24,444,825,006	-	24,805,063,883	180,667,373

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第1244回国庫短期証券	3,000,000,000	2,999,613,000	
	第1294回国庫短期証券	1,700,000,000	1,694,022,800	
	第1300回国庫短期証券	7,000,000,000	6,971,615,000	
	合計	11,700,000,000	11,665,250,800	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【分散投資コア戦略ファンドA】

【純資産額計算書】

(2025年 7月31日現在)

資産総額	93,815,237,845円
負債総額	207,942,395円
純資産総額(-)	93,607,295,450円
発行済口数	82,040,238,826口
1口当たり純資産額(/)	1.1410円
(1万口当たり純資産額)	(11,410円)

【分散投資コア戦略ファンドS】

【純資産額計算書】

(2025年 7月31日現在)

資産総額	241,358,205,663円
負債総額	502,041,322円
純資産総額(-)	240,856,164,341円
発行済口数	163,757,258,265口
1口当たり純資産額(/)	1.4708円
(1万口当たり純資産額)	(14,708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

(2025年 7月31日現在)

資産総額	805,249,076,732円
負債総額	27,314,792,681円
純資産総額(-)	777,934,284,051円
発行済口数	248,021,629,906口
1口当たり純資産額(/)	3.1366円
(1万口当たり純資産額)	(31,366円)

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

(2025年 7月31日現在)

資産総額	5,905,203,213円
負債総額	756,450円
純資産総額(-)	5,904,446,763円
発行済口数	3,221,030,945口

1口当たり純資産額（ / ）	1.8331円
（1万口当たり純資産額）	（18,331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

（2025年 7月31日現在）

資産総額	744,954,055,668円
負債総額	11,361,510,996円
純資産総額（ - ）	733,592,544,672円
発行済口数	583,812,064,853口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2566円
（1万口当たり純資産額）	（12,566円）

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

（2025年 7月31日現在）

資産総額	73,970,950,072円
負債総額	1,771,432,008円
純資産総額（ - ）	72,199,518,064円
発行済口数	88,502,431,265口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8158円
（1万口当たり純資産額）	（8,158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

（2025年 7月31日現在）

資産総額	892,114,916,817円
負債総額	6,659,339,466円
純資産総額（ - ）	885,455,577,351円
発行済口数	115,690,437,315口
1口当たり純資産額（ / ）	7.6537円
（1万口当たり純資産額）	（76,537円）

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2025年 7月31日現在）

資産総額	19,461,380,314円
負債総額	29,597,503円
純資産総額（ - ）	19,431,782,811円
発行済口数	7,662,147,449口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5361円

（1万口当たり純資産額）	（25,361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

（2025年 7月31日現在）

資産総額	404,798,811,716円
負債総額	128,862,676円
純資産総額（ - ）	404,669,949,040円
発行済口数	108,928,163,002口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7150円
（1万口当たり純資産額）	（37,150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

（2025年 7月31日現在）

資産総額	269,963,470,739円
負債総額	5,957,988,598円
純資産総額（ - ）	264,005,482,141円
発行済口数	49,810,353,564口
1口当たり純資産額（ / ）	5.3002円
（1万口当たり純資産額）	（53,002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

（2025年 7月31日現在）

資産総額	176,400,590,751円
負債総額	70,920,027円
純資産総額（ - ）	176,329,670,724円
発行済口数	71,158,590,180口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4780円
（1万口当たり純資産額）	（24,780円）

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2025年 7月31日現在）

資産総額	104,785,412,049円
負債総額	1,518,613,253円
純資産総額（ - ）	103,266,798,796円
発行済口数	44,387,933,366口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3265円
（1万口当たり純資産額）	（23,265円）

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2025年 7月31日現在)

資産総額	145,112,323,066円
負債総額	169,109,227円
純資産総額（ - ）	144,943,213,839円
発行済口数	45,827,674,655口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1628円
（1万口当たり純資産額）	（31,628円）

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2025年 7月31日現在)

資産総額	49,888,022,099円
負債総額	1,699,709,692円
純資産総額（ - ）	48,188,312,407円
発行済口数	25,819,044,874口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8664円
（1万口当たり純資産額）	（18,664円）

HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2025年 7月31日現在)

資産総額	3,274,524,718円
負債総額	64,999,076円
純資産総額（ - ）	3,209,525,642円
発行済口数	3,426,449,500口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9367円
（1万口当たり純資産額）	（9,367円）

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

純資産額計算書

(2025年 7月31日現在)

資産総額	23,990,436,268円
負債総額	167,528,545円
純資産総額（ - ）	23,822,907,723円
発行済口数	22,043,681,962口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0807円
（1万口当たり純資産額）	（10,807円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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（2025年 7月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長は、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・リスク委員会に報告されます。なお、運用・リスク委員会での報告のうち重要なものについては、経営会議（議長は社長）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10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。

2025年7月31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	527	16,726,592
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	45	124,872
単体型公社債投資信託	49	153,636
合計	621	17,005,100

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	14,909	18,950
金銭の信託	18,596	18,214
前払費用	429	238
未収委託者報酬	10,943	12,164
未収運用受託報酬	5,967	6,523
未収収益	185	198
短期差入証拠金	3,660	2,476
その他	4,074	3,072
流動資産合計	58,767	61,839
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 219	1 189
器具備品	1 436	1 338
その他	1 -	1 4
有形固定資産合計	655	532
無形固定資産		
ソフトウェア	7,463	7,143
その他	61	78
無形固定資産合計	7,524	7,221
投資その他の資産		
投資有価証券	5,753	7,241
関係会社株式	6,077	6,077
繰延税金資産	1,196	1,184
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,058	14,534
固定資産合計	21,238	22,289
資産合計	80,005	84,128

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	86	66
未払金	8,475	8,472
未払収益分配金	0	0

未払手数料	5,524	6,159
その他未払金	2,951	2,313
未払費用	797	993
未払法人税等	694	1,743
賞与引当金	719	769
その他	957	705
流動負債合計	11,730	12,751
固定負債		
退職給付引当金	975	1,104
資産除去債務	154	154
その他	42	60
固定負債合計	1,171	1,319
負債合計	12,902	14,071
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	45,974	48,819
利益剰余金合計	48,574	51,419
株主資本合計	67,813	70,658
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	360	454
繰延ヘッジ損益	1,071	1,056
評価・換算差額等合計	710	601
純資産合計	67,103	70,057
負債・純資産合計	80,005	84,128

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	44,551	50,052
運用受託報酬	11,077	12,144
その他営業収益	356	369
営業収益合計	55,985	62,566

営業費用		
支払手数料	22,341	25,372
広告宣伝費	342	258
公告費	0	1
調査費	5,796	6,470
調査費	1,172	1,511
委託調査費	4,610	4,945
図書費	14	13
営業雑経費	5,887	6,296
通信費	78	126
印刷費	439	406
協会費	56	57
諸会費	29	45
情報機器関連費	5,193	5,570
その他営業雑経費	89	89
営業費用合計	34,369	38,399
一般管理費		
給料	6,981	7,585
役員報酬	385	476
給料・手当	5,432	5,753
賞与	1,163	1,355
退職給付費用	278	305
福利費	747	812
交際費	13	13
旅費交通費	191	175
租税公課	276	300
不動産賃借料	328	324
寄付金	0	-
減価償却費	2,239	2,501
業務委託費	1,544	1,399
諸経費	1,637	1,394
一般管理費合計	14,239	14,813
営業利益	7,376	9,353

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業外収益		
受取利息	138	64
収益分配金	0	1
金銭の信託運用益	4,007	-
投資有価証券売却益	1	150
投資有価証券償還益	1	0
その他	12	27
営業外収益合計	4,162	243
営業外費用		

金銭の信託運用損	-	207
投資有価証券売却損	33	17
投資有価証券償還損	1	257
為替差損	1,273	660
デリバティブ費用	3,613	47
その他	3	107
営業外費用合計	4,925	1,296
経常利益	6,613	8,300
特別損失		
システム移行関連費用	-	147
特別損失合計	-	147
税引前当期純利益	6,613	8,153
法人税、住民税及び事業税	1,931	2,519
法人税等還付税額	-	129
法人税等調整額	95	25
法人税等合計	2,027	2,364
当期純利益	4,585	5,788

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：百万円）

株主資本	

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		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
当期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
当期純利益			5,788	5,788	5,788
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,845	2,845	2,845
当期末残高	500	2,100	48,819	51,419	70,658

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,943
当期純利益				5,788
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	94	14	108	108
当期変動額合計	94	14	108	2,954
当期末残高	454	1,056	601	70,057

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直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。

（未適用の会計基準等）

リースに関する会計基準等

・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日）

・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日）

ほか、関連する企業会計基準、企業会計基準適用指針、実務対応報告及び移管指針の改正

(1) 概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリースについて資産・負債を計上する等の取扱いを定めるもの。

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

（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 (2024年3月31日)		当事業年度 (2025年3月31日)	
建物	220	百万円	253	百万円
器具備品	823	"	942	"
その他	-	"	1	"
計	1,044	"	1,197	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(2) 基準日が当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
2025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
2025年6月20日 定時株主総会	普通株式	999	利益剰余金	333,333	2025年3月31日	2025年6月23日

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、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、*3及び(注2)、(注4)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(2024年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額(百万円)(*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等(貸借対照表計上額1,017百万円)は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式(貸借対照表計上額876百万円)及び組合出資金等(貸借対照表計上額359百万円)は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度(2025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	2,551	15,662	-	18,214
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,785	-	3,785
資産計	2,551	19,448	-	21,999
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(128)	235	-	106
通貨関連取引	-	78	-	78
デリバティブ取引計	(128)	314	-	185

(*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。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式(貸借対照表計上額887百万円)、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(貸借対照表計上額1,976百万円)及び第24-16項を適用した組合出資金等(貸借対照表計上額592百万円)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。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
投資有価証券	876	887
関係会社株式	6,077	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(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	-

当事業年度(2025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	18,950	-	-	-
未収委託者報酬	12,164	-	-	-
未収運用受託報酬	6,523	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	2,053	2,400	-

(注4) 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

前事業年度(2024年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2025年3月31日)

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位:百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさなとこととした額	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)	-	-	23	2,000	1,976	-	1,976	-

(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1,976百万円であります。

(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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
子会社株式	6,077	6,077

2. その他有価証券

前事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,394	2,593	800

小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

当事業年度（2025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	3,110	2,402	708
小計	3,110	2,402	708
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	2,651	2,712	61
小計	2,651	2,712	61
合計	5,762	5,115	647

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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
非上場株式	876	887
組合出資金等	359	592

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	528	150	17

（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（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
合計		8,231	-	10	10

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2025年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,575	-	37	37
	英ポンド	141	-	0	0
	カナダドル	118	-	0	0
	スイスフラン	52	-	0	0
	香港ドル	166	-	1	1
	ユーロ	425	-	1	1
	買建				
	米ドル	139	-	0	0
	英ポンド	5	-	0	0
	カナダドル	6	-	0	0
	スイスフラン	5	-	0	0
	香港ドル	1	-	0	0
	ユーロ	16	-	0	0
合計		6,654	-	41	41

(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（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンズ ワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2025年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	9,848	-	128	128
店頭	トータルリターンズ ワップ取引 売建	6,179	-	235	235
合計		16,027	-	106	106

(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（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英債券		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

当事業年度（2025年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		1,947	-	13	
	英債券		4,700	-	19	
	スイスフラン		47	-	0	
	香港ドル		122	-	0	
	ユーロ		40	-	0	
	シンガポールドル		449	-	3	
	買建					
	米ドル		16	-	0	
	香港ドル		94	-	0	
合計			7,419	-	36	

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
退職給付債務の期首残高	911	993
勤務費用	149	165
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	11	150
退職給付の支払額	85	42
簡便法で計算した退職給付費用	1	0
退職給付債務の期末残高	993	970

(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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	993	970
未認識数理計算上の差異	17	134
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	975	1,104

退職給付引当金	975	1,104
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	975	1,104

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
勤務費用	149	165
利息費用	3	3
数理差異償却	0	1
簡便法で計算した退職給付費用	1	0
確定給付制度に係る退職給付費用	155	171

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
割引率	0.4%	2.0%

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122百万円、当事業年度134百万円であります。

(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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	63 百万円	104 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	220 "	235 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	298 "	348 "
税務上の費用認識差額	256 "	94 "
繰延ヘッジ損益	472 "	486 "
その他	78 "	169 "
繰延税金資産 合計	1,390 "	1,437 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	159 "	209 "
その他	35 "	43 "
繰延税金負債 合計	194 "	252 "
繰延税金資産の純額	1,196 "	1,184 "

(注) 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律（令和7年法律第13号）」が2025年3月31日に成立したことに伴い、2026年4月1日以後に開始する事業年度から「防衛特別法人税」の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.62%から、2026年4月1日以後開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については31.52%となります。この税率変更により、当事業年度の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が18百万円増加、繰延ヘッジ損益が13百万円増加、その他有価証券評価差額金が5百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が10百万円減少しております。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.06%
法人税等還付税額	-	1.59%
その他	-	0.10%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	29.01%

(注)前事業年度は、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 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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025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	11,023百万円

[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 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引	運用受託報酬	10,721	未収運用受託報酬	5,856
							投信販売代行手数料等	11,500	未払手数料	2,813

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

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

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（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）

当事業年度（2025年3月31日）

三井住友トラストグループ株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
1株当たり純資産額	22,367,677円92銭	23,352,414円83銭
1株当たり当期純利益金額	1,528,527円02銭	1,929,475円95銭

（注）1．潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
当期純利益	4,585百万円	5,788百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,585百万円	5,788百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2025年10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

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2025年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2025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。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

分散投資コア戦略ファンドSの募集・販売等の取扱いを行います。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額：51,000百万円（2025年3月末日現在）

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

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年10月10日	有価証券届出書
2024年10月10日	有価証券報告書
2025年 4月10日	有価証券届出書
2025年 4月10日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2025年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一**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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年9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 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2024年7月11日から2025年7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、分散投資コア戦略ファンドAの2025年7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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年9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 百瀬和政

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2024年7月11日から2025年7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、分散投資コア戦略ファンドSの2025年7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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。