【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2026年4月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	コア投資戦略ファンド（切替型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

コア投資戦略ファンド（切替型）
愛称として、「コアラップ（切替型）」という名称を用いることがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

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

（5）【申込手数料】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、3.3%（税抜　3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1円以上1円単位です。

（７）【申込期間】

2026年 4月11日から2026年10月 9日までとします。
継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

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

コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、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。

＜スイッチング＞

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（※）の取扱いを行う場合があります。

＜受付不可日＞に該当する場合は、スイッチングの取扱いは行いません。

販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

※スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

＜受付不可日＞

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　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＞

一般社団法人資産運用業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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 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）） 資産複合 （　　） 資産配分 固定型 資産配分 変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	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 （　　）

（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、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（https://www.imaj.or.jp/）でもご覧いただけま

す。

◆一般社団法人資産運用業協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

(1)国内…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)海外…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産(収益の源泉)による区分］

(1)株式…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(2)債券…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の

記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

(1)株式

①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

［決算頻度による属性区分］

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

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

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

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

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

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

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

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

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

［特殊型］

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

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

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

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

◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

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、バンクローン、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連動性（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機動的な調整を行います。

●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。

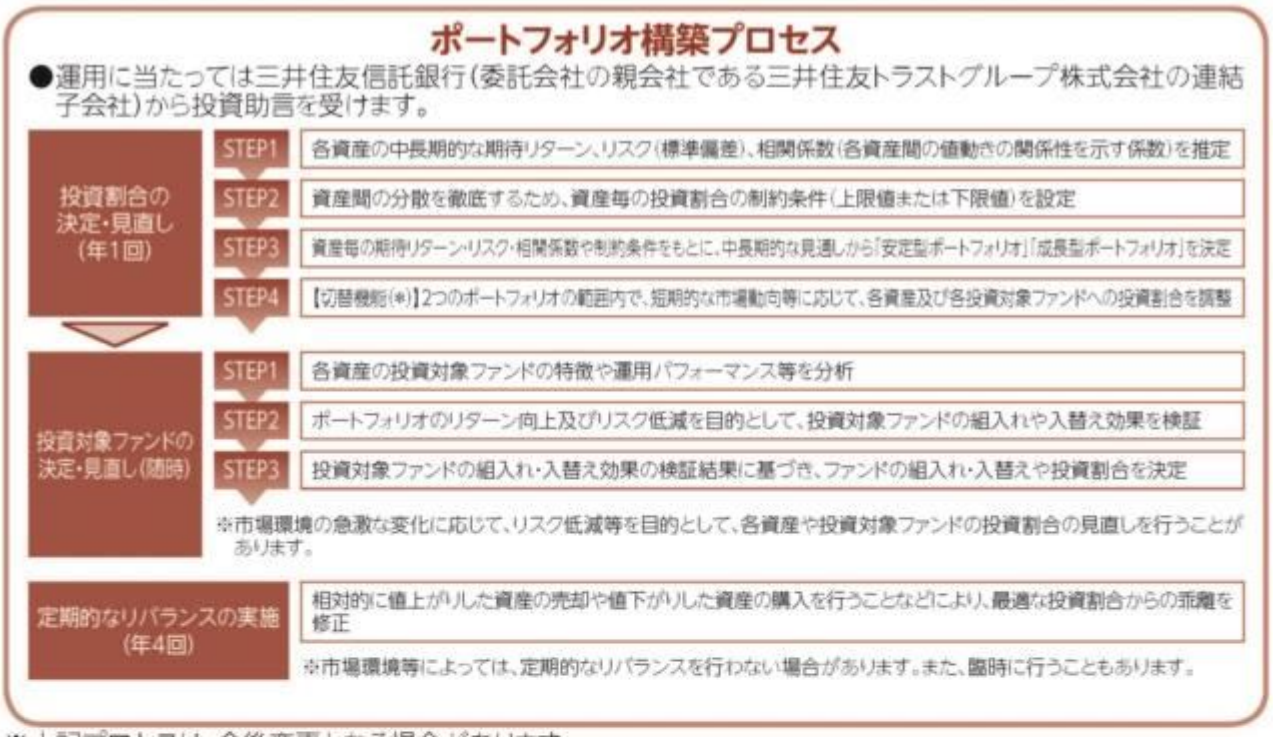
ファンドは中長期的に安定的な収益を獲得することを目指して、市場環境等の変化に応じた運用を行うため、投資対象とする資産及びファンドを限定していません。また、それらへの投資割合も予め定めているものでもありません。

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。

●「株式」、「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、75%未満とします。

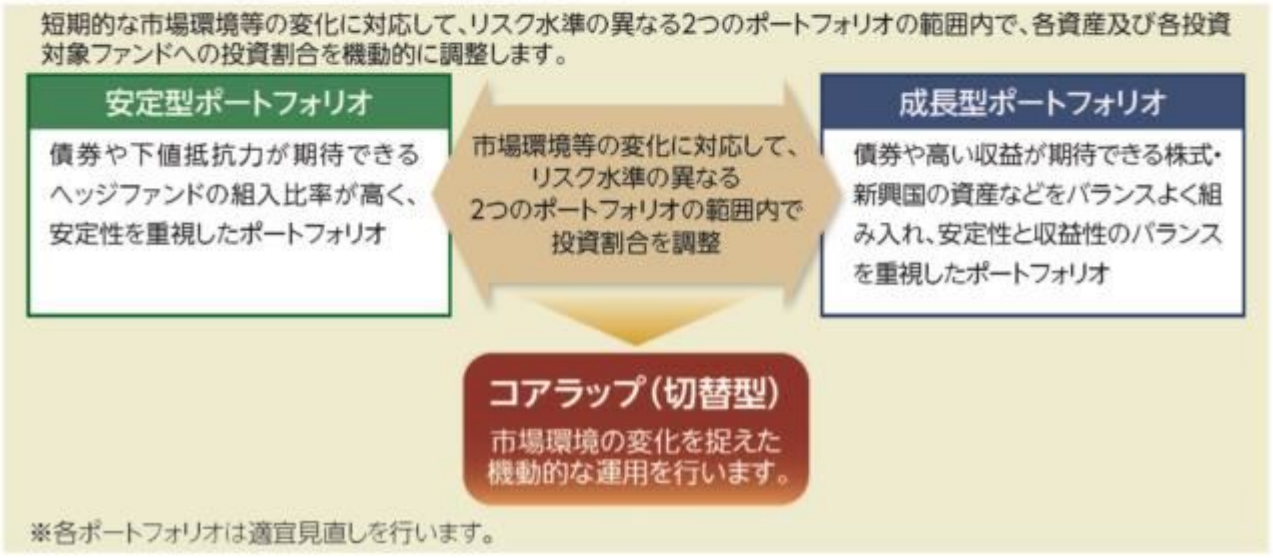
※当該投資割合には、ヘッジファンドに投資する投資対象ファンドが含まれていないため、ヘッジファンドへの投資割合が高くなる可能性があります。ヘッジファンドには特有のリスクがありますので、後掲「3　投資リスク　(1)ファンドのリスク　⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク」を十分にお読みください。

●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。



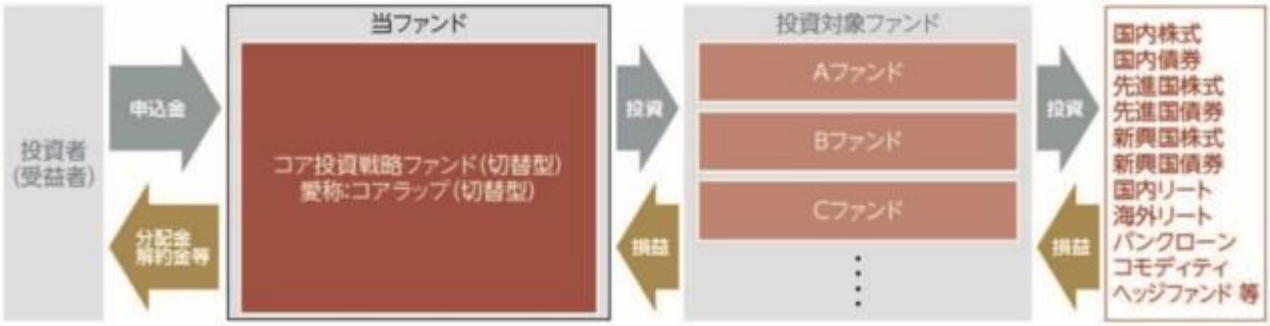
※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

<(*)「コアラップ(切替型)」の切替機能のイメージ>



ファンドのしくみ

ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



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

ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

主な投資制限

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

〈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。

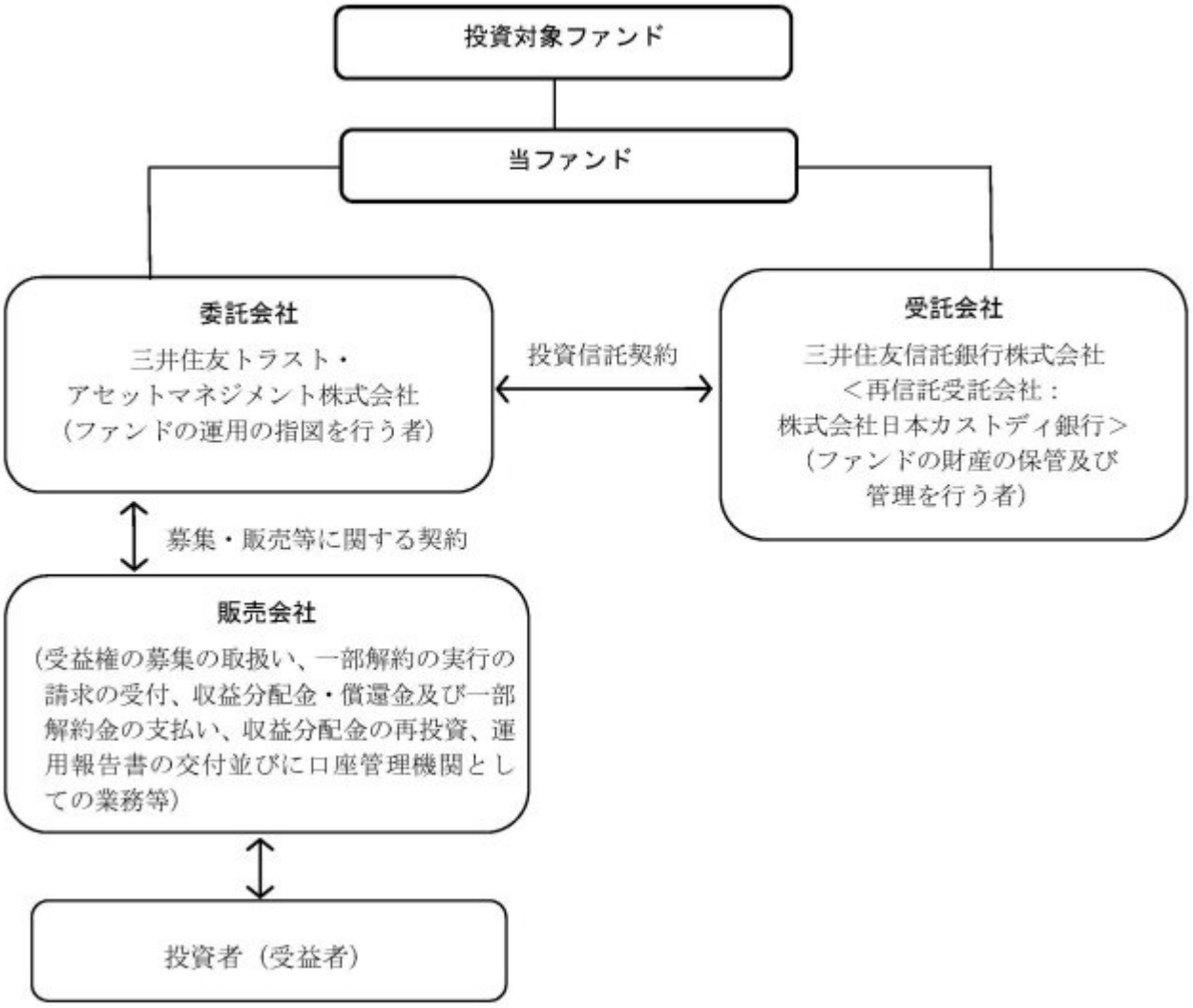
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2013年10月17日　　当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2026年 1月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①基本方針

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。なお、投資対象とするファンドは、当該ファンドの投資対象資産及び投資手法等を考慮して選定しております。

②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。

③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も機動的に調整を行います。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、75%未満とします。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】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券

2. 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

②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。

③金融商品の指図範囲

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

1.預金

2.指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3.コール・ローン

4.手形割引市場において売買される手形

ロ．上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④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、2026年1月30日（（★）のファンドに関しては2026年3月5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。

※一般社団法人の名称は2026年4月1日現在で記載しています。

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、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。**
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	**①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。** **②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。** **③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。** **④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。** **⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。**

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は、行いません。 ③新株引受権証券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。 ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ⑤同一銘柄の転換社債、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。 ⑥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。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券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、一般社団法人資産運用業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	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。

①TOPIX（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。

②ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みＴＯＰＩＸ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。

③ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及び配当込みＴＯＰＩＸ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ＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

④ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸ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、ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではない。

⑥ＪＰＸ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。

⑦ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みＴＯＰＩＸ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。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸ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ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	**三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社**
運用の基本方針	**この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。**
主要投資対象	**わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。**
投資態度	**①主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）（※）に連動する投資成果を目指します。** **②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。** **③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。** **④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。** **⑤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	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②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。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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、一般社団法人資産運用業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ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）
決算日	年1回：4月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年4月23日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

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

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

3.日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークであるＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※）に対する超過リターンを目指します。 ②株式の組入比率は、原則として信託財産総額の90%以上とします。 ③信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑤信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑦信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑤同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑦同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：11月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2002年12月20日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

4.国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	アクティブバリュー マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資を行ない、長期的な観点からわが国の株式市場全体（ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み））の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行ないません。 ④一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業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。 ⑤デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
ベンチマーク	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：10月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.517%（税抜　0.47%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2018年9月28日
信託期間	2018年9月28日から2028年10月25日
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

5.日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	**ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社**
運用の基本方針	**信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主要投資対象	**日本長期成長株集中投資マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。**
投資態度	**①主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、その組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。 ②信託財産は、マザーファンドを通じて主として日本の上場株式（これに準ずるものを含みます。）に投資します。マザーファンドにおいては、個別企業の分析を重視したボトム・アップ手法による銘柄選択を行い、原則として大型株式および中小型株式の中から持続的な成長が期待できると判断する比較的少数の銘柄でポートフォリオを構築し、長期的な投資元本の成長を追求します。 ③事業の収益性、経営陣の質に加えて株価評価基準の総合評価、目標株価からの乖離、流動性等を勘案して、銘柄選択を行います。 ④投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うこともあります。 ⑤ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（シンガポール）ピーティーイー・リミテッドに日本株式の運用（デリバティブ取引等に係る運用を含みます。）の指図に関する権限を委託します。 ⑥市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。**

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ③新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ⑦株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ⑧デリバティブ取引等については、一般社団法人資産運用業協会規則に従い、委託者が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑨一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年2回：6月および12月の15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎計算期末に原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。 ②分配金額は、基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本を下回る場合においても分配を行うことがあります。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず、元本部分と同様に運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7095%（税抜　0.645%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2014年6月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

6.FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）（配当込み）（※）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュー指標（ＰＢＲ、ＰＥＲ、配当利回り）等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③株式以外の資産（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑤信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑦信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことができます。 ⑧安定した収益の確保および効率的な運用を行うためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の５第１項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行いません。 イ．投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的 ロ．信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以内とします。 ⑤同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑥外貨建資産への投資は行いません。 ⑦デリバティブ取引等については、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業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	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
決算日	年1回：6月6日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、運用会社が決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.495%（税抜　0.45%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月17日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

7.ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「日本グロース株マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本の株式を主要投資対象とし、ＧＡＲＰ（Growth at a Reasonable Price）戦略に基づき、アクティブ運用することにより信託財産の成長を目指して運用を行います。 ②銘柄選定に関しては、ボトムアップ・アプローチによる定性分析とバリュエーション分析を重視し、組織運用による銘柄選定を行います。 ③ＴＯＰＩＸ(東証株価指数)(配当込み)（※）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ④株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。 ④一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業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	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)
決算日	年1回：11月16日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	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。 ①分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、運用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、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を定めず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

信託報酬	純資産総額に対して以下に定める率とします。 ・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜　0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜　0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜　0.35%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2024年3月18日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

8.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	①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①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。 ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人資産運用業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	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。

9.マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど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	①マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 ②NOMURA-BPI総合（※）を参考指数として、ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ④大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 ⑤一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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、一般社団法人資産運用業協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑥デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。 ⑦同一銘柄の株式、転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧信用取引、空売り、有価証券の借入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	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。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託者が基準価額の水準・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等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。
信託報酬	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.264% （税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.297% （税抜　0.27%） １%以上の場合　・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.33% （税抜　0.3%）

信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
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。

10.明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド（以下、「マザーファンド」ということがあります）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等へ分散投資を行うとともに、国債先物取引、国債先物オプション取引、選択権付債券売買取引（国債店頭オプション取引）等を行い、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②NOMURA-BPI総合（※）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。 ③信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付会社によるBBB格相当以上の格付を有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると判断した公社債に投資します。 ④債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。 ⑤マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人資産運用業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	NOMURA-BPI総合
決算日	年1回：5月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②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、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③収益分配金にあてず信託財産内に留保した利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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.264%以内（税抜　0.24%以内）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9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」は、日本国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表すために、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よって計算、公表されている投資収益指数で、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の知的財産です。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、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

11.ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。

主要投資対象	ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを主要投資対象とします。なお直接、公社債等への投資、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を行う場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの主要投資対象＞ わが国の公社債を主要投資対象とします。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの主要投資対象＞ 主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用します。
投資態度	①ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドを通じて、主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行います。 ②NOMURA-BPI（総合）指数（※）をベンチマークとし、ベンチマークを中長期的に上回る投資成果の獲得をめざします。 ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンドの投資態度＞ ①NOMURA-BPI（総合）指数をベンチマークとします。 ②主としてわが国の公社債に投資し、債券種類別構成比の調整や社債の個別銘柄選択等、信用リスクの適切な管理を主な超過収益源として、上記ベンチマークを中長期的に上回ることを目標に運用を行います。 ③公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの投資態度＞ ①主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、安定したインカム収益の確保と信託財産の成長をめざした運用を行います。 ②組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。 ③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資は転換社債の転換及び新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権をいいます。 ②同一銘柄の転換社債及び転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。 ⑥デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑦デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑧一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業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。
ベンチマーク	NOMURA-BPI（総合）指数
決算日	年1回：6月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。ただし、ニッセイ国内公社債クレジット特化型 マザーファンド及びニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型） マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分　年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分　　年率0.253%（税抜　0.23%）
信託財産留保額	取得申込受付日及び解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.03%の率を乗じて得た額
設定日	2023年4月5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

※「NOMURA-BPI（総合）指数」とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、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よって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。

12.ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「年金日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	①マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として次のような運用を行います。 ・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数（※）をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことができます。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または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。 ・信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。ただし、マザーファンド受益証券への投資には、制限を設けません。 ②株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ⑤デリバティブ取引等については、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。 ⑥一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業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	NOMURA-BPI総合指数
決算日	年1回：1月27日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	毎決算時に、原則として以下の方針に基づいて分配金額を決定します。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益も含みます。）等の範囲内とします。 ②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、運用会社が決定します。ただし、運用会社の判断により分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用については特に制限を設けず、運用会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	信託報酬率は、毎計算期間において、計算期間の開始日の属する月の前月最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発10年固定利付国債の利回り（終値）　信託報酬率 2%未満の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.2035%（税抜　0.185%） 2%以上3%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2475%（税抜　0.225%） 3%以上4%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.2915%（税抜　0.265%） 4%以上5%未満の場合・・・・純資産総額に対し、年率0.3355%（税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・純資産総額に対し、年率0.3795%（税抜　0.345%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2023年4月10日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「NOMURA-BPI総合指数」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債券市場の動向を的確に表すための市場指数です。日本の債券市場のベンチマークに多く利用されています。NOMURA-BPI総合指数に関する一切の知的財産権その他の一切の権利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ております。また、同社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

13.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	①原則としてＭＳＣＩコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。 ⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。 ⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。 ⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

主な投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに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。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑧一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人資産運用業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・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。

14.外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIコクサイセレクション指数（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目指します。 ②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤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	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②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。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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、一般社団法人資産運用業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コクサイセレクション指数（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：6月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2021年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCIコクサイセレクション指数」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にＥＳＧ評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

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

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

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

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

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

15.ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

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

主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。 ④外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ⑦運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑤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。 ⑥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。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑨外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑩一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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	MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則、毎決算時に分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。 ※分配金は、決算日から起算して５営業日以内に支払われます。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.671%（税抜　0.61%） 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。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年9月24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オール・カントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全てMSCI Inc.に帰属しま

す。MSCI Inc.では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

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

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。 ③MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）（※）をベンチマークとします。 ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。 ②徹底的なリサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。 ③運用にあたっては、Sanders Capital，LLCに運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。 ④MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ⑤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。 ⑥資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑩一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人資産運用業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。
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年1回：3月5日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	・分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.7381%（税抜　0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年3月7日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

17.世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

運用会社	アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	世界エクイティ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。以下同じ。）
投資態度	①主として、世界エクイティ・マザーファンド受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ③ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ②株式の銘柄選定にあたっては、市場動向や銘柄毎の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ④外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ⑤ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用指図権限をアモーヴァ・アセットマネジメント・ＵＫリミテッドに委託します。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則として以下の通り収益分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益及び売買益（評価益を含む）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。 ・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜　0.54%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022年12月16日
信託期間	2022年12月16日から2038年5月20日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

18.ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）

運用会社	ＪＰモルガン・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、この投資信託にかかる信託財産（以下「信託財産」といいます。）の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。
主要投資対象	ＧＩＭグローバル・セレクト株式マザーファンド（適格機関投資家専用）（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。 ＜マザーファンドの主要投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、マザーファンドの受益証券に投資します。 ②外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）およびみなし保有外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。 ③MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）（※）をベンチマークとします。 ④資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、上記①～③にしたがった運用が行えない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を除く世界各国の株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。 ②外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。 ③MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）をベンチマークとします。 ④資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、上記①～③にしたがった運用が行えない場合があります。

主な投資制限	①株式への投資割合には、制限を設けません。 ②投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ③外貨建資産への投資割合は、制限を設けません。 ④有価証券についての有価証券関連デリバティブ取引および有価証券関連デリバティブ取引以外のデリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定します。
ベンチマーク	MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）
決算日	年1回：10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.55%（税抜　0.5%） その他の費用 ・ファンド監査にかかる費用として、信託財産の純資産総額に年0.022%（税抜0.02%）（上限）の率を乗じて得た額、または年間330万円（税抜300万円）のうちいずれか少ない額を当ファンドより支弁します。 ・財務諸表その他この信託の内容にかかる開示または報告を行う資料の印刷等にかかる費用、振替受益権の管理に関する費用、この信託にかかる計理事務にかかる費用等は、ファンドの純資産総額に委託者が合理的な基準により決定する一定の率（上限年率0.033%（税抜0.03%））を乗じた額をその費用の合計額とみなして、毎日信託財産に費用計上します。
信託財産留保額	解約申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2024年10月10日
信託期間	原則として無期限
運用の外部委託先	マザーファンドの運用の指図に関する権限を「Ｊ．Ｐ．モルガン・インベストメント・マネージメント・インク」に委託します。
受託会社	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

※「MSCIコクサイ指数」は、MSCI Inc.が発表しています。同インデックスに関する情報の確実性および完結性をMSCI Inc.は何ら保証するものではありません。著作権はMSCI Inc.に帰属しています。
「MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）」は、MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）を運用会社にて円ベースに換算したものです。

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

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。

投資態度	①主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。 ②投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス（ESG）や社会的規範を考慮した運用を行います。 ③市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。 ④市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	年率0.525% その他の費用 ファンド管理費用がかかります。 その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日
信託期間	無期限
関係法人	・管理会社 キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル ・投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・管理事務代行会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・名義書換事務受託会社 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・保管受託銀行 J.P.モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）

20.FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)

投資顧問会社	Fisher Asset Management, LLC

運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	①主として世界各国の株式に投資することで、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ②フィッシャーグループのグローバルなリサーチ・プラットフォームを活用し、トップダウンの視点で投資対象にアプローチします。 ③主に国、セクター、その他マクロ要因が株式リターンを左右するという見解に基づき、マクロ見通しを最大限に活用して投資銘柄を選定します。 ④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	①株式への投資割合は、原則として高位を維持します。 ②デリバティブの利用は行いません。 ③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。 ④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。 ⑤一発行会社（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。 ⑥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。
ベンチマーク	MSCIワールド・インデックス※
決算日	年1回：9月30日
収益の分配	無分配とします。
信託報酬	年率0.7%（上限）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	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およびデリバティブ取引に要する費用等なら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。
設定日	2016年5月27日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージャー） Carne Global Fund Managers (Ireland) Limited ・投資顧問会社（インベストメントアドバイザー） Fisher Asset Management, LLC ・受託会社（トラスティ） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Fund 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） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・保管受託銀行（カストディ） State Street Custodial Services (Ireland) Limited

※「MSCIワールド・インデックス」は、先進市場の大型株および中型株の株式市場のパフォーマンスを測定するために設計された、浮動株調整時価総額加重指数です。2026年1月30日現在で、ベンチマークには次の23の先進市場国が含まれています：オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、香港、アイルランド、イスラエル、イタリア、日本、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スウェーデン、スイス、英国、米国。

21.世界債券総合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	**ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（※）（以下「ベンチマーク」ということがあります。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。**
投資態度	**①主としてベンチマークを構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ②債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、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。 ⑤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	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②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。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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、一般社団法人資産運用業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	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）
決算日	年1回：4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	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0.1%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2023年4月21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・グローバル総合（日本円除く）インデックス」とは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行なうインデックスであり、円建て債券を除く世界の投資適格債券市場を示すインデックスです。「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指数です。Bloomberg (R) 及びブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。

22.フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（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、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な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・外国債券・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	①フィデリティ・外国債券・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、世界各国の投資適格債券（除く日本円）を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を目的として運用を行ないます。 ②実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行ないません。 ③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。
主な投資制限	①株式への実質的な直接投資は、原則として行ないません。ただし、転換社債の転換ならびに新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものを除きます。 ②外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 ③同一銘柄の株式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。 ④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。 ⑤一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月30日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	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。 ①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。 ②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。 ③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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.451%（税抜0.41%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
設定日	2021年7月16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

23.L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）

運用会社	大和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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	L&Gグローバル総合債券（除く日本）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	①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、日本を除く世界の債券（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下同じ。）に投資し、中長期的にベンチマーク（ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）（※））を上回る投資成果をめざします。 ＊マザーファンドにおいて、ETF（上場投資信託証券）を通じて債券に投資する場合があります。 ②マザーファンドの運用にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ．原則として、投資する債券の格付けは、取得時においてBBB格相当以上（格付けがない債券のうち、リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッドが同等の信用力があると判断するものを含みます。）とします。 ロ．投資成果の向上を図るため、債券および通貨にかかるデリバティブ取引ならびに為替取引をヘッジ目的以外でも行ないます。 ③マザーファンドの外貨建資産の運用にあたっては、リーガル＆ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ⑤為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 ⑥当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 ⑦当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみに取得させることを目的とします。
主な投資制限	①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 ②株式への実質投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合翌営業日）（第1期決算日は2026年4月15日）
収益の分配	①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 ②分配金額は、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.3498%（税抜0.318%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2025年4月11日

信託期間	原則として無期限
運用の委託先	名称：リーガル&ジェネラル・インベストメント・マネジメント・リミテッド 所在の場所：英国　ロンドン 委託の内容：外貨建資産の運用に関する権限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「Bloomberg(R)」および「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」は、Bloomberg Finance L.P.、および同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limited（以下「BISL」）をはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）のサービスマークであり、大和アセットマネジメント株式会社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。
当ファンドについて、ブルームバーグは後援、支持、販売、または宣伝するものではありません。ブルームバーグは、一般的な証券への投資の推奨可能性または特に当ファンドへの投資の推奨可能性について、当ファンドの所有者もしくは相手先に、あるいは一般の人々に、明示、黙示を問わずいかなる表明、保証も行いません。大和アセットマネジメント株式会社とブルームバーグの唯一の関係は、特定の商標、商号、サービスマークの使用許諾、および「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」の使用許諾であり、これは、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドを考慮せずに、BISLが決定、構成、計算します。ブルームバーグは「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」を決定、構成、もしくは計算する際に、大和アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務はありません。ブルームバーグは当ファンドの発行時期、発行価格、発行数について責任を負わず、それに関与していません。ブルームバーグは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、当ファンドの顧客（これらに限定されません）に対し、いかなる義務、法的責任も負いません。
ブルームバーグは、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」もしくはそれらに関連するデータの正確性および／または完全性を保証するものではなく、それに関連する過誤、不作為、または中断に対して一切の責任を負いません。ブルームバーグは、大和アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、もしくはその他の個人または法人が「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」、またはそれに関連するデータを使用したことで、獲得する結果について、明示的にも黙示的にもいかなる保証も行いません。ブルームバーグは、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」もしくはそれらに関連するデータについて、特定の目的もしくは使用に対する商品性または適合性に関する明示的、黙示的な保証を行わず、あらゆる保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、法律で最大限に許される限り、ブルームバーグ、そのライセンサー、およびそれぞれの従業員、請負業者、エージェント、サプライヤー、ベンダーは、当ファンド、「ブルームバーグ・グローバル総合インデックス（除く日本、円ベース）」またはそれらに関するデータまたは値について、過失、その他によるかにかかわらずその可能性について知らされていた場合でも、直接的、間接的、結果的、偶発的、懲罰的、またはそれ以外の被害または損害について法的責任もしくは責任を負いません。

24. Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class

投資運用会社	BNY Mellon Investment Management Japan Limited
運用の基本方針	安定したインカムの確保と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	世界各国の政府および非政府機関（民間企業等）が発行する債券等を主要投資対象とします。

投資態度	①主として世界各国の政府および非政府機関（民間企業等）が発行する債券等に投資します。投資適格の社債、新興国債券、資産担保証券、転換社債等を中心とし、ハイイールド債券やバンクローンなど非投資適格の資産にも一部投資します。また、債券先物等のデリバティブにも投資します。 ②金利戦略、クレジット戦略および通貨戦略を組み合わせることにより、ポートフォリオを構築します。 ③債券等への投資割合は、原則として高位を維持します。 ④組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤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	①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。 ②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。 ③一発行会社（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。 ④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。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：1月31日
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	・管理会社報酬および運用会社報酬：年率0.24%（上限） ・受託会社報酬：年率0.01%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00） ・管理事務代行会社報酬：年率0.07%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD25,000.00） ・保管受託銀行報酬：年率0.05%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	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、デリバティブ取引に要する費用等、法律および税務顧問および監査人の報酬および費用、ファンドの財務およびその他の報告書、目論見書および類似書類の作成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。
設定日	2025年4月11日
信託期間	原則として無期限

関係法人	・管理会社 BNY Mellon International Management Limited ・投資運用会社 BNY Mellon Investment Management Japan Limited ・副投資運用会社 Insight Investment Management (Global) Limited ・受託会社 CIBC Caribbean Bank and Trust Company (Cayman) Limited ・管理事務代行会社 Nomura Bank (Luxembourg) S.A. ・保管受託銀行 Nomura Bank (Luxembourg) S.A.

25.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	①主として、取引所に上場されている新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。 ②株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。 ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託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。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人資産運用業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。

26.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	①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。 ②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。 ③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。 ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②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。 ③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。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤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号ロ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。 ⑥一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。 ⑦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、一般社団法人資産運用業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	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ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

①同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、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ＪＰＸが有しています。

②ＪＰＸ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。

③ＪＰＸ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。

④ＪＰＸ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、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。

⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥ＪＰＸ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。

⑦ＪＰＸ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。

⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸ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。

27.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	①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。 ②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。 ③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。 ④投資信託財産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号ロ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。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②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。 ③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。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑤一般社団法人資産運用業協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ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、一般社団法人資産運用業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。 ⑥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、一般社団法人資産運用業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	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随する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随する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。SPDJIは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、又はホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。
S&P Dow Jones Indicesは、当インデックス又はその関連データ、あるいは口頭又は書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、又は完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる誤り、欠落又は中断に対して、いかなる義務又は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的又は黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックス又はそれに関連するデータの商品性、特定の目的又は使用への適合性、それらを使用することによって当社、当ファンドの所有者、又はその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間又は信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、又は派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、又は厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと当社との間の契約又は取り決めの第三者受益者は存在しません。

28.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	①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。 ②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。 ③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。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、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。 ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	①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。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥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。 ⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。 ⑧一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人資産運用業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	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。 主要投資対象である米ドル建て債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・米ドル建て債券の評価額に対して年率0.5%～0.8%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 ・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。
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 Index SM）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 Index SM）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 Index SM）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。

29.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＞（2026年1月30日現在） iShares Gold Trust Micro SPDR Gold MiniShares Trust

投資態度	①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。 ②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。 ③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。 ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）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ます。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ⑤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	①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（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。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買及び商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限ります。）について、一般社団法人資産運用業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	LBMA金価格（円ヘッジベース）（※）（2026年1月30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。

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

管理会社	BlueBay Funds Management Company S.A.
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
主要投資対象	わが国を含む世界の投資適格債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。 なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。
投資態度	①主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。なお、投資適格未満の格付の債券等に投資することもあります。 ②ポートフォリオの構築は、買建（ロングポジション）だけでなく売建（ショートポジション）でも行います。また、債券投資の代替手段としてデリバティブ取引を活用することがあります。 ③債券の組入総額とデリバティブ取引の想定元本の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④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。 ⑤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	①投資適格債券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以上とします。 ②投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年6月30日（休業日の場合は前営業日）
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託報酬	年率0.74% なお、この報酬率には投資顧問会社の運用報酬の他、管理会社・管理事務代行会社・名義書換事務受託会社・保管受託銀行の報酬が含まれています。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2011年5月24日
関係法人	・管理会社 BlueBay Funds Management Company S.A. ・投資顧問会社 RBC Global Asset Management (UK) Limited ・副投資顧問会社 RBC Global Asset Management (U.S.) Inc. ・管理事務代行会社／名義書換事務受託会社／保管受託銀行 Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

31. 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）

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	①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。 ※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。 ②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。 ③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	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、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。 ②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。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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、一般社団法人資産運用業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	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	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。 ①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。 ②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。 ③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。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.066%（税抜　0.06%） 実質的に投資対象とする円建債券に係る費用等は、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。
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

32.コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてブルームバーグ商品指数（※）の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数」※１といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。 ※2運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②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。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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、一般社団法人資産運用業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	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。 主要投資対象である円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券の評価額に対して年率0.8%～1%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 ・円建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）及び「ブルームバーグ（Bloomberg ®）」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 Index SM）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 Index SM）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。

33.米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

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

主要投資対象	主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略※1に基づいて償還価格が決定される円建債券（以下、「円建債券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※1）この投資信託において米国株式イントラデイ・トレンド戦略とは、米国株式市場の1日の取引時間中の値動き※2を捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までに解消する戦略です。なお、株式市場の値動きによっては、同一日に買い建てポジションと売り建てポジションを同時に構築することや、買い建てポジションの合計額あるいは売り建てポジションの合計額が一時的に投資信託財産の純資産総額の2倍程度になることがあります。 ※2）当該戦略の参照対象は、S&P500のほかダウ・ジョーンズ工業株価平均（NYダウ）やナスダック総合指数等の株価指数、あるいはこれらの株価指数先物も含みます。
投資態度	①円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。 ②円建債券への投資割合は、原則として高位を維持します。 ③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	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②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。 ③外貨建資産への投資は行いません。 ④一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、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、一般社団法人資産運用業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	該当事項はありません。
決算日	年1回：3月10日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。 主要投資対象である円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券の評価額に対して年率0.22%～0.5%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 ・円建MMFもしくはそれに類するものに投資した場合、信託報酬等の費用が発生することがありますが、投資対象により報酬率が異なる等の理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2020年10月6日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

34.ＧＢＣＡ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	①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。 ②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。 ③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	①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使、株式分割、株主割当又は社債権者割当により取得したものに限ることとし、投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②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。 ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ④デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑤為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。 ⑥一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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。 ⑦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、一般社団法人資産運用業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	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

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

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

投資態度	各マザーファンド受益証券を主要投資対象、株価指数先物取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。 ①各マザーファンド受益証券に投資を行うとともに、株価指数先物取引を活用します。株価指数先物取引の活用にあたっては、実質的に投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、株価指数先物取引の売建てを行います。各マザーファンド受益証券への投資割合および株価指数先物取引の売建ての枚数は、市場環境や各マザーファンドの特性等を考慮し、適宜調整を行うことを基本とします。 ②各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として信託財産の純資産総額の70%～90%程度を維持することを基本とします。ただし、株価指数先物取引を行うにあたって必要となる証拠金の額等によっては、上記の範囲とならない場合があります。 ③非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜日本成長株投資マザーファンドの投資態度＞ ①わが国の株式の中から、個別企業の調査・分析等に基づいたボトムアップアプローチにより、企業の経営戦略や財務戦略などを通じて長期的な株主資本成長や利益成長が期待できる銘柄を選定します。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、株主資本や利益等の成長率の高さ及びその継続性等に関する評価に基づき組入銘柄を決定し、バリュエーション評価（株価の割高・割安の度合い）等を勘案して組入比率を決定します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。 ④非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ⑤資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 ＜野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンドの投資態度＞ ①株式への投資にあたっては、財務リスク・流動性等を考慮し、投資候補銘柄を選定した上で定量モデルにより最適化を行い、ポートフォリオのボラティリティを最小化することを目指します。 ②ポートフォリオの最適化にあたっては、業種配分、投資銘柄数、個別銘柄への投資比率、取引コスト等を勘案します。 ③株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とすることを基本とします。 ④資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ④デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。 ⑤新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。 ⑥同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑦同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。 ⑧投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。 ⑨一般社団法人資産運用業協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。 ⑩一般社団法人資産運用業協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.506%（税抜　0.46%）
信託財産留保額	解約申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2019年4月10日
信託期間	無期限
受託会社	野村信託銀行株式会社

36.MA Hedge Fund Strategies Limited

運用会社	O'Connor Alternative Investments, LLC
運用の基本方針	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。
主要投資対象	主として世界各国（日本を含みます。）の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。

投資態度	①公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。 ②ポートフォリオ構築プロセスに沿って適切な格付を付与、これに基づき確信度、リスク/リターン、ファンダメンタル要因などの分析結果に基づきポジションを決定します。 ③為替変動リスクを回避するために、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主な投資制限	①投資法人財産を超える有価証券（現物に限ります）の空売りは行いません。 ②投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 ③一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の50%超を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。 ④流動性に欠ける資産への投資は、投資法人財産の15%以下とします。 ⑤外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 ⑥一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。 ⑦投資信託証券への投資は行いません。 ⑧デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：12月31日（決算日が休日の場合は、前営業日となります。）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	運用報酬：年率0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年10月10日
関係法人	・運用会社 O'Connor Alternative Investments, LLC ・保管銀行・管理事務代行会社 MUFG Alternative Fund Services (Ireland) Limited

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

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
運用の基本方針	オルタナティブ運用手法を活用して投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物に投資します。

投資態度	・主として世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物で運用します。 ・トレーディング・アドバイザーの支援を受けて、各先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉します。 ・各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築します。 ・資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	・先物での運用割合（想定元本ベース）は、投資信託財産の純資産総額の90%以上とします。 ・現物の空売りは行いません。 ・発行体の法的支配や経営権の取得を企図した有価証券の取得を行いません。 ・投資信託財産の純資産総額の10%を超える借り入れは行いません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月の最終ファンド営業日
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	固定報酬：年率0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年12月19日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社（マネージャー） SG Corporate Services (CI) Limited ・投資顧問会社（トレーディング・アドバイザー） Graham Capital Management, L.P. ・副管理会社（サブ・マネージャー） Amundi Asset Management S.A.S ・管理事務代行会社（アドミニストレーター） Societe Generale Securities Services France S.A. ・名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） CACEIS Bank, Luxembourg Branch ・保管受託銀行（カストディ） Kleinwort Hambros Trust Company (CI) Limited

38.JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund Class I (perf) (acc) - JPY (hedged)（★）

投資顧問会社	JPMorgan Asset Management (UK) 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	欧州に本拠を置く、または欧州にて主な経済活動を行う企業の株式等

投資態度	①主として、直接またはデリバティブを活用して、欧州企業の株式の買建（ロングポジション）および売建（ショートポジション）を組み合わせることで、市場エクスポージャーを抑制しながら投資信託財産の成長を目指します。なお、小型株に投資することがあります。 ②ボトムアップ・アプローチを基本とし、ファンダメンタルズ分析と、定量的な分析を組み合わせることで、幅広いユニバースの中から銘柄選択を行います。 ③ロング・ショート戦略により、魅力的と判断した企業の株式を買い、魅力的でないと判断した企業の株式を空売りします。 ④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	①一発行会社に対する投資比率は、純資産総額の10%以下とします。 ②純資産総額の５％を超えて投資する発行体に対する投資比率の総計は、純資産総額の40%以下とします。
ベンチマーク	ICE BofA TONAR Overnight Rate Index（※）
決算日	年1回：6月30日
収益の分配	原則として分配を行ないません。
信託報酬	・運用報酬：年率0.75% ・管理報酬：年率上限0.16% ・成功報酬：15.0%
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	組入有価証券の売買等取引にかかる費用および手数料等管理費用に含まれない費用が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	2026年3月5日
信託期間	原則として無期限
関係法人	・管理会社 JPMorgan Asset Management (Europe) S.a r.l. ・投資顧問会社 JPMorgan Asset Management (UK) Limited ・管理事務代行会社 J P. Morgan SE, Luxembourg Branch ・名義書換事務受託会社 JPMorgan Asset Management (Europe) S.a r.l. ・保管受託銀行 J P. Morgan SE, Luxembourg Branch

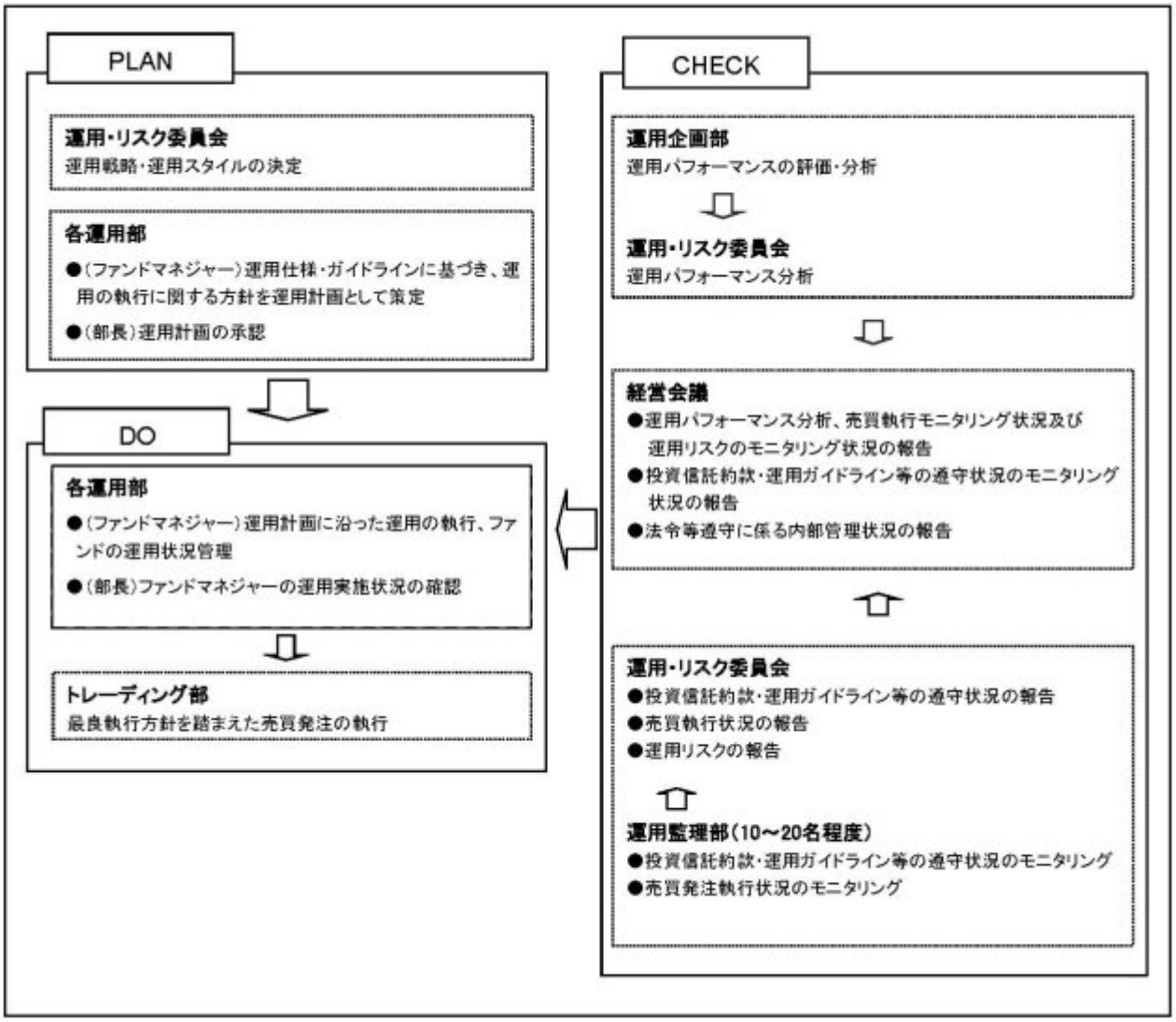
※ICE BofA TONAR Overnight Rate Indexは、ICE Data Indices, LLC が公表しているものであり、著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は同社に帰属します。

ICE BofA TONAR Overnight Rate Index SM/ (R) is a service/trade mark of ICE Data Indices, LLC or its affiliates (“ICE Data”) and has been licensed, along with the ICE BofA TONAR Overnight Rate Index (“Index”) for use by LICENSEE in connection with JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund-I (perf) (acc) - JPY (hedged) (the “Fund”). Neither the LICENSEE, J P. Morgan SE, Luxembourg Branch (the “Trust”) nor the Fund, as applicable, is sponsored, endorsed, sold or promoted by ICE Data. ICE Data makes no representations or warranties regarding the advisability of investing in securities generally, in the Fund particularly, the Trust or the ability of the Index to track general stock market performance.
ICE DATA AND ITS RESPECTIVE THIRD PARTY SUPPLIERS MAKE NO EXPRESS OR IMPLIED WARRANTIES, AND HEREBY EX-PRESSLY DISCLAIMS ALL WARRANTIES OF MER-CHANTABILITY OR FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE WITH RESPECT TO THE INDEX, INDEX VALUES OR ANY DATA INCLUDED THEREIN. IN NO EVENT

SHALL ICE DATA HAVE ANY LIABILITY FOR ANY SPECIAL, PUNITIVE, DIRECT, INDIRECT, OR CONSEQUENTIAL DAMAGES (INCLUDING LOST PROFITS), EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES.

（３）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

イ．投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ．株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ．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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

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

（ニ）上記（イ）の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

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。

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

（ニ）借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ヌ．一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

①株価変動リスク

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

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧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。

⑨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。

⑩ヘッジファンドの運用手法に係るリスク

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

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

⑪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。

⑫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、ファンドが大きな影響を被る可能性があります。

⑬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。

⑭ESGの投資リスク

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

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

①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。

②分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

③ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市

場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

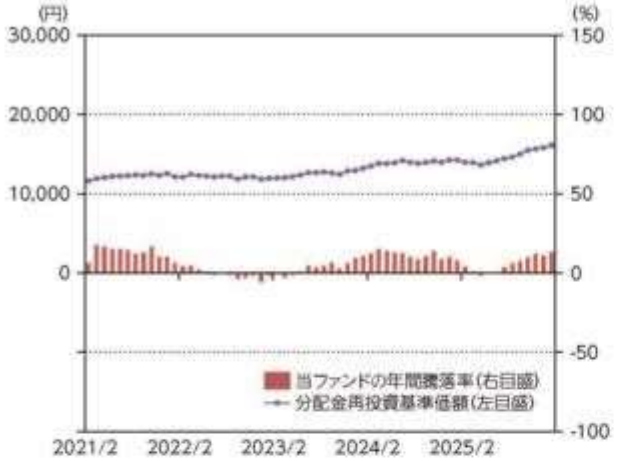
(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

*2021年2月～2026年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数値の算出、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向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガンガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

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

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

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

④当ファンドが投資対象ファンドに投資する際に信託財産留保額（※3）がかかる場合、当該信託財産留保額を当ファンドが負担します。

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　1.518%（税抜　1.38%）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　0.968%　（税抜　0.88%）	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　0.495%　（税抜　0.45%）	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

※2026年 4月10日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

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、実質的に投資対象とする仕組み債券の発行・管理手数料等として、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ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	ありません。
国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.517%　（税抜　0.47%）
日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.7095%　（税抜　0.645%）
FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.495%　（税抜　0.45%）
ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	・純資産総額200億円未満の部分 年率0.495%（税抜　0.45%） ・純資産総額200億円以上400億円未満の部分 年率0.44%（税抜　0.4%） ・純資産総額400億円以上の部分 年率0.385%（税抜　0.35%）
国内債券インデックス マザーファンド	ありません。

マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	毎年3月および9月の最終営業日における日本相互証券株式会社の発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下の通りとし、当該最終営業日の翌月の21日以降で、前日が営業日である最初の営業日から適用するものとします。 新発10年固定利付国債の利回り　信託報酬 0.5%未満の場合・・・・・・・・・年率　0.264% （税抜　0.24%） 0.5%以上１%未満の場合・・・・・年率　0.297% （税抜　0.27%） １%以上の場合 ・・・・・・・・・年率　0.33% （税抜　0.3%）
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.264%以内　（税抜　0.24%以内）
ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	・純資産総額100億円以下の部分 年率0.275%（税抜　0.25%） ・純資産総額100億円超の部分 年率0.253%（税抜　0.23%）
ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	信託報酬率は、毎計算期間において、計算期間の開始日の属する月の前月最終営業日における日本相互証券株式会社が発表する新発10年固定利付国債の利回り（終値）に応じて以下に定める率とします。 新発10年固定利付国債の利回り（終値）　信託報酬率 2%未満の場合・・・・・・・・年率0.2035% （税抜　0.185%） 2%以上3%未満の場合・・・・年率0.2475% （税抜　0.225%） 3%以上4%未満の場合・・・・年率0.2915% （税抜　0.265%） 4%以上5%未満の場合・・・・年率0.3355% （税抜　0.305%） 5%以上の場合・・・・・・・・年率0.3795% （税抜　0.345%）
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.671%　（税抜　0.61%）
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	年率　0.7381%　（税抜　0.671%）

世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	・純資産総額100億円以下の部分 年率0.704%（税抜　0.64%） ・純資産総額100億円超、200億円以下の部分 年率0.649%（税抜　0.59%） ・純資産総額200億円超の部分 年率0.594%（税抜　0.54%）
ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	年率　0.55%　（税抜　0.5%）
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率　0.525%
FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares （unhedged）	年率　0.7%（上限）
世界債券総合インデックスマザーファンド	ありません。
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.451%　（税抜　0.41%）
L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）	年率　0.3498%　（税抜　0.318%）
Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class	・管理会社報酬および運用会社報酬：年率　0.24%（上限） ・受託会社報酬：年率0.01%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00） ・管理事務代行会社報酬：年率0.07%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD25,000.00） ・保管受託銀行報酬：年率0.05%（上限） （ただし、最低報酬額年間USD15,000.00）
新興国株式インデックス 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。 主要投資対象である米ドル建て債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・米ドル建て債券の評価額に対して年率0.5%～0.8%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	ありません。
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	年率　0.74%

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）	年率　0.066%（税抜　0.06%） 実質的に投資対象とする円建債券に係る費用等は、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。
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ありません。 主要投資対象である円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券の評価額に対して年率0.8%～1%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ありません。 主要投資対象である円建債券に係る費用等は、以下の通りです。 ・円建債券の評価額に対して年率0.22%～0.5%程度（投資比率による加重平均）が発行・管理手数料等としてかかります。 これらの費用等は全て、今後、変更となる場合があります。
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	ありません。
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	年率　0.506%　（税抜　0.46%）
MA Hedge Fund Strategies Limited	運用報酬：年率　0.6% 成功報酬：15% 月末最終営業日時点の1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の月末最終営業日時点での純資産価格の最高値）を上回った場合、超過部分の15%。
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	固定報酬：年率　0.85% 成功報酬：12% 1口当たり純資産価格がハイ・ウォーター・マーク（過去の決算日の純資産総額の最高値）を上回った場合、超過部分の12%
JPMorgan Funds - Europe Equity Absolute Alpha Fund Class I (perf) (acc) - JPY (hedged)	・運用報酬：年率0.75% ・管理報酬：年率上限0.16% ・成功報酬：15.0%

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（実質的に投資対象とする仕組み債券等に係る費用等を含みます。）の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況等により実質的な信託報酬率は変動します。なお、投資対象ファンドによっては、別途運用実績に基づき計算される成功報酬額がかかる場合があります。

◎実質的な信託報酬率：年率1.518%～2.395%程度（税抜　1.38%～2.25%程度）

（投資対象とする投資信託証券（ファンドが実質的に投資対象とする仕組み債券等に係る費用等を含みます。）：年率0.0%～0.877%程度（税抜　0.0%～0.87%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】

①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。

②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、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を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

⑤これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.495%（税抜0.45%）を乗じて得たものとします。
手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。また、上場投資信託証券は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託証券の費用は表示しておりません。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

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

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

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

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

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

い。

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

※上記は、2026年 1月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの経費率は以下の通りです。

経費率（①＋②）	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.80%	1.53%	0.27%

※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運用管理費用は、その他費用に含まれています。なお、運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれていません。

※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。

※実質的に仕組み債券や上場投資信託証券等を組み入れた場合には、それぞれ固有の費用が内包されることがありますが、上記には含まれておりません。

※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、2026年1月30日現在の状況について記載してあります。

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	15,760,694,823	51.81
	ケイマン	418,791,551	1.38
	小計	16,179,486,374	53.19
投資証券	ルクセンブルク	2,046,930,839	6.73
	ケイマン	559,686,737	1.84
	アイルランド	363,184,989	1.19
	ジャージー	223,466,544	0.73
	小計	3,193,269,109	10.50
親投資信託受益証券	日本	10,785,859,319	35.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	261,706,060	0.86
合計(純資産総額)		30,420,320,862	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	投資信託受益証券	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	2,100,569,572	0.9017	1,894,104,588	0.8762	1,840,519,058	6.05
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）	606,380,988	1.8981	1,150,971,754	3.0188	1,830,542,926	6.02
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	448,624,538	3.1048	1,392,889,466	3.8435	1,724,288,411	5.67
日本	親投資信託受益証券	世界債券総合インデックスマザーファンド	1,197,899,187	1.2328	1,476,804,582	1.3089	1,567,930,245	5.15
日本	投資信託受益証券	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,751,995,231	0.9045	1,584,726,990	0.8744	1,531,944,629	5.04
日本	投資信託受益証券	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,709,892,913	0.9265	1,584,325,217	0.8953	1,530,867,125	5.03
日本	投資信託受益証券	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	573,210,892	2.0584	1,179,940,532	2.5954	1,487,711,549	4.89
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	401,956.328	2,923.33	1,175,054,334	3,614	1,452,670,169	4.78
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	412,928,779	3.1613	1,305,397,836	3.4306	1,416,593,469	4.66
日本	投資信託受益証券	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,353,416,829	0.9335	1,263,430,850	0.9015	1,220,105,271	4.01
日本	投資信託受益証券	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	431,029,196	2.0999	905,156,139	2.7247	1,174,425,250	3.86
日本	投資信託受益証券	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	385,939,302	2.1375	824,951,433	2.9391	1,134,314,202	3.73
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	560,881,770	1.686	945,671,877	1.9655	1,102,413,118	3.62
日本	投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	559,723,966	1.7711	991,327,681	1.8247	1,021,328,320	3.36
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	353,905,074	2.2293	788,960,582	2.5354	897,290,924	2.95
日本	投資信託受益証券	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	230,146,267	3.2855	756,155,193	3.5528	817,663,657	2.69
日本	投資信託受益証券	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	590,169,720	1.2627	745,252,592	1.3287	784,158,506	2.58
日本	投資信託受益証券	ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	58,773	10,796.67	634,552,707	12,163	714,855,999	2.35
日本	親投資信託受益証券	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	794,454,223	0.6572	522,115,316	0.8340	662,574,821	2.18
ルクセンブルク	投資証券	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	53,211.544	11,118.12	591,612,331	11,167.89	594,260,670	1.95
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）	505,041,227	1.106	558,589,233	1.1629	587,312,442	1.93
ケイマン	投資証券	MA Hedge Fund Strategies Limited	53,377	10,248.94	547,057,670	10,485.54	559,686,737	1.84
日本	親投資信託受益証券	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	439,983,267	1.2751	561,022,664	1.2312	541,707,398	1.78
ケイマン	投資信託受益証券	Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class	362,088,493	1.08	393,208,015	1.15	418,791,551	1.38
日本	投資信託受益証券	L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）	342,942,816	1.0751	368,713,205	1.1323	388,314,150	1.28
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	56,483,336	5.2924	298,933,887	6.8200	385,216,351	1.27
アイルランド	投資証券	FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)	26,493.667	11,624.38	307,972,671	13,708.37	363,184,989	1.19

日本	親投資信託受益証券	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	155,286,528	1.9652	305,181,574	2.2818	354,332,799	1.16
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	40,264,305	7.6329	307,337,221	8.7611	352,759,602	1.16
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）	286,327,642	1.0750	307,802,216	1.0911	312,412,090	1.03

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	53.19
投資証券	10.50
親投資信託受益証券	35.46
合計	99.14

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

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3期計算期間末　(2016年 7月11日)	30,311,407,780	30,311,407,780	10,121	10,121
第4期計算期間末　(2017年 7月10日)	27,946,158,080	27,946,158,080	10,720	10,720
第5期計算期間末　(2018年 7月10日)	31,588,404,244	31,588,404,244	10,895	10,895
第6期計算期間末　(2019年 7月10日)	31,612,123,675	31,612,123,675	10,862	10,862
第7期計算期間末　(2020年 7月10日)	28,489,916,074	28,489,916,074	10,680	10,680
第8期計算期間末　(2021年 7月12日)	29,305,810,861	29,305,810,861	12,276	12,276
第9期計算期間末　(2022年 7月11日)	30,094,696,745	30,094,696,745	12,081	12,081
第10期計算期間末　(2023年 7月10日)	32,359,119,133	32,359,119,133	12,548	12,548
第11期計算期間末　(2024年 7月10日)	32,815,511,954	32,815,511,954	14,354	14,354
第12期計算期間末　(2025年 7月10日)	28,709,948,537	28,709,948,537	14,212	14,212
2025年 1月末日	29,809,427,726	—	14,233	—
2月末日	28,705,614,734	—	13,954	—
3月末日	28,510,333,946	—	13,931	—
4月末日	27,753,665,253	—	13,615	—
5月末日	28,293,650,874	—	13,906	—
6月末日	28,643,119,232	—	14,136	—
7月末日	28,995,298,950	—	14,426	—
8月末日	29,198,378,904	—	14,632	—
9月末日	29,690,347,682	—	14,980	—

10月末日	30,239,684,888	—	15,484	—
11月末日	30,204,888,336	—	15,644	—
12月末日	30,052,265,826	—	15,788	—
2026年 1月末日	30,420,320,862	—	16,114	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第4期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第5期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第6期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第7期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第8期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第9期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第10期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0
第11期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0
第12期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第3期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	△6.2
第4期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	5.9
第5期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.6
第6期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	△0.3
第7期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	△1.7
第8期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.9
第9期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	△1.6
第10期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	3.9
第11期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	14.4
第12期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	△1.0
第13期中間計算期間	2025年 7月11日～2026年 1月10日	12.5

(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3期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	5,892,656,977	1,314,548,833	29,948,251,518
第4期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	1,610,441,134	5,489,774,092	26,068,918,560
第5期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	10,500,659,721	7,576,138,726	28,993,439,555
第6期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	7,219,577,787	7,109,737,294	29,103,280,048
第7期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	4,135,234,340	6,562,751,288	26,675,763,100
第8期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	2,229,880,533	5,033,545,480	23,872,098,153
第9期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	3,902,131,262	2,862,618,517	24,911,610,898

第10期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	2,976,027,979	2,099,867,593	25,787,771,284
第11期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	1,370,035,532	4,296,043,470	22,861,763,346
第12期計算期間	2024年 7月11日～2025年 7月10日	636,436,125	3,297,036,296	20,201,163,175
第13期中間計算期間	2025年 7月11日～2026年 1月10日	192,172,814	1,386,598,255	19,006,737,734

(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	902,871,594,020	99.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	6,301,309,545	0.69
合計(純資産総額)		909,172,903,565	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	5,937,820,000	0.65

(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	9,512,300	2,735.08	26,016,901,484	3,504.00	33,331,099,200	3.67
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	11,117,800	2,009.93	22,345,999,754	2,804.50	31,179,870,100	3.43
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,598,600	4,091.84	18,816,735,424	5,361.00	24,653,094,600	2.71
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	6,172,700	3,159.34	19,501,658,018	3,454.00	21,320,505,800	2.35
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	3,871,800	3,722.45	14,412,581,910	5,472.00	21,186,489,600	2.33
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,499,100	4,080.79	10,198,302,289	6,783.00	16,951,395,300	1.86
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	378,700	24,279.03	9,194,468,661	41,310.00	15,644,097,000	1.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,774,400	2,991.30	11,290,362,720	4,097.00	15,463,716,800	1.70
日本	株式	三菱重工業	機械	3,386,200	3,384.60	11,460,932,520	4,519.00	15,302,237,800	1.68
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3,439,900	2,019.09	6,945,467,691	4,253.00	14,629,894,700	1.61
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	563,900	7,837.06	4,419,318,134	25,505.00	14,382,269,500	1.58
日本	株式	三井物産	卸売業	2,722,100	3,044.49	8,287,406,229	5,035.00	13,705,773,500	1.51
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	6,363,200	1,530.89	9,741,359,248	1,971.00	12,541,867,200	1.38

日本	株式	任天堂	その他製品	1,129,700	12,327.19	13,926,026,543	10,055.00	11,359,133,500	1.25
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,360,500	8,962.60	12,193,617,300	8,100.00	11,020,050,000	1.21
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,811,900	6,134.38	11,114,883,122	5,727.00	10,376,751,300	1.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	179,000	62,209.83	11,135,559,570	56,440.00	10,102,760,000	1.11
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,979,700	3,045.38	6,028,938,786	4,830.00	9,561,951,000	1.05
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	344,400	17,752.89	6,114,095,316	25,870.00	8,909,628,000	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,596,900	4,259.05	6,801,276,945	5,242.00	8,370,949,800	0.92
日本	株式	信越化学工業	化学	1,593,900	4,652.10	7,414,982,190	5,129.00	8,175,113,100	0.90
日本	株式	ＮＴＴ	情報・通信業	49,276,700	155.84	7,679,280,928	154.90	7,632,960,830	0.84
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	127,800	48,667.81	6,219,746,118	58,800.00	7,514,640,000	0.83
日本	株式	丸紅	卸売業	1,444,700	2,946.96	4,257,473,112	5,115.00	7,389,640,500	0.81
日本	株式	富士通	電気機器	1,663,100	3,351.05	5,573,131,255	4,283.00	7,123,057,300	0.78
日本	株式	住友商事	卸売業	1,134,900	3,748.35	4,254,002,415	6,249.00	7,091,990,100	0.78
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	2,522,100	2,506.91	6,322,677,711	2,606.50	6,573,853,650	0.72
日本	株式	日本電気	電気機器	1,186,800	3,817.45	4,530,549,660	5,210.00	6,183,228,000	0.68
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	3,886,400	1,494.75	5,809,196,400	1,555.00	6,043,352,000	0.66
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	28,862,900	222.87	6,432,674,523	209.00	6,032,346,100	0.66

(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。

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	0.38
		建設業	2.47
		食料品	2.66
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.14
		化学	4.44
		医薬品	3.62
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.61
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.78
		非鉄金属	1.85
		金属製品	0.43
		機械	6.39
		電気機器	18.42
		輸送用機器	6.81
		精密機器	1.89
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.34

	陸運業	2.11
	海運業	0.51
	空運業	0.29
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	6.48
	卸売業	7.95
	小売業	4.13
	銀行業	10.95
	証券、商品先物取引業	1.03
	保険業	3.05
	その他金融業	1.15
	不動産業	1.95
	サービス業	3.37
	小計	99.31
合計		99.31

(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	166	円	6,017,452,300	5,937,820,000	0.65

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

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

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	26,135,502,970	99.32
投資証券	日本	56,281,700	0.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	123,800,945	0.47
合計(純資産総額)		26,315,585,615	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	82,271,000	0.31

(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	486,700	2,376.44	1,156,617,576	3,504.00	1,705,396,800	6.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	235,300	2,968.80	698,559,616	5,361.00	1,261,443,300	4.79
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	315,800	2,569.07	811,315,325	3,454.00	1,090,773,200	4.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	188,200	3,081.75	579,987,228	5,472.00	1,029,830,400	3.91
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	23,000	18,696.60	430,021,825	41,310.00	950,130,000	3.61
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	127,900	3,322.57	424,957,074	6,783.00	867,545,700	3.30
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	196,300	1,819.49	357,166,733	4,253.00	834,863,900	3.17
日本	株式	三菱重工業	機械	164,600	2,345.94	386,142,102	4,519.00	743,827,400	2.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	305,200	1,289.78	393,643,395	1,971.00	601,549,200	2.29
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	72,300	6,956.77	502,975,116	8,100.00	585,630,000	2.23
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	9,800	43,140.46	422,776,576	58,800.00	576,240,000	2.19
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	94,400	4,779.70	451,204,537	5,727.00	540,628,800	2.05
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	17,600	15,588.24	274,353,043	25,870.00	455,312,000	1.73
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	150,500	2,357.58	354,815,800	2,606.50	392,278,250	1.49
日本	株式	富士通	電気機器	90,400	2,799.35	253,061,294	4,283.00	387,183,200	1.47
日本	株式	丸紅	卸売業	72,500	2,227.34	161,482,428	5,115.00	370,837,500	1.41
日本	株式	日本電気	電気機器	66,600	3,098.70	206,373,658	5,210.00	346,986,000	1.32
日本	株式	ディスコ	機械	4,700	44,513.03	209,211,284	66,190.00	311,093,000	1.18
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,474,900	202.07	298,038,512	209.00	308,254,100	1.17
日本	株式	中外製薬	医薬品	34,500	6,562.34	226,400,868	8,801.00	303,634,500	1.15
日本	株式	ファナック	電気機器	47,900	3,392.59	162,505,269	6,269.00	300,285,100	1.14
日本	株式	小松製作所	機械	48,800	3,914.89	191,046,736	5,929.00	289,335,200	1.10
日本	株式	オリックス	その他金融業	59,700	2,815.56	168,088,966	4,694.00	280,231,800	1.06
日本	株式	第一三共	医薬品	92,400	3,406.82	314,790,512	2,836.00	262,046,400	1.00
日本	株式	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	保険業	66,100	2,718.43	179,688,724	3,932.00	259,905,200	0.99
日本	株式	パナソニック　ホールディングス	電気機器	119,700	1,458.02	174,525,875	2,117.00	253,404,900	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	13,500	15,663.79	211,461,286	18,585.00	250,897,500	0.95
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	180,500	1,238.83	223,609,848	1,352.50	244,126,250	0.93
日本	株式	ＳＯＭＰＯホールディングス	保険業	45,600	3,984.22	181,680,576	5,316.00	242,409,600	0.92
日本	株式	イオン	小売業	114,400	1,364.12	156,055,901	2,115.00	241,956,000	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、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	0.59
		建設業	2.15
		食料品	2.30
		繊維製品	0.36
		化学	4.96
		医薬品	3.60
		石油・石炭製品	0.88
		ゴム製品	0.78
		ガラス・土石製品	0.37
		鉄鋼	0.45
		非鉄金属	0.98
		金属製品	0.22
		機械	7.82
		電気機器	21.30
		輸送用機器	6.69
		精密機器	2.06
		その他製品	1.39
		電気・ガス業	1.33
		陸運業	2.32
		海運業	0.41
		空運業	0.09
		倉庫・運輸関連業	0.04
		情報・通信業	6.95
		卸売業	4.31
		小売業	4.59
		銀行業	8.13
		証券、商品先物取引業	1.22
		保険業	4.89
		その他金融業	1.13
		不動産業	3.13
		サービス業	3.89
		小計	99.32
投資証券	—	—	0.21
合計			99.53

(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	23	円	82,184,274	82,271,000	0.31

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

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

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	78,767,348,390	99.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	563,314,902	0.71
合計(純資産総額)		79,330,663,292	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,810,600	2,514.03	4,551,908,010	2,804.50	5,077,827,700	6.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	792,600	4,872.84	3,862,220,576	5,472.00	4,337,107,200	5.47
日本	株式	日立製作所	電気機器	614,500	4,913.44	3,019,309,846	5,361.00	3,294,334,500	4.15
日本	株式	ＭＡＲＵＷＡ	ガラス・土石製品	69,000	48,247.91	3,329,105,964	47,640.00	3,287,160,000	4.14
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	77,300	33,090.74	2,557,914,447	41,310.00	3,193,263,000	4.03
日本	株式	三越伊勢丹ホールディングス	小売業	1,231,000	2,478.29	3,050,779,255	2,475.50	3,047,340,500	3.84
日本	株式	三菱重工業	機械	672,700	4,010.76	2,698,042,519	4,519.00	3,039,931,300	3.83
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	100,800	20,271.86	2,043,404,486	25,505.00	2,570,904,000	3.24
日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	369,400	6,385.73	2,358,892,035	6,724.00	2,483,845,600	3.13
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	696,400	4,301.51	2,995,574,931	3,454.00	2,405,365,600	3.03
日本	株式	ディスコ	機械	34,400	45,501.91	1,565,265,751	66,190.00	2,276,936,000	2.87
日本	株式	三菱商事	卸売業	544,000	3,719.97	2,023,667,620	4,097.00	2,228,768,000	2.81
日本	株式	ダイフク	機械	391,000	5,062.57	1,979,468,689	5,538.00	2,165,358,000	2.73
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	599,800	3,155.23	1,892,509,847	3,504.00	2,101,699,200	2.65
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	304,000	5,666.98	1,722,764,504	6,783.00	2,062,032,000	2.60
日本	株式	荏原製作所	機械	440,600	4,022.84	1,772,465,379	4,656.00	2,051,433,600	2.59
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	146,300	10,391.33	1,520,251,718	12,875.00	1,883,612,500	2.37
日本	株式	信越化学工業	化学	343,500	4,766.40	1,637,258,732	5,129.00	1,761,811,500	2.22
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	217,000	8,079.78	1,753,313,433	8,100.00	1,757,700,000	2.22
日本	株式	富士通	電気機器	366,500	4,119.96	1,509,966,631	4,283.00	1,569,719,500	1.98

日本	株式	キーエンス	電気機器	26,900	53,500.57	1,439,165,360	56,440.00	1,518,236,000	1.91
日本	株式	マツキヨココカラ&カンパニー	小売業	572,400	2,796.09	1,600,481,949	2,478.00	1,418,407,200	1.79
日本	株式	富士電機	電気機器	121,800	10,737.66	1,307,847,297	10,990.00	1,338,582,000	1.69
日本	株式	野村総合研究所	情報・通信業	283,400	6,235.39	1,767,111,145	4,701.00	1,332,263,400	1.68
日本	株式	ＪＸ金属	非鉄金属	523,700	1,786.07	935,365,328	2,536.50	1,328,365,050	1.67
日本	株式	ＮＴＴ	情報・通信業	8,518,600	155.96	1,328,628,059	154.90	1,319,531,140	1.66
日本	株式	日本電気	電気機器	233,000	5,631.02	1,312,027,941	5,210.00	1,213,930,000	1.53
日本	株式	第一三共	医薬品	425,800	3,722.90	1,585,212,766	2,836.00	1,207,568,800	1.52
日本	株式	村田製作所	電気機器	378,600	3,232.64	1,223,877,594	3,136.00	1,187,289,600	1.50
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	43,800	23,376.46	1,023,889,291	25,870.00	1,133,106,000	1.43

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	建設業	0.74
		食料品	1.00
		化学	3.28
		医薬品	2.11
		ガラス・土石製品	4.14
		非鉄金属	5.88
		機械	12.97
		電気機器	23.94
		輸送用機器	5.72
		精密機器	1.43
		陸運業	2.30
		情報・通信業	4.70
		卸売業	2.81
		小売業	9.69
		銀行業	14.47
		保険業	1.07
		不動産業	0.82
		サービス業	2.22
		小計	99.29
合計			99.29

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	712,284,040,986	70.35
	イギリス	38,428,007,779	3.80
	カナダ	37,010,011,487	3.66
	スイス	27,595,953,596	2.73
	ドイツ	24,683,560,256	2.44
	フランス	24,293,901,189	2.40
	オランダ	18,788,102,497	1.86
	アイルランド	17,145,373,311	1.69
	オーストラリア	16,204,031,618	1.60
	スペイン	9,959,413,676	0.98
	スウェーデン	9,026,488,166	0.89
	イタリア	7,501,049,426	0.74
	デンマーク	5,292,522,694	0.52
	香港	4,045,623,798	0.40
	シンガポール	3,890,154,634	0.38
	フィンランド	3,040,850,974	0.30
	イスラエル	2,953,114,669	0.29
	ベルギー	2,351,890,695	0.23
	ケイマン	1,805,554,306	0.18
	ノルウェー	1,642,487,841	0.16
	ルクセンブルク	1,631,577,985	0.16
	ジャージー	1,370,254,673	0.14
	リベリア	1,091,867,584	0.11
	バミューダ	1,045,421,731	0.10
	キュラソー	903,965,784	0.09
	オーストリア	730,408,442	0.07
	ニュージーランド	570,787,269	0.06
	ポルトガル	500,673,048	0.05
	パナマ	415,746,599	0.04
	マン島	65,048,582	0.01
	小計	976,267,885,295	96.42
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	オーストラリア	80,208,536	0.01
	香港	72,468,648	0.01
	小計	152,677,184	0.02
投資証券	アメリカ	12,974,421,876	1.28
	オーストラリア	939,182,055	0.09
	フランス	372,758,704	0.04
	シンガポール	256,984,222	0.03

	イギリス	238,618,313	0.02
	香港	175,835,289	0.02
	小計	14,957,800,459	1.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	21,113,684,503	2.09
合計(純資産総額)		1,012,492,047,441	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	16,171,314,773	1.60
	買建	カナダ	520,454,323	0.05
	買建	ドイツ	2,812,429,638	0.28
	買建	イギリス	1,053,607,653	0.10
	買建	オーストラリア	599,785,275	0.06

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

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

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	1,066,238,685	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。

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	1,953,176	20,733.34	40,495,869,510	29,581.08	57,777,068,401	5.71
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	1,192,835	30,796.53	36,735,187,451	39,687.30	47,340,406,221	4.68
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	567,588	70,304.05	39,903,740,694	66,611.61	37,807,950,497	3.73
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	771,627	31,475.87	24,287,634,103	37,144.23	28,661,492,151	2.83
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	467,983	26,483.30	12,393,734,652	51,975.49	24,323,648,077	2.40
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	392,806	26,640.03	10,464,365,274	52,038.49	20,441,033,303	2.02
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	173,925	98,906.33	17,202,283,828	113,448.71	19,731,567,687	1.95

アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	360,356	36,845.63	13,277,545,104	50,819.97	18,313,281,758	1.81
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	227,178	54,807.44	12,451,046,604	64,008.60	14,541,347,912	1.44
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	221,019	40,487.87	8,948,589,291	47,084.49	10,406,568,487	1.03
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	110,593.71	7,152,758,905	157,369.35	10,178,020,236	1.01
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	110,610	77,325.56	8,552,980,376	73,263.55	8,103,681,420	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	342,670	15,690.22	5,376,568,579	21,590.76	7,398,507,991	0.73
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	136,537	55,289.94	7,549,122,701	50,984.38	6,961,255,384	0.69
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,011	121,136.78	3,756,572,808	218,565.11	6,777,922,936	0.67
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	192,003	23,430.07	4,498,645,036	34,925.38	6,705,778,005	0.66
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	351,879	14,944.97	5,258,821,662	18,041.22	6,348,326,664	0.63
アメリカ	株式	MICRON TECHNOLOGY	半導体・半導体製造装置	90,221	15,396.51	1,389,089,412	66,963.49	6,041,513,158	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	68,029	88,623.40	6,028,961,618	83,549.55	5,683,792,459	0.56
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,328	155,758.99	5,502,653,796	146,421.07	5,172,763,822	0.51
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	129,314	17,331.31	2,241,181,203	38,749.97	5,010,914,759	0.49
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,853	28,142.82	3,964,001,894	33,871.27	4,770,870,529	0.47
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	565,585	6,770.25	3,829,157,276	8,156.27	4,613,065,552	0.46
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	80,488	56,557.05	4,552,163,961	57,132.32	4,598,466,542	0.45
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	189,886	25,722.71	4,884,383,773	23,033.63	4,373,764,626	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	341,830	18,570.11	6,347,823,545	12,778.36	4,368,028,713	0.43
アメリカ	株式	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	ソフトウェア・サービス	182,595	19,355.44	3,534,206,626	23,334.80	4,260,819,194	0.42
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	154,582	20,782.51	3,212,602,734	26,305.05	4,066,288,074	0.40
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	56,949	52,143.06	2,969,495,637	69,507.57	3,958,386,604	0.39
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	85,996	37,515.54	3,226,187,170	45,922.82	3,949,179,482	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	3.73
		素材	3.49
		資本財	8.00
		商業・専門サービス	1.13
		運輸	1.37
		自動車・自動車部品	1.94
		耐久消費財・アパレル	0.87
		消費者サービス	1.66
		メディア・娯楽	7.74
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.77
		生活必需品流通・小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	2.50
		家庭用品・パーソナル用品	1.12
		ヘルスケア機器・サービス	2.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.65
		銀行	6.84
		金融サービス	6.63
		保険	2.77
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.02
		ソフトウェア・サービス	8.11
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.60
		電気通信サービス	1.14
		公益事業	2.63
		半導体・半導体製造装置	11.84
		不動産管理・開発	0.27
		小計	96.42
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.48
合計			97.91

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	301	アメリカドル	103,888,084.6	15,963,443,079	105,240,887.5	16,171,314,773	1.60
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	12	カナダドル	4,490,006	510,423,882	4,578,240	520,454,323	0.05

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	33	スイスフラン	4,293,041	859,939,042	4,317,390	864,816,390	0.09
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	180	ユーロ	10,460,561	1,918,048,465	10,621,800	1,947,613,248	0.19
オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	5,404,100	583,426,636	5,555,625	599,785,275	0.06
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	49	イギリスポンド	4,825,398.75	1,021,729,931	4,975,950	1,053,607,653	0.10

(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	5,300,000.00	811,887,000	814,174,820	0.08
	ユーロ	買建	610,000.00	111,847,160	111,835,875	0.01
	スイスフラン	買建	700,000.00	140,219,100	140,227,990	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ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	20,278,672,140	69.27
	イギリス	1,078,304,283	3.68
	カナダ	1,059,474,196	3.62
	フランス	924,487,506	3.16
	オランダ	705,409,752	2.41
	スイス	689,766,976	2.36
	アイルランド	679,741,825	2.32
	オーストラリア	336,614,662	1.15
	ドイツ	307,231,252	1.05
	スウェーデン	301,168,475	1.03
	デンマーク	254,940,047	0.87
	イタリア	204,186,878	0.70
	スペイン	198,281,585	0.68
	香港	148,524,862	0.51
	フィンランド	96,626,942	0.33
	ノルウェー	74,559,459	0.25
	ルクセンブルク	59,837,205	0.20
	シンガポール	49,690,545	0.17
	キュラソー	47,646,893	0.16

	ベルギー	40,367,361	0.14
	バミューダ	28,591,676	0.10
	ポルトガル	21,187,688	0.07
	ニュージーランド	14,405,528	0.05
	ジャージー	11,858,644	0.04
	ケイマン	11,835,705	0.04
	オーストリア	9,527,981	0.03
	イスラエル	4,430,159	0.02
	小計	27,637,370,225	94.41
投資信託受益証券	オーストラリア	5,136,659	0.02
	香港	3,220,828	0.01
	小計	8,357,487	0.03
投資証券	アメリカ	396,386,744	1.35
	オーストラリア	29,602,053	0.10
	イギリス	13,435,279	0.05
	シンガポール	6,672,106	0.02
	フランス	5,252,833	0.02
	小計	451,349,015	1.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,177,015,920	4.02
合計(純資産総額)		29,274,092,647	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	967,055,368	3.30
	買建	ドイツ	173,121,177	0.59

(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	—	314,820,374	1.08

(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	106,786	23,245.68	2,482,313,697	29,581.08	3,158,845,914	10.79
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	31,028	75,522.35	2,343,307,581	66,611.60	2,066,825,035	7.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	25,547	27,356.08	698,866,026	51,975.49	1,327,817,971	4.54
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	21,458	27,502.06	590,139,350	52,038.49	1,116,642,039	3.81
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	12,407	52,742.25	654,373,200	64,008.60	794,154,819	2.71
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	3,530	120,066.85	423,835,983	157,369.35	555,513,814	1.90
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	7,447	53,988.44	402,051,920	50,984.38	379,680,737	1.30
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,701	127,083.14	216,168,436	218,565.11	371,779,269	1.27
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	10,551	24,089.27	254,165,974	34,925.38	368,497,699	1.26
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	3,735	86,461.40	322,933,362	83,549.55	312,057,576	1.07
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	7,100	22,074.79	156,731,048	38,749.97	275,124,849	0.94
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	4,355	56,098.19	244,307,630	57,132.32	248,811,274	0.85
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	10,236	24,508.77	250,871,770	23,033.63	235,772,278	0.81
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	4,639	38,843.71	180,195,977	45,922.82	213,035,997	0.73
アメリカ	株式	LAM RESEARCH CORP	半導体・半導体製造装置	5,508	15,167.77	83,544,125	38,133.80	210,040,983	0.72
アメリカ	株式	CATERPILLAR	資本財	2,048	59,464.88	121,784,081	102,220.77	209,348,154	0.72
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	75,225	1,907.77	143,512,555	2,689.09	202,287,397	0.69
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	17,864	10,765.41	192,313,456	11,283.25	201,564,046	0.69
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	4,071	44,447.69	180,946,553	47,517.81	193,445,039	0.66
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,778	22,524.90	152,673,781	28,500.20	193,174,383	0.66
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	8,326	19,349.94	161,107,650	22,891.42	190,594,019	0.65
アメリカ	株式	APPLIED MATERIALS	半導体・半導体製造装置	3,478	27,798.63	96,683,638	52,450.30	182,422,159	0.62
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	10,913	12,500.24	136,415,130	16,647.52	181,674,434	0.62
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	3,113	45,269.77	140,924,802	48,481.26	150,922,183	0.52

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	19,684	3,618.69	71,230,353	7,477.09	147,179,150	0.50
アメリカ	株式	MORGAN STANLEY	金融サービス	5,224	21,278.83	111,160,644	28,027.58	146,416,099	0.50
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	2,045	70,974.01	145,141,865	69,915.29	142,976,788	0.49
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	4,157	41,376.02	172,000,149	32,895.53	136,746,730	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	5,958	20,521.29	122,265,864	22,847.70	136,126,629	0.47
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	7,840	18,177.97	142,515,347	17,145.38	134,419,801	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	外国	エネルギー	2.36
		素材	3.56
		資本財	6.96
		商業・専門サービス	1.14
		運輸	1.42
		自動車・自動車部品	2.84
		耐久消費財・アパレル	1.09
		消費者サービス	1.40
		メディア・娯楽	9.58
		一般消費財・サービス流通・小売り	2.91
		生活必需品流通・小売り	0.80
		食品・飲料・タバコ	1.93
		家庭用品・パーソナル用品	2.12
		ヘルスケア機器・サービス	1.86
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.35
		銀行	4.07
		金融サービス	7.35
		保険	3.13
		エクイティ不動産投資信託（REIT）	0.04
		ソフトウェア・サービス	11.32
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.81
		電気通信サービス	1.01
		公益事業	1.90
		半導体・半導体製造装置	16.22
		不動産管理・開発	0.26
		小計	94.41
投資信託受益証券	—	—	0.03
投資証券	—	—	1.54
合計			95.98

(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	18	アメリカドル	6,267,125.3	963,006,473	6,293,475	967,055,368	3.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOX	買建	16	ユーロ	946,916.2	173,626,554	944,160	173,121,177	0.59

(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	1,540,000.00	235,779,000	236,574,884	0.81
	カナダドル	買建	115,000.00	13,004,200	13,071,348	0.04
	ユーロ	買建	146,000.00	26,769,976	26,767,275	0.09
	イギリスポンド	買建	64,000.00	13,543,488	13,547,724	0.05
	スイスフラン	買建	62,000.00	12,400,806	12,419,951	0.04
	デンマーククローネ	買建	133,000.00	3,266,081	3,264,870	0.01
	オーストラリアドル	買建	85,000.00	9,158,325	9,174,322	0.03

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

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

世界債券総合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	16,588,445,627	20.00
	中国	5,044,564,957	6.08
	イギリス	2,679,270,253	3.23
	フランス	2,660,075,758	3.21
	イタリア	2,543,452,289	3.07
	ドイツ	2,214,746,413	2.67
	スペイン	1,686,895,143	2.03
	韓国	948,289,069	1.14
	カナダ	835,049,081	1.01
	ベルギー	555,364,473	0.67
	オーストラリア	547,671,201	0.66
	スイス	522,013,168	0.63

	メキシコ	490,565,924	0.59
	オランダ	469,290,136	0.57
	インドネシア	447,867,552	0.54
	オーストリア	392,447,442	0.47
	マレーシア	370,745,870	0.45
	ポーランド	354,611,778	0.43
	タイ	341,661,890	0.41
	ポルトガル	215,245,112	0.26
	イスラエル	211,435,878	0.25
	デンマーク	192,855,442	0.23
	シンガポール	188,275,613	0.23
	フィンランド	185,381,460	0.22
	サウジアラビア	159,086,594	0.19
	ルーマニア	157,754,651	0.19
	ニュージーランド	152,992,921	0.18
	アイルランド	145,920,111	0.18
	チェコ	143,770,203	0.17
	ギリシャ	128,193,598	0.15
	ハンガリー	112,520,216	0.14
	スウェーデン	81,487,792	0.10
	ノルウェー	81,344,993	0.10
	カタール	58,961,709	0.07
	パナマ	57,587,158	0.07
	フィリピン	56,803,331	0.07
	ブルガリア	49,710,068	0.06
	チリ	45,949,690	0.06
	香港	31,408,184	0.04
	アラブ首長国連邦	29,230,726	0.04
	ペルー	23,677,469	0.03
	ウルグアイ	10,320,316	0.01
	小計	42,212,941,259	50.89
地方債証券	カナダ	1,228,944,353	1.48
	オーストラリア	405,204,540	0.49
	ドイツ	385,111,476	0.46
	デンマーク	42,166,157	0.05
	スペイン	37,090,235	0.04
	スウェーデン	35,959,842	0.04
	ニュージーランド	21,581,204	0.03
	小計	2,156,057,807	2.60
特殊債券	中国	3,927,005,780	4.73
	国際機関	2,386,256,540	2.88
	ドイツ	717,324,664	0.86

	カナダ	375,111,689	0.45
	フランス	339,902,001	0.41
	オランダ	238,332,279	0.29
	韓国	184,985,675	0.22
	アメリカ	159,275,238	0.19
	日本	139,733,754	0.17
	スウェーデン	84,983,911	0.10
	オーストリア	77,897,484	0.09
	ノルウェー	41,635,204	0.05
	スペイン	37,225,821	0.04
	インド	31,955,009	0.04
	小計	8,741,625,049	10.54
社債券	アメリカ	9,379,940,313	11.31
	フランス	1,716,474,593	2.07
	カナダ	1,094,217,955	1.32
	イギリス	993,560,159	1.20
	オランダ	979,345,519	1.18
	ドイツ	894,103,750	1.08
	日本	550,586,116	0.66
	オーストラリア	427,794,089	0.52
	スウェーデン	417,611,366	0.50
	スペイン	393,886,642	0.47
	イタリア	360,330,160	0.43
	ノルウェー	162,884,523	0.20
	フィンランド	162,253,797	0.20
	ルクセンブルク	145,651,801	0.18
	スイス	118,670,820	0.14
	アイルランド	118,658,404	0.14
	ケイマン	118,188,505	0.14
	シンガポール	98,831,852	0.12
	デンマーク	83,271,191	0.10
	インドネシア	78,444,220	0.09
	ベルギー	70,696,359	0.09
	オーストリア	56,498,939	0.07
	インド	49,227,495	0.06
	バミューダ	38,757,321	0.05
	香港	31,780,816	0.04
	マレーシア	31,681,444	0.04
	ニュージーランド	30,476,758	0.04
	タイ	29,259,220	0.04
	メキシコ	17,945,570	0.02
	ジャージー	17,306,368	0.02

	小計	18,668,336,065	22.51
投資信託受益証券	アメリカ	9,496,095,412	11.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	1,668,887,891	2.01
合計(純資産総額)		82,943,943,483	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	257,824,684	0.31
	買建	ドイツ	94,122,355	0.11

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

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

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	―	428,370,516	0.52

(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	投資信託受益証券	ISHARES MBS ETF	645,155	14,347.96	9,256,659,897	14,719.09	9,496,095,412	―	―	11.45
アメリカ	国債証券	T 3.875% 06/15/28	2,750,000	15,410.41	423,786,477	15,467.73	425,362,840	3.875	2028/6/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.625% 10/31/30	2,650,000	15,310.21	405,720,824	15,250.75	404,145,008	3.625	2030/10/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.75% 04/15/28	2,100,000	15,278.35	320,845,431	15,420.62	323,833,047	3.750	2028/4/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.5% 10/31/27	2,000,000	15,373.55	307,471,026	15,349.19	306,983,869	3.500	2027/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	T 4.125% 10/31/27	1,900,000	15,539.78	295,255,944	15,510.95	294,708,174	4.125	2027/10/31	0.36
中国	特殊債券	SDBC 3.43% 01/14/27	13,000,000	2,274.96	295,745,965	2,248.70	292,331,598	3.430	2027/1/14	0.35
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/27	1,900,000	15,005.85	285,111,328	15,181.12	288,441,428	2.500	2027/3/31	0.35
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/34	1,650,000	15,457.85	255,054,675	15,459.03	255,074,099	4.250	2034/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/35	1,600,000	15,925.19	254,803,092	15,876.49	254,023,988	4.625	2035/2/15	0.31
アメリカ	国債証券	T 4% 03/31/30	1,600,000	15,513.05	248,208,918	15,513.05	248,208,917	4.000	2030/3/31	0.30
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/29	1,620,000	14,742.65	238,831,035	14,928.72	241,845,414	2.750	2029/5/31	0.29
アメリカ	国債証券	T 1.5% 01/31/27	1,600,000	14,764.86	236,237,845	15,054.51	240,872,241	1.500	2027/1/31	0.29
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/27	1,500,000	15,579.98	233,699,753	15,546.07	233,191,054	4.500	2027/5/15	0.28
アメリカ	国債証券	T 1.375% 10/31/28	1,600,000	14,158.02	226,528,453	14,472.85	231,565,620	1.375	2028/10/31	0.28
アメリカ	国債証券	T 4.25% 05/15/35	1,500,000	15,245.43	228,681,494	15,423.62	231,354,338	4.250	2035/5/15	0.28
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	1,500,000	15,024.76	225,371,501	15,168.82	227,532,345	3.125	2028/11/15	0.27
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	1,500,000	14,724.94	220,874,245	14,921.52	223,822,897	2.625	2029/2/15	0.27

アメリカ	国債証券	T 4.625% 02/15/55	1,500,000	14,769.76	221,546,509	14,805.68	222,085,219	4.625	2055/2/15	0.27
アメリカ	国債証券	T 4.125% 07/31/31	1,400,000	15,457.53	216,405,499	15,559.57	217,834,058	4.125	2031/7/31	0.26
アメリカ	国債証券	T 3.5% 10/15/28	1,400,000	15,369.88	215,178,379	15,320.38	214,485,351	3.500	2028/10/15	0.26
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/31/32	1,400,000	15,460.52	216,447,346	15,263.65	213,691,239	3.875	2032/8/31	0.26
アメリカ	国債証券	T 2.625% 05/31/27	1,400,000	15,013.66	210,191,273	15,180.52	212,527,386	2.625	2027/5/31	0.26
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	1,550,000	13,017.28	201,767,883	13,359.11	207,066,303	1.375	2031/11/15	0.25
アメリカ	国債証券	T 4.375% 12/31/29	1,280,000	15,701.86	200,983,856	15,726.74	201,302,281	4.375	2029/12/31	0.24
中国	特殊債券	ADBCH 1.59% 05/13/30	9,000,000	2,195.90	197,631,650	2,194.29	197,486,151	1.590	2030/5/13	0.24
アメリカ	国債証券	T 2.375% 03/31/29	1,310,000	14,562.28	190,765,947	14,783.47	193,663,489	2.375	2029/3/31	0.23
中国	国債証券	CGB 2.44% 10/15/27	8,600,000	2,255.92	194,009,814	2,248.45	193,367,487	2.440	2027/10/15	0.23
中国	特殊債券	SDBC 3% 01/17/32	8,000,000	2,381.30	190,504,748	2,352.74	188,219,928	3.000	2032/1/17	0.23
アメリカ	国債証券	T 0.5% 06/30/27	1,250,000	14,327.59	179,094,933	14,724.64	184,058,120	0.500	2027/6/30	0.22

(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	50.89
地方債証券	2.60
特殊債券	10.54
社債券	22.51
投資信託受益証券	11.45
合計	97.99

(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 10YR NOTE	買建	15	アメリカドル	1,682,151.45	258,479,391	1,677,890.7	257,824,684	0.31
	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	512,728.4	94,013,879	513,320	94,122,355	0.11

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,360,000.00	214,686,744	208,726,000	0.25
	カナダドル	買建	140,000.00	15,942,892	15,904,700	0.02
	ユーロ	買建	610,000.00	112,461,247	111,785,550	0.13
	イギリスポンド	買建	110,000.00	23,389,201	23,262,250	0.03
	オーストラリアドル	買建	80,000.00	8,473,144	8,626,800	0.01
	オフショア人民元	買建	2,720,000.00	61,690,416	60,065,216	0.07

(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	69,258,156,520	20.39
	ケイマン	53,046,587,802	15.62
	韓国	51,186,967,107	15.07
	インド	44,157,694,321	13.00
	中国	34,646,692,997	10.20
	ブラジル	12,549,734,229	3.69
	南アフリカ	11,309,005,431	3.33
	サウジアラビア	9,488,751,447	2.79
	メキシコ	6,151,684,103	1.81
	アラブ首長国連邦	4,801,847,382	1.41
	マレーシア	3,858,159,024	1.14
	ポーランド	3,430,494,354	1.01
	タイ	3,317,425,240	0.98
	インドネシア	3,237,489,886	0.95
	香港	2,662,392,861	0.78
	カタール	2,107,799,417	0.62
	クウェート	1,993,645,214	0.59
	ギリシャ	1,944,953,387	0.57
	チリ	1,906,411,392	0.56
	イギリス	1,675,063,255	0.49
	トルコ	1,567,815,169	0.46
	バミューダ	1,316,352,976	0.39
	フィリピン	1,188,720,954	0.35
	アメリカ	1,053,754,786	0.31
	ハンガリー	1,035,524,405	0.30
	コロンビア	560,862,996	0.17
	ルクセンブルク	509,113,511	0.15
	チェコ	453,268,508	0.13
	エジプト	218,911,404	0.06
	ペルー	218,644,796	0.06
	オランダ	168,979,902	0.05
	カナダ	153,142,282	0.05
	シンガポール	8,034,360	0.00
	ロシア	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—

	小計	331,184,081,418	97.51
投資信託受益証券	ブラジル	596,592,821	0.18
	メキシコ	155,600,451	0.05
	小計	752,193,272	0.22
投資証券	メキシコ	316,775,638	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	7,402,420,614	2.18
合計(純資産総額)		339,655,470,942	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,150,317,634	2.11

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

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

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	―	141,318,532	△0.04

(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	4,708,389	7,152.83	33,678,315,508	8,843.05	41,636,547,597	12.26
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	902,594	10,494.88	9,472,615,719	17,227.04	15,549,022,942	4.58
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,222,300	12,477.12	15,250,783,776	12,240.96	14,962,125,408	4.41
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	3,271,288	3,150.76	10,307,069,550	3,410.54	11,156,871,661	3.28
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	104,819	62,176.00	6,517,226,144	92,299.20	9,674,709,845	2.85
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	2,151,007	1,661.10	3,573,039,878	1,581.24	3,401,276,592	1.00
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	18,360,620	159.99	2,937,669,823	160.58	2,948,509,933	0.87
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,172,176	2,498.24	2,928,379,901	2,352.31	2,757,322,499	0.81
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	2,406,248	1,195.40	2,876,440,409	1,097.42	2,640,666,605	0.78

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	292,804	6,172.99	1,807,476,749	8,720.57	2,553,419,535	0.75
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	1,023,868	2,269.24	2,323,409,899	2,339.12	2,394,959,331	0.71
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	831.28	2,741,904,506	720.68	2,377,096,189	0.70
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	4,727.72	1,786,622,594	6,148.49	2,323,535,084	0.68
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	132,945	20,863.95	2,773,758,470	15,780.88	2,097,989,357	0.62
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	156,989	8,072.15	1,267,240,326	12,392.31	1,945,457,924	0.57
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	964,050	2,007.36	1,935,195,408	1,940.44	1,870,688,894	0.55
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	648,000	2,438.58	1,580,202,562	2,882.66	1,867,964,717	0.55
ブラジル	株式	VALE SA	素材	694,587	1,916.39	1,331,106,315	2,585.86	1,796,109,957	0.53
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,212,000	1,140.45	1,382,232,672	1,442.54	1,748,363,328	0.51
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	617,187	2,496.72	1,540,944,053	2,801.51	1,729,057,404	0.51
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	382,348	4,211.72	1,610,346,542	4,400.56	1,682,545,315	0.50
イギリス	株式	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	素材	97,443	11,538.22	1,124,319,083	17,190.18	1,675,063,255	0.49
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	502,386	3,381.85	1,698,998,616	3,326.17	1,671,023,000	0.49
南アフリカ	株式	GOLD FIELDS LTD	素材	176,906	6,546.05	1,158,035,893	9,108.25	1,611,304,605	0.47
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	11,862,515	124.57	1,477,765,689	130.67	1,550,136,520	0.46
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	150,490	11,841.89	1,782,087,004	9,945.03	1,496,628,016	0.44
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	1,086,267	1,153.74	1,253,275,906	1,365.26	1,483,041,968	0.44
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	25,602	28,300.79	724,557,081	56,601.59	1,449,114,163	0.43
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	720,000	1,926.67	1,387,203,840	2,003.42	1,442,465,280	0.42
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	343,430	4,309.92	1,480,155,826	4,065.88	1,396,347,916	0.41

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	3.65
		素材	7.53
		資本財	5.45
		商業・専門サービス	0.08
		運輸	1.42
		自動車・自動車部品	3.11

		耐久消費財・アパレル	0.84
		消費者サービス	1.62
		メディア・娯楽	6.33
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.48
		生活必需品流通・小売り	0.86
		食品・飲料・タバコ	2.03
		家庭用品・パーソナル用品	0.41
		ヘルスケア機器・サービス	0.55
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.35
		銀行	15.62
		金融サービス	2.43
		保険	2.80
		ソフトウェア・サービス	1.61
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10.35
		電気通信サービス	2.29
		公益事業	2.08
		半導体・半導体製造装置	17.48
		不動産管理・開発	1.16
		小計	97.51
投資信託受益証券	—	—	0.22
投資証券	—	—	0.09
合計			97.82

(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	598	アメリカドル	41,675,942	6,403,925,248	46,533,370	7,150,317,634	2.11

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

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

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	920,000.00	141,312,000	141,318,532	△0.04

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

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	115,140,214,900	97.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,974,032,178	2.52
合計(純資産総額)		118,114,247,078	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	2,954,898,000	2.50

(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。

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	60,173	144,299.91	8,682,958,699	143,500	8,634,825,500	7.31
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	51,165	129,460.28	6,623,835,469	124,800	6,385,392,000	5.41
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	51,730	120,757.79	6,246,800,493	121,700	6,295,541,000	5.33
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	31,745	166,217.4	5,276,571,477	167,100	5,304,589,500	4.49
日本	投資証券	ＫＤＸ不動産投資法人	29,050	172,428.8	5,009,056,714	167,300	4,860,065,000	4.11
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	32,780	142,142.11	4,659,418,656	142,200	4,661,316,000	3.95
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	51,284	91,623.5	4,698,819,796	90,300	4,630,945,200	3.92
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	31,364	136,559.64	4,283,056,758	134,800	4,227,867,200	3.58
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	39,699	106,209.27	4,216,402,097	103,600	4,112,816,400	3.48
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	22,968	188,343.22	4,325,867,265	178,700	4,104,381,600	3.47
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	54,993	68,819.01	3,784,564,234	65,400	3,596,542,200	3.04
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	20,513	168,116.85	3,448,581,005	168,000	3,446,184,000	2.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	36,657	89,989.06	3,298,729,018	83,100	3,046,196,700	2.58
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	27,624	105,057.15	2,902,098,824	104,900	2,897,757,600	2.45
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	18,240	148,198.52	2,703,141,127	149,800	2,732,352,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	29,406	80,843.15	2,377,273,901	90,800	2,670,064,800	2.26
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	21,998	114,124	2,510,499,899	115,400	2,538,569,200	2.15
日本	投資証券	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	17,199	131,487.2	2,261,448,419	138,300	2,378,621,700	2.01
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	15,381	142,742.25	2,195,518,648	144,500	2,222,554,500	1.88
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	12,915	152,781.51	1,973,173,230	157,000	2,027,655,000	1.72
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	19,750	102,119.05	2,016,851,317	101,100	1,996,725,000	1.69

日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	15,093	109,327.06	1,650,073,423	111,800	1,687,397,400	1.43
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	14,586	112,542.67	1,641,547,455	114,800	1,674,472,800	1.42
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	11,531	148,155.6	1,708,382,316	145,200	1,674,301,200	1.42
日本	投資証券	イオンリート投資法人	12,097	132,291.15	1,600,326,087	133,800	1,618,578,600	1.37
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	17,509	91,342.92	1,599,323,252	91,100	1,595,069,900	1.35
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	8,803	171,350.37	1,508,397,308	172,200	1,515,876,600	1.28
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	19,202	78,472.75	1,506,833,753	77,700	1,491,995,400	1.26
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	4,034	380,891.06	1,536,514,551	368,500	1,486,529,000	1.26
日本	投資証券	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	10,031	137,829.26	1,382,565,387	142,600	1,430,420,600	1.21

(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	97.48
合計	97.48

(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	1,503	円	2,929,460,040	2,954,898,000	2.50

(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。

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	123,973,481,930	76.63
	オーストラリア	12,544,318,977	7.75
	イギリス	7,074,907,787	4.37
	シンガポール	5,794,108,888	3.58
	フランス	3,548,932,106	2.19
	カナダ	2,124,119,130	1.31
	ベルギー	1,978,179,581	1.22
	香港	1,376,885,399	0.85
	スペイン	817,893,566	0.51
	韓国	338,412,076	0.21
	イスラエル	318,273,412	0.20
	オランダ	264,121,271	0.16

	ガーンジー	237,703,271	0.15
	ニュージーランド	189,970,096	0.12
	アイルランド	68,002,155	0.04
	ドイツ	40,468,806	0.03
	イタリア	21,932,900	0.01
	小計	160,711,711,351	99.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,077,897,840	0.67
合計(純資産総額)		161,789,609,191	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	1,147,913,956	0.71

(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	—	285,444,065	0.18

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	461,565	29,223.08	13,488,352,834	28,533.12	13,169,892,025	8.14
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	624,485	19,309.92	12,058,758,016	20,038.80	12,513,930,393	7.73
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	66,058	126,446.69	8,352,815,463	126,930.84	8,384,797,627	5.18
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	219,703	28,212.54	6,198,381,845	29,164.66	6,407,565,054	3.96
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	617,182	8,744.34	5,396,852,540	9,339.45	5,764,143,392	3.56
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	216,655	26,047.81	5,643,388,836	25,728.83	5,574,279,750	3.45
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,377,058	3,332.37	4,588,869,587	3,320.84	4,573,002,509	2.83
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	105,981	42,691.43	4,524,481,246	42,632.96	4,518,284,476	2.79
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	315,386	11,710.67	3,693,381,725	11,811.84	3,725,290,295	2.30
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	717,907	4,653.79	3,340,990,216	4,319.38	3,100,915,004	1.92
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	142,557	20,476.99	2,919,138,861	21,338.76	3,041,990,208	1.88
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	198,661	15,918.62	3,162,409,245	14,294.98	2,839,856,969	1.76
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	95,351	27,261.48	2,599,409,483	26,859.76	2,561,105,739	1.58
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	233,568	9,182.54	2,144,749,443	9,505.40	2,220,159,042	1.37
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST	43,353	39,998.38	1,734,049,950	38,396.56	1,664,606,100	1.03

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	78,827	19,931.71	1,571,157,063	20,541.26	1,619,206,596	1.00
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	147,574	10,355.28	1,528,170,498	10,628.66	1,568,514,195	0.97
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	3,510,606	443.72	1,557,758,550	439.39	1,542,550,447	0.95
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	379,764	4,301.64	1,633,610,345	4,048.94	1,537,642,030	0.95
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	78,289	19,451.50	1,522,838,484	19,451.81	1,522,863,489	0.94
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	912,874	1,527.14	1,394,091,981	1,619.81	1,478,683,347	0.91
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	457,709	3,155.96	1,444,511,335	3,182.29	1,456,566,710	0.90
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	82,147	16,485.95	1,354,271,719	16,924.12	1,390,266,343	0.86
アメリカ	投資証券	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	199,857	6,694.20	1,337,884,676	6,670.38	1,333,122,256	0.82
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	190,748	6,901.73	1,316,492,952	6,970.01	1,329,516,917	0.82
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	130,690	9,547.16	1,247,718,457	9,645.23	1,260,536,180	0.78
香港	投資証券	LINK REIT	1,735,400	813.04	1,410,958,565	714.77	1,240,425,047	0.77
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	111,392	10,728.02	1,195,016,117	11,060.44	1,232,045,290	0.76
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	428,348	2,739.66	1,173,528,570	2,867.29	1,228,200,336	0.76
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	464,006	2,739.07	1,270,946,711	2,633.73	1,222,067,636	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	99.33
合計	99.33

(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	204	アメリカドル	7,412,923.2	1,139,069,778	7,470,480	1,147,913,956	0.71

(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	1,480,000.00	227,106,864	227,358,192	0.14
	カナダドル	買建	100,000.00	11,365,400	11,366,390	0.01
	ユーロ	買建	90,000.00	16,498,890	16,499,700	0.01
	オーストラリアドル	買建	280,000.00	30,200,730	30,219,783	0.02

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

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	ルクセンブルク	18,101,532,150	43.33
	アイルランド	18,081,602,448	43.28
	ケイマン	1,709,867,016	4.09
	イギリス	1,527,011,616	3.66
	アメリカ	1,009,776,690	2.42
	ジャージー	894,915,840	2.14
	小計	41,324,705,760	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	452,636,333	1.08
合計(純資産総額)		41,777,342,093	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	—	384,051,000	0.92

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	STAR HELIOS 008 10/26/26	56,000,000	26,850.08	15,036,045,882	32,288.57	18,081,602,448	0.000	2026/10/26	43.28
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 045 06/30/26	28,000,000	15,115.47	4,232,334,210	17,938.26	5,022,715,152	0.000	2026/6/30	12.02
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 047 10/30/26	29,000,000	15,189.82	4,405,048,050	17,271.38	5,008,701,360	0.000	2026/10/30	11.99
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 046 08/28/26	23,000,000	15,101.77	3,473,407,470	17,884.48	4,113,432,102	0.000	2026/8/28	9.85
ルクセンブルク	社債券	SG ISSUER 048 12/30/26	24,000,000	15,522.28	3,725,348,406	16,486.18	3,956,683,536	0.000	2026/12/30	9.47
ケイマン	社債券	MS SPACE II 001 03/29/30	9,000,000	16,542.86	1,488,857,838	18,998.52	1,709,867,016	0.000	2030/3/29	4.09
イギリス	社債券	BAR USD COM 043 03/31/26	8,000,000	15,513.51	1,241,081,088	19,087.64	1,527,011,616	0.000	2026/3/31	3.66
アメリカ	社債券	IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000	5,239.68	785,952,461	6,731.84	1,009,776,690	0.000	2036/6/12	2.42
ジャージー	社債券	ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000	1,797.82	719,128,800	2,237.28	894,915,840	0.000	9999/99/99	2.14

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(注3) 償還期限は、償還期限の定めがない場合「9999/99/99」と記載しております。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	98.92
合計	98.92

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,500,000.00	382,725,000	384,051,000	0.92

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

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

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	76,433,931,434	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	923,832,919	1.19
合計(純資産総額)		77,357,764,353	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	―	76,236,629,207	△98.55

(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	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	2,652,442	10,439.51	27,690,218,428	16,406.27	43,516,701,361	56.25
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST MICRO	3,982,547	5,115.32	20,372,026,352	8,265.37	32,917,230,073	42.55

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、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	98.81
合計	98.81

(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	497,507,648.00	76,234,440,173	76,236,629,207	△98.55

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

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

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	11,420,279,000	51.91
	イギリス	5,300,100,000	24.09
	ケイマン	5,127,220,000	23.30
	小計	21,847,599,000	99.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	153,122,131	0.70
合計(純資産総額)		22,000,721,131	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ ＨＥＬＩＯＳ ０％ ０７／１６／２６	9,230,000,000	128.51	11,861,693,000	123.73	11,420,279,000	0.000	2026/7/16	51.91
イギリス	社債券	ソシエテ・ジェネラル ０％ ２０２６／０３／３１	5,400,000,000	101.13	5,461,270,000	98.15	5,300,100,000	0.000	2026/3/31	24.09
ケイマン	社債券	ＭＳ ＳＰＡＣＥ ＩＩ ０％ ２０３０／０３／２９	5,300,000,000	98.98	5,246,030,000	96.74	5,127,220,000	0.000	2030/3/29	23.30

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.30
合計	99.30

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
社債券	アイルランド	5,820,469,200	99.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	53,234,252	0.91
合計(純資産総額)		5,873,703,452	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アイルランド	社債券	ＳＴＡＲ ＨＥＬＩＯＳ ０％ １０／２０／２６	6,846,000,000	85.30	5,839,788,400	85.02	5,820,469,200	0.000	2026/10/20	99.09

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
社債券	99.09
合計	99.09

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券	日本	11,676,393,900	43.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	15,403,994,894	56.88
合計(純資産総額)		27,080,388,794	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	イギリス	16,099,672,074	59.45
	売建	日本	6,975,330,000	△25.76
	売建	アメリカ	7,751,928,861	△28.63
	売建	ドイツ	3,388,404,787	△12.51

(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	―	13,187,310,140	48.70
	売建	―	13,408,948,670	△49.52

(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	99.84	6,989,087,000	―	2026/4/20	25.81
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	99.63	2,988,927,000	―	2026/7/21	11.04
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	99.90	1,698,379,900	―	2026/3/23	6.27

(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	43.12
合計	43.12

(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	53	円	6,976,462,510	6,976,462,510	6,975,330,000	6,975,330,000	△25.76
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US 10YR NOTE	売建	451	アメリカドル	50,666,113.2	7,785,354,954	50,448,580.38	7,751,928,861	△28.63
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	売建	144	ユーロ	18,355,487.6	3,365,662,206	18,479,520	3,388,404,787	△12.51
	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	835	イギリスポンド	75,880,727.5	16,066,985,241	76,035,100	16,099,672,074	59.45

(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。

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	12,029,000.00	1,898,794,462	1,846,150,775	6.82
	ユーロ	買建	26,890,000.00	4,939,504,342	4,927,726,950	18.20
	イギリスポンド	買建	4,798,000.00	1,013,943,894	1,014,657,050	3.75
	ノルウェークローネ	買建	133,660,000.00	2,102,880,010	2,146,579,600	7.93
	オーストラリアドル	買建	30,159,000.00	3,246,453,491	3,252,195,765	12.01
	カナダドル	売建	22,299,000.00	2,524,051,808	2,533,277,895	△9.35
	スイスフラン	売建	30,871,000.00	6,134,012,289	6,185,467,915	△22.84
	スウェーデンクローナ	売建	161,196,000.00	2,784,232,940	2,805,616,380	△10.36
	ニュージーランドドル	売建	20,272,000.00	1,872,186,565	1,884,586,480	△6.96

(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。

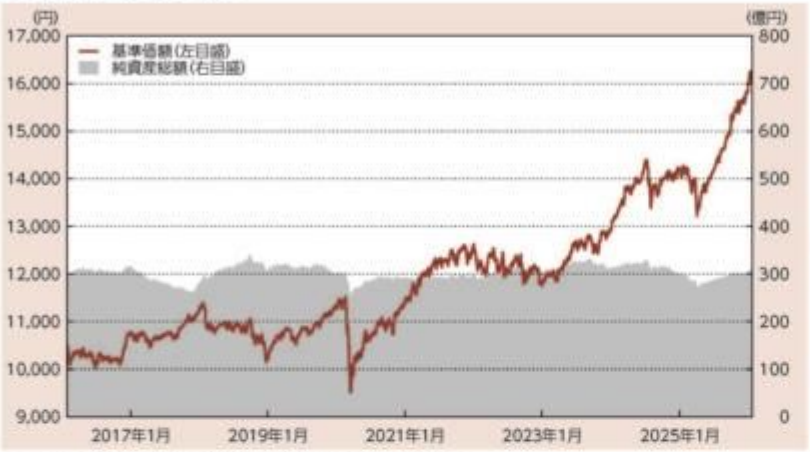
≪参考情報≫

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10月17日
作成基準日：2026年 1 月30日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	16,114円
純資産総額	304.20億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2021年７月	0円
2022年７月	0円
2023年７月	0円
2024年７月	0円
2025年７月	0円
設定来分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	6.1%
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	5.7%
世界債券総合インデックスマザーファンド	5.2%
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	5.0%
SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	5.0%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4.9%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	4.8%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.7%
ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4.0%

※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)

※2026年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

＜申込手続＞

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

＜申込コース＞

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

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

＜申込みの受付＞

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

＜申込単位＞

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

＜申込価額＞

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

＜申込手数料＞

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

＜申込代金の支払い＞

販売会社が定める期日までにお支払いください。

＜受付不可日＞

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

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

＜申込受付の中止等＞

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等（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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

＜スイッチング＞

当ファンドはコア投資戦略ファンドを構成する各ファンドの間において、スイッチング（※）の取扱いを行う場合があります。上記受付不可日の場合は、スイッチングの取扱いは行いません。
販売会社によってはスイッチングの取扱いを行わない場合があります。

※スイッチングとは、当ファンドの解約請求日に当該ファンドの解約に係る手取金をもって別のファンドの取得申込みを行うことをいいます。

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

＜一部解約手続＞

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

＜一部解約の受付＞

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

＜一部解約単位＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

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

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

＜一部解約代金の支払い＞

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

＜受付不可日＞

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
ロンドンの銀行休業日

＜一部解約受付の中止等＞

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記＜解約価額＞の規定に準じて計算された価額とします。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
ホームページ：https://www.smtam.jp/
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

＜基準価額の算出頻度＞

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

＜主要な投資対象資産の評価方法＞

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

・国内上場株式、国内上場投信（J-REITを含みます。）

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

・公社債等（仕組債を含みます。）

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

a.日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b.金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c.価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

・市場デリバティブ取引

金融商品取引所が発表する計算日の清算値段又は帳入値段で評価します。

・店頭デリバティブ取引

計算日における次のa.又はb.のいずれかの価額で評価します。

a.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。）

b.価格情報会社の提供する価額

⑥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10月17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10月17日から2014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）

①委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合

・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合

・やむを得ない事情が発生した場合

②委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

③委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④上記①から③までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記①から③までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

＜投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き＞

(1)投資信託約款の変更等

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

・受益者の利益のため必要と認めるとき
・やむを得ない事情が発生したとき

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をし

た場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

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

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

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

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分

別して管理することがあります。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

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

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12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【財務諸表】

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2024年 7月10日現在）	第12期 （2025年 7月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	615,573,730	504,260,862
投資信託受益証券	15,736,647,657	14,888,791,523
投資証券	2,091,181,071	2,305,960,931
親投資信託受益証券	14,648,069,539	11,147,456,614
未収入金	12,100,000	126,507,367
未収利息	1,135	6,452
流動資産合計	33,103,573,132	28,972,983,749
資産合計	33,103,573,132	28,972,983,749
負債の部		
流動負債		
未払解約金	46,133,502	47,307,187
未払受託者報酬	8,735,582	7,796,453
未払委託者報酬	232,366,397	207,152,918
その他未払費用	825,697	778,654
流動負債合計	288,061,178	263,035,212
負債合計	288,061,178	263,035,212
純資産の部		
元本等		
元本	22,861,763,346	20,201,163,175
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,953,748,608	8,508,785,362
（分配準備積立金）	7,016,378,901	6,020,786,340
元本等合計	32,815,511,954	28,709,948,537
純資産合計	32,815,511,954	28,709,948,537
負債純資産合計	33,103,573,132	28,972,983,749

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期 自　2023年 7月11日 至　2024年 7月10日	第12期 自　2024年 7月11日 至　2025年 7月10日
営業収益		
受取配当金	11,943,125	9,274,159
受取利息	157,449	2,474,766
有価証券売買等損益	4,756,847,360	70,196,321
営業収益合計	4,768,947,934	81,945,246
営業費用		
支払利息	429,948	-
受託者報酬	17,615,873	16,438,307
委託者報酬	468,582,183	437,026,242
その他費用	1,661,059	1,613,410
営業費用合計	488,289,063	455,077,959
営業利益又は営業損失（△）	4,280,658,871	△373,132,713
経常利益又は経常損失（△）	4,280,658,871	△373,132,713
当期純利益又は当期純損失（△）	4,280,658,871	△373,132,713
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（△）	207,909,312	△109,282,060
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,571,347,849	9,953,748,608
剰余金増加額又は欠損金減少額	407,037,716	252,257,146
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	407,037,716	252,257,146
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,097,386,516	1,433,369,739
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,097,386,516	1,433,369,739
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,953,748,608	8,508,785,362

（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11期 (2024年 7月10日現在)		第12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		22,861,763,346口		20,201,163,175口
２．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4354円 (14,354円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4212円 (14,212円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第11期
自 2023年 7月11日
至 2024年 7月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	279,760,156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	3,792,989,403円
収益調整金額	C	2,937,369,707円
分配準備積立金額	D	2,943,629,342円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,953,748,608円
当ファンドの期末残存口数	F	22,861,763,346口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,353円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

第12期
自 2024年 7月11日
至 2025年 7月10日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	－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	2,487,999,022円
分配準備積立金額	D	6,020,786,340円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,508,785,362円
当ファンドの期末残存口数	F	20,201,163,175口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,212円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	－円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第12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12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11期 自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日	第12期 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	25,787,771,284円	22,861,763,346円
期中追加設定元本額	1,370,035,532円	636,436,125円
期中一部解約元本額	4,296,043,470円	3,297,036,296円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2024年 7月10日現在)	第12期 (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	1,675,964,497	331,575,805
投資証券	296,521,811	118,236,776
親投資信託受益証券	2,032,830,418	465,689,838
合計	4,005,316,726	915,502,419

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	ノムラＦＯＦｓ用　日本株ベータヘッジ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	137,035,727	113,917,799	
	国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）	488,563,287	988,314,673	
	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	509,087,553	889,070,502	

	L&Gグローバル総合債券ファンド（除く日本）（FOFs用）（適格機関投資家専用）	660,363,075	690,013,377	
	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,328,298,815	1,203,837,216	
	ＧＩＭグローバル・セレクト株式ファンドＦＢ（適格機関投資家専用）	55,392	584,994,912	
	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	588,182,190	1,164,718,372	
	ニッセイ国内債券アクティブプラス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	1,031,334,981	964,813,874	
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）	1,168,507,892	1,438,316,364	
	日本長期成長株集中投資ファンド（適格機関投資家専用）	223,252,384	718,381,521	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	530,508,264	873,322,704	
	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）	365,303,895	289,466,806	
	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）	308,913,003	339,649,846	
	ＳＭＤＡＭ日本債券ファンド（適格機関投資家専用）	1,296,253,875	1,203,830,973	
	ＳＭＤＡＭ日本グロース株ファンド（適格機関投資家専用）	208,788,894	250,024,700	
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド（適格機関投資家専用）	476,349,386	981,756,084	
	マニュライフＦＯＦｓ用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用）	1,603,632,902	1,447,920,147	
	Global Aggregate Bond Strategy Fund JPY W Class	703,195,152	746,441,653	
投資信託受益証券合計		11,627,626,667	14,888,791,523	
投資証券	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	30,342	286,822,926	
	FI Institutional Global Developed Concentrated Equity Selection Fund JPY Class Shares (unhedged)	25,762.025	289,821,235	
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund － クラスS-JPY	25,756.498	285,178,006	
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	410,918.202	1,158,378,411	
	MA Hedge Fund Strategies Limited	28,010	285,760,353	
投資証券合計		520,788.725	2,305,960,931	
親投資信託受益証券	Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	384,918,372	858,098,526	
	グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	455,108,700	1,395,272,252	
	新興国株式インデックス　マザーファンド	57,834,036	293,501,949	
	国内株式インデックス　マザーファンド	483,834,437	1,450,051,807	
	外国株式インデックス　マザーファンド	39,609,333	293,513,079	
	グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	858,102,299	563,944,830	

	ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	742,783,068	1,409,876,541	
	コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	312,141,304	396,981,310	
	日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	145,688,965	240,532,481	
	外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	153,136,070	291,953,917	
	米国株式ＬＳマザーファンド	323,186,321	419,011,065	
	ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	261,385,186	280,126,503	
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	164,453,324	142,252,125	
	世界債券総合インデックスマザーファンド	2,387,999,826	2,867,032,591	
	日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	36,101,729	245,307,638	
親投資信託受益証券合計		6,806,282,970	11,147,456,614	
合計			28,342,209,068	

(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
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

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
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。

	2025年 7月10日現在

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
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　ファンド２０２５	17,320,136円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	525,878,073円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド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

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）	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　ファンド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・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	83,021,374円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	90,793,471円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	44,596,472円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（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・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０３５	43,533,070円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）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

区分	2025年 7月10日現在
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	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)	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	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	
ニッスイ	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	
ＩＮＰＥＸ	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	
淺沼組	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	
大氣社	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	
ニップン	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	
DM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	
キユーピー	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	
ピッ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	
グンゼ	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	
ＴＳＩ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	
東亞合成	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	
日本パーカライジング	83,400	1,305.00	108,837,000	
高圧ガス工業	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	
ＡＤＥＫＡ	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	
ＤＩＣ	66,500	2,906.00	193,249,000	
サカタインクス	41,600	2,024.00	84,198,400	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	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－ｎｅ	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	
ＪＣＵ	20,400	3,240.00	66,096,000	
ＯＡＴ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	
ＺＡＣＲＯＳ	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	
ＪＳＰ	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
ＥＮＥＯＳ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	
ＡＧＣ	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	
フジミ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	
中部鋼鈑	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
ＪＸ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	
ＤＯＷＡ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
ＵＡＣＪ	26,400	5,380.00	142,032,000	
ＣＫ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	
ＳＷＣＣ	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	
ＡＲＥ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	
ＳＵＭＣＯ	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	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	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	
文化シヤッター	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	
ＬＩＸＩＬ	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	
東プレ	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	
ＦＵＪＩ	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	
DMG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	
冨士ダイス	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	
ＰＥＧＡＳＵＳ	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	
ＳＭＣ	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	
ＴＯＷＡ	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	
酉島製作所	16,200	2,079.00	33,679,800	
ＡＩＲＭＡＮ	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	
ＣＫＤ	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	
ＳＡＮＫＹＯ	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	
ＪＵＫＩ	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	
ＴＰＲ	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	
ＮＴＮ	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	
ＴＨＫ	108,900	3,844.00	418,611,600	
ＹＵＳＨＩＮ	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	
ＰＩＬＬＡＲ	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	
ＩＨＩ	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	
ＩＤＥＣ	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	
ＢＵＦＦＡＬＯ	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	
ＥＩＺＯ	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	
ＴＤＫ	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	
ＳＭＫ	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	
ＴＯＡ	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	

エスペック	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	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	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	
オプテックスグループ	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	
ＫＯＡ	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	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	78,100	11,995.00	936,809,500	
キヤノン電子	17,800	2,468.00	43,930,400	
キヤノン	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	
日本車輌製造	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	
トピー工業	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	
ＮＯＫ	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	
ＳＵＢＡＲＵ	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	
ＪＭＳ	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	
ＨＯＹＡ	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
前田工繊	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	
ＳＨＯＥＩ	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	
ＴＯＰＰＡＮ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	
ＮＩＳＳＨＡ	32,000	1,299.00	41,568,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	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	
タカラスタンダード	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	
ＡＺ－ＣＯＭ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	
ＳＧホールディングス	313,200	1,628.50	510,046,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳ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
ＮＳ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	
ＡＮＡ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	
キユーソー流通システム	12,400	3,245.00	40,238,000	
エーアイテイー	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	
ソフトクリエイトホールディングス	13,500	2,103.00	28,390,500	
ＴＩＳ	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	
GMO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	
ＫＬａｂ	55,300	121.00	6,691,300	
ポールトゥ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
コロプラ	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	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,400	2,082.00	21,652,800	貸付有価証券 7,200株
オプティム	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	
ＳＨＩＦＴ	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	
ｅＢＡＳＥ	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	
マークラインズ	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	
ｇｕｍｉ	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	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	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	
Ｕｂｉｃｏｍ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	
ＰＫＳＨＡ　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	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	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	
ＩＰＳ	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	
ギフティ	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	
ＪＭＤＣ	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	
ＴＤＣソフト	31,600	1,282.00	40,511,200	
ＬＩＮＥ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	
ＩＤ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	
ＤＴＳ	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	
ＳＣＳＫ	153,000	4,191.00	641,223,000	
ＮＳＷ	8,300	2,590.00	21,497,000	
アイネス	14,600	1,654.00	24,148,400	
ＴＫＣ	29,200	4,335.00	126,582,000	
ＮＳＤ	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	
ＪＢＣＣ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	
佐鳥電機	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	
メディパルホールディングス	214,500	2,379.50	510,402,750	
ＳＰＫ	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	
ハピネット	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
ＩＤＯＭ	67,200	1,100.00	73,920,000	
進和	12,000	3,110.00	37,320,000	
ダイトロン	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	
ＧＳＩ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	
トーホー	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	
キャンドゥ	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	
ジンズホールディングス	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
ブロンコビリー	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	
カッパ・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	
ＶＴ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
ＳＲＳ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
ＭｒＭａｘＨＤ	25,500	777.00	19,813,500	
ＡＯＫＩ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	

ケーズホールディングス	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	
バ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	
サックスバー　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	
ＦＰＧ	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	
ＳＢＩ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	
ＦＰパートナー	8,400	2,130.00	17,892,000	貸付有価証券 5,400株
ＳＯＭＰＯ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	
ＭＳ＆ＡＤ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	
ＳＢＩ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	
ＮＥＣ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
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	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	
ＳＲＥ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	
ＪＰＭＣ	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	
Ａｎｄ　Ｄｏ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	
テーオーシー	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	
ＭＩＲＡＲＴＨ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	
ＦＪ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	
ＬＩＦＵＬＬ	57,200	186.00	10,639,200	
ＭＩＸＩ	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
ＮＪＳ	4,800	5,570.00	26,736,000	貸付有価証券 3,200株
綜合警備保障	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	
ＪＰホールディングス	49,400	532.00	26,280,800	貸付有価証券 32,900株
ＣＬ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	
ＳＢＩ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	
GMO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	
ＫｅｅＰｅｒ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	
ＩＢＪ	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	
ベイカレント	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ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	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	159,939,562
株式	18,800,681,580
投資証券	60,089,700
派生商品評価勘定	290,040
未収配当金	38,738,480
未収利息	2,046
前払金	161,500
差入委託証拠金	9,318,579
流動資産合計	19,069,221,487
資産合計	19,069,221,487
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	457,964
未払解約金	502,996
流動負債合計	960,960
負債合計	960,960
純資産の部	
元本等	
元本	11,549,751,477
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,518,509,050
元本等合計	19,068,260,527
純資産合計	19,068,260,527
負債純資産合計	19,069,221,487

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	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 先物取引

	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	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。 (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	11,549,751,477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 1.6510円 (1万口当たり純資産額) (16,510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	9,412,266,386円
期中追加設定元本額	3,169,567,494円
期中一部解約元本額	1,032,082,403円
期末元本額	11,549,751,477円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	142,745,162円
コア投資戦略ファンド（成長型）	355,342,641円
コア投資戦略ファンド（切替型）	145,688,965円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	7,991,830,631円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	78,454,489円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	115,482,275円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	39,154,257円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	2,570,247,352円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	55,940,527円
ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	54,865,178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	3,332,499,192
投資証券	4,041,837
合計	3,336,541,029

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（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	205,620,000	－	205,458,500	△161,500
合計		205,620,000	－	205,458,500	△161,500

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

銘　柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ＩＮＰＥＸ	41,300	2,073.50	85,635,550	
安藤・間	6,800	1,571.00	10,682,800	
大林組	30,400	2,159.00	65,633,600	
清水建設	23,500	1,634.50	38,410,750	
戸田建設	9,800	957.40	9,382,520	
熊谷組	1,500	4,405.00	6,607,500	
住友林業	21,700	1,460.00	31,682,000	
大和ハウス工業	26,200	4,929.00	129,139,800	
積水ハウス	27,900	3,172.00	88,498,800	
高砂熱学工業	2,000	7,179.00	14,358,000	
インフロニア・ホールディングス	9,000	1,242.00	11,178,000	
明治ホールディングス	11,200	3,094.00	34,652,800	
サッポロホールディングス	3,000	7,044.00	21,132,000	
アサヒグループホールディングス	67,600	1,855.00	125,398,000	
キリンホールディングス	36,400	1,975.50	71,908,200	
サントリー食品インターナショナル	6,500	4,451.00	28,931,500	
伊藤園	2,400	3,252.00	7,804,800	
キッコーマン	31,800	1,283.50	40,815,300	
味の素	42,400	3,950.00	167,480,000	
カゴメ	4,000	2,824.50	11,298,000	
ニチレイ	9,600	1,794.00	17,222,400	
日清食品ホールディングス	9,200	2,897.50	26,657,000	
東洋紡	3,800	932.00	3,541,600	
帝人	8,300	1,216.50	10,096,950	
東レ	64,900	995.30	64,594,970	
クラレ	13,700	1,839.00	25,194,300	
旭化成	57,500	1,022.00	58,765,000	
レゾナック・ホールディングス	8,200	3,498.00	28,683,600	
住友化学	69,800	360.40	25,155,920	
日産化学	5,800	4,512.00	26,169,600	
クレハ	1,400	3,245.00	4,543,000	
日本曹達	2,000	3,280.00	6,560,000	
東ソー	12,900	2,219.00	28,625,100	
デンカ	3,700	2,054.50	7,601,650	
エア・ウォーター	8,600	2,188.50	18,821,100	
カネカ	2,000	4,018.00	8,036,000	
三井化学	8,500	3,430.00	29,155,000	
東京応化工業	4,500	4,042.00	18,189,000	
三菱ケミカルグループ	63,500	782.10	49,663,350	
ダイセル	10,400	1,233.50	12,828,400	

積水化学工業	17,700	2,555.00	45,223,500	
ＵＢＥ	4,500	2,294.50	10,325,250	
日本化薬	6,200	1,321.00	8,190,200	
花王	21,800	6,566.00	143,138,800	
日本ペイントホールディングス	44,400	1,203.00	53,413,200	
関西ペイント	6,700	2,004.00	13,426,800	
中国塗料	1,800	2,653.00	4,775,400	
ＤＩＣ	3,600	2,906.00	10,461,600	
サカタインクス	1,900	2,024.00	3,845,600	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	1,600	3,060.00	4,896,000	
富士フイルムホールディングス	52,400	2,995.00	156,938,000	
資生堂	18,700	2,522.00	47,161,400	
ライオン	12,000	1,452.00	17,424,000	
長谷川香料	1,500	3,020.00	4,530,000	
日東電工	33,100	2,762.00	91,422,200	
ニフコ	3,500	3,471.00	12,148,500	
ユニ・チャーム	52,300	1,028.50	53,790,550	
アステラス製薬	84,700	1,377.00	116,631,900	
塩野義製薬	35,400	2,468.00	87,367,200	
中外製薬	31,400	6,859.00	215,372,600	
エーザイ	12,300	3,966.00	48,781,800	
第一三共	80,400	3,210.00	258,084,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	127,800	729.10	93,178,980	
ブリヂストン	26,700	6,003.00	160,280,100	
東海カーボン	9,500	1,010.50	9,599,750	
ＴＯＴＯ	6,200	3,776.00	23,411,200	
日本特殊陶業	7,000	4,890.00	34,230,000	
神戸製鋼所	16,700	1,614.00	26,953,800	
ＪＦＥホールディングス	26,900	1,772.50	47,680,250	
大同特殊鋼	6,100	995.10	6,070,110	
日本軽金属ホールディングス	2,600	1,650.00	4,290,000	
三井金属鉱業	2,600	5,218.00	13,566,800	
三菱マテリアル	5,800	2,267.00	13,148,600	
住友金属鉱山	11,600	3,499.00	40,588,400	
ＤＯＷＡホールディングス	2,500	4,800.00	12,000,000	
ＵＡＣＪ	1,700	5,380.00	9,146,000	
三和ホールディングス	8,500	4,716.00	40,086,000	
ＬＩＸＩＬ	13,400	1,728.50	23,161,900	
三浦工業	4,100	2,893.50	11,863,350	
ナブテスコ	5,100	2,642.50	13,476,750	
小松製作所	42,300	4,791.00	202,659,300	
日立建機	4,500	4,283.00	19,273,500	

クボタ	45,800	1,614.50	73,944,100	
荏原製作所	21,600	2,776.50	59,972,400	
ダイキン工業	12,300	18,110.00	222,753,000	
栗田工業	4,900	5,592.00	27,400,800	
ダイフク	15,100	3,631.00	54,828,100	
セガサミーホールディングス	7,300	3,102.00	22,644,600	
ＮＴＮ	21,200	239.80	5,083,760	
カナデビア	7,600	990.00	7,524,000	
三菱重工業	150,000	3,250.00	487,500,000	
ＩＨＩ	6,900	14,895.00	102,775,500	
イビデン	5,600	6,326.00	35,425,600	
コニカミノルタ	21,200	442.80	9,387,360	
ブラザー工業	10,900	2,484.50	27,081,050	
日立製作所	214,400	4,115.00	882,256,000	
富士電機	6,300	6,540.00	41,202,000	
オムロン	8,200	3,831.00	31,414,200	
日本電気	57,500	3,866.00	222,295,000	
富士通	82,400	3,258.00	268,459,200	
ルネサスエレクトロニクス	78,800	1,893.00	149,168,400	
セイコーエプソン	14,000	1,859.00	26,026,000	
パナソニック　ホールディングス	109,100	1,448.00	157,976,800	
シャープ	12,200	639.30	7,799,460	
アンリツ	6,000	1,801.00	10,806,000	
ソニーグループ	287,900	3,607.00	1,038,455,300	
アルプスアルパイン	7,700	1,528.00	11,765,600	
マクセル	1,900	1,832.00	3,480,800	
横河電機	10,700	3,788.00	40,531,600	
アズビル	21,000	1,355.50	28,465,500	
アドバンテスト	35,900	11,245.00	403,695,500	
シスメックス	23,600	2,444.00	57,678,400	
スタンレー電気	5,000	2,884.50	14,422,500	
ウシオ電機	3,200	1,773.50	5,675,200	
ファナック	44,300	3,734.00	165,416,200	
太陽誘電	5,800	2,575.00	14,935,000	
キヤノン	43,700	4,017.00	175,542,900	
リコー	25,300	1,321.00	33,421,300	
東京エレクトロン	21,000	26,760.00	561,960,000	
トヨタ自動車	443,600	2,473.50	1,097,244,600	
ヤマハ発動機	43,200	1,058.50	45,727,200	
島津製作所	11,100	3,416.00	37,917,600	
ニコン	11,700	1,437.00	16,812,900	
ＨＯＹＡ	16,200	17,780.00	288,036,000	

ノーリツ鋼機	2,500	1,487.00	3,717,500	
メニコン	3,000	1,152.00	3,456,000	
前田工繊	1,900	1,905.00	3,619,500	
大日本印刷	18,400	2,193.50	40,360,400	
アシックス	30,900	3,720.00	114,948,000	
ヤマハ	17,400	1,008.50	17,547,900	
ピジョン	5,400	1,697.50	9,166,500	
リンテック	1,900	2,933.00	5,572,700	
美津濃	2,400	2,646.00	6,350,400	
東北電力	22,400	1,045.50	23,419,200	
九州電力	20,000	1,269.50	25,390,000	
東京瓦斯	15,500	4,756.00	73,718,000	
大阪瓦斯	17,000	3,662.00	62,254,000	
東邦瓦斯	3,200	4,121.00	13,187,200	
相鉄ホールディングス	3,700	2,290.00	8,473,000	
東急	23,400	1,684.00	39,405,600	
京王電鉄	4,500	3,455.00	15,547,500	
西日本旅客鉄道	20,900	3,272.00	68,384,800	
西武ホールディングス	9,800	4,569.00	44,776,200	
西日本鉄道	2,800	2,036.00	5,700,800	
阪急阪神ホールディングス	10,700	3,827.00	40,948,900	
南海電気鉄道	4,800	2,192.50	10,524,000	
京阪ホールディングス	4,200	3,079.00	12,931,800	
名古屋鉄道	8,700	1,641.00	14,276,700	
ヤマトホールディングス	11,800	1,980.50	23,369,900	
山九	2,100	8,117.00	17,045,700	
センコーグループホールディングス	6,200	2,048.00	12,697,600	
セイノーホールディングス	4,400	2,198.00	9,671,200	
九州旅客鉄道	6,600	3,674.00	24,248,400	
ＳＧホールディングス	15,000	1,628.50	24,427,500	
日本郵船	20,500	5,100.00	104,550,000	
ＡＮＡホールディングス	7,500	2,945.00	22,087,500	
三井倉庫ホールディングス	2,600	3,750.00	9,750,000	
ＴＩＳ	10,000	4,628.00	46,280,000	
ＳＨＩＦＴ	8,800	1,563.50	13,758,800	
インターネットイニシアティブ	5,100	2,689.50	13,716,450	
マネーフォワード	2,100	5,095.00	10,699,500	
野村総合研究所	17,700	5,331.00	94,358,700	
メルカリ	5,400	2,559.00	13,818,600	
フリー	2,100	3,725.00	7,822,500	
ＬＩＮＥヤフー	133,900	532.70	71,328,530	
ＢＩＰＲＯＧＹ	3,300	5,883.00	19,413,900	

スカパーＪＳＡＴホールディングス	7,700	1,357.00	10,448,900	
ＫＤＤＩ	143,600	2,433.50	349,450,600	
ソフトバンク	1,340,000	217.60	291,584,000	
コナミグループ	4,700	20,150.00	94,705,000	
ソフトバンクグループ	44,700	10,740.00	480,078,000	
あらた	1,300	3,070.00	3,991,000	
双日	10,500	3,606.00	37,863,000	
アルフレッサ　ホールディングス	7,600	2,032.50	15,447,000	
伊藤忠商事	55,600	7,590.00	422,004,000	
丸紅	66,100	2,992.50	197,804,250	
三愛オブリ	2,300	1,907.00	4,386,100	
サンゲツ	2,200	2,975.00	6,545,000	
伊藤忠エネクス	2,200	1,824.00	4,012,800	
サンリオ	8,400	6,746.00	56,666,400	
ＰＡＬＴＡＣ	1,300	4,103.00	5,333,900	
アスクル	1,800	1,428.00	2,570,400	
アダストリア	1,300	2,947.00	3,831,100	
エディオン	3,700	2,097.00	7,758,900	
ジンズホールディングス	600	8,860.00	5,316,000	
ビックカメラ	4,400	1,726.50	7,596,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	11,400	1,991.50	22,703,100	
マツキヨココカラ&カンパニー	15,600	3,081.00	48,063,600	
ＺＯＺＯ	19,000	1,546.50	29,383,500	
三越伊勢丹ホールディングス	15,100	2,130.50	32,170,550	
ジョイフル本田	2,300	2,078.00	4,779,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,200	907.00	3,809,400	
イオン北海道	2,000	887.00	1,774,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	17,800	4,994.00	88,893,200	
スギホールディングス	4,900	3,369.00	16,508,100	
日本瓦斯	4,800	2,663.00	12,782,400	
青山商事	1,900	2,290.00	4,351,000	
丸井グループ	7,800	3,003.00	23,423,400	
イオン	34,700	4,320.00	149,904,000	
イズミ	1,700	3,201.00	5,441,700	
ヤオコー	900	9,562.00	8,605,800	
ケーズホールディングス	5,700	1,527.50	8,706,750	
ヤマダホールディングス	24,900	457.30	11,386,770	
ファーストリテイリング	8,900	46,740.00	415,986,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	48,200	933.60	44,999,520	
三井住友トラストグループ	30,000	3,879.00	116,370,000	
三井住友フィナンシャルグループ	172,700	3,595.00	620,856,500	

みずほフィナンシャルグループ	111,800	4,003.00	447,535,400	
大和証券グループ本社	62,400	1,006.50	62,805,600	
野村ホールディングス	140,700	928.40	130,625,880	
ＳＯＭＰＯホールディングス	41,700	4,185.00	174,514,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	60,200	3,098.00	186,499,600	
東京海上ホールディングス	86,000	5,697.00	489,942,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	22,900	3,168.00	72,547,200	
東京センチュリー	6,900	1,705.00	11,764,500	
オリックス	54,400	3,296.00	179,302,400	
ヒューリック	21,600	1,465.00	31,644,000	
野村不動産ホールディングス	25,800	859.50	22,175,100	
オープンハウスグループ	3,400	6,760.00	22,984,000	
東急不動産ホールディングス	27,000	1,051.50	28,390,500	
三井不動産	123,700	1,376.00	170,211,200	
三菱地所	49,800	2,722.50	135,580,500	
平和不動産	1,800	2,226.00	4,006,800	
東京建物	8,800	2,556.00	22,492,800	
住友不動産	14,500	5,534.00	80,243,000	
ＭＩＸＩ	1,600	3,400.00	5,440,000	
ジェイエイシーリクルートメント	3,100	1,041.00	3,227,100	
パーソルホールディングス	80,000	286.50	22,920,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	2,600	3,147.00	8,182,200	
オリエンタルランド	50,600	3,074.00	155,544,400	
ダスキン	1,800	3,958.00	7,124,400	
リゾートトラスト	8,100	1,798.00	14,563,800	
ユー・エス・エス	19,200	1,630.00	31,296,000	
楽天グループ	70,600	808.50	57,080,100	
テクノプロ・ホールディングス	4,900	4,298.00	21,060,200	
リクルートホールディングス	65,900	8,379.00	552,176,100	
インソース	2,400	987.00	2,368,800	
乃村工藝社	3,600	928.00	3,340,800	
トーカイ	800	2,112.00	1,689,600	
セコム	19,700	5,215.00	102,735,500	
合　計	7,478,600		18,800,681,580	

(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	積水ハウス・リート投資法人	195	14,683,500	
	オリックス不動産投資法人	123	23,616,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	138	21,790,200	
合計		456	60,089,700	

(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。

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

貸借対照表

	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	279,312,541
株式	51,601,767,830
未収配当金	63,769,550
未収利息	3,574
流動資産合計	51,944,853,495
資産合計	51,944,853,495
負債の部	
流動負債	
未払解約金	40,163,209
流動負債合計	40,163,209
負債合計	40,163,209
純資産の部	
元本等	
元本	7,638,753,165
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	44,265,937,121
元本等合計	51,904,690,286
純資産合計	51,904,690,286
負債純資産合計	51,944,853,495

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.収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		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	7,638,753,165口
２．	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額　6.7949円 (1万口当たり純資産額)　(67,949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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	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	7,386,247,441円
期中追加設定元本額	1,000,671,018円
期中一部解約元本額	748,165,294円
期末元本額	7,638,753,165円
期末元本額の内訳	
ＤＣ日本株式エクセレント・フォーカス	5,091,652,830円
コア投資戦略ファンド（安定型）	39,419,591円
コア投資戦略ファンド（成長型）	96,061,665円
コア投資戦略ファンド（切替型）	36,101,729円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	1,987,211,073円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	19,056,206円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	29,057,531円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	10,159,202円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	262,394,442円
ＦＯＦｓ用　日本株式エクセレント・フォーカスＳ（適格機関投資家専用）	14,638,756円
ＳＭＴ　ＥＴＦ日本株厳選投資アクティブ	52,797,663円
日本株式エクセレント・フォーカスＶＡ（適格機関投資家専用）	202,477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	2,812,051,604
合計	2,812,051,604

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式エクセレント・フォーカス　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

銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大和ハウス工業	93,700	4,929.00	461,847,300	
信越化学工業	289,400	4,650.00	1,345,710,000	
ユニ・チャーム	441,000	1,028.50	453,568,500	
エーザイ	71,000	3,966.00	281,586,000	
第一三共	308,000	3,210.00	988,680,000	
ＭＡＲＵＷＡ	68,500	42,290.00	2,896,865,000	
住友金属鉱山	76,500	3,499.00	267,673,500	
住友電気工業	311,000	3,213.00	999,243,000	
ディスコ	33,600	43,010.00	1,445,136,000	
ＳＭＣ	12,600	49,560.00	624,456,000	
荏原製作所	469,800	2,776.50	1,304,399,700	
ダイフク	329,300	3,631.00	1,195,688,300	
三菱重工業	583,800	3,250.00	1,897,350,000	
イビデン	44,500	6,326.00	281,507,000	
日立製作所	518,000	4,115.00	2,131,570,000	
富士電機	102,400	6,540.00	669,696,000	
富士通	209,100	3,258.00	681,247,800	
ソニーグループ	587,000	3,607.00	2,117,309,000	
アドバンテスト	136,500	11,245.00	1,534,942,500	
キーエンス	22,500	55,480.00	1,248,300,000	
村田製作所	282,300	2,131.00	601,581,300	
東京エレクトロン	66,800	26,760.00	1,787,568,000	
デンソー	218,700	1,951.00	426,683,700	
川崎重工業	182,500	10,080.00	1,839,600,000	
トヨタ自動車	343,900	2,473.50	850,636,650	
シマノ	17,300	20,260.00	350,498,000	
ＨＯＹＡ	36,900	17,780.00	656,082,000	
東海旅客鉄道	184,500	3,328.00	614,016,000	
西武ホールディングス	182,100	4,569.00	832,014,900	

ＳＨＩＦＴ	909,900	1,563.50	1,422,628,650	
GMOペイメントゲートウェイ	34,700	8,696.00	301,751,200	
野村総合研究所	238,500	5,331.00	1,271,443,500	
ＮＴＴ	5,881,800	152.60	897,562,680	
三菱商事	458,400	2,873.00	1,316,983,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	468,300	1,991.50	932,619,450	
マツキヨココカラ＆カンパニー	482,600	3,081.00	1,486,890,600	
三越伊勢丹ホールディングス	1,037,300	2,130.50	2,209,967,650	
良品計画	132,600	7,046.00	934,299,600	
ニトリホールディングス	21,800	13,445.00	293,101,000	
ファーストリテイリング	11,100	46,740.00	518,814,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,525,600	1,972.50	3,009,246,000	
三井住友フィナンシャルグループ	667,700	3,595.00	2,400,381,500	
みずほフィナンシャルグループ	189,300	4,003.00	757,767,900	
第一生命ホールディングス	527,900	1,080.00	570,132,000	
パーク２４	277,500	1,922.50	533,493,750	
三井不動産	309,500	1,376.00	425,872,000	
リクルートホールディングス	183,000	8,379.00	1,533,357,000	
合　計	19,580,700		51,601,767,830	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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	

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
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	(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。 (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。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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。

	2025年 7月10日現在
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	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	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	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	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,253,883,227円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	4,784,362円
ＳＭＴ　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
ＤＣマイセレクション２５	491,333,057円
ＤＣマイセレクション５０	2,842,430,600円
ＤＣマイセレクション７５	3,824,726,740円
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	13,899,867,505円
ＤＣマイセレクションＳ２５	416,060,392円
ＤＣマイセレクションＳ５０	2,071,089,867円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,449,825,253円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０２５	3,510,781円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	106,596,714円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	91,460,280円
ＤＣ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
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,390,416円
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

区分	2025年 7月10日現在
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
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)	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	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				
	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。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	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	
FREEPORT-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	
ENTERGY 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	
	BRENNTAG 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	
NEMETSCHEK 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	
ユーロ 小計		15,685,023		467,585,035.97 (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	
	ASHTEAD 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 SYSYEMS 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	
	YANGZIJIANG 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	
	SEMBCORP 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 HAPOALIM 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ＥＳＧリーダーズ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	194,515,935
コール・ローン	168,731,957
株式	21,392,041,846
投資信託受益証券	7,506,407
投資証券	377,909,315
派生商品評価勘定	18,225,579
未収配当金	10,594,502
未収利息	2,159
差入委託証拠金	292,162,285
流動資産合計	22,461,689,985
資産合計	22,461,689,985
負債の部	
流動負債	
前受金	18,225,579
未払金	2,428,905
未払解約金	165,158,283
流動負債合計	185,812,767
負債合計	185,812,767
純資産の部	
元本等	
元本	11,684,306,264
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,591,570,954
元本等合計	22,275,877,218
純資産合計	22,275,877,218
負債純資産合計	22,461,689,985

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	(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。 (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。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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	11,684,306,264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 1.9065円 (1万口当たり純資産額) (19,065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。

	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、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	9,375,233,537円
期中追加設定元本額	3,967,151,972円
期中一部解約元本額	1,658,079,245円
期末元本額	11,684,306,264円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	148,577,401円
コア投資戦略ファンド（成長型）	373,139,116円
コア投資戦略ファンド（切替型）	153,136,070円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	83,672,900円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	8,199,963,428円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	132,455,362円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,824,717円
ＤＣ外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスファンド	2,484,551,046円
ＦＯＦｓ用　外国株式ＥＳＧリーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	63,986,224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	505,195,736
投資信託受益証券	147,590
投資証券	△13,291,492
合計	492,051,834

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（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	461,316,615	―	479,542,194	18,225,579
合計		461,316,615	―	479,542,194	18,225,579

(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	BAKER HUGHES CO	3,991	39.33	156,966.03	
	CHENIERE ENERGY INC	896	235.96	211,420.16	
	HALLIBURTON CO	3,697	22.04	81,481.88	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,251	179.27	224,266.77	
	ONEOK INC	2,445	81.16	198,436.20	
	PHILLIPS 66	1,659	130.51	216,516.09	
	SCHLUMBERGER	5,611	36.25	203,398.75	
	TARGA RESOURCES CORP	844	170.69	144,062.36	
	VALERO ENERGY CORP	1,296	149.07	193,194.72	
	WILLIAMS COS	4,912	57.85	284,159.20	
	AVERY DENNISON CORP	314	183.52	57,625.28	
	BALL CORP	1,123	57.94	65,066.62	
	CRH PLC	2,687	96.47	259,214.89	

ECOLAB INC	1,007	268.21	270,087.47	
INT'L PAPER CO	1,861	51.36	95,580.96	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,084	76.55	82,980.20	
LINDE PLC	1,906	471.27	898,240.62	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	943	64.84	61,144.12	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	251	567.02	142,322.02	
NEWMONT CORPORATION	4,531	58.75	266,196.25	
NUCOR CORP	1,029	139.70	143,751.30	
PPG INDUSTRIES INC	865	118.19	102,234.35	
SMURFIT WESTROCK PLC	1,924	47.24	90,889.76	
STEEL DYNAMICS INC	540	136.08	73,483.20	
3 M COMPANY	2,135	155.98	333,017.30	
AERCAP HOLDINGS NV	771	114.05	87,932.55	
ALLEGION PLC	318	150.06	47,719.08	
AXON ENTERPRISE INC	287	805.86	231,281.82	
CARRIER GLOBAL CORP	3,192	75.89	242,240.88	
CATERPILLAR	1,942	402.18	781,033.56	
CNH INDUSTRIAL NV	3,795	13.69	51,953.55	
CUMMINS INC	547	334.60	183,026.20	
DEERE&CO	1,058	509.33	538,871.14	
DOVER CORP	564	188.22	106,156.08	
EATON CORP	1,566	359.78	563,415.48	
EMCOR GROUP INC	177	546.28	96,691.56	
FERGUSON ENTERPRISES INC	808	224.00	180,992.00	
FORTIVE CORP	1,302	52.99	68,992.98	
GE AEROSPACE	4,291	250.33	1,074,166.03	
GRACO INC	657	88.45	58,111.65	
GRAINGER (WW) INC	191	1,045.29	199,650.39	
HUBBELL INC	230	417.71	96,073.30	
IDEX CORP	274	184.38	50,520.12	
ILLINOIS TOOL WORKS	1,157	259.75	300,530.75	
INGERSOLL-RAND INC	1,675	87.70	146,897.50	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,641	106.50	281,266.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	119	602.38	71,683.22	
OWENS CORNING	314	147.29	46,249.06	
PENTAIR PLC	604	106.90	64,567.60	
QUANTA SERVICES INC	590	382.12	225,450.80	
ROCKWELL AUTOMATION INC	435	340.26	148,013.10	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	904	433.61	391,983.44	
UNITED RENTALS INC	266	803.99	213,861.34	
XYLEM INC	993	131.55	130,629.15	
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,647	308.41	507,951.27	

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	478	238.76	114,127.28	
CINTAS CORP	1,473	216.64	319,110.72	
PAYCHEX INC	1,294	145.94	188,846.36	
TRANSUNION	763	93.52	71,355.76	
VERALTO CORP	1,027	102.37	105,133.99	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	419	99.12	41,531.28	
CSX CORP	7,628	33.33	254,241.24	
DELTA AIR LINES INC	570	50.70	28,899.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	511	117.27	59,924.97	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	9,455	4.99	47,180.45	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	307	152.67	46,869.69	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	739	168.01	124,159.39	
UNION PACIFIC CORP	2,421	236.49	572,542.29	
UNITED PARCEL SERVICE B	2,976	102.15	303,998.40	
APTIV PLC	979	70.92	69,430.68	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,859	13.20	37,738.80	
TESLA INC	11,651	295.88	3,447,297.88	
DECKERS OUTDOOR CORP	581	104.91	60,952.71	
DR HORTON INC	1,186	138.41	164,154.26	
GARMIN LTD	630	217.11	136,779.30	
LULULEMON ATHLETICA INC	418	235.89	98,602.02	
NVR INC	12	7,700.93	92,411.16	
PULTE GROUP INC	804	113.77	91,471.08	
BOOKING HOLDINGS INC	133	5,668.04	753,849.32	
DARDEN RESTAURANTS INC	455	215.83	98,202.65	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	976	272.53	265,989.28	
MCDONALD'S CORP	2,878	293.02	843,311.56	
YUM BRANDS INC	1,127	150.85	170,007.95	
ALPHABET INC-CL A	23,497	176.62	4,150,040.14	
ALPHABET INC-CL C	19,912	177.66	3,537,565.92	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	378	403.56	152,545.68	
COMCAST CORP-CL A	14,958	35.62	532,803.96	
ELECTRONIC ARTS INC	962	152.68	146,878.16	
FOX CORP - CLASS A	784	55.21	43,284.64	
FOX CORP- CLASS B	492	50.61	24,900.12	
OMNICOM GROUP	768	72.50	55,680.00	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	618	722.12	446,270.16	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	705	242.23	170,772.15	
THE WALT DISNEY CO	7,276	120.61	877,558.36	
AUTOZONE INC	67	3,742.18	250,726.06	
BEST BUY COMPANY INC	803	72.46	58,185.38	
BURLINGTON STORES INC	235	253.36	59,539.60	

DICK'S SPORTING GOODS INC	248	210.31	52,156.88	
EBAY	1,817	76.32	138,673.44	
GENUINE PARTS CO	602	125.25	75,400.50	
HOME DEPOT	4,003	371.04	1,485,273.12	
LKQ CORP	1,088	38.85	42,268.80	
LOWES COMPANIES	2,263	225.57	510,464.91	
MERCADOLIBRE INC	185	2,477.08	458,259.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,405	92.58	315,234.90	
POOL CORP	137	308.46	42,259.02	
TJX COMPANIES INC	4,500	125.45	564,525.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,006	57.21	114,763.26	
ULTA BEAUTY INC	176	475.57	83,700.32	
WILLIAMS-SONOMA INC	466	173.73	80,958.18	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	1,753	22.33	39,144.49	
DOLLAR GENERAL CORP	849	112.35	95,385.15	
KROGER CO	2,516	70.26	176,774.16	
SYSCO CORP	1,895	76.33	144,645.35	
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,822	102.43	186,627.46	
BUNGE GLOBAL SA	574	75.64	43,417.36	
COCA-COLA CO	16,452	69.48	1,143,084.96	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	947	95.86	90,779.42	
CONAGRA BRANDS INC	1,731	20.38	35,277.78	
GENERAL MILLS INC	2,069	51.20	105,932.80	
HORMEL FOODS CORP	1,124	31.27	35,147.48	
JM SMUCKER CO	387	104.17	40,313.79	
KELLANOVA	1,022	79.22	80,962.84	
KEURIG DR PEPPER INC	5,523	33.65	185,848.95	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	985	72.21	71,126.85	
MONSTER BEVERAGE CORP	2,964	59.57	176,565.48	
PEPSICO INC	5,599	134.48	752,953.52	
THE CAMPBELL'S COMPANY	623	30.74	19,151.02	
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,009	98.39	99,275.51	
CLOROX COMPANY	452	126.00	56,952.00	
COLGATE-PALMOLIVE CO	3,094	91.58	283,348.52	
ESTEE LAUDER CO-CL A	901	86.61	78,035.61	
KENVUE INC	7,398	20.76	153,582.48	
KIMBERLY-CLARK CORP	1,345	131.49	176,854.05	
PROCTER & GAMBLE CO	9,435	157.52	1,486,201.20	
ALIGN TECHNOLOGY INC	283	200.48	56,735.84	
CENCORA INC	779	300.16	233,824.64	
COOPER COS INC/THE	721	74.95	54,038.95	
DAVITA INC	166	141.84	23,545.44	

DEXCOM INC	1,492	84.87	126,626.04	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,400	77.19	185,256.00	
ELEVANCE HEALTH INC	909	346.36	314,841.24	
HCA HEALTHCARE INC	758	378.44	286,857.52	
HOLOGIC INC	919	65.85	60,516.15	
HUMANA INC	488	236.70	115,509.60	
IDEXX LABORATORIES INC	335	540.64	181,114.40	
INSULET CORP	273	297.46	81,206.58	
LABCORP HOLDINGS INC	305	259.07	79,016.35	
MOLINA HEALTHCARE INC	229	237.22	54,323.38	
QUEST DIAGNOSTICS	413	173.62	71,705.06	
SOLVENTUM CORP	641	74.19	47,555.79	
STERIS PLC	408	231.28	94,362.24	
THE CIGNA GROUP	1,090	309.78	337,660.20	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	665	284.36	189,099.40	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	754	95.20	71,780.80	
AGILENT TECHNOLOGIES	1,172	121.30	142,163.60	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	540	320.87	173,269.80	
AMGEN	2,166	296.52	642,262.32	
AVANTOR INC	2,683	13.57	36,408.31	
BIOGEN INC	623	133.02	82,871.46	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8,248	47.66	393,099.68	
DANAHER CORP	2,592	200.96	520,888.32	
ELI LILLY & CO	3,247	786.92	2,555,129.24	
GILEAD SCIENCES INC	5,064	113.24	573,447.36	
INCYTE CORP	809	68.72	55,594.48	
IQVIA HOLDINGS INC	679	162.02	110,011.58	
JOHNSON & JOHNSON	9,695	156.28	1,515,134.60	
MERCK & CO	10,261	83.71	858,948.31	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	87	1,218.65	106,022.55	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	371	133.51	49,532.21	
REVVITY INC	520	100.13	52,067.60	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,600	35.87	57,392.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,050	478.96	502,913.25	
WATERS CORP	233	349.21	81,365.93	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	271	226.18	61,294.78	
ZOETIS INC	1,777	158.27	281,245.79	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,735	47.38	82,204.30	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	5,388	17.42	93,858.96	
KEY CORP	3,475	18.46	64,148.50	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,623	196.14	318,335.22	
REGIONS FINL CORP	3,815	24.63	93,963.45	

TRUIST FINANCIAL CORP	5,319	45.16	240,206.04	
US BANCORP	6,404	47.30	302,909.20	
AMERICAN EXPRESS	2,268	317.35	719,749.80	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	392	539.47	211,472.24	
BANK NEW YORK CO	2,901	93.05	269,938.05	
BLACKROCK INC	597	1,088.75	649,983.75	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,605	218.03	567,968.15	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	433	232.06	100,481.98	
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	53.18	59,933.86	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	138	447.81	61,797.78	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	2,037	80.02	163,000.74	
FISERV INC	2,229	170.95	381,047.55	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2,320	182.16	422,611.20	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	321	380.90	122,268.90	
MASTERCARD INC-CLASS A	3,282	565.11	1,854,691.02	
MOODY'S CORP	639	502.22	320,918.58	
MORGAN STANLEY	4,885	141.55	691,471.75	
NASDAQ INC	1,760	89.83	158,100.80	
NORTHERN TRUST CORP	742	127.00	94,234.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	3,822	74.83	286,000.26	
PRICE T ROWE GROUP INC	936	101.45	94,957.20	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	859	158.66	136,288.94	
S&P GLOBAL INC	1,274	528.73	673,602.02	
SCHWAB (CHARLES) CORP	6,999	92.32	646,147.68	
STATE STREET CORP	1,094	109.40	119,683.60	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,453	70.16	101,942.48	
VISA INC-CLASS A SHARES	6,937	357.76	2,481,781.12	
AFLAC	2,093	101.91	213,297.63	
ALLSTATE CORP	1,055	194.09	204,764.95	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,523	87.92	133,902.16	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	1,091	121.87	132,960.17	
MARSH & MCLENNAN COS	1,993	214.17	426,840.81	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	842	80.86	68,084.12	
PROGRESSIVE CORP	2,397	250.41	600,232.77	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,434	106.60	152,864.40	
TRAVELERS COS INC/THE	905	255.32	231,064.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	412	308.51	127,106.12	
WEYERHAEUSER CO	2,692	26.15	70,395.80	
ACCENTURE PLC-CL A	2,552	297.40	758,964.80	
ADOBE INC	1,706	373.38	636,986.28	
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	598	80.63	48,216.74	
ANSYS INC	357	366.87	130,972.59	

ATLASSIAN CORP-CL A	637	220.89	140,706.93	
AUTODESK INC	844	307.27	259,335.88	
CADENCE DESIGN SYSTEMS	1,118	322.91	361,013.38	
DOCUSIGN INC	788	79.58	62,709.04	
FAIR ISAAC CORP	98	1,591.73	155,989.54	
GARTNER INC	293	394.44	115,570.92	
HUBSPOT INC	205	560.55	114,912.75	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	3,738	290.14	1,084,543.32	
INTUIT INC	1,127	769.59	867,327.93	
MICROSOFT CORP	28,418	503.51	14,308,747.18	
PALO ALTO NETWORKS INC	2,722	206.06	560,895.32	
PTC INC	509	210.47	107,129.23	
SALESFORCE INC	3,870	270.92	1,048,460.40	
SERVICENOW INC	843	1,013.71	854,557.53	
SYNOPSYS INC	631	550.95	347,649.45	
TWILIO INC - A	549	121.49	66,698.01	
WORKDAY INC-CLASS A	839	240.17	201,502.63	
ZSCALER INC	402	316.50	127,233.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	5,349	20.80	111,259.20	
HP INC	3,542	25.62	90,746.04	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	715	163.90	117,188.50	
NETAPP INC	843	106.67	89,922.81	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	863	142.01	122,554.63	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	903	79.62	71,896.86	
WESTERN DIGITAL CORP	1,282	64.64	82,868.48	
VERIZON COMMUNICATIONS	17,226	42.61	733,999.86	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	743	141.80	105,357.40	
ATMOS ENERGY CORP	665	153.10	101,811.50	
CMS ENERGY CORP	1,236	69.76	86,223.36	
CONSOLIDATED EDISON INC	1,386	99.97	138,558.42	
EDISON INTL	1,467	50.63	74,274.21	
ESSENTIAL UTILITIES INC	1,060	37.35	39,591.00	
EVERSOURCE ENERGY	1,527	65.11	99,422.97	
EXELON CORP	3,971	43.14	171,308.94	
NISOURCE INC	1,950	39.34	76,713.00	
NRG ENERGY INC	833	150.27	125,174.91	
SEMPRA	2,641	74.49	196,728.09	
ADVANCED MICRO DEVICES	6,539	138.41	905,062.99	
ANALOG DEVICES	2,000	242.72	485,440.00	
APPLIED MATERIALS	3,336	195.39	651,821.04	
FIRST SOLAR INC	393	165.99	65,234.07	
INTEL CORP	17,207	23.44	403,332.08	

	LAM RESEARCH CORP	5,172	99.81	516,217.32	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	3,386	72.26	244,672.36	
	NVIDIA CORP	98,188	162.88	15,992,861.44	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	1,011	230.42	232,954.62	
	TEXAS INSTRUMENTS	3,720	216.39	804,970.80	
	CBRE GROUP INC-A	1,161	139.75	162,249.75	
アメリカドル 小計		708,808		112,804,235.70 (16,457,009,946)	
カナダドル	CAMECO CORP	1,766	97.95	172,979.70	
	ENBRIDGE	8,586	59.95	514,730.70	
	IMPERIAL OIL	669	109.39	73,181.91	
	KEYERA CORP	820	42.10	34,522.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,410	49.91	120,283.10	
	AGNICO EAGLE MINES	1,995	161.06	321,314.70	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	2,664	10.70	28,504.80	
	KINROSS GOLD CORP	4,493	20.98	94,263.14	
	LUNDIN MINING CORP	3,014	14.11	42,527.54	
	NUTRIEN LTD	1,854	85.04	157,664.16	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	257	103.60	26,625.20	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,819	121.60	221,190.40	
	CAE INC	1,167	40.45	47,205.15	
	WSP GLOBAL INC	537	280.34	150,542.58	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	1,892	34.58	65,425.36	
	RB GLOBAL INC	721	144.88	104,458.48	
	THOMSON REUTERS CORP	645	273.73	176,555.85	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,128	143.42	305,197.76	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	267	189.05	50,476.35	
	DOLLARAMA INC	1,129	192.21	217,005.09	
	LOBLAW COMPANIES LTD	620	225.66	139,909.20	
	METRO INC	904	105.92	95,751.68	
	WESTON (GEORGE) LTD	250	270.73	67,682.50	
	BANK MONTREAL	2,860	154.75	442,585.00	
	BANK NOVA SCOTIA	4,902	75.02	367,748.04	
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,605	141.27	226,738.35	
	TORONTO-DOMINION BANK	7,210	101.44	731,382.40	
	BROOKFIELD CORP	5,472	85.61	468,457.92	
	INTACT FINANCIAL CORP	718	308.81	221,725.58	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	2,310	84.30	194,733.00	
	CGI INC - CL A	791	140.70	111,293.70	
	OPEN TEXT CORP	1,049	39.50	41,435.50	
	SHOPIFY INC - CLASS A	4,991	156.49	781,041.59	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,342	44.00	59,048.00	

	TELUS CORP	1,700	22.65	38,505.00	
	FORTIS INC	1,864	64.09	119,463.76	
	HYDRO ONE LTD	1,329	49.07	65,214.03	
	FIRSTSERVICE CORP	180	243.29	43,792.20	
カナダドル 小計		78,930		7,141,161.42 (761,747,688)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,984	16.52	32,785.60	
	NESTE OIL OYJ	1,576	12.29	19,376.92	
	OMV AG	448	46.80	20,966.40	
	REPSOL SA	4,227	12.78	54,021.06	
	TOTALENERGIES SE	8,214	53.28	437,641.92	
	AKZO NOBEL	607	60.60	36,784.20	
	COVESTRO AG-TEND	815	60.40	49,226.00	
	DSM-FIRMENICH AG	783	90.04	70,501.32	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,045	17.79	18,590.55	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	573	204.90	117,407.70	
	STORA ENSO OYJ R	2,074	9.26	19,209.38	
	SYENSQO SA	428	69.16	29,600.48	
	SYMRISE AG	485	90.76	44,018.60	
	UPM KYMMENE OYJ	2,489	23.88	59,437.32	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	645	56.70	36,571.50	
	ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	645	1.61	1,038.96	
	BOUYGUES ORD	856	39.35	33,683.60	
	EIFFAGE	297	118.95	35,328.15	
	FERROVIAL SE	2,200	44.99	98,978.00	
	GEA GROUP AG	600	59.10	35,460.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	591	72.20	42,670.20	
	KNORR-BREMSE AG	346	84.75	29,323.50	
	KONE OYJ-B	1,339	54.80	73,377.20	
	LEGRAND SA	1,100	113.75	125,125.00	
	METSO CORPORATION	3,096	11.41	35,340.84	
	MTU AERO ENGINES AG	207	384.00	79,488.00	
	PRYSMIAN SPA	1,150	61.12	70,288.00	
	REXEL SA	717	26.26	18,828.42	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	2,158	227.70	491,376.60	
	BUREAU VERITAS SA	1,600	27.90	44,640.00	
	RANDSTAD NV	706	41.38	29,214.28	
	WOLTERS KLUWER	955	138.85	132,601.75	
	ADP	92	105.70	9,724.40	
	AENA SME SA	3,100	23.43	72,648.50	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	3,000	7.41	22,242.00	
	GETLINK	1,366	16.11	22,006.26	

INPOST SA	1,567	13.21	20,700.07	
MICHELIN	2,609	32.22	84,061.98	
ADIDAS AG	663	212.30	140,754.90	
HERMES INTERNATIONAL	124	2,434.00	301,816.00	
KERING	275	199.80	54,945.00	
LVMH	1,126	487.85	549,319.10	
MONCLER SPA	906	51.26	46,441.56	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,859	71.24	132,435.16	
PUBLICIS GROUPE	885	88.84	78,623.40	
SCOUT24 SE	292	119.80	34,981.60	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	4,419	26.73	118,119.87	
PROSUS	5,376	47.59	255,843.84	
ZALANDO SE	845	28.91	24,428.95	
CARREFOUR	2,101	12.47	26,199.47	
JERONIMO MARTINS	863	22.76	19,641.88	
KESKO OYJ-B SHS	1,028	20.92	21,505.76	
KONINKLIJKE AHOLD NV	3,615	35.19	127,211.85	
DANONE (GROUPE)	2,633	67.94	178,886.02	
KERRY GROUP PLC-A	686	90.85	62,323.10	
LOTUS BAKERIES	2	7,900.00	15,800.00	
BEIERSDORF AG	441	109.30	48,201.30	
HENKEL AG & CO KGAA	380	62.35	23,693.00	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	654	67.94	44,432.76	
LOREAL	985	374.35	368,734.75	
ESSILORLUXOTTICA	1,195	252.90	302,215.50	
EUROFINS SCIENTIFIC	625	59.70	37,312.50	
MERCK KGAA	539	111.30	59,990.70	
QIAGEN N.V.	841	40.65	34,190.85	
SARTORIUS AG-VORZUG	83	218.10	18,102.30	
BANCO DE SABADELL SA	19,827	3.04	60,412.86	
BNP PARIBAS	3,988	78.87	314,533.56	
COMMERZBANK AG	3,529	30.08	106,152.32	
CREDIT AGRICOLE SA	4,455	16.40	73,062.00	
FINECOBANK SPA	2,270	18.95	43,016.50	
ING GROEP NV-CVA	12,350	19.79	244,480.60	
INTESA SANPAOLO	60,666	5.06	307,455.28	
KBC GROEP NV	872	91.12	79,456.64	
MEDIOBANCA	1,829	18.90	34,568.10	
SOCIETE GENERALE	3,098	52.00	161,096.00	
DEUTSCHE BOERSE	750	271.80	203,850.00	
EURAZEO SA	173	60.05	10,388.65	
NEXI SPA	1,449	5.25	7,607.25	

	AGEAS	508	56.75	28,829.00	
	ASR NEDERLAND NV	692	56.74	39,264.08	
	AXA SA	7,108	42.05	298,891.40	
	GENERALI	3,826	31.27	119,639.02	
	MUENCHENER RUECKVERSICH.	554	576.80	319,547.20	
	NN GROUP NV	960	56.34	54,086.40	
	POSTE ITALIANE SPA	1,615	18.13	29,279.95	
	SAMPO OYJ-A SHS	9,570	9.25	88,560.78	
	DASSAULT SYSTEMES SA	2,778	31.69	88,034.82	
	NOKIA OYJ	22,958	4.34	99,637.72	
	CELLNEX TELECOM SA	2,072	32.35	67,029.20	
	ELISA A	506	46.92	23,741.52	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	1,606	10.29	16,525.74	
	KPN (KON.)	14,277	4.08	58,321.54	
	EDP SA	15,486	3.82	59,249.43	
	ELIA GROUP SA/NV	200	97.65	19,530.00	
	ENDESA	1,600	26.51	42,416.00	
	ENEL	31,872	8.11	258,768.76	
	IBERDROLA SA	22,943	15.65	359,172.66	
	IBERDROLA SA-RTS	22,943	0.40	9,177.20	
	REDEIA CORP SA	1,436	17.67	25,374.12	
	VERBUND AG	301	63.95	19,248.95	
	ASML HOLDING NV	1,583	679.80	1,076,123.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES	5,182	37.91	196,449.62	
	STMICROELECTRONICS NV	2,523	27.09	68,348.07	
	LEG IMMOBILIEN SE	314	72.15	22,655.10	
	VONOVIA SE	2,857	28.60	81,710.20	
ユーロ 小計		383,657		10,996,127.42 (1,882,866,898)	
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	4,609	21.70	100,015.30	
	ANTOFAGASTA PLC	1,487	18.64	27,717.68	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	30.06	12,384.72	
	MONDI PLC	1,465	11.86	17,382.22	
	ASHTEAD GROUP PLC	1,625	47.40	77,025.00	
	BUNZL PLC	1,318	23.06	30,393.08	
	DCC PLC	353	47.66	16,823.98	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	5,400	5.32	28,738.80	
	SMITHS GROUP PLC	1,623	22.64	36,744.72	
	SPIRAX GROUP PLC	247	61.90	15,289.30	
	INTERTEK GROUP PLC	614	48.34	29,680.76	
	RELX PLC	7,537	39.35	296,580.95	
	RENTOKIL INITIAL PLC	9,235	3.35	30,955.72	

	BARRATT REDROW PLC	5,407	4.23	22,898.64	
	PEARSON	3,089	10.50	32,434.50	
	WHITBREAD PLC	586	29.82	17,474.52	
	AUTO TRADER GROUP PLC	3,977	8.12	32,301.19	
	INFORMA PLC	4,875	8.23	40,131.00	
	WPP PLC	4,040	4.28	17,315.44	
	KINGFISHER PLC	6,491	2.83	18,414.96	
	SAINSBURY (J) PLC	8,664	2.83	24,519.12	
	TESCO PLC	26,319	4.02	105,986.61	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	20.56	26,769.12	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	956	39.24	37,513.44	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,747	50.30	138,174.10	
	UNILEVER PLC	10,094	44.45	448,678.30	
	ASTRAZENECA	6,246	103.62	647,210.52	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	72,000	9.06	652,392.00	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	233,819	0.75	176,673.63	
	3I GROUP PLC	3,871	41.76	161,652.96	
	M&G PLC	11,538	2.57	29,698.81	
	SCHRODERS PLC	2,334	3.78	8,836.52	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,040	32.80	34,112.00	
	AVIVA PLC	12,298	6.15	75,632.70	
	LEGAL & GENERAL GROUP	23,637	2.50	59,305.23	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	6.36	14,766.80	
	PRUDENTIAL	10,657	9.12	97,234.46	
	THE SAGE GROUP PLC	3,701	12.38	45,818.38	
	BT GROUP PLC	27,513	1.97	54,200.61	
	VODAFONE GROUP PLC	84,454	0.80	68,019.25	
	NATIONAL GRID PLC	19,207	10.33	198,504.34	
	SSE PLC	4,600	18.86	86,756.00	
イギリスポンド 小計		633,707		4,093,157.38 (812,655,466)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	38	3,832.00	145,616.00	
	SIG GROUP AG	1,000	14.88	14,880.00	
	SIKA AG-BR	620	206.70	128,154.00	
	ABB LTD	6,361	47.25	300,557.25	
	GEBERIT AG-REG	135	613.60	82,836.00	
	VAT GROUP AG	110	333.10	36,641.00	
	SGS SA	646	82.14	53,062.44	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	202	171.50	34,643.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	8	13,110.00	104,880.00	
	ALCON INC	1,956	68.62	134,220.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	189	231.20	43,696.80	

	LONZA GROUP AG-REG	281	562.60	158,090.60	
	NOVARTIS	7,721	97.55	753,183.55	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	95.85	13,802.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	835	54.32	45,357.20	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	195.40	31,264.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	116	810.20	93,983.20	
	SWISS RE LTD	1,207	141.55	170,850.85	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	589	557.40	328,308.60	
	TEMENOS AG - REG	200	58.25	11,650.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	637	74.78	47,634.86	
	SWISSCOM	106	562.50	59,625.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	347	115.50	40,078.50	
スイスフラン 小計		23,608		2,833,015.97 (521,388,259)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	963	299.60	288,514.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	294	374.20	110,014.80	
	SCA SV CELLULOSA B	2,552	123.45	315,044.40	
	ADDTECH AB-B SHARES	1,369	323.80	443,282.20	
	ALFA LAVAL AB	1,050	415.70	436,485.00	
	ASSA ABLOY AB-B	3,876	300.80	1,165,900.80	
	ATLAS COPCO A	10,665	160.00	1,706,400.00	
	ATLAS COPCO B	5,753	138.40	796,215.20	
	EPIROC AB-A	2,356	212.30	500,178.80	
	EPIROC AB-B	1,714	185.70	318,289.80	
	INDUTRADE AB	1,507	271.40	408,999.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	5,380	42.96	231,124.80	
	SANDVIK AB	4,153	226.60	941,069.80	
	SKANSKA B	1,835	223.30	409,755.50	
	SKF AB-B	1,636	220.20	360,247.20	
	VOLVO B	6,417	270.40	1,735,156.80	
	EVOLUTION AB	623	766.40	477,467.20	
	HENNES & MAURITZ B	1,899	136.15	258,548.85	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,401	264.10	634,104.10	
	SVENSKA HANDELSBK A	5,659	127.60	722,088.40	
	EQT AB	1,399	328.90	460,131.10	
	TELE2 AB-B SHS	2,489	138.50	344,726.50	
	TELIA CO AB	7,952	33.59	267,107.68	
スウェーデンクローナ 小計		73,942		13,330,853.53 (204,628,601)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	1,284	263.40	338,205.60	
	EQUINOR ASA	3,352	264.90	887,944.80	
	NORSK HYDRO	5,901	60.08	354,532.08	

	YARA INTERNATIONAL ASA	556	390.40	217,062.40	
	MOWI ASA	2,077	192.40	399,614.80	
	ORKLA	2,624	106.80	280,243.20	
	DNB BANK ASA	3,375	281.80	951,075.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	680	260.00	176,800.00	
	TELENOR ASA	2,936	156.30	458,896.80	
ノルウェークローネ 小計		22,785		4,064,374.68 (58,770,857)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,516	456.50	692,054.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	500	292.90	146,450.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	3,655	107.35	392,364.25	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	16	12,340.00	197,440.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	12,480.00	224,640.00	
	DSV A/S	830	1,551.00	1,287,330.00	
	PANDORA A/S	297	1,076.50	319,720.50	
	COLOPLAST-B	468	602.80	282,110.40	
	GENMAB A/S	227	1,371.50	311,330.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	13,021	443.05	5,768,954.05	
	TRYG A/S	1,109	161.50	179,103.50	
	ORSTED A/S	606	279.40	169,316.40	
デンマーククローネ 小計		22,263		9,970,813.60 (228,830,172)	
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	7,242	24.00	173,808.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,620	24.58	39,819.60	
	EVOLUTION MINING LTD	10,050	7.29	73,264.50	
	FORTESCUE LTD	7,185	16.20	116,397.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	2,330	42.47	98,955.10	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	5,334	16.37	87,317.58	
	SOUTH32 LTD	23,850	3.02	72,027.00	
	BRAMBLES LTD	5,349	23.14	123,775.86	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,937	39.77	77,034.49	
	TRANSURBAN GROUP	12,378	13.41	165,988.98	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	2,102	68.00	142,936.00	
	CAR GROUP LTD	2,015	37.22	74,998.30	
	REA GROUP LTD	218	235.02	51,234.36	
	COLES GROUP LTD	4,848	20.30	98,414.40	
	COCHLEAR LIMITED	291	303.07	88,193.37	
	CSL LIMITED	1,897	243.71	462,317.87	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	11,818	30.06	355,249.08	
	ASX LTD	680	71.18	48,402.40	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,427	223.23	318,549.21	
	QBE INSURANCE GROUP	6,294	22.68	142,747.92	

	SUNCORP GROUP LTD	3,795	20.81	78,973.95	
	WISETECH GLOBAL LTD	811	112.41	91,164.51	
	XERO LTD	615	177.67	109,267.05	
オーストラリアドル 小計		114,086		3,090,836.53 (295,267,613)	
ニュージーランドドル	CONTACT ENERGY LTD	3,079	9.09	27,988.11	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	5.86	23,463.44	
ニュージーランドドル 小計		7,083		51,451.55 (4,509,728)	
香港ドル	SWIRE PACIFIC A	1,500	69.00	103,500.00	
	MTR CORP	7,000	27.60	193,200.00	
	WH GROUP LTD	45,000	7.42	333,900.00	
	HANG SENG BANK	3,400	120.60	410,040.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	4,800	411.60	1,975,680.00	
	AIA GROUP LTD	42,600	68.50	2,918,100.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,000	51.35	154,050.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	40,000	6.65	266,000.00	
	SINO LAND CO	10,000	8.65	86,500.00	
香港ドル 小計		157,300		6,440,970.00 (119,673,222)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	6,500	7.77	50,505.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	5,100	36.56	186,456.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	3,700	15.41	57,017.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	3,300	7.44	24,552.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	2.69	20,982.00	
シンガポールドル 小計		26,400		339,512.00 (38,728,133)	
イスラエルシェケル	NICE LTD	236	575.00	135,700.00	
イスラエルシェケル 小計		236		135,700.00 (5,965,263)	
合　計		2,252,805		21,392,041,846 (21,392,041,846)	

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	5,334	44,485.56	
	オーストラリアドル 小計		5,334	44,485.56 (4,249,705)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	14,000	175,280.00	
	香港ドル 小計		14,000	175,280.00 (3,256,702)	
			19,334	7,506,407	

投資信託受益証券合計				(7,506,407)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,891	419,480.53	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,520	49,694.40	
		BXP INC	522	36,033.66	
		CROWN CASTLE INC	1,756	181,587.96	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,375	235,372.50	
		EQUINIX INC	386	295,178.06	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,071	56,076.46	
		IRON MOUNTAIN INC	1,221	121,184.25	
		PROLOGIS INC	3,784	402,579.76	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	402	94,176.54	
		WELLTOWER INC	2,634	401,026.50	
	アメリカドル 小計		19,562	2,292,390.62 (334,436,867)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	195	10,218.00	
		GECINA SA	233	20,970.00	
	ユーロ 小計		428	31,188.00 (5,340,321)	
	イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	2,248	13,386.84	
		SEGRO PLC	4,774	31,909.41	
	イギリスポンド 小計		7,022	45,296.25 (8,993,117)	
	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	7,836	266,659.08	
	オーストラリアドル 小計		7,836	266,659.08 (25,473,941)	
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	11,900	32,130.00	
	シンガポールドル 小計		11,900	32,130.00 (3,665,069)	
投資証券合計			46,748	377,909,315 (377,909,315)	
合計				385,415,722 (385,415,722)	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

有価証券明細表注記

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式　271銘柄	98.0%	—	—	75.6%

	投資証券　11銘柄	—	—	2.0%	1.5%
カナダドル	株式　38銘柄	100.0%	—	—	3.5%
ユーロ	株式　105銘柄	99.7%	—	—	8.6%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.3%	0.0%
イギリスポンド	株式　42銘柄	98.9%	—	—	3.7%
	投資証券　2銘柄	—	—	1.1%	0.0%
スイスフラン	株式　23銘柄	100.0%	—	—	2.4%
スウェーデンクローナ	株式　23銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式　9銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式　12銘柄	100.0%	—	—	1.1%
オーストラリアドル	株式　23銘柄	90.9%	—	—	1.4%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	1.3%	—	0.0%
	投資証券　1銘柄	—	—	7.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　2銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　9銘柄	97.4%	—	—	0.5%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	2.6%	—	0.0%
シンガポールドル	株式　5銘柄	91.4%	—	—	0.2%
	投資証券　1銘柄	—	—	8.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式　1銘柄	100.0%	—	—	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

世界債券総合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	649,871,665
コール・ローン	1,594,390,611
国債証券	68,940,171,877
地方債証券	3,593,482,836
特殊債券	14,329,109,403
社債券	30,760,410,510
投資信託受益証券	15,734,352,699
派生商品評価勘定	16,587,828
未収入金	8,564,065
未収利息	1,082,507,827
前払費用	101,849,944
差入委託証拠金	72,746,758
流動資産合計	136,884,046,023

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	136,884,046,023
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,969,316
前受金	1,059,578
未払金	1,012,521,064
未払解約金	951,786
流動負債合計	1,021,501,744
負債合計	1,021,501,744
純資産の部	
元本等	
元本	113,163,718,012
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,698,826,267
元本等合計	135,862,544,279
純資産合計	135,862,544,279
負債純資産合計	136,884,046,023

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

	2025年 7月10日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		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	113,163,718,012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 1.2006円 (1万口当たり純資産額) (12,006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 期首	2024年 7月11日

区分	2025年 7月10日現在
期首元本額	105,249,450,279円
期中追加設定元本額	13,776,210,261円
期中一部解約元本額	5,861,942,528円
期末元本額	113,163,718,012円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,135,751,716円
コア投資戦略ファンド（成長型）	5,800,926,729円
コア投資戦略ファンド（切替型）	2,387,999,826円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	99,640,924,864円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,182,791,545円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	342,990,260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）	448,521,754円
ＦＯＦｓ用　世界債券総合インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	1,223,811,318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	△225,387,972
地方債証券	△16,721,982
特殊債券	△20,094,779
社債券	195,334,821
投資信託受益証券	6,746,426
合計	△60,123,486

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「世界債券総合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)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	582,545,524	－	583,605,102	1,059,578
合計		582,545,524	－	583,605,102	1,059,578

(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)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,540,880,529	－	1,549,439,463	8,558,934
	アメリカドル	577,607,249	－	581,866,278	4,259,029

	カナダドル	78,991,748	—	78,923,948	△67,800
	ユーロ	530,996,445	—	534,178,437	3,181,992
	イギリスポンド	96,852,857	—	97,258,081	405,224
	オーストラリアドル	40,872,569	—	41,069,255	196,686
	オフショア人民元	215,559,661	—	216,143,464	583,803
合計		1,540,880,529	—	1,549,439,463	8,558,934

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	ADGB 1.625% 06/02/28	200,000.00	186,731.27	
		BGARIA 5% 03/05/37	200,000.00	196,479.78	
		CHILE 2.55% 07/27/33	200,000.00	168,148.92	
		CHILE 2.75% 01/31/27	200,000.00	195,103.95	
		CHILE 4.34% 03/07/42	200,000.00	171,781.90	
		CHILE 4% 01/31/52	200,000.00	152,719.98	
		HKINTL 4.5% 01/11/28	200,000.00	202,375.68	
		HKINTL 4.625% 01/11/33	200,000.00	201,939.97	
		INDON 2.85% 02/14/30	200,000.00	187,096.86	
		INDON 3.35% 03/12/71	200,000.00	125,625.68	
		INDON 4.3% 03/31/52	200,000.00	161,474.30	
		INDON 4.35% 01/11/48	200,000.00	167,381.47	
		ISRAEL 4.5% 01/17/33	200,000.00	191,104.16	
		ISRAEL 5.375% 02/19/30	200,000.00	204,049.84	
		ITALY 2.875% 10/17/29	200,000.00	188,154.96	
		ITALY 3.875% 05/06/51	200,000.00	139,646.75	
		KOREA 2.5% 06/19/29	200,000.00	187,949.41	
		KSA 2.75% 02/03/32	400,000.00	359,144.44	
		KSA 3.25% 10/22/30	400,000.00	375,973.12	
		KSA 3.45% 02/02/61	200,000.00	124,163.85	
		KSA 4.5% 10/26/46	200,000.00	165,081.13	
		KSA 4.875% 07/18/33	200,000.00	200,909.39	
		KSA 5% 01/18/53	200,000.00	171,532.41	

		MEX 3.25% 04/16/30	200,000.00	184,600.00	
		MEX 3.75% 04/19/71	200,000.00	113,015.00	
		MEX 4.28% 08/14/41	200,000.00	153,350.00	
		MEX 4.4% 02/12/52	200,000.00	140,229.43	
		MEX 4.75% 04/27/32	200,000.00	190,798.00	
		MEX 6.4% 05/07/54	200,000.00	183,144.50	
		PANAMA 2.252% 09/29/32	200,000.00	153,765.29	
		PANAMA 6.4% 02/14/35	200,000.00	196,609.92	
		PERU 3.3% 03/11/41	200,000.00	148,589.44	
		PHILIP 3.229% 03/29/27	200,000.00	196,321.30	
		PHILIP 4.2% 03/29/47	200,000.00	163,637.68	
		PHILIP 5.17% 10/13/27	200,000.00	203,597.62	
		PHILIP 5.5% 01/17/48	200,000.00	195,009.76	
		POLAND 4.625% 03/18/29	200,000.00	202,517.29	
		POLAND 5.5% 11/16/27	200,000.00	206,581.07	
		QATAR 3.75% 04/16/30	200,000.00	195,921.40	
		QATAR 4.817% 03/14/49	200,000.00	181,897.19	
		REPHUN 5.5% 03/26/36	400,000.00	387,155.65	
		T 0.375% 07/31/27	1,500,000.00	1,397,724.61	
		T 0.5% 06/30/27	1,250,000.00	1,171,044.92	
		T 0.5% 10/31/27	1,000,000.00	926,953.12	
		T 0.625% 05/15/30	1,000,000.00	856,054.69	
		T 0.625% 07/31/26	1,400,000.00	1,350,210.05	
		T 0.625% 08/15/30	3,300,000.00	2,799,650.40	
		T 0.625% 11/30/27	1,200,000.00	1,113,046.87	
		T 0.625% 12/31/27	2,000,000.00	1,850,195.32	
		T 0.75% 01/31/28	1,000,000.00	925,625.00	
		T 0.75% 08/31/26	1,000,000.00	963,476.56	
		T 0.875% 09/30/26	3,000,000.00	2,888,203.14	
		T 0.875% 11/15/30	1,400,000.00	1,193,882.81	
		T 1.125% 02/15/31	1,000,000.00	860,156.25	
		T 1.125% 02/29/28	1,000,000.00	932,773.44	
		T 1.125% 05/15/40	500,000.00	307,626.95	
		T 1.125% 08/15/40	300,000.00	182,789.06	
		T 1.125% 08/31/28	1,600,000.00	1,472,812.49	
		T 1.125% 10/31/26	1,000,000.00	963,632.81	
		T 1.25% 03/31/28	1,000,000.00	933,925.78	
		T 1.25% 04/30/28	1,150,000.00	1,071,880.85	
		T 1.25% 05/15/50	400,000.00	189,593.75	
		T 1.25% 05/31/28	1,050,000.00	976,705.07	
		T 1.25% 06/30/28	1,050,000.00	974,736.32	
		T 1.25% 08/15/31	1,750,000.00	1,487,773.43	

		T 1.25% 09/30/28	1,250,000.00	1,152,905.27	
		T 1.25% 11/30/26	1,000,000.00	963,476.56	
		T 1.25% 12/31/26	2,000,000.00	1,923,046.88	
		T 1.375% 08/15/50	950,000.00	462,308.58	
		T 1.375% 10/31/28	1,600,000.00	1,478,531.24	
		T 1.375% 11/15/31	1,550,000.00	1,317,711.91	
		T 1.375% 11/15/40	300,000.00	189,333.98	
		T 1.375% 12/31/28	1,000,000.00	920,527.34	
		T 1.5% 01/31/27	1,600,000.00	1,541,312.49	
		T 1.5% 02/15/30	500,000.00	450,166.01	
		T 1.5% 08/15/26	1,000,000.00	972,636.72	
		T 1.625% 05/15/31	2,100,000.00	1,840,699.22	
		T 1.625% 11/15/50	1,000,000.00	520,019.53	
		T 1.75% 01/31/29	2,300,000.00	2,140,751.95	
		T 1.75% 08/15/41	400,000.00	263,117.18	
		T 1.875% 02/15/32	230,000.00	200,715.42	
		T 1.875% 02/15/41	500,000.00	340,654.29	
		T 1.875% 02/15/51	800,000.00	443,500.00	
		T 1.875% 02/28/27	1,000,000.00	967,753.91	
		T 1.875% 02/28/29	1,000,000.00	933,554.69	
		T 1.875% 11/15/51	1,300,000.00	713,121.09	
		T 1% 07/31/28	970,000.00	891,585.35	
		T 2.25% 02/15/27	1,000,000.00	974,101.56	
		T 2.25% 02/15/52	500,000.00	301,445.31	
		T 2.25% 05/15/41	260,000.00	186,996.87	
		T 2.25% 08/15/46	300,000.00	194,460.93	
		T 2.25% 08/15/49	900,000.00	557,701.17	
		T 2.25% 11/15/27	2,000,000.00	1,929,375.00	
		T 2.375% 02/15/42	900,000.00	648,175.77	
		T 2.375% 03/31/29	1,310,000.00	1,243,118.35	
		T 2.375% 05/15/27	2,000,000.00	1,946,718.76	
		T 2.375% 05/15/29	2,000,000.00	1,894,609.38	
		T 2.375% 05/15/51	1,450,000.00	907,496.10	
		T 2.375% 11/15/49	800,000.00	508,468.75	
		T 2.5% 02/15/45	700,000.00	487,894.53	
		T 2.5% 02/15/46	800,000.00	549,015.62	
		T 2.5% 03/31/27	1,900,000.00	1,855,988.28	
		T 2.5% 05/15/46	700,000.00	478,679.68	
		T 2.625% 02/15/29	1,500,000.00	1,438,916.01	
		T 2.625% 05/31/27	1,400,000.00	1,368,281.25	
		T 2.625% 07/31/29	2,450,000.00	2,336,400.38	
		T 2.75% 04/30/27	1,000,000.00	980,292.97	
		T 2.75% 05/31/29	1,620,000.00	1,555,516.40	

		T 2.75% 07/31/27	3,000,000.00	2,934,785.16	
		T 2.75% 08/15/32	800,000.00	732,703.12	
		T 2.75% 08/15/42	200,000.00	151,304.68	
		T 2.75% 11/15/42	1,200,000.00	903,890.62	
		T 2.875% 04/30/29	2,920,000.00	2,819,054.69	
		T 2.875% 05/15/28	4,100,000.00	3,995,578.12	
		T 2.875% 05/15/32	800,000.00	741,250.00	
		T 2.875% 05/15/43	300,000.00	228,597.65	
		T 2.875% 05/15/49	700,000.00	496,658.20	
		T 2.875% 05/15/52	600,000.00	416,917.96	
		T 2.875% 08/15/45	220,000.00	162,825.78	
		T 2.875% 11/15/46	600,000.00	437,085.93	
		T 2% 02/15/50	1,100,000.00	638,279.30	
		T 2% 08/15/51	900,000.00	511,734.37	
		T 2% 11/15/26	1,300,000.00	1,266,230.47	
		T 2% 11/15/41	350,000.00	238,519.53	
		T 3.125% 02/15/42	200,000.00	161,445.31	
		T 3.125% 02/15/43	300,000.00	238,511.71	
		T 3.125% 08/15/44	600,000.00	468,398.43	
		T 3.125% 08/31/27	1,000,000.00	985,253.91	
		T 3.125% 08/31/29	1,000,000.00	971,503.91	
		T 3.125% 11/15/28	1,500,000.00	1,466,455.08	
		T 3.125% 11/15/41	500,000.00	405,605.47	
		T 3.25% 05/15/42	920,000.00	753,537.50	
		T 3.25% 06/30/27	1,000,000.00	988,671.88	
		T 3.25% 06/30/29	2,000,000.00	1,955,039.06	
		T 3.375% 05/15/33	1,050,000.00	993,459.95	
		T 3.375% 05/15/44	300,000.00	244,289.06	
		T 3.375% 08/15/42	400,000.00	332,218.75	
		T 3.375% 11/15/48	850,000.00	665,158.19	
		T 3.5% 02/15/33	1,050,000.00	1,004,698.24	
		T 3.5% 09/30/26	1,800,000.00	1,788,714.84	
		T 3.625% 02/15/44	600,000.00	508,335.93	
		T 3.625% 02/15/53	820,000.00	660,996.87	
		T 3.625% 03/31/30	1,000,000.00	987,519.53	
		T 3.625% 05/15/53	400,000.00	322,117.18	
		T 3.625% 08/15/43	350,000.00	297,855.46	
		T 3.75% 04/15/28	2,100,000.00	2,095,939.46	
		T 3.75% 06/30/30	1,150,000.00	1,140,835.93	
		T 3.75% 08/31/31	2,200,000.00	2,165,753.89	
		T 3.75% 11/15/43	700,000.00	605,171.87	
		T 3.75% 12/31/28	1,600,000.00	1,595,031.24	

		T 3.875% 02/15/43	600,000.00	531,644.53	
		T 3.875% 04/30/30	750,000.00	748,828.12	
		T 3.875% 08/15/33	970,000.00	948,042.38	
		T 3.875% 08/15/34	2,000,000.00	1,937,304.68	
		T 3.875% 08/15/40	100,000.00	91,031.25	
		T 3.875% 12/31/29	1,150,000.00	1,148,966.79	
		T 3% 02/15/49	500,000.00	364,287.11	
		T 3% 05/15/42	100,000.00	78,945.31	
		T 3% 05/15/45	770,000.00	583,846.48	
		T 3% 05/15/47	220,000.00	163,075.00	
		T 3% 08/15/48	500,000.00	365,878.90	
		T 3% 08/15/52	800,000.00	569,953.12	
		T 3% 11/15/44	750,000.00	571,801.75	
		T 3% 11/15/45	200,000.00	150,835.93	
		T 4.125% 03/31/31	650,000.00	654,329.10	
		T 4.125% 07/31/28	1,250,000.00	1,260,766.60	
		T 4.125% 07/31/31	1,400,000.00	1,407,164.06	
		T 4.125% 08/15/44	700,000.00	635,003.90	
		T 4.125% 08/15/53	1,190,000.00	1,049,710.15	
		T 4.125% 09/30/27	2,100,000.00	2,113,125.00	
		T 4.125% 11/15/32	1,000,000.00	999,238.28	
		T 4.25% 02/15/54	1,100,000.00	990,966.79	
		T 4.25% 02/28/29	1,000,000.00	1,013,339.84	
		T 4.25% 02/28/31	1,100,000.00	1,114,587.89	
		T 4.25% 05/15/39	100,000.00	96,386.71	
		T 4.25% 06/30/31	1,400,000.00	1,416,925.77	
		T 4.25% 08/15/54	2,480,000.00	2,236,553.12	
		T 4.25% 11/15/34	1,950,000.00	1,940,707.04	
		T 4.25% 11/15/40	500,000.00	474,375.00	
		T 4.375% 01/31/32	1,700,000.00	1,728,521.47	
		T 4.375% 05/15/34	2,000,000.00	2,015,429.68	
		T 4.375% 05/15/41	230,000.00	220,593.35	
		T 4.375% 08/15/43	800,000.00	754,843.75	
		T 4.375% 11/30/28	2,500,000.00	2,542,041.02	
		T 4.375% 11/30/30	1,000,000.00	1,019,843.75	
		T 4.375% 12/15/26	2,600,000.00	2,614,828.11	
		T 4.5% 02/15/36	550,000.00	559,281.25	
		T 4.5% 02/15/44	450,000.00	430,453.12	
		T 4.5% 04/15/27	2,000,000.00	2,020,273.44	
		T 4.5% 05/15/27	1,500,000.00	1,516,230.46	
		T 4.5% 05/15/38	300,000.00	300,597.65	
		T 4.5% 08/15/39	300,000.00	295,968.75	
		T 4.5% 11/15/33	2,300,000.00	2,344,427.74	

	T 4.5% 11/15/54	2,000,000.00	1,882,343.76	
	T 4.625% 02/15/35	1,400,000.00	1,432,703.13	
	T 4.625% 02/15/55	500,000.00	480,625.00	
	T 4.625% 05/15/44	1,000,000.00	971,132.81	
	T 4.625% 05/15/54	1,200,000.00	1,151,226.56	
	T 4.625% 05/31/31	830,000.00	856,407.62	
	T 4.625% 09/30/30	1,760,000.00	1,815,721.88	
	T 4.625% 10/15/26	3,000,000.00	3,022,617.18	
	T 4.625% 11/15/26	1,600,000.00	1,613,124.99	
	T 4.625% 11/15/44	800,000.00	775,500.00	
	T 4.75% 02/15/41	200,000.00	200,539.06	
	T 4.75% 11/15/43	700,000.00	692,097.65	
	T 4.75% 11/15/53	900,000.00	880,875.00	
	T 4.875% 10/31/28	2,400,000.00	2,476,546.87	
	T 4% 01/15/27	3,000,000.00	3,001,699.22	
	T 4% 02/15/34	2,000,000.00	1,963,906.24	
	T 4% 02/28/30	500,000.00	502,226.56	
	T 4% 03/31/30	1,600,000.00	1,606,312.49	
	T 4% 04/30/32	2,000,000.00	1,988,437.50	
	T 4% 10/31/29	900,000.00	904,078.12	
	T 4% 11/15/42	1,000,000.00	903,261.72	
	T 4% 11/15/52	840,000.00	725,500.78	
	T 5.0% 05/15/37	100,000.00	105,345.70	
	UAE 4.917% 09/25/33	200,000.00	208,450.01	
	UAE 4.951% 07/07/52	200,000.00	183,519.00	
	URUGUA 4.375% 10/27/27	100,000.00	100,190.00	
	URUGUA 5.75% 10/28/34	200,000.00	211,000.00	
アメリカドル 小計		210,460,000.00	193,737,143.35 (28,264,311,843)	
カナダドル	CAN 0.5% 12/01/30	940,000.00	823,529.21	
	CAN 1.25% 03/01/27	200,000.00	195,535.80	
	CAN 1.25% 06/01/30	630,000.00	581,528.22	
	CAN 1.5% 06/01/31	640,000.00	586,776.13	
	CAN 1.5% 12/01/31	610,000.00	553,678.44	
	CAN 1.75% 12/01/53	710,000.00	469,637.74	
	CAN 1% 06/01/27	100,000.00	96,978.82	
	CAN 1% 09/01/26	620,000.00	608,524.99	
	CAN 2.25% 06/01/29	200,000.00	195,831.64	
	CAN 2.25% 12/01/29	270,000.00	263,074.85	
	CAN 2.75% 03/01/30	800,000.00	794,349.20	
	CAN 2.75% 06/01/33	150,000.00	144,980.30	
	CAN 2.75% 09/01/27	300,000.00	300,455.44	

	CAN 2.75% 12/01/48	110,000.00	94,376.65	
	CAN 2.75% 12/01/55	310,000.00	257,688.74	
	CAN 2% 06/01/28	260,000.00	254,836.25	
	CAN 2% 06/01/32	270,000.00	250,834.63	
	CAN 2% 12/01/51	230,000.00	164,715.74	
	CAN 3.25% 06/01/35	200,000.00	197,982.44	
	CAN 3.25% 09/01/28	50,000.00	50,734.84	
	CAN 3.25% 11/01/26	420,000.00	423,207.18	
	CAN 3.25% 12/01/33	200,000.00	199,783.37	
	CAN 3.25% 12/01/34	340,000.00	337,508.54	
	CAN 3.5% 03/01/28	450,000.00	458,847.31	
	CAN 3.5% 03/01/34	300,000.00	304,785.92	
	CAN 3.5% 09/01/29	290,000.00	297,114.03	
	CAN 3.5% 12/01/45	480,000.00	472,302.75	
	CAN 3.5% 12/01/57	150,000.00	144,705.99	
	CAN 3% 06/01/34	100,000.00	97,649.10	
	CAN 4.0% 06/01/41	620,000.00	653,049.17	
	CAN 4% 03/01/29	210,000.00	218,522.96	
	CAN 4% 08/01/26	500,000.00	507,046.75	
	CAN 5.75% 06/01/29	150,000.00	165,933.64	
	CAN 5.75% 06/01/33	180,000.00	211,102.66	
	CAN 5% 06/01/37	880,000.00	1,011,793.05	
カナダドル 小計		12,870,000.00	12,389,402.49 (1,321,577,563)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	2,200,000.00	2,305,517.31	
	MBONO 5.5% 03/04/27	3,700,000.00	3,550,262.92	
	MBONO 7.5% 05/26/33	4,700,000.00	4,280,211.74	
	MBONO 7.5% 06/03/27	6,550,000.00	6,471,552.35	
	MBONO 7.75% 05/29/31	7,950,000.00	7,581,953.87	
	MBONO 7.75% 11/13/42	6,100,000.00	5,019,441.36	
	MBONO 7.75% 11/23/34	5,500,000.00	4,985,742.85	
	MBONO 7% 09/03/26	4,550,000.00	4,491,305.50	
	MBONO 8.5% 02/28/30	2,000,000.00	1,987,390.50	
	MBONO 8.5% 03/01/29	3,000,000.00	2,990,866.35	
	MBONO 8.5% 05/31/29	7,100,000.00	7,074,196.18	
	MBONO 8.5% 11/18/38	2,150,000.00	1,962,560.03	
	MBONO 8% 05/24/35	700,000.00	655,321.37	
	MBONO 8% 07/31/53	4,500,000.00	3,688,608.60	
	MBONO 8% 11/07/47	5,020,000.00	4,149,842.23	
メキシコペソ 小計		65,720,000.00	61,194,773.16 (480,060,756)	
ユーロ	BGARIA 4.125% 09/23/29	100,000.00	106,236.83	
	BGB 0.1% 06/22/30	170,000.00	151,199.70	

		BGB 0.35% 06/22/32	460,000.00	388,796.60	
		BGB 0.4% 06/22/40	170,000.00	106,949.12	
		BGB 0.65% 06/22/71	60,000.00	18,244.63	
		BGB 0.8% 06/22/27	210,000.00	205,358.68	
		BGB 0.8% 06/22/28	220,000.00	211,660.24	
		BGB 0.9% 06/22/29	200,000.00	189,365.92	
		BGB 0% 10/22/27	200,000.00	191,097.80	
		BGB 0% 10/22/31	250,000.00	211,333.12	
		BGB 1.25% 04/22/33	210,000.00	186,333.21	
		BGB 1.4% 06/22/53	110,000.00	62,055.12	
		BGB 1.45% 06/22/37	50,000.00	40,469.25	
		BGB 1.6% 06/22/47	120,000.00	79,790.40	
		BGB 1.7% 06/22/50	270,000.00	173,766.87	
		BGB 1.9% 06/22/38	130,000.00	108,617.60	
		BGB 1% 06/22/31	210,000.00	191,019.93	
		BGB 2.15% 06/22/66	140,000.00	85,757.81	
		BGB 2.25% 06/22/57	160,000.00	107,570.70	
		BGB 2.7% 10/22/29	260,000.00	263,264.30	
		BGB 2.75% 04/22/39	80,000.00	73,149.20	
		BGB 2.85% 10/22/34	150,000.00	146,553.33	
		BGB 3.1% 06/22/35	200,000.00	198,032.00	
		BGB 3.3% 06/22/54	130,000.00	113,583.21	
		BGB 3.45% 06/22/42	100,000.00	96,204.16	
		BGB 3.45% 06/22/43	90,000.00	86,282.91	
		BGB 3.5% 06/22/55	80,000.00	72,118.92	
		BGB 3.75% 06/22/45	160,000.00	158,469.45	
		BGB 3% 06/22/33	100,000.00	100,321.34	
		BGB 3% 06/22/34	140,000.00	139,165.07	
		BGB 4.25% 03/28/41	230,000.00	245,795.25	
		BGB 4% 03/28/32	140,000.00	150,377.43	
		BGB 5.5% 03/28/28	320,000.00	348,374.46	
		BGB 5% 03/28/35	380,000.00	437,871.56	
		BKO 1.7% 06/10/27	550,000.00	548,436.90	
		BTPS 0.25% 03/15/28	190,000.00	180,731.56	
		BTPS 0.45% 02/15/29	200,000.00	187,133.46	
		BTPS 0.5% 07/15/28	210,000.00	199,632.43	
		BTPS 0.6% 08/01/31	450,000.00	393,947.50	
		BTPS 0.85% 01/15/27	370,000.00	364,281.97	
		BTPS 0.9% 04/01/31	370,000.00	333,073.84	
		BTPS 0.95% 03/01/37	250,000.00	187,190.36	
		BTPS 0.95% 06/01/32	270,000.00	235,875.14	
		BTPS 0.95% 08/01/30	200,000.00	183,973.54	
		BTPS 0.95% 09/15/27	390,000.00	381,293.84	

		BTPS 0.95% 12/01/31	230,000.00	203,865.81	
		BTPS 0% 08/01/26	160,000.00	156,922.73	
		BTPS 1.1% 04/01/27	300,000.00	295,522.61	
		BTPS 1.25% 12/01/26	300,000.00	297,453.46	
		BTPS 1.35% 04/01/30	350,000.00	331,361.67	
		BTPS 1.45% 03/01/36	250,000.00	204,442.05	
		BTPS 1.5% 04/30/45	170,000.00	112,138.24	
		BTPS 1.65% 03/01/32	320,000.00	295,178.54	
		BTPS 1.65% 12/01/30	300,000.00	283,905.03	
		BTPS 1.7% 09/01/51	210,000.00	129,468.53	
		BTPS 1.8% 03/01/41	280,000.00	210,976.24	
		BTPS 2.05% 08/01/27	290,000.00	290,277.38	
		BTPS 2.1% 07/15/26	170,000.00	170,360.38	
		BTPS 2.15% 03/01/72	110,000.00	64,699.93	
		BTPS 2.15% 09/01/52	160,000.00	107,360.25	
		BTPS 2.2% 06/01/27	420,000.00	421,820.15	
		BTPS 2.25% 09/01/36	290,000.00	255,515.39	
		BTPS 2.45% 09/01/33	300,000.00	284,712.44	
		BTPS 2.45% 09/01/50	190,000.00	139,254.58	
		BTPS 2.5% 12/01/32	290,000.00	279,166.05	
		BTPS 2.65% 12/01/27	390,000.00	395,037.08	
		BTPS 2.7% 03/01/47	220,000.00	176,339.05	
		BTPS 2.7% 10/01/30	300,000.00	299,200.16	
		BTPS 2.7% 10/15/27	250,000.00	253,221.62	
		BTPS 2.8% 03/01/67	140,000.00	99,582.35	
		BTPS 2.8% 06/15/29	400,000.00	405,502.68	
		BTPS 2.8% 12/01/28	300,000.00	305,329.38	
		BTPS 2.95% 02/15/27	300,000.00	304,370.22	
		BTPS 2.95% 07/01/30	300,000.00	303,466.80	
		BTPS 2.95% 09/01/38	180,000.00	165,575.40	
		BTPS 2% 02/01/28	200,000.00	199,538.73	
		BTPS 3.1% 03/01/40	260,000.00	238,405.81	
		BTPS 3.1% 08/28/26	400,000.00	405,057.80	
		BTPS 3.15% 11/15/31	250,000.00	252,693.32	
		BTPS 3.25% 03/01/38	240,000.00	228,805.39	
		BTPS 3.25% 09/01/46	310,000.00	273,139.20	
		BTPS 3.35% 03/01/35	520,000.00	518,474.74	
		BTPS 3.35% 07/01/29	200,000.00	206,480.56	
		BTPS 3.4% 04/01/28	350,000.00	361,123.03	
		BTPS 3.45% 03/01/48	280,000.00	252,286.79	
		BTPS 3.45% 07/15/31	350,000.00	360,403.29	
		BTPS 3.5% 02/15/31	280,000.00	289,760.35	

		BTPS 3.5% 03/01/30	450,000.00	469,239.03	
		BTPS 3.6% 10/01/35	200,000.00	201,627.70	
		BTPS 3.65% 08/01/35	200,000.00	202,866.84	
		BTPS 3.7% 06/15/30	180,000.00	188,508.79	
		BTPS 3.8% 08/01/28	200,000.00	209,014.58	
		BTPS 3.85% 02/01/35	220,000.00	227,658.79	
		BTPS 3.85% 07/01/34	280,000.00	290,986.64	
		BTPS 3.85% 09/01/49	280,000.00	266,653.58	
		BTPS 3.85% 09/15/26	830,000.00	847,993.73	
		BTPS 3.85% 10/01/40	300,000.00	296,996.36	
		BTPS 3.85% 12/15/29	350,000.00	368,991.56	
		BTPS 3% 08/01/29	280,000.00	286,272.36	
		BTPS 3% 10/01/29	320,000.00	325,824.28	
		BTPS 4.05% 10/30/37	140,000.00	145,354.09	
		BTPS 4.1% 02/01/29	400,000.00	423,211.40	
		BTPS 4.1% 04/30/46	80,000.00	80,362.44	
		BTPS 4.15% 10/01/39	300,000.00	309,850.74	
		BTPS 4.2% 03/01/34	240,000.00	256,530.04	
		BTPS 4.3% 10/01/54	270,000.00	268,046.63	
		BTPS 4.35% 11/01/33	520,000.00	561,770.35	
		BTPS 4.4% 05/01/33	350,000.00	379,986.56	
		BTPS 4.45% 09/01/43	150,000.00	157,602.15	
		BTPS 4.5% 10/01/53	210,000.00	216,203.10	
		BTPS 4.75% 09/01/28	400,000.00	429,981.36	
		BTPS 4.75% 09/01/44	280,000.00	306,736.69	
		BTPS 4% 02/01/37	440,000.00	458,248.47	
		BTPS 4% 04/30/35	140,000.00	147,615.90	
		BTPS 4% 10/30/31	150,000.00	159,641.22	
		BTPS 4% 11/15/30	250,000.00	265,510.05	
		BTPS 5.0% 08/01/39	330,000.00	373,423.64	
		BTPS 5.25% 11/01/29	330,000.00	367,659.50	
		BTPS 5.75% 02/01/33	350,000.00	411,552.78	
		BTPS 5% 08/01/34	330,000.00	373,574.25	
		BTPS 5% 09/01/40	310,000.00	349,669.89	
		BTPS 6.5% 11/01/27	200,000.00	219,751.96	
		BTPS 6% 05/01/31	400,000.00	468,985.92	
		CHILE 0.555% 01/21/29	200,000.00	185,333.50	
		CHILE 1.3% 07/26/36	100,000.00	77,305.62	
		DBR 0.25% 08/15/28	550,000.00	522,297.87	
		DBR 0.5% 08/15/27	850,000.00	826,789.90	
		DBR 0% 02/15/30	1,050,000.00	952,972.12	
		DBR 0% 02/15/31	890,000.00	786,606.24	
		DBR 0% 02/15/32	1,220,000.00	1,046,590.42	

		DBR 0% 05/15/36	700,000.00	521,228.75	
		DBR 0% 08/15/29	1,930,000.00	1,775,107.43	
		DBR 0% 08/15/30	850,000.00	761,597.23	
		DBR 0% 08/15/31	900,000.00	784,405.03	
		DBR 0% 08/15/50	1,200,000.00	561,099.00	
		DBR 0% 08/15/52	510,000.00	223,913.46	
		DBR 0% 11/15/28	200,000.00	187,394.40	
		DBR 1.7% 08/15/32	220,000.00	210,220.23	
		DBR 1.8% 08/15/53	610,000.00	460,406.65	
		DBR 1% 05/15/38	620,000.00	496,487.32	
		DBR 2.1% 11/15/29	830,000.00	828,921.62	
		DBR 2.2% 02/15/34	600,000.00	583,807.50	
		DBR 2.3% 02/15/33	300,000.00	296,893.27	
		DBR 2.4% 11/15/30	250,000.00	251,992.25	
		DBR 2.5% 02/15/35	320,000.00	316,491.19	
		DBR 2.5% 07/04/44	570,000.00	526,567.71	
		DBR 2.5% 08/15/46	610,000.00	557,981.64	
		DBR 2.5% 08/15/54	350,000.00	307,992.30	
		DBR 2.6% 08/15/33	520,000.00	523,702.40	
		DBR 2.6% 08/15/34	800,000.00	800,444.88	
		DBR 3.25% 07/04/42	90,000.00	92,976.52	
		DBR 4.0% 01/04/37	330,000.00	369,588.18	
		DBR 4.25% 07/04/39	370,000.00	427,079.16	
		DBR 4.75% 07/04/28	100,000.00	108,049.25	
		DBR 4.75% 07/04/34	600,000.00	705,429.00	
		DBR 4.75% 07/04/40	150,000.00	182,697.10	
		DBR 5.625% 01/04/28	450,000.00	490,693.05	
		FRTR 0.25% 11/25/26	490,000.00	478,985.80	
		FRTR 0.5% 05/25/29	800,000.00	744,093.25	
		FRTR 0.5% 05/25/40	450,000.00	285,956.79	
		FRTR 0.5% 05/25/72	200,000.00	52,797.03	
		FRTR 0.5% 06/25/44	290,000.00	160,934.58	
		FRTR 0.75% 02/25/28	600,000.00	578,893.56	
		FRTR 0.75% 05/25/28	850,000.00	815,973.22	
		FRTR 0.75% 05/25/52	570,000.00	265,895.05	
		FRTR 0.75% 05/25/53	490,000.00	221,992.33	
		FRTR 0.75% 11/25/28	940,000.00	892,736.75	
		FRTR 0% 02/25/27	600,000.00	581,684.14	
		FRTR 0% 05/25/32	600,000.00	491,764.87	
		FRTR 0% 11/25/29	800,000.00	718,278.00	
		FRTR 0% 11/25/30	1,140,000.00	989,272.17	
		FRTR 0% 11/25/31	830,000.00	694,334.85	

		FRTR 1.25% 05/25/34	810,000.00	688,018.54	
		FRTR 1.25% 05/25/36	660,000.00	529,653.05	
		FRTR 1.25% 05/25/38	410,000.00	310,825.06	
		FRTR 1.5% 05/25/31	800,000.00	746,303.43	
		FRTR 1.5% 05/25/50	470,000.00	285,526.21	
		FRTR 1.75% 05/25/66	240,000.00	126,740.02	
		FRTR 1.75% 06/25/39	470,000.00	374,111.46	
		FRTR 1% 05/25/27	750,000.00	736,699.16	
		FRTR 2.4% 09/24/28	200,000.00	200,715.96	
		FRTR 2.5% 05/25/30	830,000.00	826,769.32	
		FRTR 2.5% 05/25/43	430,000.00	356,028.78	
		FRTR 2.5% 09/24/26	490,000.00	493,638.78	
		FRTR 2.5% 09/24/27	850,000.00	858,149.71	
		FRTR 2.7% 02/25/31	400,000.00	399,158.63	
		FRTR 2.75% 02/25/29	620,000.00	628,305.52	
		FRTR 2.75% 02/25/30	750,000.00	756,058.50	
		FRTR 2.75% 10/25/27	850,000.00	862,848.60	
		FRTR 2% 05/25/48	400,000.00	283,596.68	
		FRTR 2% 11/25/32	730,000.00	681,689.70	
		FRTR 3.2% 05/25/35	600,000.00	592,695.42	
		FRTR 3.25% 05/25/45	450,000.00	411,613.46	
		FRTR 3.25% 05/25/55	340,000.00	288,785.13	
		FRTR 3.5% 11/25/33	610,000.00	625,887.38	
		FRTR 3.6% 05/25/42	200,000.00	194,563.66	
		FRTR 3.75% 05/25/56	200,000.00	185,725.39	
		FRTR 3% 05/25/33	910,000.00	904,407.09	
		FRTR 3% 05/25/54	380,000.00	308,894.07	
		FRTR 3% 06/25/49	230,000.00	195,725.45	
		FRTR 3% 11/25/34	600,000.00	586,318.02	
		FRTR 4.5% 04/25/41	510,000.00	555,361.44	
		FRTR 4.75% 04/25/35	430,000.00	480,954.35	
		FRTR 4% 04/25/55	280,000.00	274,644.01	
		FRTR 4% 04/25/60	300,000.00	290,684.29	
		FRTR 4% 10/25/38	520,000.00	540,719.19	
		FRTR 5.5% 04/25/29	690,000.00	767,205.06	
		FRTR 5.75% 10/25/32	560,000.00	661,115.05	
		GGB 2% 04/22/27	70,000.00	69,997.54	
		GGB 3.875% 06/15/28	300,000.00	313,686.63	
		GGB 4.125% 06/15/54	80,000.00	79,015.76	
		GGB 4.2% 01/30/42	100,000.00	104,651.83	
		GGB 4.25% 06/15/33	300,000.00	323,938.80	
		GGB 4.375% 07/18/38	250,000.00	268,316.72	
		ICELND 0% 04/15/28	100,000.00	93,665.27	

		IRISH 0.2% 05/15/27	60,000.00	58,206.66	
		IRISH 0.2% 10/18/30	160,000.00	142,483.06	
		IRISH 0.35% 10/18/32	40,000.00	33,879.88	
		IRISH 0.4% 05/15/35	50,000.00	38,955.72	
		IRISH 0.55% 04/22/41	80,000.00	52,752.08	
		IRISH 0.9% 05/15/28	170,000.00	164,877.90	
		IRISH 0% 10/18/31	120,000.00	102,363.84	
		IRISH 1.1% 05/15/29	170,000.00	163,176.88	
		IRISH 1.3% 05/15/33	110,000.00	99,030.11	
		IRISH 1.35% 03/18/31	100,000.00	94,296.15	
		IRISH 1.5% 05/15/50	120,000.00	81,315.60	
		IRISH 1.7% 05/15/37	130,000.00	111,817.68	
		IRISH 2.4% 05/15/30	140,000.00	140,322.51	
		IRISH 2% 02/18/45	200,000.00	160,185.35	
		IRISH 3.15% 10/18/55	50,000.00	46,043.00	
		IRISH 3% 10/18/43	20,000.00	18,962.00	
		ISRAEL 1.5% 01/16/29	100,000.00	94,702.99	
		ISRAEL 2.5% 01/16/49	100,000.00	77,666.25	
		KAZAKS 1.5% 09/30/34	100,000.00	86,043.19	
		KSA 0.75% 07/09/27	100,000.00	96,600.00	
		MEX 1.45% 10/25/33	200,000.00	158,306.80	
		MEX 2.125% 10/25/51	100,000.00	53,642.00	
		NETHER 0.25% 07/15/29	170,000.00	157,463.41	
		NETHER 0.5% 01/15/40	210,000.00	147,126.89	
		NETHER 0.5% 07/15/26	170,000.00	167,730.11	
		NETHER 0.5% 07/15/32	310,000.00	269,495.94	
		NETHER 0.75% 07/15/27	250,000.00	244,408.24	
		NETHER 0.75% 07/15/28	330,000.00	317,719.29	
		NETHER 0% 01/15/27	230,000.00	223,714.52	
		NETHER 0% 01/15/29	190,000.00	176,475.36	
		NETHER 0% 01/15/38	160,000.00	109,822.62	
		NETHER 0% 01/15/52	310,000.00	134,387.12	
		NETHER 0% 07/15/30	280,000.00	249,539.15	
		NETHER 0% 07/15/31	210,000.00	181,531.66	
		NETHER 2.5% 01/15/30	220,000.00	222,197.80	
		NETHER 2.5% 01/15/33	190,000.00	188,696.82	
		NETHER 2.5% 07/15/33	110,000.00	108,785.32	
		NETHER 2.5% 07/15/34	200,000.00	196,003.79	
		NETHER 2.5% 07/15/35	200,000.00	194,169.49	
		NETHER 2.75% 01/15/47	340,000.00	316,278.79	
		NETHER 2% 01/15/54	180,000.00	138,158.29	
		NETHER 3.25% 01/15/44	120,000.00	121,240.48	

		NETHER 3.75% 01/15/42	270,000.00	291,072.09	
		NETHER 4% 01/15/37	240,000.00	264,825.93	
		NETHER 5.5% 01/15/28	170,000.00	184,603.20	
		OBL 0% 04/16/27	600,000.00	581,044.50	
		OBL 1.3% 10/15/27	1,020,000.00	1,007,901.78	
		OBL 2.1% 04/12/29	710,000.00	711,091.98	
		OBL 2.4% 10/19/28	460,000.00	465,897.20	
		PGB 0.3% 10/17/31	70,000.00	60,860.62	
		PGB 0.475% 10/18/30	200,000.00	181,097.60	
		PGB 0.7% 10/15/27	100,000.00	97,388.92	
		PGB 0.9% 10/12/35	110,000.00	88,801.35	
		PGB 1.15% 04/11/42	70,000.00	48,567.29	
		PGB 1.65% 07/16/32	150,000.00	139,963.95	
		PGB 1.95% 06/15/29	300,000.00	297,297.93	
		PGB 1% 04/12/52	100,000.00	53,336.00	
		PGB 2.125% 10/17/28	100,000.00	100,176.28	
		PGB 2.25% 04/18/34	100,000.00	94,667.80	
		PGB 2.875% 07/21/26	150,000.00	151,524.45	
		PGB 2.875% 10/20/34	250,000.00	247,066.00	
		PGB 3.5% 06/18/38	100,000.00	101,216.67	
		PGB 3.625% 06/12/54	30,000.00	28,466.06	
		PGB 3.875% 02/15/30	90,000.00	96,062.08	
		PGB 3% 06/15/35	100,000.00	99,062.97	
		PGB 4.1% 02/15/45	100,000.00	105,528.15	
		PGB 4.1% 04/15/37	120,000.00	129,908.64	
		PGB 4.125% 04/14/27	100,000.00	103,858.32	
		POLAND 2.375% 01/18/36	100,000.00	90,460.84	
		POLAND 3.875% 02/14/33	100,000.00	104,869.73	
		POLAND 4.125% 01/11/44	100,000.00	99,759.53	
		RAGB 0.25% 10/20/36	220,000.00	159,399.98	
		RAGB 0.5% 02/20/29	180,000.00	169,339.23	
		RAGB 0.5% 04/20/27	160,000.00	156,036.25	
		RAGB 0.7% 04/20/71	70,000.00	24,553.90	
		RAGB 0.75% 02/20/28	280,000.00	270,821.60	
		RAGB 0.75% 03/20/51	150,000.00	80,001.15	
		RAGB 0.75% 10/20/26	260,000.00	256,428.90	
		RAGB 0.85% 06/30/20	50,000.00	15,718.25	
		RAGB 0.9% 02/20/32	180,000.00	160,839.90	
		RAGB 0% 02/20/30	250,000.00	224,409.85	
		RAGB 0% 02/20/31	180,000.00	156,418.59	
		RAGB 0% 10/20/28	130,000.00	121,209.11	
		RAGB 0% 10/20/40	80,000.00	47,784.09	
		RAGB 1.5% 02/20/47	130,000.00	90,352.70	

		RAGB 1.5% 11/02/86	20,000.00	9,485.20	
		RAGB 1.85% 05/23/49	90,000.00	65,527.40	
		RAGB 2.1% 09/20/17	100,000.00	59,577.25	
		RAGB 2.4% 05/23/34	130,000.00	124,751.83	
		RAGB 2.5% 10/20/29	100,000.00	100,713.30	
		RAGB 2.9% 02/20/33	200,000.00	201,385.90	
		RAGB 2.9% 02/20/34	200,000.00	199,913.80	
		RAGB 2.9% 05/23/29	60,000.00	61,430.32	
		RAGB 2.95% 02/20/35	200,000.00	198,839.10	
		RAGB 2% 07/15/26	60,000.00	60,091.50	
		RAGB 3.15% 06/20/44	170,000.00	162,515.19	
		RAGB 3.15% 10/20/53	110,000.00	100,379.66	
		RAGB 3.2% 07/15/39	100,000.00	98,406.89	
		RAGB 3.45% 10/20/30	120,000.00	125,754.96	
		RAGB 3.8% 01/26/62	70,000.00	71,511.23	
		RAGB 4.15% 03/15/37	190,000.00	207,775.60	
		RAGB 6.25% 07/15/27	100,000.00	108,430.89	
		REPHUN 4% 07/25/29	100,000.00	102,664.37	
		REPHUN 5% 02/22/27	100,000.00	104,220.26	
		RFGB 0.125% 04/15/36	50,000.00	36,296.20	
		RFGB 0.125% 04/15/52	70,000.00	29,300.00	
		RFGB 0.125% 09/15/31	130,000.00	111,720.54	
		RFGB 0.25% 09/15/40	30,000.00	18,900.47	
		RFGB 0.5% 04/15/43	60,000.00	36,620.50	
		RFGB 0.5% 09/15/27	70,000.00	67,854.60	
		RFGB 0.5% 09/15/28	160,000.00	152,055.61	
		RFGB 0.5% 09/15/29	50,000.00	46,456.56	
		RFGB 0.75% 04/15/31	50,000.00	45,256.06	
		RFGB 0% 09/15/26	110,000.00	107,662.11	
		RFGB 0% 09/15/30	100,000.00	88,132.94	
		RFGB 1.125% 04/15/34	80,000.00	68,892.44	
		RFGB 1.375% 04/15/27	50,000.00	49,527.03	
		RFGB 1.375% 04/15/47	70,000.00	47,205.79	
		RFGB 1.5% 09/15/32	90,000.00	82,764.96	
		RFGB 2.5% 04/15/30	60,000.00	60,228.24	
		RFGB 2.625% 07/04/42	90,000.00	80,964.53	
		RFGB 2.75% 04/15/38	80,000.00	75,707.68	
		RFGB 2.75% 07/04/28	100,000.00	101,951.78	
		RFGB 2.875% 04/15/29	40,000.00	40,877.96	
		RFGB 2.95% 04/15/55	60,000.00	52,520.63	
		RFGB 3.2% 04/15/45	100,000.00	95,507.57	
		RFGB 3% 09/15/33	150,000.00	151,567.17	

		RFGB 3% 09/15/34	50,000.00	50,142.41	
		RFGB 3% 09/15/35	100,000.00	99,460.52	
		ROMANI 2.125% 03/07/28	100,000.00	96,871.86	
		ROMANI 2.625% 12/02/40	100,000.00	64,162.40	
		ROMANI 2.75% 04/14/41	100,000.00	64,591.87	
		ROMANI 2% 01/28/32	100,000.00	82,798.78	
		ROMANI 2% 04/14/33	100,000.00	78,253.93	
		ROMANI 3.624% 05/26/30	100,000.00	96,209.00	
		ROMANI 3.875% 10/29/35	100,000.00	84,729.94	
		ROMANI 5.125% 09/24/31	300,000.00	300,152.16	
		ROMANI 5% 09/27/26	100,000.00	102,975.68	
		ROMANI 6.375% 09/18/33	100,000.00	104,849.40	
		SPGB 0.1% 04/30/31	540,000.00	466,432.69	
		SPGB 0.5% 04/30/30	350,000.00	318,557.75	
		SPGB 0.5% 10/31/31	670,000.00	583,896.62	
		SPGB 0.6% 10/31/29	400,000.00	370,587.70	
		SPGB 0.7% 04/30/32	370,000.00	321,917.76	
		SPGB 0.8% 07/30/27	300,000.00	292,955.27	
		SPGB 0.8% 07/30/29	350,000.00	328,555.93	
		SPGB 0.85% 07/30/37	290,000.00	215,937.14	
		SPGB 0% 01/31/27	430,000.00	417,359.93	
		SPGB 0% 01/31/28	400,000.00	379,352.40	
		SPGB 1.2% 10/31/40	400,000.00	284,683.17	
		SPGB 1.25% 10/31/30	300,000.00	280,324.28	
		SPGB 1.3% 10/31/26	650,000.00	645,019.37	
		SPGB 1.4% 04/30/28	260,000.00	254,940.33	
		SPGB 1.4% 07/30/28	600,000.00	586,136.10	
		SPGB 1.45% 04/30/29	570,000.00	551,846.21	
		SPGB 1.45% 10/31/27	480,000.00	473,776.32	
		SPGB 1.45% 10/31/71	110,000.00	49,697.69	
		SPGB 1.5% 04/30/27	440,000.00	436,620.80	
		SPGB 1.85% 07/30/35	410,000.00	361,926.27	
		SPGB 1.9% 10/31/52	310,000.00	202,684.97	
		SPGB 1.95% 07/30/30	280,000.00	272,298.67	
		SPGB 1% 07/30/42	270,000.00	177,043.32	
		SPGB 1% 10/31/50	500,000.00	267,714.91	
		SPGB 2.35% 07/30/33	350,000.00	334,115.81	
		SPGB 2.4% 05/31/28	200,000.00	201,166.40	
		SPGB 2.5% 05/31/27	410,000.00	413,763.26	
		SPGB 2.55% 10/31/32	300,000.00	293,496.93	
		SPGB 2.7% 01/31/30	150,000.00	151,341.19	
		SPGB 2.7% 10/31/48	270,000.00	220,169.05	
		SPGB 2.9% 10/31/46	340,000.00	292,598.73	

	SPGB 3.1% 07/30/31	100,000.00	102,103.81	
	SPGB 3.15% 04/30/33	350,000.00	354,406.57	
	SPGB 3.15% 04/30/35	350,000.00	347,802.87	
	SPGB 3.2% 10/31/35	300,000.00	297,869.68	
	SPGB 3.25% 04/30/34	280,000.00	282,882.74	
	SPGB 3.45% 07/30/43	240,000.00	227,894.01	
	SPGB 3.45% 07/30/66	240,000.00	205,585.64	
	SPGB 3.45% 10/31/34	670,000.00	685,349.63	
	SPGB 3.5% 01/31/41	150,000.00	145,707.75	
	SPGB 3.5% 05/31/29	410,000.00	426,967.07	
	SPGB 3.55% 10/31/33	230,000.00	238,484.12	
	SPGB 3.9% 07/30/39	240,000.00	247,185.48	
	SPGB 4.2% 01/31/37	310,000.00	333,557.83	
	SPGB 4.7% 07/30/41	320,000.00	357,531.20	
	SPGB 4.9% 07/30/40	270,000.00	307,945.80	
	SPGB 4% 10/31/54	110,000.00	108,316.14	
	SPGB 5.15% 10/31/28	580,000.00	633,165.41	
	SPGB 5.15% 10/31/44	260,000.00	306,416.50	
	SPGB 5.75% 07/30/32	450,000.00	533,160.45	
	SPGB 5.9% 07/30/26	210,000.00	218,710.59	
ユーロ 小計		119,700,000.00	111,515,688.27 (19,094,831,302)	
イギリスポンド	UKT 0.125% 01/31/28	430,000.00	393,082.78	
	UKT 0.25% 07/31/31	450,000.00	359,329.95	
	UKT 0.375% 10/22/26	450,000.00	432,048.60	
	UKT 0.375% 10/22/30	560,000.00	465,491.60	
	UKT 0.5% 01/31/29	520,000.00	463,002.28	
	UKT 0.5% 10/22/61	360,000.00	91,655.64	
	UKT 0.625% 07/31/35	280,000.00	191,151.52	
	UKT 0.625% 10/22/50	440,000.00	157,102.00	
	UKT 0.875% 01/31/46	150,000.00	67,685.25	
	UKT 0.875% 07/31/33	560,000.00	427,243.60	
	UKT 0.875% 10/22/29	680,000.00	601,489.24	
	UKT 1.125% 01/31/39	410,000.00	258,099.92	
	UKT 1.125% 10/22/73	210,000.00	66,381.00	
	UKT 1.25% 07/22/27	660,000.00	628,038.84	
	UKT 1.25% 07/31/51	460,000.00	195,799.00	
	UKT 1.25% 10/22/41	460,000.00	265,701.06	
	UKT 1.5% 07/22/26	810,000.00	791,785.53	
	UKT 1.5% 07/22/47	420,000.00	213,254.16	
	UKT 1.5% 07/31/53	370,000.00	163,552.95	
	UKT 1.625% 10/22/28	530,000.00	495,463.61	

	UKT 1.625% 10/22/54	480,000.00	217,079.52	
	UKT 1.625% 10/22/71	430,000.00	168,534.63	
	UKT 1.75% 01/22/49	610,000.00	319,177.62	
	UKT 1.75% 07/22/57	440,000.00	199,830.40	
	UKT 1.75% 09/07/37	520,000.00	375,220.04	
	UKT 1% 01/31/32	470,000.00	384,977.00	
	UKT 2.5% 07/22/65	330,000.00	178,460.70	
	UKT 3.25% 01/22/44	440,000.00	335,919.32	
	UKT 3.25% 01/31/33	690,000.00	641,410.20	
	UKT 3.5% 01/22/45	570,000.00	446,626.92	
	UKT 3.5% 07/22/68	290,000.00	203,002.32	
	UKT 3.75% 01/29/38	500,000.00	447,969.50	
	UKT 3.75% 03/07/27	310,000.00	309,391.16	
	UKT 3.75% 07/22/52	370,000.00	284,089.33	
	UKT 3.75% 10/22/53	350,000.00	265,972.35	
	UKT 4.125% 01/29/27	380,000.00	381,343.68	
	UKT 4.125% 07/22/29	550,000.00	553,707.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	730,000.00	703,436.76	
	UKT 4.25% 06/07/32	510,000.00	511,867.62	
	UKT 4.25% 07/31/34	500,000.00	489,678.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	510,000.00	472,224.81	
	UKT 4.25% 12/07/27	370,000.00	374,584.67	
	UKT 4.25% 12/07/40	200,000.00	182,700.20	
	UKT 4.25% 12/07/46	240,000.00	206,950.56	
	UKT 4.25% 12/07/49	390,000.00	330,816.33	
	UKT 4.25% 12/07/55	410,000.00	340,049.49	
	UKT 4.375% 01/31/40	270,000.00	251,886.78	
	UKT 4.375% 03/07/28	420,000.00	425,076.12	
	UKT 4.375% 03/07/30	330,000.00	334,705.80	
	UKT 4.375% 07/31/54	310,000.00	263,145.98	
	UKT 4.5% 03/07/35	450,000.00	446,420.25	
	UKT 4.5% 06/07/28	460,000.00	468,094.62	
	UKT 4.5% 09/07/34	570,000.00	570,163.59	
	UKT 4.5% 12/07/42	350,000.00	322,890.05	
	UKT 4.625% 01/31/34	450,000.00	455,004.00	
	UKT 4.75% 10/22/43	270,000.00	254,130.48	
	UKT 4.75% 12/07/30	600,000.00	622,397.40	
	UKT 4.75% 12/07/38	290,000.00	285,911.00	
	UKT 4% 01/22/60	390,000.00	306,733.05	
	UKT 4% 10/22/31	490,000.00	484,645.28	
	UKT 4% 10/22/63	250,000.00	194,560.25	
	UKT 6.0% 12/07/28	470,000.00	503,610.64	

イギリスポンド 小計		27,170,000.00	22,241,753.95 (4,415,877,829)	
スイスフラン	SWISS 0.25% 06/23/35	180,000.00	177,276.42	
	SWISS 0.5% 05/24/55	60,000.00	58,135.60	
	SWISS 0.5% 05/27/30	250,000.00	254,416.25	
	SWISS 0.5% 05/30/58	40,000.00	39,037.10	
	SWISS 0.5% 06/27/32	190,000.00	193,339.91	
	SWISS 0.5% 06/28/45	130,000.00	126,260.51	
	SWISS 0.875% 05/22/47	50,000.00	52,228.68	
	SWISS 0% 06/22/29	500,000.00	498,629.37	
	SWISS 0% 06/26/34	310,000.00	300,096.27	
	SWISS 0% 07/24/39	150,000.00	138,394.20	
	SWISS 1.25% 06/27/37	60,000.00	65,170.44	
	SWISS 1.25% 06/28/43	50,000.00	55,324.12	
	SWISS 1.5% 04/30/42	220,000.00	250,999.65	
	SWISS 1.5% 10/26/38	130,000.00	145,622.42	
	SWISS 2.25% 06/22/31	320,000.00	359,048.32	
	SWISS 2.5% 03/08/36	160,000.00	194,314.72	
	SWISS 2% 06/25/64	50,000.00	74,973.06	
	SWISS 3.25% 06/27/27	540,000.00	575,584.11	
	SWISS 3.5% 04/08/33	250,000.00	311,502.50	
	SWISS 4% 01/06/49	20,000.00	34,691.85	
	SWISS 4% 04/08/28	550,000.00	610,748.43	
スイスフラン 小計		4,210,000.00	4,515,793.93 (831,086,714)	
スウェーデンクローナ	SGB 0.125% 05/12/31	770,000.00	691,282.90	
	SGB 0.75% 05/12/28	2,540,000.00	2,469,769.00	
	SGB 0.75% 11/12/29	4,230,000.00	4,033,305.00	
	SGB 1.75% 11/11/33	950,000.00	918,156.00	
	SGB 2.25% 05/11/35	650,000.00	647,338.25	
	SGB 2.25% 06/01/32	650,000.00	656,799.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	680,000.00	761,141.00	
スウェーデンクローナ 小計		10,470,000.00	10,177,791.15 (156,229,094)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	900,000.00	778,137.57	
	NGB 1.375% 08/19/30	870,000.00	778,581.19	
	NGB 1.75% 02/17/27	1,890,000.00	1,837,949.43	
	NGB 1.75% 09/06/29	750,000.00	697,012.29	
	NGB 2.125% 05/18/32	450,000.00	405,675.76	
	NGB 2% 04/26/28	1,360,000.00	1,305,039.80	
	NGB 3.5% 10/06/42	610,000.00	588,519.52	
	NGB 3.625% 04/13/34	370,000.00	363,751.21	
	NGB 3.625% 05/31/39	400,000.00	390,925.12	

	NGB 3.75% 06/12/35	650,000.00	644,020.32	
	NGB 3% 08/15/33	1,310,000.00	1,235,112.48	
ノルウェークローネ 小計		9,560,000.00	9,024,724.69 (130,497,519)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	900,000.00	466,815.96	
	DGB 0.5% 11/15/27	3,660,000.00	3,564,523.73	
	DGB 0.5% 11/15/29	3,450,000.00	3,240,521.30	
	DGB 0% 11/15/31	1,170,000.00	1,019,629.69	
	DGB 2.25% 11/15/26	1,500,000.00	1,516,068.30	
	DGB 2.25% 11/15/33	1,110,000.00	1,099,643.19	
	DGB 4.5% 11/15/39	1,550,000.00	1,867,822.85	
デンマーククローネ 小計		13,340,000.00	12,775,025.02 (293,186,824)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	1,600,000.00	1,365,040.75	
	CZGB 0.25% 02/10/27	2,100,000.00	1,997,670.21	
	CZGB 0.95% 05/15/30	2,500,000.00	2,188,815.27	
	CZGB 1.2% 03/13/31	1,550,000.00	1,343,354.34	
	CZGB 1.5% 04/24/40	1,000,000.00	669,423.25	
	CZGB 1.75% 06/23/32	2,400,000.00	2,084,665.82	
	CZGB 1.95% 07/30/37	1,400,000.00	1,079,862.07	
	CZGB 2.5% 08/25/28	1,500,000.00	1,450,872.48	
	CZGB 2.75% 07/23/29	1,400,000.00	1,351,219.78	
	CZGB 2% 10/13/33	3,300,000.00	2,815,996.59	
	CZGB 3.5% 05/30/35	1,400,000.00	1,318,903.82	
	CZGB 3.6% 06/03/36	600,000.00	563,157.91	
	CZGB 4.2% 12/04/36	1,300,000.00	1,278,619.94	
	CZGB 4.25% 10/24/34	600,000.00	599,784.12	
	CZGB 4.5% 11/11/32	2,050,000.00	2,111,630.79	
	CZGB 4.85% 11/26/57	500,000.00	497,941.68	
	CZGB 4.9% 04/14/34	2,300,000.00	2,421,497.50	
	CZGB 5.5% 12/12/28	1,800,000.00	1,908,346.68	
	CZGB 5.75% 03/29/29	2,000,000.00	2,144,428.40	
	CZGB 5% 09/30/30	1,000,000.00	1,056,205.30	
	CZGB 6.2% 06/16/31	1,000,000.00	1,123,811.20	
チェココルナ 小計		33,300,000.00	31,371,247.90 (218,030,172)	
ハンガリーフォリント	HGB 1.5% 08/26/26	28,000,000.00	26,674,761.68	
	HGB 2.25% 04/20/33	16,000,000.00	11,734,423.84	
	HGB 2.25% 06/22/34	8,000,000.00	5,581,139.60	
	HGB 2.75% 12/22/26	10,000,000.00	9,549,981.40	
	HGB 2% 05/23/29	20,000,000.00	17,074,346.00	
	HGB 3.25% 10/22/31	23,000,000.00	19,154,054.08	

		HGB 3% 04/25/41	8,000,000.00	4,864,292.24	
		HGB 3% 08/21/30	30,000,000.00	25,670,654.70	
		HGB 3% 10/27/27	26,000,000.00	24,240,026.20	
		HGB 3% 10/27/38	14,000,000.00	9,117,507.98	
		HGB 4.5% 03/23/28	15,000,000.00	14,353,361.70	
		HGB 4.5% 05/27/32	19,000,000.00	16,753,504.98	
		HGB 4.75% 11/24/32	12,000,000.00	10,646,291.88	
		HGB 6.75% 10/22/28	11,000,000.00	11,124,205.40	
		HGB 7% 10/24/35	15,000,000.00	14,983,282.05	
		HGB 9.5% 10/21/26	13,000,000.00	13,512,765.50	
	ハンガリーフォリント 小計		268,000,000.00	235,034,599.23 (101,064,877)	
	ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	680,000.00	646,537.20	
		POLGB 1.25% 10/25/30	870,000.00	729,585.37	
		POLGB 1.75% 04/25/32	630,000.00	509,572.42	
		POLGB 2.5% 07/25/26	350,000.00	344,014.89	
		POLGB 2.5% 07/25/27	730,000.00	703,837.82	
		POLGB 2.75% 04/25/28	650,000.00	622,306.75	
		POLGB 2.75% 10/25/29	2,350,000.00	2,181,129.72	
		POLGB 3.75% 05/25/27	640,000.00	634,177.56	
		POLGB 4.5% 07/25/30	400,000.00	394,319.10	
		POLGB 4.75% 07/25/29	570,000.00	572,384.59	
		POLGB 5.75% 04/25/29	550,000.00	572,597.57	
		POLGB 5% 01/25/30	270,000.00	272,922.29	
		POLGB 5% 10/25/34	810,000.00	791,068.58	
		POLGB 6% 10/25/33	910,000.00	956,527.75	
		POLGB 7.5% 07/25/28	700,000.00	758,995.72	
	ポーランドズロチ 小計		11,110,000.00	10,689,977.33 (431,554,384)	
	オーストラリアドル	ACGB 0.5% 09/21/26	430,000.00	415,315.50	
		ACGB 1.25% 05/21/32	400,000.00	334,860.00	
		ACGB 1.5% 06/21/31	1,150,000.00	1,008,837.50	
		ACGB 1.75% 06/21/51	220,000.00	115,933.40	
		ACGB 1.75% 11/21/32	400,000.00	341,540.00	
		ACGB 1% 11/21/31	460,000.00	385,360.40	
		ACGB 1% 12/21/30	700,000.00	606,732.00	
		ACGB 2.25% 05/21/28	500,000.00	484,030.00	
		ACGB 2.5% 05/21/30	640,000.00	607,993.60	
		ACGB 2.75% 05/21/41	140,000.00	109,905.60	
		ACGB 2.75% 06/21/35	350,000.00	305,399.50	
		ACGB 2.75% 11/21/27	720,000.00	709,279.20	
		ACGB 2.75% 11/21/28	490,000.00	478,916.20	
		ACGB 2.75% 11/21/29	780,000.00	754,299.00	

		ACGB 3.25% 04/21/29	740,000.00	733,132.80	
		ACGB 3.25% 06/21/39	270,000.00	233,377.20	
		ACGB 3.5% 12/21/34	420,000.00	394,422.00	
		ACGB 3.75% 04/21/37	420,000.00	393,279.60	
		ACGB 3.75% 05/21/34	200,000.00	192,894.00	
		ACGB 3% 03/21/47	190,000.00	142,123.80	
		ACGB 3% 11/21/33	270,000.00	247,611.60	
		ACGB 4.25% 03/21/36	320,000.00	316,604.80	
		ACGB 4.25% 06/21/34	300,000.00	300,348.00	
		ACGB 4.25% 12/21/35	200,000.00	198,216.00	
		ACGB 4.5% 04/21/33	490,000.00	502,994.80	
		ACGB 4.75% 04/21/27	460,000.00	470,690.40	
		ACGB 4.75% 06/21/54	100,000.00	96,042.00	
	オーストラリアドル 小計		11,760,000.00	10,880,138.90 (1,039,379,669)	
	ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	290,000.00	264,553.72	
		NZGB 1.5% 05/15/31	340,000.00	294,414.42	
		NZGB 1.75% 05/15/41	110,000.00	70,549.60	
		NZGB 2.75% 04/15/37	130,000.00	106,100.73	
		NZGB 2.75% 05/15/51	90,000.00	58,293.68	
		NZGB 2% 05/15/32	250,000.00	216,578.01	
		NZGB 3.5% 04/14/33	190,000.00	178,974.16	
		NZGB 3% 04/20/29	470,000.00	458,440.04	
		NZGB 4.25% 05/15/34	100,000.00	98,137.47	
		NZGB 4.25% 05/15/36	90,000.00	86,548.68	
		NZGB 4.5% 04/15/27	390,000.00	397,964.65	
		NZGB 4.5% 05/15/30	260,000.00	266,839.11	
		NZGB 4.5% 05/15/35	180,000.00	178,509.66	
		NZGB 5% 05/15/54	60,000.00	57,411.13	
	ニュージーランドドル 小計		2,950,000.00	2,733,315.06 (239,575,065)	
	シンガポールドル	SIGB 1.25% 11/01/26	150,000.00	149,084.77	
		SIGB 1.625% 07/01/31	120,000.00	117,781.98	
		SIGB 1.875% 03/01/50	110,000.00	104,527.14	
		SIGB 1.875% 10/01/51	120,000.00	112,449.23	
		SIGB 2.25% 08/01/36	220,000.00	222,195.84	
		SIGB 2.375% 07/01/39	60,000.00	61,379.35	
		SIGB 2.5% 04/01/30	200,000.00	206,751.00	
		SIGB 2.625% 05/01/28	180,000.00	184,321.92	
		SIGB 2.625% 08/01/32	60,000.00	62,299.17	
		SIGB 2.75% 03/01/46	120,000.00	132,004.20	
		SIGB 2.75% 04/01/42	160,000.00	173,427.80	
		SIGB 2.875% 07/01/29	120,000.00	124,924.42	

	SIGB 2.875% 08/01/28	90,000.00	93,010.33	
	SIGB 2.875% 09/01/27	130,000.00	133,163.61	
	SIGB 2.875% 09/01/30	200,000.00	210,067.76	
	SIGB 3.25% 06/01/54	30,000.00	36,982.80	
	SIGB 3.375% 05/01/34	140,000.00	154,206.44	
	SIGB 3.375% 09/01/33	140,000.00	153,019.98	
	SIGB 3.5% 03/01/27	180,000.00	185,162.40	
	SIGB 3% 04/01/29	40,000.00	41,751.66	
	SIGB 3% 08/01/72	80,000.00	97,107.92	
シンガポールドル 小計		2,650,000.00	2,755,619.72 (314,333,541)	
マレーシアリンギット	MGS 2.632% 04/15/31	820,000.00	790,742.94	
	MGS 3.502% 05/31/27	450,000.00	454,244.31	
	MGS 3.582% 07/15/32	600,000.00	608,633.94	
	MGS 3.733% 06/15/28	880,000.00	895,479.55	
	MGS 3.757% 05/22/40	890,000.00	895,603.44	
	MGS 3.828% 07/05/34	700,000.00	718,384.24	
	MGS 3.844% 04/15/33	630,000.00	647,675.53	
	MGS 3.885% 08/15/29	300,000.00	307,959.54	
	MGS 3.899% 11/16/27	780,000.00	794,940.74	
	MGS 3.9% 11/30/26	880,000.00	891,317.41	
	MGS 3.906% 07/15/26	420,000.00	424,131.49	
	MGS 4.054% 04/18/39	400,000.00	416,470.96	
	MGS 4.065% 06/15/50	1,090,000.00	1,106,258.87	
	MGS 4.232% 06/30/31	930,000.00	973,762.35	
	MGS 4.254% 05/31/35	690,000.00	733,136.24	
	MGS 4.457% 03/31/53	540,000.00	581,559.48	
	MGS 4.498% 04/15/30	430,000.00	454,766.88	
	MGS 4.504% 04/30/29	850,000.00	890,266.54	
	MGS 4.642% 11/07/33	700,000.00	760,398.80	
	MGS 4.696% 10/15/42	960,000.00	1,072,321.72	
	MGS 4.736% 03/15/46	240,000.00	267,697.27	
	MGS 4.762% 04/07/37	690,000.00	765,889.99	
	MGS 4.893% 06/08/38	920,000.00	1,031,750.74	
	MGS 4.921% 07/06/48	420,000.00	480,924.69	
マレーシアリンギット 小計		16,210,000.00	16,964,317.66 (582,936,365)	
タイバーツ	THAIGB 1.585% 12/17/35	6,800,000.00	6,821,207.84	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	4,000,000.00	4,020,789.20	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	8,000,000.00	8,068,378.40	
	THAIGB 1% 06/17/27	4,700,000.00	4,668,510.98	
	THAIGB 2.05% 04/17/28	7,000,000.00	7,133,025.90	

		THAIGB 2.125% 12/17/26	5,000,000.00	5,052,604.00	
		THAIGB 2.25% 03/17/27	5,500,000.00	5,579,888.60	
		THAIGB 2.4% 03/17/29	3,000,000.00	3,109,316.40	
		THAIGB 2.5% 06/17/71	3,000,000.00	3,132,284.10	
		THAIGB 2.65% 06/17/28	4,000,000.00	4,148,504.80	
		THAIGB 2.75% 06/17/52	2,200,000.00	2,482,034.06	
		THAIGB 2.8% 06/17/34	6,000,000.00	6,637,285.80	
		THAIGB 2.875% 06/17/46	4,600,000.00	5,215,350.74	
		THAIGB 2.875% 12/17/28	3,500,000.00	3,676,032.15	
		THAIGB 2.98% 06/17/45	4,000,000.00	4,630,738.80	
		THAIGB 2% 06/17/42	5,000,000.00	5,108,406.50	
		THAIGB 2% 12/17/31	9,000,000.00	9,295,722.00	
		THAIGB 3.3% 06/17/38	3,000,000.00	3,565,657.20	
		THAIGB 3.35% 06/17/33	7,500,000.00	8,520,987.75	
		THAIGB 3.39% 06/17/37	6,400,000.00	7,615,896.96	
		THAIGB 3.45% 06/17/43	1,200,000.00	1,460,986.56	
		THAIGB 3.6% 06/17/67	7,300,000.00	9,684,550.11	
		THAIGB 3.8% 06/14/41	2,000,000.00	2,556,644.20	
		THAIGB 4% 06/17/55	2,000,000.00	2,811,168.60	
		THAIGB 4% 06/17/72	1,000,000.00	1,471,092.30	
	タイバーツ 小計		115,700,000.00	126,467,063.95 (566,572,446)	
	インドネシアルピア	INDOGB 5.125% 04/15/27	7,400,000,000.00	7,297,510,000.00	
		INDOGB 6.25% 06/15/36	2,000,000,000.00	1,939,280,000.00	
		INDOGB 6.375% 04/15/32	5,000,000,000.00	4,986,250,000.00	
		INDOGB 6.375% 08/15/28	5,300,000,000.00	5,344,732,000.00	
		INDOGB 6.5% 02/15/31	2,000,000,000.00	2,014,420,000.00	
		INDOGB 6.5% 07/15/30	4,000,000,000.00	4,046,640,000.00	
		INDOGB 6.625% 02/15/34	3,500,000,000.00	3,518,754,400.00	
		INDOGB 6.75% 07/15/35	1,000,000,000.00	1,011,155,000.00	
		INDOGB 6.875% 04/15/29	2,000,000,000.00	2,046,202,800.00	
		INDOGB 6.875% 07/15/54	1,000,000,000.00	985,140,000.00	
		INDOGB 6.875% 08/15/51	1,000,000,000.00	988,620,000.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/38	3,000,000,000.00	3,095,430,000.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/42	3,000,000,000.00	3,054,720,000.00	
		INDOGB 7.125% 06/15/43	3,000,000,000.00	3,058,830,000.00	
		INDOGB 7.375% 05/15/48	4,000,000,000.00	4,156,640,000.00	
		INDOGB 7.5% 04/15/40	1,000,000,000.00	1,051,500,000.00	
		INDOGB 7.5% 05/15/38	2,000,000,000.00	2,112,380,000.00	
		INDOGB 7% 02/15/33	5,500,000,000.00	5,650,315,000.00	
		INDOGB 7% 09/15/30	3,500,000,000.00	3,614,695,000.00	
		INDOGB 8.25% 05/15/29	2,500,000,000.00	2,678,550,000.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	1,100,000,000.00	1,245,068,000.00	

インドネシアルピア 小計		62,800,000,000.00	63,896,832,200.00 (575,071,489)	
韓国ウォン	KTB 1.125% 09/10/39	600,000,000.00	478,657,134.00	
	KTB 1.375% 12/10/29	400,000,000.00	379,022,036.00	
	KTB 1.5% 03/10/50	300,000,000.00	232,650,345.00	
	KTB 1.5% 09/10/36	600,000,000.00	520,645,746.00	
	KTB 1.5% 09/10/40	200,000,000.00	166,597,566.00	
	KTB 1.5% 12/10/30	800,000,000.00	752,846,664.00	
	KTB 1.875% 06/10/29	500,000,000.00	486,823,665.00	
	KTB 1.875% 09/10/41	300,000,000.00	262,306,401.00	
	KTB 2.125% 03/10/47	200,000,000.00	178,491,014.00	
	KTB 2.25% 09/10/37	200,000,000.00	187,002,394.00	
	KTB 2.375% 03/10/27	900,000,000.00	899,056,188.00	
	KTB 2.375% 12/10/27	1,000,000,000.00	997,264,820.00	
	KTB 2.5% 03/10/52	300,000,000.00	285,690,873.00	
	KTB 2.625% 03/10/30	800,000,000.00	799,853,680.00	
	KTB 2.625% 03/10/48	300,000,000.00	292,213,176.00	
	KTB 2.625% 03/10/55	200,000,000.00	195,744,670.00	
	KTB 2.75% 09/10/54	300,000,000.00	300,613,710.00	
	KTB 2.75% 12/10/44	200,000,000.00	198,106,114.00	
	KTB 2% 03/10/46	300,000,000.00	262,563,423.00	
	KTB 2% 03/10/49	700,000,000.00	606,826,591.00	
	KTB 2% 06/10/31	800,000,000.00	768,948,784.00	
	KTB 3.25% 03/10/28	700,000,000.00	713,135,430.00	
	KTB 3.25% 03/10/53	1,500,000,000.00	1,642,801,350.00	
	KTB 3.25% 06/10/27	200,000,000.00	203,027,800.00	
	KTB 3.25% 06/10/33	700,000,000.00	719,968,760.00	
	KTB 3.25% 09/10/42	600,000,000.00	633,637,980.00	
	KTB 3.375% 06/10/32	800,000,000.00	829,745,520.00	
	KTB 3.5% 06/10/34	300,000,000.00	314,087,160.00	
	KTB 3.5% 09/10/28	400,000,000.00	411,558,040.00	
	KTB 3.625% 09/10/53	600,000,000.00	701,997,720.00	
	KTB 3.75% 12/10/33	400,000,000.00	426,097,320.00	
韓国ウォン 小計		16,100,000,000.00	15,847,982,074.00 (1,687,810,090)	
イスラエル シェケル	ILGOV 1.3% 04/30/32	590,000.00	496,701.51	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	480,000.00	359,409.65	
	ILGOV 1% 03/31/30	630,000.00	551,489.70	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	450,000.00	427,523.29	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	300,000.00	216,942.96	
	ILGOV 2% 03/31/27	550,000.00	532,713.63	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	460,000.00	457,128.26	

		ILGOV 3.75% 03/31/47	340,000.00	306,126.93	
		ILGOV 3.75% 09/30/27	300,000.00	298,767.95	
		ILGOV 4.6% 08/31/29	160,000.00	164,660.35	
		ILGOV 4% 03/30/35	610,000.00	605,249.25	
		ILGOV 5.5% 01/31/42	370,000.00	420,464.44	
		ILGOV 6.25% 10/30/26	100,000.00	102,978.83	
	イスラエルシェケル 小計		5,340,000.00	4,940,156.75 (217,165,338)	
	オフショア人民元	CGB 1.38% 06/15/27	11,000,000.00	11,002,453.00	
		CGB 1.43% 01/25/30	5,500,000.00	5,485,818.91	
		CGB 1.46% 05/25/28	3,000,000.00	3,005,040.30	
		CGB 1.65% 05/15/35	3,000,000.00	2,990,818.11	
		CGB 1.85% 05/15/27	3,200,000.00	3,227,783.36	
		CGB 1.87% 09/15/31	6,000,000.00	6,100,730.40	
		CGB 2.04% 11/25/34	6,000,000.00	6,191,896.80	
		CGB 2.11% 08/25/34	4,300,000.00	4,455,641.94	
		CGB 2.12% 06/25/31	6,000,000.00	6,183,942.60	
		CGB 2.18% 08/15/26	7,000,000.00	7,061,432.00	
		CGB 2.27% 05/25/34	7,500,000.00	7,862,571.75	
		CGB 2.28% 03/25/31	7,000,000.00	7,269,374.70	
		CGB 2.35% 02/25/34	6,000,000.00	6,323,029.80	
		CGB 2.37% 01/15/29	5,000,000.00	5,154,166.00	
		CGB 2.37% 01/20/27	11,000,000.00	11,164,283.90	
		CGB 2.39% 11/15/26	6,000,000.00	6,082,128.60	
		CGB 2.4% 07/15/28	5,200,000.00	5,349,718.40	
		CGB 2.44% 10/15/27	8,600,000.00	8,790,595.78	
		CGB 2.48% 09/25/28	7,500,000.00	7,745,004.75	
		CGB 2.5% 07/25/27	6,500,000.00	6,632,965.30	
		CGB 2.52% 08/25/33	15,000,000.00	15,974,574.00	
		CGB 2.54% 12/25/30	6,800,000.00	7,151,086.72	
		CGB 2.6% 09/15/30	5,500,000.00	5,790,212.45	
		CGB 2.62% 04/15/28	6,100,000.00	6,301,227.41	
		CGB 2.62% 06/25/30	4,400,000.00	4,632,071.84	
		CGB 2.62% 09/25/29	9,000,000.00	9,411,750.90	
		CGB 2.64% 01/15/28	4,200,000.00	4,329,451.56	
		CGB 2.65% 03/25/74	1,000,000.00	1,218,219.40	
		CGB 2.67% 05/25/33	15,000,000.00	16,121,781.00	
		CGB 2.67% 11/25/33	7,000,000.00	7,551,700.10	
		CGB 2.68% 05/21/30	3,000,000.00	3,163,519.20	
		CGB 2.69% 08/12/26	7,000,000.00	7,106,836.80	
		CGB 2.69% 08/15/32	5,000,000.00	5,359,585.00	
		CGB 2.75% 02/17/32	3,000,000.00	3,216,504.60	
		CGB 2.75% 06/15/29	10,500,000.00	11,010,682.20	

		CGB 2.76% 05/15/32	7,300,000.00	7,858,163.84	
		CGB 2.79% 12/15/29	6,000,000.00	6,335,257.80	
		CGB 2.8% 03/24/29	5,000,000.00	5,244,083.00	
		CGB 2.8% 11/15/32	5,000,000.00	5,414,889.00	
		CGB 2.85% 06/04/27	7,700,000.00	7,923,568.73	
		CGB 2.88% 02/25/33	6,700,000.00	7,306,947.64	
		CGB 2.91% 10/14/28	4,400,000.00	4,611,672.12	
		CGB 3.01% 05/13/28	6,600,000.00	6,911,714.04	
		CGB 3.02% 05/27/31	3,000,000.00	3,253,402.80	
		CGB 3.12% 10/25/52	3,200,000.00	4,009,544.96	
		CGB 3.13% 11/21/29	6,700,000.00	7,195,630.49	
		CGB 3.19% 04/15/53	4,100,000.00	5,213,292.68	
		CGB 3.27% 03/25/73	1,000,000.00	1,406,913.30	
		CGB 3.27% 11/19/30	7,000,000.00	7,668,670.80	
		CGB 3.28% 12/03/27	13,000,000.00	13,632,522.80	
		CGB 3.32% 04/15/52	3,800,000.00	4,911,810.08	
		CGB 3.39% 03/16/50	2,700,000.00	3,472,865.55	
		CGB 3.4% 07/15/72	2,000,000.00	2,887,432.40	
		CGB 3.53% 10/18/51	2,000,000.00	2,660,532.80	
		CGB 3.72% 04/12/51	3,200,000.00	4,373,616.32	
		CGB 3.73% 05/25/70	4,000,000.00	6,116,200.00	
		CGB 3.76% 03/22/71	1,000,000.00	1,543,182.00	
		CGB 3.81% 09/14/50	2,300,000.00	3,160,298.90	
		CGB 3.82% 11/19/68	1,000,000.00	1,531,471.00	
		CGB 3.86% 07/22/49	5,900,000.00	8,105,273.09	
		CGB 3% 10/15/53	1,000,000.00	1,246,792.50	
		CGB 4.08% 10/22/48	10,200,000.00	14,325,967.32	
		CGB 4% 06/24/69	5,000,000.00	8,001,388.00	
	オフショア人民元 小計		358,600,000.00	392,741,703.54 (7,979,018,997)	
国債証券合計				68,940,171,877 (68,940,171,877)	
地方債証券	**アメリカドル**	ALTA 1.3% 07/22/30	200,000.00	174,751.43	
		ALTA 4.5% 01/24/34	200,000.00	198,909.68	
		BRCOL 1.3% 01/29/31	100,000.00	85,687.68	
		BRCOL 4.2% 07/06/33	500,000.00	489,232.39	
		BRCOL 4.75% 06/12/34	200,000.00	202,223.71	
		CADEPO 4.625% 01/24/30	250,000.00	255,251.70	
		CADEPO 4.875% 06/05/29	250,000.00	257,453.82	
		KOMMUN 3.75% 05/24/28	200,000.00	198,746.55	
		MP 1.5% 10/25/28	200,000.00	184,677.27	
		MP 4.3% 07/27/33	300,000.00	294,387.54	

		ONT 1.125% 10/07/30	200,000.00	171,958.96	
		ONT 1.6% 02/25/31	200,000.00	174,323.86	
		ONT 1.8% 10/14/31	200,000.00	172,574.11	
		ONT 2.125% 01/21/32	400,000.00	349,484.30	
		ONT 5.05% 04/24/34	200,000.00	206,435.77	
		Q 1.35% 05/28/30	300,000.00	264,245.96	
		Q 1.9% 04/21/31	300,000.00	264,382.62	
		Q 4.5% 09/08/33	400,000.00	399,444.80	
	アメリカドル 小計		4,600,000.00	4,344,172.15 (633,771,274)	
	カナダドル	ALTA 1.65% 06/01/31	100,000.00	91,264.59	
		ALTA 2.55% 06/01/27	200,000.00	199,381.33	
		ALTA 2.9% 09/20/29	100,000.00	99,546.13	
		ALTA 2.95% 06/01/52	200,000.00	150,334.86	
		ALTA 4.15% 06/01/33	100,000.00	103,542.66	
		BRCOL 1.55% 06/18/31	200,000.00	181,177.99	
		BRCOL 2.95% 06/18/50	200,000.00	151,977.76	
		BRCOL 2.95% 12/18/28	100,000.00	100,153.70	
		BRCOL 3.2% 06/18/32	200,000.00	196,750.63	
		BRCOL 3.2% 06/18/44	100,000.00	83,223.96	
		BRCOL 4.45% 12/18/55	300,000.00	294,990.55	
		BRCOL 4% 06/18/35	500,000.00	502,053.19	
		BRCOL 5.62% 08/17/28	100,000.00	108,040.55	
		MP 2.85% 09/05/46	100,000.00	75,974.40	
		MP 3.2% 03/05/50	200,000.00	157,381.94	
		MP 3.25% 09/05/29	100,000.00	100,793.31	
		MP 6.3% 03/05/31	100,000.00	115,207.01	
		NBRNS 2.9% 08/14/52	100,000.00	73,325.08	
		NBRNS 5.5% 01/27/34	100,000.00	112,293.99	
		NF 1.25% 06/02/27	100,000.00	97,173.04	
		NF 2.65% 10/17/50	100,000.00	68,823.59	
		NF 3.15% 12/02/52	200,000.00	150,139.42	
		NF 3.7% 10/17/48	200,000.00	169,504.61	
		NS 3.15% 12/01/51	100,000.00	77,213.59	
		NS 4.05% 06/01/29	200,000.00	207,571.82	
		NS 4.4% 06/01/42	100,000.00	98,513.24	
		NS 4.6% 12/01/55	200,000.00	198,965.67	
		ONT 1.35% 09/08/26	300,000.00	295,441.44	
		ONT 1.55% 11/01/29	300,000.00	281,990.05	
		ONT 1.9% 12/02/51	200,000.00	119,643.56	
		ONT 2.25% 12/02/31	100,000.00	93,477.93	
		ONT 2.55% 12/02/52	100,000.00	69,161.65	
		ONT 2.6% 06/02/27	200,000.00	199,551.83	

		ONT 2.65% 12/02/50	100,000.00	71,605.90	
		ONT 2.8% 06/02/48	200,000.00	150,678.23	
		ONT 2.9% 06/02/49	200,000.00	152,466.35	
		ONT 2.9% 12/02/46	400,000.00	310,878.06	
		ONT 3.4% 09/08/28	200,000.00	203,089.19	
		ONT 3.45% 06/02/45	200,000.00	172,283.42	
		ONT 3.5% 06/02/43	400,000.00	352,536.10	
		ONT 3.6% 06/02/35	300,000.00	291,810.85	
		ONT 3.65% 06/02/33	100,000.00	100,070.03	
		ONT 3.75% 06/02/32	100,000.00	101,705.74	
		ONT 3.8% 12/02/34	200,000.00	198,889.51	
		ONT 4.15% 06/02/34	500,000.00	513,277.51	
		ONT 4.65% 06/02/41	200,000.00	205,934.37	
		ONT 4.7% 06/02/37	100,000.00	105,199.86	
		ONT 5.6% 06/02/35	300,000.00	341,241.58	
		ONT 6.2% 06/02/31	100,000.00	115,403.38	
		ONT 6.5% 03/08/29	100,000.00	112,287.96	
		Q 1.9% 09/01/30	100,000.00	93,971.68	
		Q 2.75% 09/01/28	200,000.00	199,278.76	
		Q 3.1% 12/01/51	300,000.00	232,992.91	
		Q 3.25% 09/01/32	200,000.00	196,692.15	
		Q 3.5% 12/01/45	300,000.00	258,312.09	
		Q 3.6% 09/01/33	300,000.00	298,385.68	
		Q 3.65% 05/20/32	100,000.00	101,171.96	
		Q 4.2% 12/01/57	400,000.00	376,993.22	
		Q 4.4% 12/01/55	200,000.00	195,142.64	
		Q 5% 12/01/41	200,000.00	212,757.61	
		Q 6% 10/01/29	100,000.00	111,599.47	
		SCDA 2.65% 06/02/27	200,000.00	199,683.56	
		SCDA 3.75% 03/05/54	100,000.00	87,118.20	
		SCDA 3.8% 06/02/35	200,000.00	197,911.46	
		SCDA 4.2% 12/02/54	100,000.00	94,459.67	
		SCDA 4.75% 06/01/40	100,000.00	104,649.27	
	カナダドル 小計		12,300,000.00	11,485,063.44 (1,225,111,717)	
	ユーロ	ALTA 3.125% 10/16/34	200,000.00	198,903.30	
		BAYERN 0.01% 01/18/35	100,000.00	75,964.49	
		BAYERN 0.01% 05/07/29	100,000.00	91,457.97	
		BAYERN 0.03% 04/03/28	100,000.00	94,407.34	
		BERGER 0.01% 07/02/30	100,000.00	88,288.76	
		BERGER 0.125% 06/04/35	100,000.00	75,721.57	
		BERGER 0.125% 11/24/45	200,000.00	100,872.96	

		BERGER 0.625% 01/26/52	100,000.00	48,404.84	
		BERGER 0.625% 07/15/39	100,000.00	69,791.42	
		BERGER 2.625% 01/24/31	200,000.00	200,516.46	
		HESLAN 2.375% 09/21/26	100,000.00	100,376.11	
		HESLAN 2.625% 08/24/27	100,000.00	100,397.75	
		HESLAN 4% 02/04/30	100,000.00	105,571.97	
		HESSEN 1.3% 10/10/33	100,000.00	88,799.56	
		HESSEN 2.625% 09/10/27	200,000.00	202,372.88	
		HESSEN 2.75% 01/10/34	200,000.00	198,129.07	
		HESSEN 2.875% 01/10/33	100,000.00	100,619.71	
		KOMINS 0.875% 09/01/29	100,000.00	94,033.86	
		KOMINS 2.875% 05/23/30	100,000.00	101,433.39	
		KOMINS 3.375% 03/15/27	400,000.00	408,654.84	
		KOMMUN 0% 11/17/29	100,000.00	90,116.92	
		KOMMUN 3.375% 04/26/43	200,000.00	195,795.12	
		LANDER 0.01% 02/04/31	100,000.00	86,551.70	
		LANDER 1.25% 05/04/29	100,000.00	95,841.83	
		LANDER 2.625% 02/27/30	100,000.00	100,524.81	
		MADRID 0.16% 07/30/28	100,000.00	93,705.50	
		MADRID 0.827% 07/30/27	100,000.00	97,455.30	
		MADRID 3.462% 04/30/34	200,000.00	204,202.90	
		MADRID 3.596% 04/30/33	100,000.00	103,550.95	
		NIESA 0.05% 03/09/35	100,000.00	75,847.72	
		NIESA 0% 02/11/27	100,000.00	96,891.36	
		NIESA 1.125% 09/12/33	100,000.00	87,534.20	
		NIESA 2.75% 02/17/31	300,000.00	302,381.22	
		NRW 0.375% 09/02/50	100,000.00	45,846.42	
		NRW 0.5% 11/25/39	100,000.00	67,873.82	
		NRW 0.6% 06/04/41	100,000.00	65,458.86	
		NRW 0% 10/12/35	100,000.00	73,304.69	
		NRW 1.45% 01/19/22	200,000.00	82,267.00	
		NRW 1.65% 05/16/47	100,000.00	70,617.63	
		NRW 2.25% 06/14/52	100,000.00	75,532.90	
		NRW 2.65% 01/15/30	300,000.00	302,753.31	
		NRW 2.75% 01/15/32	300,000.00	301,306.05	
		NRW 3.4% 03/07/2073	100,000.00	90,300.37	
		NRW 3% 01/27/28	200,000.00	204,182.10	
		ONT 0.01% 11/25/30	100,000.00	86,693.00	
		ONT 0.25% 06/09/31	100,000.00	86,231.67	
		Q 0.875% 05/04/27	100,000.00	97,780.20	
		Q 3.125% 03/27/34	200,000.00	199,582.80	
		Q 3% 01/24/33	100,000.00	99,904.90	
		SACHAN 0.125% 06/21/29	100,000.00	91,584.60	

		SACHAN 3.15% 02/06/54	200,000.00	180,612.02	
	ユーロ 小計		7,100,000.00	6,396,950.12 (1,095,349,769)	
	オーストラリアドル	ALTA 5.2% 05/15/34	200,000.00	202,832.00	
		NSWTC 1.25% 11/20/30	400,000.00	347,028.00	
		NSWTC 1.5% 02/20/32	100,000.00	83,525.00	
		NSWTC 2.25% 05/07/41	300,000.00	199,071.00	
		NSWTC 2% 03/08/33	100,000.00	83,198.00	
		NSWTC 3% 04/20/29	400,000.00	389,336.00	
		NSWTC 3% 05/20/27	200,000.00	198,108.00	
		NSWTC 3% 11/15/28	100,000.00	97,902.00	
		NSWTC 4.25% 02/20/36	400,000.00	373,476.00	
		NSWTC 4.75% 02/20/35	200,000.00	197,712.00	
		NSWTC 4.75% 02/20/37	100,000.00	96,109.00	
		NZLGFA 4.4% 09/08/27	400,000.00	404,892.00	
		NZLGFA 4.7% 08/01/28	200,000.00	204,302.00	
		QTC 1.5% 03/02/32	300,000.00	249,801.00	
		QTC 1.5% 08/20/32	200,000.00	163,234.00	
		QTC 1.75% 07/20/34	100,000.00	76,975.00	
		QTC 2.25% 10/28/50	100,000.00	53,338.00	
		QTC 2% 08/22/33	200,000.00	163,186.00	
		QTC 3.25% 07/21/28	200,000.00	197,726.00	
		QTC 4.5% 03/09/33	100,000.00	99,392.00	
		QTC 4.5% 08/22/35	200,000.00	191,208.00	
		QTC 4.75% 02/02/34	200,000.00	199,478.00	
		QTC 5% 07/21/37	200,000.00	194,364.00	
		TCV 1.25% 11/19/27	300,000.00	284,397.00	
		TCV 1.5% 09/10/31	600,000.00	508,014.00	
		TCV 1.5% 11/20/30	200,000.00	174,794.00	
		TCV 2.25% 09/15/33	400,000.00	332,268.00	
		TCV 2.5% 10/22/29	500,000.00	472,380.00	
		TCV 2% 11/20/37	100,000.00	69,570.00	
		WATC 1.5% 10/22/30	100,000.00	88,238.00	
		WATC 3% 10/21/26	100,000.00	99,450.00	
		WATC 4.25% 07/20/33	200,000.00	196,312.00	
	オーストラリアドル 小計		7,400,000.00	6,691,616.00 (639,250,076)	
地方債証券合計				3,593,482,836 (3,593,482,836)	
特殊債券	アメリカドル	AFDB 0.875% 07/22/26	100,000.00	96,749.35	
		AFDB 4.375% 03/14/28	100,000.00	101,294.20	
		AFDB 5.75% PERP	200,000.00	193,328.62	

		AGFRNC 4.875% 01/16/30	200,000.00	204,692.50	
		AIIB 4.125% 01/18/29	200,000.00	201,370.28	
		AIIB 4.5% 01/16/30	200,000.00	204,554.02	
		ASIA 1.5% 03/04/31	200,000.00	174,659.74	
		ASIA 1.75% 09/19/29	100,000.00	91,760.75	
		ASIA 1.875% 01/24/30	200,000.00	183,099.89	
		ASIA 3.625% 08/28/29	100,000.00	98,978.29	
		ASIA 3.75% 04/25/28	200,000.00	199,460.89	
		ASIA 3.875% 09/28/32	100,000.00	98,126.98	
		ASIA 4% 01/12/33	100,000.00	98,766.05	
		BNG 4.375% 02/11/28	200,000.00	202,295.16	
		CADES 1.375% 01/20/31	200,000.00	172,423.05	
		CADES 3.75% 05/24/28	200,000.00	198,711.24	
		CADES 4.5% 05/22/29	200,000.00	203,298.97	
		CADES 4.75% 01/22/30	200,000.00	205,684.40	
		CAF 5% 01/22/30	200,000.00	205,498.33	
		COE 3.625% 01/26/28	100,000.00	99,397.75	
		COE 4.125% 01/24/29	100,000.00	100,661.05	
		DBJJP 1.25% 10/20/26	300,000.00	288,999.95	
		DBJJP 4.5% 01/30/34	200,000.00	199,349.03	
		EBRD 4.375% 03/09/28	100,000.00	101,242.48	
		EIB 1.375% 03/15/27	400,000.00	383,470.02	
		EIB 1.75% 03/15/29	100,000.00	92,766.81	
		EIB 4.375% 10/10/31	500,000.00	508,837.78	
		EIB 4.5% 03/14/30	200,000.00	204,964.17	
		EIBKOR 1.25% 09/21/30	200,000.00	172,016.16	
		EIBKOR 2.5% 06/29/41	200,000.00	141,006.66	
		EIBKOR 5% 01/11/28	200,000.00	203,516.35	
		EXIMBK 5.5% 01/13/35	200,000.00	204,771.48	
		FFCB 4% 04/01/30	500,000.00	500,746.65	
		FHLB 4% 03/10/27	200,000.00	200,292.48	
		FNMA 0.75% 10/08/27	200,000.00	186,684.40	
		FNMA 1.875% 09/24/26	100,000.00	97,368.71	
		FNMA 5.625% 07/15/37	200,000.00	217,473.52	
		FNMA 7.125% 01/15/30	200,000.00	226,298.70	
		IADB 1.125% 01/13/31	100,000.00	85,776.25	
		IADB 3.5% 09/14/29	100,000.00	98,430.89	
		IADB 4.375% 01/24/44	200,000.00	184,376.84	
		IADB 4.5% 02/15/30	500,000.00	511,774.12	
		IADB 4.5% 09/13/33	200,000.00	203,052.57	
		IBRD 0.875% 07/15/26	100,000.00	96,828.73	
		IBRD 1.125% 09/13/28	200,000.00	183,721.01	

	IBRD 1.375% 04/20/28	100,000.00	93,505.18	
	IBRD 3.125% 06/15/27	500,000.00	492,628.70	
	IBRD 3.5% 07/12/28	100,000.00	98,973.51	
	IBRD 4.75% 11/14/33	200,000.00	206,650.13	
	IDBINV 4.125% 02/15/28	100,000.00	100,402.30	
	IFC 0.75% 08/27/30	100,000.00	85,153.89	
	JBIC 4.375% 01/24/31	500,000.00	504,510.16	
	JBIC 4.375% 10/05/27	200,000.00	201,674.72	
	JICA 3.25% 05/25/27	200,000.00	196,507.59	
	KBN 4% 01/19/28	200,000.00	200,288.69	
	KDB 4.25% 09/08/32	200,000.00	195,323.49	
	KFW 0.75% 09/30/30	100,000.00	85,145.55	
	KFW 1% 10/01/26	500,000.00	482,037.80	
	KFW 3.75% 02/15/28	200,000.00	199,873.84	
	KFW 4.125% 07/15/33	300,000.00	297,917.88	
	KFW 4% 03/15/29	200,000.00	201,097.69	
	KOHNPW 4.625% 07/29/29	200,000.00	200,905.06	
	KORELE 5.375% 07/31/26	200,000.00	201,833.48	
	KORGAS 1.125% 07/13/26	200,000.00	193,625.37	
	KOROIL 4.75% 03/31/30	200,000.00	202,497.68	
	LBANK 1.375% 10/12/28	100,000.00	92,086.75	
	NEDFIN 4.75% 11/15/28	200,000.00	204,439.12	
	NEDWBK 1% 05/28/30	200,000.00	173,115.67	
	NEDWBK 4% 06/01/28	200,000.00	200,271.10	
	NIB 3.375% 09/08/27	200,000.00	197,879.93	
	NIB 4.25% 02/28/29	200,000.00	202,259.05	
	OKB 3.625% 09/09/27	200,000.00	198,950.55	
	OKB 4.125% 01/18/29	200,000.00	201,799.80	
	SDBC 2% 02/16/27	200,000.00	193,599.38	
	SEK 2.25% 03/22/27	200,000.00	194,231.54	
	TVA 3.875% 03/15/28	200,000.00	200,084.94	
	TVA 4.25% 09/15/65	100,000.00	79,389.71	
	TVA 7.125% 05/01/30	200,000.00	227,513.59	
アメリカドル 小計		15,700,000.00	15,434,751.11 (2,251,775,839)	
カナダドル	ASIA 1.5% 05/04/28	100,000.00	96,356.93	
	ASIA 4.65% 02/16/27	200,000.00	205,963.63	
	CANHOU 1.1% 03/15/31	200,000.00	178,658.14	
	CANHOU 1.1% 12/15/26	400,000.00	391,232.94	
	CANHOU 1.4% 03/15/31	300,000.00	272,632.53	
	CANHOU 1.75% 06/15/30	300,000.00	282,101.24	
	CANHOU 2.15% 12/15/31	100,000.00	93,502.97	
	CANHOU 2.65% 12/15/28	100,000.00	99,348.78	

		CANHOU 3.1% 06/15/28	100,000.00	100,842.82	
		CANHOU 3.5% 12/15/34	400,000.00	395,772.90	
		CANHOU 3.55% 09/15/32	200,000.00	202,141.25	
		CANHOU 3.6% 12/15/27	300,000.00	306,030.87	
		CANHOU 3.65% 06/15/33	100,000.00	101,146.03	
		CANHOU 3.8% 06/15/27	100,000.00	102,065.25	
		CANHOU 3.95% 06/15/28	200,000.00	206,443.77	
		CANHOU 4.15% 06/15/33	200,000.00	209,165.20	
		CANHOU 4.25% 03/15/34	600,000.00	630,398.14	
		IBRD 4.25% 09/18/30	100,000.00	105,153.36	
		KFW 4.25% 09/19/28	100,000.00	103,899.40	
		QHEL 2% 09/01/28	100,000.00	97,305.15	
		QHEL 3.4% 09/01/29	200,000.00	202,593.44	
		QHEL 4% 02/15/55	100,000.00	90,895.60	
		QHEL 4% 02/15/63	400,000.00	361,867.62	
		QHEL 5% 02/15/50	100,000.00	105,920.28	
	カナダドル 小計		5,000,000.00	4,941,438.24 (527,103,217)	
	ユーロ	AFDB 0.5% 03/22/27	100,000.00	97,602.89	
		AFDB 2.25% 09/14/29	100,000.00	99,446.69	
		AGFRNC 0.125% 09/29/31	100,000.00	83,672.45	
		AGFRNC 3.5% 02/25/33	200,000.00	203,997.44	
		AGFRNC 3.625% 01/20/35	200,000.00	202,705.70	
		AGFRNC 3.75% 02/15/27	100,000.00	102,533.25	
		ASFING 0.125% 06/02/31	100,000.00	86,276.85	
		ASIA 0.025% 01/31/30	100,000.00	89,559.03	
		ASIA 1.95% 07/22/32	200,000.00	189,868.94	
		BNG 0.01% 10/05/32	200,000.00	163,643.20	
		BNG 0.125% 07/09/35	100,000.00	74,811.55	
		BNG 0.75% 01/24/29	100,000.00	94,707.37	
		BNG 0.805% 06/28/49	100,000.00	54,210.37	
		BNG 1.25% 03/30/37	100,000.00	80,714.60	
		BNG 2.75% 10/04/27	100,000.00	101,389.20	
		BNG 3% 04/23/30	100,000.00	102,188.75	
		CADES 0.45% 01/19/32	300,000.00	257,100.75	
		CADES 0% 02/25/28	300,000.00	283,234.89	
		CADES 0% 05/25/29	100,000.00	90,919.31	
		CADES 0% 05/25/31	100,000.00	85,038.00	
		CADES 2.75% 09/24/27	200,000.00	202,704.14	
		CADES 2.75% 11/25/32	100,000.00	98,092.60	
		CADES 2.875% 05/25/27	100,000.00	101,554.60	
		CADES 3.125% 03/01/30	200,000.00	204,553.94	

		CAF 3.625% 02/13/30	200,000.00	205,559.24	
		COE 0.25% 01/19/32	100,000.00	85,385.09	
		COE 1% 04/13/29	100,000.00	95,185.00	
		DBHNGR 1.125% 05/29/51	100,000.00	55,897.00	
		DBHNGR 1.875% 05/24/30	100,000.00	97,139.15	
		DBHNGR 3.25% 05/19/33	200,000.00	205,491.00	
		DBHNGR 4% 11/23/43	200,000.00	206,682.60	
		DBJJP 3.125% 04/13/28	100,000.00	102,071.40	
		EDC 2.625% 01/18/29	200,000.00	201,691.30	
		EDF 3.875% 01/12/27	100,000.00	101,997.00	
		EDF 4.375% 10/12/29	200,000.00	211,742.40	
		EDF 4.625% 01/25/43	100,000.00	100,319.96	
		EFSF 0.05% 10/17/29	100,000.00	90,632.35	
		EFSF 0.7% 01/17/53	200,000.00	98,659.58	
		EFSF 0.875% 04/10/35	100,000.00	82,504.60	
		EFSF 0.875% 09/05/28	100,000.00	96,097.40	
		EFSF 0% 01/20/31	100,000.00	86,957.42	
		EFSF 0% 07/20/26	300,000.00	294,136.80	
		EFSF 1.75% 07/17/53	200,000.00	133,884.45	
		EFSF 2.375% 06/21/32	300,000.00	293,889.39	
		EFSF 2.875% 02/13/34	400,000.00	400,177.56	
		EFSF 2.875% 02/16/33	200,000.00	201,951.52	
		EFSF 3% 09/04/34	42,000.00	42,288.47	
		EIB 0.01% 05/15/41	500,000.00	294,091.99	
		EIB 0.01% 11/15/35	100,000.00	73,863.77	
		EIB 0.05% 10/13/34	100,000.00	77,316.19	
		EIB 0.05% 11/15/29	100,000.00	90,528.68	
		EIB 0.2% 03/17/36	300,000.00	224,050.98	
		EIB 0.25% 01/20/32	100,000.00	85,796.16	
		EIB 0.25% 06/15/40	100,000.00	63,582.23	
		EIB 0.375% 09/15/27	100,000.00	96,564.32	
		EIB 0.625% 01/22/29	100,000.00	94,563.55	
		EIB 0% 05/15/28	200,000.00	188,565.90	
		EIB 0% 06/17/27	100,000.00	96,284.50	
		EIB 0% 09/09/30	100,000.00	88,123.05	
		EIB 2.75% 01/16/34	200,000.00	198,958.11	
		EIB 2.75% 07/28/28	100,000.00	101,868.42	
		EIB 2.875% 10/15/31	500,000.00	507,552.95	
		EIB 3.625% 03/14/42	100,000.00	101,853.79	
		EIB 3% 07/15/33	300,000.00	304,780.41	
		ESM 0.01% 10/15/31	100,000.00	85,281.68	
		ESM 0.5% 03/05/29	200,000.00	187,760.00	
		ESM 0% 12/15/26	200,000.00	194,654.40	

		ESM 3% 03/15/28	200,000.00	204,792.90	
		ESM 3% 08/23/33	100,000.00	101,623.44	
		EU 0.25% 04/22/36	100,000.00	73,624.12	
		EU 0.3% 11/04/50	200,000.00	91,374.99	
		EU 0.4% 02/04/37	100,000.00	73,145.64	
		EU 0.45% 05/02/46	700,000.00	379,547.06	
		EU 0.45% 07/04/41	200,000.00	125,250.37	
		EU 0.7% 07/06/51	400,000.00	200,638.99	
		EU 0.75% 01/04/47	100,000.00	57,983.66	
		EU 0% 07/04/31	500,000.00	428,466.36	
		EU 0% 07/04/35	400,000.00	295,458.52	
		EU 0% 07/06/26	100,000.00	98,144.76	
		EU 0% 10/04/28	800,000.00	745,658.99	
		EU 0% 10/04/30	100,000.00	87,952.50	
		EU 1.125% 06/04/37	500,000.00	396,355.09	
		EU 1.625% 12/04/29	500,000.00	484,127.50	
		EU 1% 07/06/32	100,000.00	88,997.07	
		EU 2.5% 10/04/52	100,000.00	77,182.97	
		EU 2.625% 02/04/48	100,000.00	83,109.13	
		EU 2.625% 07/04/28	300,000.00	303,936.81	
		EU 2.75% 02/04/33	100,000.00	99,551.50	
		EU 2.75% 10/05/26	500,000.00	505,008.10	
		EU 2.75% 12/04/37	200,000.00	188,621.55	
		EU 2.875% 12/06/27	500,000.00	509,393.35	
		EU 2% 10/04/27	100,000.00	99,934.00	
		EU 3.125% 12/04/30	500,000.00	514,616.00	
		EU 3.25% 07/04/34	500,000.00	509,958.35	
		EU 3.375% 10/04/39	200,000.00	197,447.06	
		EU 3.375% 10/05/54	200,000.00	181,335.31	
		EU 3.375% 11/04/42	400,000.00	387,026.70	
		EU 4% 04/04/44	200,000.00	207,942.56	
		EUROF 0.01% 06/23/28	100,000.00	93,329.90	
		EUROF 0.15% 10/10/34	100,000.00	76,769.24	
		EUROF 2.875% 01/31/35	200,000.00	195,172.88	
		IBRD 0.01% 04/24/28	300,000.00	282,745.65	
		IBRD 0.1% 09/17/35	100,000.00	74,196.37	
		IBRD 0.2% 01/21/61	100,000.00	32,429.49	
		IBRD 0.25% 01/10/50	200,000.00	92,584.32	
		IBRD 0.5% 04/16/30	100,000.00	91,092.62	
		IBRD 0.7% 10/22/46	100,000.00	58,143.35	
		IBRD 0% 01/15/27	100,000.00	97,020.10	
		IBRD 0% 02/21/30	200,000.00	178,588.30	

		IBRD 2.9% 01/19/33	100,000.00	100,717.39	
		IBRD 3.1% 04/14/38	100,000.00	98,014.09	
		ICO 3.05% 10/31/27	200,000.00	204,198.18	
		IDAWBG 0.7% 01/17/42	100,000.00	65,259.44	
		IDAWBG 1.75% 05/05/37	100,000.00	85,343.74	
		IDAWBG 2.5% 01/15/38	100,000.00	91,875.51	
		IDBINV 3.125% 06/07/30	200,000.00	204,678.40	
		IDBINV 3.125% 11/15/27	100,000.00	102,037.80	
		JBIC 3.125% 02/15/28	100,000.00	102,170.26	
		KDB 3.375% 05/23/28	200,000.00	205,645.54	
		KFW 0.125% 01/09/32	300,000.00	255,900.84	
		KFW 0.375% 05/20/36	100,000.00	76,305.77	
		KFW 0% 01/10/31	200,000.00	174,534.50	
		KFW 0% 03/31/27	100,000.00	96,735.50	
		KFW 0% 09/30/26	100,000.00	97,707.25	
		KFW 1.25% 06/30/27	200,000.00	197,178.50	
		KFW 2.375% 10/04/29	500,000.00	501,576.25	
		KFW 2.5% 10/15/31	300,000.00	298,875.17	
		KFW 2.625% 01/10/34	400,000.00	395,165.54	
		KFW 2.75% 02/14/33	100,000.00	100,328.71	
		KFW 2.75% 03/15/28	800,000.00	813,955.20	
		KFW 2% 11/15/29	100,000.00	98,658.17	
		LBANK 0.375% 02/25/27	100,000.00	97,367.53	
		LBANK 0.75% 03/16/32	100,000.00	88,100.07	
		NEDFIN 0.125% 04/03/27	100,000.00	96,836.20	
		NEDWBK 0.5% 04/26/51	100,000.00	47,150.90	
		NEDWBK 0.75% 10/04/41	100,000.00	65,375.97	
		NEDWBK 0% 02/16/37	300,000.00	206,508.15	
		NIB 2.5% 01/30/30	100,000.00	100,224.07	
		NRWBK 0.1% 07/09/35	100,000.00	74,586.96	
		NRWBK 0.75% 06/30/28	100,000.00	95,616.17	
		NRWBK 0% 05/14/29	100,000.00	91,131.47	
		NRWBK 1.25% 05/13/49	100,000.00	60,603.91	
		NRWBK 1.625% 08/03/32	100,000.00	92,666.10	
		NRWBK 2.875% 04/05/33	100,000.00	100,126.87	
		OKB 1.5% 07/13/27	100,000.00	98,900.10	
		RENTEN 0.01% 11/26/40	100,000.00	60,104.57	
		RENTEN 0.05% 01/31/31	100,000.00	87,210.21	
		RENTEN 0.1% 03/08/27	100,000.00	96,933.16	
		RENTEN 0% 12/13/28	100,000.00	92,614.35	
		RENTEN 2.75% 02/16/32	200,000.00	201,332.20	
		RENTEN 3.25% 09/06/30	500,000.00	518,035.00	
		RENTEN 3% 11/14/34	100,000.00	100,942.63	

	RESFER 0.875% 01/22/29	400,000.00	377,037.60	
	RESFER 2.25% 12/20/47	100,000.00	71,193.20	
	RESFER 3.125% 10/25/28	100,000.00	101,757.27	
	SBAB 0.5% 02/08/27	200,000.00	194,749.79	
	SEK 2.75% 09/05/31	200,000.00	199,630.75	
	SEK 3% 02/05/35	200,000.00	197,331.00	
	SNCF 0.625% 04/17/30	100,000.00	90,535.75	
	SNCF 1% 01/19/61	100,000.00	37,680.10	
	SNCF 3.375% 05/25/33	200,000.00	201,824.80	
ユーロ 小計		30,242,000.00	27,178,154.44 (4,653,715,384)	
イギリスポンド	AIIB 1.125% 09/15/26	100,000.00	96,698.75	
	ASIA 0.75% 12/07/27	100,000.00	92,818.00	
	BNG 0.5% 12/21/26	100,000.00	95,201.75	
	DEXGRP 0.25% 12/10/26	100,000.00	94,935.71	
	EIB 0.75% 07/22/27	100,000.00	93,989.32	
	EIB 3.875% 04/12/28	200,000.00	199,643.90	
	EIB 4.875% 12/16/30	200,000.00	206,744.10	
	EIB 5.625% 06/07/32	100,000.00	107,684.90	
	IADB 2.125% 12/15/28	100,000.00	94,024.87	
	IADB 5% 07/20/30	100,000.00	103,816.13	
	IBRD 0.25% 07/22/26	100,000.00	96,286.60	
	IFC 3.875% 09/12/30	200,000.00	197,660.66	
	KFW 3.75% 07/30/27	100,000.00	99,646.80	
	KFW 4.875% 02/03/31	100,000.00	103,173.35	
	NEDWBK 0.875% 09/30/26	200,000.00	192,501.70	
	RENTEN 2.125% 12/15/28	100,000.00	94,024.89	
	SNCF 5.875% 01/29/55	100,000.00	98,163.12	
イギリスポンド 小計		2,100,000.00	2,067,014.55 (410,385,068)	
オーストラリアドル	AFDB 3.3% 07/27/27	100,000.00	99,156.00	
	ASIA 4.25% 01/17/28	100,000.00	101,219.00	
	BNG 1.6% 11/27/30	100,000.00	86,758.00	
	BNG 5% 03/13/34	100,000.00	101,879.00	
	EDC 4.5% 09/06/28	100,000.00	102,071.00	
	EIB 1.8% 01/19/27	100,000.00	97,228.00	
	EIB 4.55% 06/02/33	200,000.00	198,644.00	
	EUROF 3.35% 05/21/29	100,000.00	97,290.00	
	IBRD 3% 10/19/26	100,000.00	99,199.00	
	IBRD 4.4% 01/13/28	100,000.00	101,665.00	
	IFC 1.25% 02/06/31	100,000.00	84,986.00	
	KBN 5.25% 04/18/34	200,000.00	206,854.00	

	KFW 4.3% 07/13/27	100,000.00	101,285.00	
	NEDWBK 3.3% 05/02/29	200,000.00	194,866.00	
	NIB 4.1% 06/08/28	100,000.00	100,556.00	
	RENTEN 2.6% 03/23/27	100,000.00	98,264.00	
オーストラリアドル 小計		1,900,000.00	1,871,920.00 (178,824,517)	
オフショア人民元	ADBCH 1.32% 01/07/28	12,000,000.00	11,929,924.20	
	ADBCH 1.59% 05/13/30	4,000,000.00	3,991,357.16	
	ADBCH 1.66% 01/09/35	4,000,000.00	3,966,208.56	
	ADBCH 2.12% 03/12/27	6,000,000.00	6,056,610.00	
	ADBCH 2.3% 07/04/34	2,000,000.00	2,090,318.40	
	ADBCH 2.5% 08/24/27	5,000,000.00	5,097,404.50	
	ADBCH 2.57% 09/13/28	5,000,000.00	5,150,770.50	
	ADBCH 2.63% 06/07/28	6,000,000.00	6,178,678.20	
	ADBCH 2.74% 02/23/27	2,000,000.00	2,038,245.80	
	ADBCH 2.83% 08/11/29	7,000,000.00	7,348,868.80	
	ADBCH 2.85% 10/20/33	3,500,000.00	3,793,271.30	
	ADBCH 2.9% 03/08/28	2,000,000.00	2,068,998.80	
	ADBCH 2.91% 02/21/29	2,000,000.00	2,093,892.40	
	ADBCH 2.97% 10/14/32	2,000,000.00	2,169,173.60	
	ADBCH 2.99% 08/11/26	5,000,000.00	5,080,626.50	
	ADBCH 3.01% 03/16/30	1,500,000.00	1,591,230.90	
	ADBCH 3.06% 06/06/32	4,000,000.00	4,348,116.00	
	ADBCH 3.1% 02/27/33	5,000,000.00	5,483,598.50	
	ADBCH 3.19% 08/12/28	2,000,000.00	2,104,453.00	
	ADBCH 3.3% 11/05/31	2,000,000.00	2,189,932.00	
	ADBCH 3.52% 05/24/31	5,000,000.00	5,508,224.00	
	ADBCH 3.79% 10/26/30	2,000,000.00	2,212,713.20	
	ADBCH 3.92% 06/18/51	1,000,000.00	1,403,382.60	
	ADBCH 3.95% 02/26/36	1,000,000.00	1,210,501.00	
	EXIMCH 2.44% 04/12/34	4,000,000.00	4,220,372.80	
	EXIMCH 2.5% 08/04/28	3,000,000.00	3,081,768.00	
	EXIMCH 2.61% 01/27/27	4,000,000.00	4,065,402.40	
	EXIMCH 2.82% 06/17/27	8,000,000.00	8,194,141.60	
	EXIMCH 2.87% 02/06/28	5,000,000.00	5,163,547.00	
	EXIMCH 2.9% 08/19/32	4,000,000.00	4,313,535.20	
	EXIMCH 3.1% 02/13/33	2,000,000.00	2,191,605.80	
	EXIMCH 3.18% 03/11/32	5,000,000.00	5,459,541.00	
	EXIMCH 3.23% 03/23/30	6,000,000.00	6,425,334.00	
	EXIMCH 3.38% 07/16/31	2,000,000.00	2,190,795.20	
	EXIMCH 3.74% 11/16/30	3,000,000.00	3,315,063.00	
	EXIMCH 3.86% 05/20/29	5,000,000.00	5,414,300.00	
	EXIMCH 3.88% 01/12/36	1,000,000.00	1,198,073.50	

		SDBC 1.27% 01/06/30	7,000,000.00	6,904,927.61	
		SDBC 1.57% 01/03/35	3,000,000.00	2,959,072.65	
		SDBC 1.8% 09/02/27	2,000,000.00	2,011,685.60	
		SDBC 2.25% 07/06/26	4,000,000.00	4,030,892.40	
		SDBC 2.26% 07/19/34	4,000,000.00	4,171,838.40	
		SDBC 2.3% 02/22/29	4,000,000.00	4,100,368.40	
		SDBC 2.35% 05/06/34	6,500,000.00	6,819,665.45	
		SDBC 2.63% 01/08/34	3,000,000.00	3,208,710.00	
		SDBC 2.65% 02/24/27	3,000,000.00	3,053,289.00	
		SDBC 2.69% 06/16/27	3,000,000.00	3,065,452.80	
		SDBC 2.73% 01/11/28	3,000,000.00	3,085,978.50	
		SDBC 2.82% 05/22/33	6,000,000.00	6,477,817.80	
		SDBC 2.83% 09/10/26	8,000,000.00	8,123,640.00	
		SDBC 2.96% 07/18/32	2,000,000.00	2,164,339.00	
		SDBC 2.98% 04/22/32	2,000,000.00	2,162,858.80	
		SDBC 2.99% 03/01/29	2,000,000.00	2,096,741.00	
		SDBC 3.02% 03/06/33	7,000,000.00	7,642,628.00	
		SDBC 3.03% 07/24/43	5,000,000.00	5,860,356.50	
		SDBC 3.07% 03/10/30	7,000,000.00	7,444,253.60	
		SDBC 3.09% 06/18/30	2,000,000.00	2,136,191.40	
		SDBC 3.09% 08/09/28	5,000,000.00	5,225,056.00	
		SDBC 3.12% 09/13/31	2,000,000.00	2,166,521.00	
		SDBC 3.4% 01/08/28	5,000,000.00	5,223,579.00	
		SDBC 3.41% 06/07/31	4,000,000.00	4,386,658.80	
		SDBC 3.43% 01/14/27	13,000,000.00	13,366,588.30	
		SDBC 3.45% 09/20/29	7,000,000.00	7,499,157.40	
		SDBC 3.49% 11/08/41	3,000,000.00	3,671,130.00	
		SDBC 3.5% 11/04/46	2,000,000.00	2,552,783.80	
		SDBC 3.65% 05/21/29	4,000,000.00	4,302,926.00	
		SDBC 3.66% 03/01/31	2,000,000.00	2,212,808.20	
		SDBC 3.7% 10/20/30	8,000,000.00	8,821,597.60	
		SDBC 3.8% 01/25/36	2,000,000.00	2,386,685.20	
		SDBC 3% 01/17/32	8,000,000.00	8,638,068.80	
		SDBC 4.04% 07/06/28	2,000,000.00	2,142,698.20	
	オフショア人民元 小計		293,500,000.00	310,456,944.63 (6,307,305,378)	
特殊債券合計				14,329,109,403 (14,329,109,403)	
社債券	**アメリカドル**	AAPL 1.4% 08/05/28	100,000.00	92,434.54	
		AAPL 2.65% 05/11/50	100,000.00	62,119.76	
		AAPL 2.7% 08/05/51	200,000.00	123,981.17	
		AAPL 3.35% 08/08/32	100,000.00	93,935.18	

		AAPL 3.75% 11/13/47	100,000.00	78,504.39	
		AAPL 4.1% 08/08/62	200,000.00	156,595.11	
		ABBV 4.3% 05/14/36	200,000.00	187,601.46	
		ABBV 4.45% 05/14/46	100,000.00	85,459.46	
		ABBV 5.35% 03/15/44	200,000.00	195,252.48	
		ABC 2.7% 03/15/31	100,000.00	90,042.97	
		ABIBB 4.7% 02/01/36	100,000.00	96,979.42	
		ABIBB 4.9% 02/01/46	100,000.00	91,101.51	
		ABIBB 5.55% 01/23/49	100,000.00	98,830.24	
		ABIBB 5.8% 01/23/59	100,000.00	101,217.87	
		ABIBB 5% 06/15/34	200,000.00	202,622.63	
		ABNANV 2.47% 12/13/29	200,000.00	186,381.91	
		ABNANV 3.324% 03/13/37	200,000.00	175,103.64	
		ABT 1.15% 01/30/28	100,000.00	93,366.51	
		ABT 1.4% 06/30/30	100,000.00	87,727.30	
		ACAFP 5.862% 01/09/36	250,000.00	258,108.31	
		ACGL 3.635% 06/30/50	100,000.00	72,920.56	
		ADBE 2.15% 02/01/27	100,000.00	97,060.35	
		ADM 4.5% 08/15/33	100,000.00	97,302.64	
		AEE 1.95% 03/15/27	100,000.00	96,270.39	
		AEE 3.9% 04/01/52	100,000.00	75,472.32	
		AEE 5.2% 04/01/34	200,000.00	202,298.32	
		AEP 3.75% 07/01/47	100,000.00	75,705.42	
		AEP 5.625% 04/01/53	200,000.00	194,894.56	
		AEP 6.2% 03/15/40	100,000.00	103,079.21	
		AER 2.45% 10/29/26	150,000.00	146,009.01	
		AER 3.4% 10/29/33	150,000.00	131,782.45	
		AER 3.85% 10/29/41	150,000.00	119,766.61	
		AER 4.625% 09/10/29	150,000.00	149,747.61	
		AES 5.45% 06/01/28	100,000.00	101,667.98	
		AFL 3.6% 04/01/30	100,000.00	96,750.35	
		AGR 3.8% 06/01/29	100,000.00	97,371.28	
		AIA 5.625% 10/25/27	200,000.00	205,696.91	
		AIG 3.4% 06/30/30	200,000.00	189,660.88	
		AIRFP 3.95% 04/10/47	150,000.00	120,529.05	
		AJG 5.5% 03/02/33	100,000.00	102,606.89	
		AL 3.125% 12/01/30	100,000.00	92,245.79	
		AL 5.3% 02/01/28	200,000.00	204,145.85	
		ALL 1.45% 12/15/30	100,000.00	85,124.16	
		ALLY 4.75% 06/09/27	100,000.00	100,335.49	
		AMG 3.3% 06/15/30	100,000.00	93,650.24	
		AMGN 2% 01/15/32	200,000.00	169,730.80	

		AMGN 3.15% 02/21/40	100,000.00	76,318.99	
		AMGN 3.375% 02/21/50	200,000.00	139,291.88	
		AMGN 5.15% 03/02/28	100,000.00	101,961.65	
		AMGN 5.6% 03/02/43	200,000.00	197,669.94	
		AMGN 5.75% 03/02/63	100,000.00	95,786.02	
		AMP 5.15% 05/15/33	100,000.00	102,076.81	
		AMT 1.875% 10/15/30	100,000.00	86,715.29	
		AMT 2.95% 01/15/51	100,000.00	62,622.16	
		AMT 3.8% 08/15/29	100,000.00	96,880.45	
		AMT 5.65% 03/15/33	100,000.00	103,658.16	
		AMXLMM 2.875% 05/07/30	200,000.00	184,502.73	
		AMZN 3.875% 08/22/37	300,000.00	269,358.67	
		AMZN 4.05% 08/22/47	100,000.00	82,078.29	
		AMZN 4.25% 08/22/57	100,000.00	81,193.01	
		AMZN 4.55% 12/01/27	100,000.00	100,992.96	
		AMZN 4.7% 12/01/32	200,000.00	202,648.33	
		AN 1.95% 08/01/28	100,000.00	92,731.19	
		ANZNZ 3.45% 01/21/28	200,000.00	195,745.85	
		AON 3.75% 05/02/29	300,000.00	292,539.93	
		APD 2.05% 05/15/30	100,000.00	90,057.39	
		APD 2.7% 05/15/40	100,000.00	72,088.83	
		APH 2.2% 09/15/31	100,000.00	87,431.92	
		APP 5.125% 12/01/29	200,000.00	202,774.80	
		ARE 2.75% 12/15/29	100,000.00	92,092.30	
		ARE 3.55% 03/15/52	100,000.00	67,068.29	
		ARE 4.75% 04/15/35	100,000.00	95,392.95	
		ATH 3.95% 05/25/51	100,000.00	69,854.80	
		ATH 5.875% 01/15/34	200,000.00	206,120.48	
		ATH 6.15% 04/03/30	100,000.00	105,701.74	
		ATH 6.625% 10/15/54	200,000.00	198,347.08	
		ATO 5.75% 10/15/52	100,000.00	99,412.39	
		ATO 6.2% 11/15/53	200,000.00	213,353.84	
		AVB 1.9% 12/01/28	100,000.00	92,581.92	
		AVGO 1.95% 02/15/28	100,000.00	94,086.47	
		AVGO 3.137% 11/15/35	200,000.00	167,517.81	
		AVGO 3.469% 04/15/34	200,000.00	177,346.61	
		AVGO 4.15% 04/15/32	100,000.00	95,945.58	
		AVGO 4.926% 05/15/37	200,000.00	193,012.30	
		AVOL 5.75% 03/01/29	200,000.00	205,340.36	
		AXP 2.55% 03/04/27	100,000.00	97,352.19	
		AXP 5.625% 07/28/34	200,000.00	204,463.45	
		AZN 4.85% 02/26/29	200,000.00	203,751.08	
		AZN 4.875% 03/03/33	100,000.00	101,195.36	

		AZO 4% 04/15/30	100,000.00	97,672.56	
		BA 3.25% 02/01/28	200,000.00	193,659.74	
		BA 5.15% 05/01/30	100,000.00	101,625.04	
		BA 5.805% 05/01/50	100,000.00	95,166.44	
		BA 6.388% 05/01/31	100,000.00	107,463.97	
		BABA 2.125% 02/09/31	200,000.00	176,197.38	
		BAC 1.734% 07/22/27	100,000.00	97,154.03	
		BAC 1.898% 07/23/31	100,000.00	87,547.33	
		BAC 2.087% 06/14/29	100,000.00	93,483.01	
		BAC 2.572% 10/20/32	300,000.00	263,587.63	
		BAC 2.676% 06/19/41	100,000.00	70,875.96	
		BAC 2.687% 04/22/32	200,000.00	178,642.49	
		BAC 3.483% 03/13/52	100,000.00	70,651.66	
		BAC 3.946% 01/23/49	300,000.00	233,478.33	
		BAC 4.083% 03/20/51	100,000.00	78,447.70	
		BAC 5.202% 04/25/29	500,000.00	509,413.66	
		BAC 5.468% 01/23/35	200,000.00	204,432.00	
		BAC 5.526% 08/18/26	250,000.00	253,089.04	
		BAC 5.819% 09/15/29	200,000.00	207,814.00	
		BACR 4.942% 09/10/30	200,000.00	201,085.56	
		BACR 5.088% 06/20/30	200,000.00	200,480.17	
		BACR 7.385% 11/02/28	200,000.00	211,763.76	
		BALN 3.4% 04/15/30	200,000.00	190,610.65	
		BATSLN 3.734% 09/25/40	100,000.00	78,589.84	
		BATSLN 4.54% 08/15/47	100,000.00	80,775.33	
		BATSLN 7.75% 10/19/32	200,000.00	230,420.92	
		BAX 1.915% 02/01/27	100,000.00	96,213.88	
		BAYNGR 4.4% 07/15/44	200,000.00	154,877.44	
		BAYNGR 4.7% 07/15/64	100,000.00	74,350.46	
		BDX 4.298% 08/22/32	100,000.00	96,613.19	
		BDX 4.693% 02/13/28	100,000.00	100,808.77	
		BFB 4.75% 04/15/33	100,000.00	99,579.02	
		BFCM 4.753% 07/13/27	200,000.00	201,218.96	
		BFCM 5.538% 01/22/30	200,000.00	206,222.78	
		BG 2.75% 05/14/31	100,000.00	90,330.66	
		BHF 5.625% 05/15/30	100,000.00	102,005.47	
		BHI 4.08% 12/15/47	100,000.00	78,131.94	
		BHP 4.75% 02/28/28	100,000.00	101,283.84	
		BIIB 3.15% 05/01/50	100,000.00	62,633.50	
		BK 4.596% 07/26/30	100,000.00	100,771.50	
		BK 5.188% 03/14/35	200,000.00	201,729.02	
		BK 5.834% 10/25/33	100,000.00	105,587.84	

		BKH 3.05% 10/15/29	200,000.00	186,706.87	
		BKH 3.875% 10/15/49	100,000.00	72,025.43	
		BKH 6.15% 05/15/34	200,000.00	209,322.72	
		BKNG 4.625% 04/13/30	100,000.00	100,852.32	
		BLK 1.9% 01/28/31	100,000.00	87,780.73	
		BMO 4.7% 09/14/27	100,000.00	100,647.12	
		BMW 3.45% 04/01/27	100,000.00	98,331.30	
		BMY 2.95% 03/15/32	100,000.00	90,330.34	
		BMY 3.55% 03/15/42	200,000.00	156,975.26	
		BMY 4.25% 10/26/49	100,000.00	80,200.21	
		BMY 4.625% 05/15/44	100,000.00	87,922.80	
		BMY 4.9% 02/22/29	200,000.00	204,102.91	
		BNP 1.904% 09/30/28	200,000.00	188,328.35	
		BNP 2.159% 09/15/29	200,000.00	185,128.02	
		BNP 5.738% 02/20/35	200,000.00	206,140.84	
		BNS 4.588% 05/04/37	100,000.00	94,477.89	
		BNS 4.932% 02/14/29	200,000.00	202,248.67	
		BNSF 2.875% 06/15/52	100,000.00	62,687.48	
		BNSF 3.05% 02/15/51	100,000.00	65,978.05	
		BNSF 4.05% 06/15/48	100,000.00	80,293.24	
		BNSF 4.9% 04/01/44	100,000.00	93,194.76	
		BOCAVI 2.625% 09/17/30	200,000.00	182,921.81	
		BOCAVI 4.875% 05/03/33	200,000.00	200,485.13	
		BPCEGP 3.116% 10/19/32	250,000.00	217,906.24	
		BPLN 3.001% 03/17/52	100,000.00	62,329.18	
		BPLN 3.06% 06/17/41	200,000.00	147,175.27	
		BPLN 3.543% 04/06/27	100,000.00	98,853.03	
		BPLN 4.893% 09/11/33	100,000.00	99,543.62	
		BRITEL 3.25% 11/08/29	200,000.00	188,994.14	
		BRK 2.3% 03/15/27	100,000.00	97,335.56	
		BRK 2.875% 03/15/32	100,000.00	91,588.51	
		BRKHEC 2.85% 05/15/51	100,000.00	60,904.36	
		BRKHEC 3.65% 04/15/29	100,000.00	97,693.59	
		BRKHEC 3.7% 07/15/30	100,000.00	96,709.05	
		BRKHEC 3.95% 08/01/47	100,000.00	78,722.93	
		BRKHEC 4.45% 01/15/49	100,000.00	82,117.31	
		BRKHEC 5.3% 02/01/55	100,000.00	94,104.35	
		BRKHEC 5.35% 01/15/34	100,000.00	102,684.43	
		BRO 4.2% 03/17/32	200,000.00	190,560.71	
		BSX 2.65% 06/01/30	200,000.00	184,516.89	
		BXP 3.25% 01/30/31	100,000.00	91,612.50	
		BXP 3.4% 06/21/29	100,000.00	94,850.81	
		BZLNZ 4.846% 02/07/28	250,000.00	253,137.75	

		C 2.904% 11/03/42	100,000.00	70,443.38	
		C 3.668% 07/24/28	100,000.00	98,307.74	
		C 4.65% 07/23/48	200,000.00	171,624.14	
		C 4.658% 05/24/28	200,000.00	200,287.03	
		C 4.75% 05/18/46	100,000.00	85,811.68	
		C 4.786% 03/04/29	200,000.00	201,014.50	
		C 5.592% 11/19/34	200,000.00	202,624.56	
		C 5.827% 02/13/35	200,000.00	203,097.84	
		C 5.875% 01/30/42	300,000.00	307,403.93	
		C 6.27% 11/17/33	200,000.00	213,756.33	
		CABKSM 5.673% 03/15/30	200,000.00	206,174.80	
		CABKSM 6.684% 09/13/27	200,000.00	204,542.45	
		CAG 1.375% 11/01/27	100,000.00	93,120.43	
		CAG 5.3% 10/01/26	200,000.00	201,693.56	
		CAG 5.3% 11/01/38	100,000.00	94,940.68	
		CARGIL 3.25% 05/23/29	100,000.00	96,349.05	
		CARR 3.577% 04/05/50	200,000.00	146,478.07	
		CAT 3.25% 04/09/50	100,000.00	69,365.72	
		CAT 3.6% 08/12/27	100,000.00	98,865.63	
		CAT 4.85% 02/27/29	200,000.00	203,951.75	
		CB 1.375% 09/15/30	100,000.00	86,503.49	
		CB 2.85% 12/15/51	100,000.00	63,629.49	
		CBAAU 3.305% 03/11/41	200,000.00	146,676.04	
		CBAAU 3.9% 03/16/28	200,000.00	198,848.49	
		CCI 1.05% 07/15/26	100,000.00	96,463.55	
		CCI 3.25% 01/15/51	100,000.00	65,194.11	
		CCI 4.8% 09/01/28	100,000.00	100,465.67	
		CDEL 5.125% 02/02/33	200,000.00	194,779.54	
		CDEL 5.95% 01/08/34	200,000.00	203,659.97	
		CDEL 6.44% 01/26/36	200,000.00	208,717.18	
		CDW 5.55% 08/22/34	100,000.00	100,270.00	
		CEG 5.6% 06/15/42	100,000.00	97,567.19	
		CENEXP 1.169% 08/21/26	200,000.00	192,517.73	
		CHD 5.6% 11/15/32	100,000.00	104,885.98	
		CHH 3.7% 01/15/31	100,000.00	92,750.96	
		CHTR 2.25% 01/15/29	100,000.00	91,932.48	
		CHTR 2.8% 04/01/31	200,000.00	177,487.23	
		CHTR 3.5% 06/01/41	100,000.00	71,723.37	
		CHTR 3.9% 06/01/52	100,000.00	67,566.68	
		CHTR 4.4% 04/01/33	100,000.00	93,831.23	
		CHTR 5.5% 04/01/63	100,000.00	83,424.72	
		CHTR 5.75% 04/01/48	100,000.00	89,458.12	

		CI 2.375% 03/15/31	100,000.00	88,674.47	
		CI 4.8% 07/15/46	200,000.00	172,605.52	
		CI 4.8% 08/15/38	100,000.00	93,143.60	
		CITNAT 4.625% 04/21/28	200,000.00	201,631.11	
		CL 4.6% 03/01/33	100,000.00	100,661.81	
		CLR 5.75% 01/15/31	100,000.00	100,964.82	
		CLX 1.8% 05/15/30	100,000.00	88,074.40	
		CM 3.6% 04/07/32	100,000.00	92,964.16	
		CMCSA 2.65% 02/01/30	100,000.00	92,731.58	
		CMCSA 2.8% 01/15/51	100,000.00	59,473.49	
		CMCSA 3.25% 11/01/39	100,000.00	77,841.64	
		CMCSA 3.9% 03/01/38	100,000.00	86,227.47	
		CMCSA 4% 03/01/48	100,000.00	76,907.94	
		CMCSA 5.35% 05/15/53	100,000.00	92,011.66	
		CMCSA 5.35% 11/15/27	200,000.00	204,872.71	
		CMCSA 5.5% 05/15/64	100,000.00	92,524.95	
		CME 4.15% 06/15/48	100,000.00	83,559.60	
		CMS 4.75% 06/01/50	100,000.00	97,311.90	
		CNA 2.05% 08/15/30	100,000.00	87,742.57	
		CNC 4.625% 12/15/29	200,000.00	190,790.49	
		CNP 2.65% 06/01/31	100,000.00	88,853.45	
		CNP 7% 02/15/55	100,000.00	104,691.80	
		CNQCN 2.95% 07/15/30	100,000.00	91,460.39	
		CNRCN 2.45% 05/01/50	100,000.00	58,636.54	
		COF 3.273% 03/01/30	100,000.00	95,464.29	
		COF 4.927% 05/10/28	100,000.00	100,637.13	
		COF 5.268% 05/10/33	100,000.00	100,356.55	
		COF 5.7% 02/01/30	200,000.00	206,324.45	
		COP 3.8% 03/15/52	100,000.00	71,908.06	
		COP 4.875% 10/01/47	300,000.00	266,015.76	
		COST 1.375% 06/20/27	100,000.00	95,231.08	
		CP 3% 12/02/41	100,000.00	72,190.02	
		CP 4.95% 08/15/45	100,000.00	91,198.02	
		CPB 2.375% 04/24/30	100,000.00	90,152.24	
		CPPIBC 3.25% 06/15/27	250,000.00	246,627.24	
		CRM 1.5% 07/15/28	100,000.00	92,750.06	
		CSCO 2.5% 09/20/26	100,000.00	98,110.45	
		CSCO 5.05% 02/26/34	200,000.00	203,565.51	
		CSX 3.8% 03/01/28	100,000.00	98,879.37	
		CSX 4.1% 11/15/32	100,000.00	96,443.41	
		CSX 5.2% 11/15/33	200,000.00	205,506.28	
		CTRA 5.4% 02/15/35	100,000.00	98,388.89	
		CVECN 2.65% 01/15/32	100,000.00	86,311.16	

		CVS 1.75% 08/21/30	100,000.00	86,240.77	
		CVS 4.125% 04/01/40	43,000.00	35,693.15	
		CVS 4.78% 03/25/38	100,000.00	91,286.08	
		CVS 5.125% 02/21/30	200,000.00	203,199.67	
		CVS 5.125% 07/20/45	100,000.00	87,464.48	
		CVS 6% 06/01/44	100,000.00	98,242.30	
		CVS 6% 06/01/63	100,000.00	94,906.79	
		CVX 2.236% 05/11/30	200,000.00	181,791.04	
		CVX 6% 03/01/41	100,000.00	105,658.64	
		D 2.4% 03/30/32	100,000.00	86,552.57	
		D 3.3% 04/15/41	100,000.00	73,732.02	
		D 3.5% 03/15/27	100,000.00	98,737.15	
		D 5.45% 04/01/53	200,000.00	189,044.55	
		D 7% 06/01/54	100,000.00	107,361.70	
		DAL 3.75% 10/28/29	100,000.00	95,635.75	
		DANBNK 4.298% 04/01/28	200,000.00	198,975.01	
		DB 4.875% 12/01/32	200,000.00	197,700.89	
		DB 7.079% 02/10/34	200,000.00	212,812.12	
		DB 7.146% 07/13/27	300,000.00	307,131.14	
		DD 4.725% 11/15/28	100,000.00	101,334.30	
		DE 2% 06/17/31	100,000.00	87,426.93	
		DE 3.1% 04/15/30	100,000.00	94,695.37	
		DE 4.75% 01/20/28	300,000.00	304,060.91	
		DE 4.85% 06/11/29	100,000.00	102,135.13	
		DELL 3.45% 12/15/51	37,000.00	25,047.95	
		DELL 6.2% 07/15/30	200,000.00	212,914.82	
		DFS 7.964% 11/02/34	100,000.00	115,768.43	
		DG 4.125% 04/03/50	100,000.00	74,721.11	
		DGELN 5.625% 10/05/33	200,000.00	209,550.22	
		DGX 2.8% 06/30/31	100,000.00	90,346.47	
		DHR 3.25% 11/15/39	100,000.00	79,587.98	
		DIS 2.75% 09/01/49	100,000.00	62,477.27	
		DIS 3.5% 05/13/40	100,000.00	81,675.87	
		DIS 3.6% 01/13/51	100,000.00	73,228.97	
		DIS 3.7% 03/23/27	100,000.00	99,485.17	
		DIS 6.2% 12/15/34	100,000.00	111,057.99	
		DIS 6.65% 11/15/37	200,000.00	227,118.65	
		DKS 4.1% 01/15/52	100,000.00	71,304.95	
		DLTR 4.2% 05/15/28	100,000.00	98,880.34	
		DOW 3.6% 11/15/50	100,000.00	67,165.64	
		DOW 6.3% 03/15/33	100,000.00	107,185.34	
		DT 4.375% 06/21/28	150,000.00	150,354.96	

		DT 4.75% 06/21/38	150,000.00	141,444.12	
		DTE 3% 03/01/32	100,000.00	90,386.04	
		DTE 5.4% 04/01/53	100,000.00	96,832.85	
		DTRGR 4.95% 01/13/28	300,000.00	302,705.74	
		DUK 3.3% 06/15/41	200,000.00	148,831.25	
		DUK 3.64% 11/01/46	100,000.00	72,651.91	
		DUK 3.7% 09/01/28	100,000.00	98,531.71	
		DUK 5.25% 03/15/33	100,000.00	102,617.08	
		DUK 5.25% 04/01/33	100,000.00	102,038.43	
		DUK 5.35% 01/15/53	200,000.00	190,465.59	
		DUK 5.55% 03/15/54	200,000.00	194,175.30	
		DUK 5.55% 03/15/55	100,000.00	97,118.89	
		DUK 5% 08/15/52	100,000.00	86,895.72	
		DVN 4.5% 01/15/30	100,000.00	99,150.09	
		EBAY 3.65% 05/10/51	100,000.00	71,864.78	
		EBAY 5.95% 11/22/27	100,000.00	103,609.05	
		ECL 3.95% 12/01/47	100,000.00	78,964.44	
		ECL 5.25% 01/15/28	200,000.00	205,550.51	
		EDF 4.875% 09/21/38	200,000.00	182,930.63	
		EDF 5.7% 05/23/28	200,000.00	205,479.20	
		EDF 6.9% 05/23/53	200,000.00	212,972.87	
		EDF 6% 04/22/64	200,000.00	189,158.85	
		EFX 2.35% 09/15/31	100,000.00	86,830.73	
		EIX 2.25% 06/01/30	100,000.00	87,963.05	
		EIX 4.125% 03/01/48	100,000.00	72,683.45	
		EIX 5.95% 11/01/32	100,000.00	102,560.14	
		EL 4.375% 05/15/28	200,000.00	200,200.54	
		ELV 4.75% 02/15/33	100,000.00	98,688.87	
		ELV 5.125% 02/15/53	100,000.00	88,084.30	
		ELV 5.2% 02/15/35	200,000.00	200,187.80	
		EMN 5.75% 03/08/33	100,000.00	103,831.51	
		EMR 2.2% 12/21/31	100,000.00	87,425.42	
		ENBCN 3.4% 08/01/51	100,000.00	65,456.97	
		ENBCN 5.7% 03/08/33	100,000.00	103,208.47	
		ENBCN 7.2% 06/27/54	100,000.00	103,698.80	
		ENELIM 2.125% 07/12/28	200,000.00	186,631.10	
		ENELIM 2.875% 07/12/41	200,000.00	137,082.16	
		ENELIM 4.75% 05/25/47	200,000.00	168,159.32	
		ENIIM 4.25% 05/09/29	200,000.00	199,058.01	
		EOG 4.375% 04/15/30	100,000.00	99,406.45	
		EPD 3.7% 01/31/51	100,000.00	71,611.03	
		EPD 4.25% 02/15/48	100,000.00	80,275.48	
		EPD 4.85% 01/31/34	100,000.00	98,904.25	

		EPD 7.55% 04/15/38	100,000.00	118,384.99	
		EQH 4.35% 04/20/28	100,000.00	99,594.07	
		EQH 5% 04/20/48	68,000.00	59,672.78	
		EQIX 2.5% 05/15/31	100,000.00	88,499.06	
		EQIX 3% 07/15/50	100,000.00	62,334.26	
		EQNR 3.625% 04/06/40	100,000.00	83,088.06	
		EQNR 3.7% 04/06/50	200,000.00	149,796.94	
		EQR 1.85% 08/01/31	100,000.00	86,015.58	
		ES 3.45% 01/15/50	100,000.00	69,680.72	
		ES 5.45% 03/01/28	100,000.00	102,386.60	
		ES 5.95% 02/01/29	100,000.00	104,238.48	
		ET 4.15% 09/15/29	100,000.00	98,335.16	
		ET 5.55% 02/15/28	100,000.00	102,533.20	
		ET 5.6% 09/01/34	200,000.00	202,257.07	
		ET 5.75% 02/15/33	100,000.00	103,340.08	
		ET 5.8% 06/15/38	100,000.00	99,566.51	
		ET 6% 06/15/48	100,000.00	94,942.15	
		ETR 1.9% 06/15/28	100,000.00	93,392.09	
		ETR 2.35% 06/15/32	200,000.00	171,678.12	
		ETR 2.4% 06/15/31	100,000.00	88,100.31	
		EXC 3.35% 03/15/32	100,000.00	92,119.55	
		EXC 4.1% 03/15/52	100,000.00	75,878.05	
		EXC 5.15% 03/15/28	100,000.00	101,859.98	
		EXC 5.625% 06/15/35	200,000.00	204,791.73	
		EXPE 4.625% 08/01/27	200,000.00	200,548.36	
		F 7.35% 11/04/27	400,000.00	415,440.83	
		FANG 4.4% 03/24/51	100,000.00	77,181.63	
		FANG 5.9% 04/18/64	200,000.00	184,692.59	
		FCX 4.125% 03/01/28	100,000.00	98,421.02	
		FCX 4.25% 03/01/30	100,000.00	97,649.35	
		FDX 2.4% 05/15/31	100,000.00	88,586.51	
		FDX 3.1% 08/05/29	100,000.00	94,369.47	
		FDX 3.25% 05/15/41	200,000.00	142,764.95	
		FDX 4.05% 02/15/48	100,000.00	73,662.32	
		FDX 5.25% 05/15/50	100,000.00	87,905.51	
		FE 4.55% 11/15/30	100,000.00	98,215.36	
		FE 5.95% 12/15/36	100,000.00	103,535.09	
		FI 5.6% 03/02/33	100,000.00	103,263.77	
		FIS 2.25% 03/01/31	100,000.00	87,544.90	
		FIS 3.1% 03/01/41	100,000.00	72,874.02	
		FISV 5.45% 03/02/28	100,000.00	102,349.20	
		FITB 1.707% 11/01/27	100,000.00	96,433.57	

		FITB 4.772% 07/28/30	100,000.00	100,225.22	
		FLEX 6% 01/15/28	100,000.00	103,037.75	
		FMC 3.45% 10/01/29	100,000.00	93,064.13	
		FNF 2.45% 03/15/31	100,000.00	86,833.92	
		FOXA 4.709% 01/25/29	100,000.00	100,560.55	
		FUKOKU 6.8% PERP	200,000.00	209,161.22	
		GBLATL 6.75% 03/15/54	100,000.00	101,684.59	
		GD 2.85% 06/01/41	100,000.00	72,636.33	
		GD 4.25% 04/01/40	100,000.00	88,905.90	
		GE 4.35% 05/01/50	100,000.00	83,177.68	
		GE 4.5% 03/11/44	100,000.00	87,653.45	
		GEHC 5.857% 03/15/30	100,000.00	105,248.08	
		GILD 1.2% 10/01/27	100,000.00	93,699.02	
		GILD 2.8% 10/01/50	100,000.00	62,103.08	
		GILD 5.25% 10/15/33	200,000.00	205,426.35	
		GIS 4.95% 03/29/33	100,000.00	100,185.45	
		GIS 5.5% 10/17/28	100,000.00	103,459.24	
		GLENLN 5.371% 04/04/29	200,000.00	204,597.49	
		GLENLN 6.141% 04/01/55	100,000.00	100,334.75	
		GLW 5.45% 11/15/79	100,000.00	90,173.14	
		GM 3.1% 01/12/32	100,000.00	88,006.96	
		GM 5.05% 04/04/28	100,000.00	100,749.82	
		GM 5.15% 04/01/38	200,000.00	186,213.69	
		GM 5.4% 04/01/48	100,000.00	87,801.62	
		GM 5.4% 10/15/29	100,000.00	102,172.39	
		GM 5.45% 07/15/30	100,000.00	101,365.99	
		GM 5% 04/09/27	100,000.00	100,466.81	
		GMT 3.5% 06/01/32	100,000.00	90,772.79	
		GMT 4% 06/30/30	100,000.00	97,101.10	
		GMT 5.45% 09/15/33	100,000.00	101,583.07	
		GOOGL 1.9% 08/15/40	100,000.00	66,221.96	
		GOOGL 2.05% 08/15/50	100,000.00	55,146.97	
		GPN 2.9% 05/15/30	100,000.00	91,753.11	
		GPN 4.95% 08/15/27	100,000.00	100,894.51	
		GPN 5.95% 08/15/52	100,000.00	95,803.98	
		GRUMAB 5.39% 12/09/34	200,000.00	201,273.53	
		GS 2.6% 02/07/30	100,000.00	92,125.39	
		GS 3.102% 02/24/33	200,000.00	179,230.26	
		GS 3.8% 03/15/30	200,000.00	194,157.02	
		GS 3.85% 01/26/27	100,000.00	99,207.65	
		GS 4.411% 04/23/39	100,000.00	89,624.16	
		GS 4.482% 08/23/28	500,000.00	500,249.22	
		GS 6.484% 10/24/29	400,000.00	423,352.77	

		GS 6.75% 10/01/37	100,000.00	109,086.25	
		GSK 3.375% 06/01/29	100,000.00	96,773.78	
		HAL 2.92% 03/01/30	200,000.00	185,574.23	
		HAS 3.55% 11/19/26	100,000.00	98,602.44	
		HBAN 4.443% 08/04/28	100,000.00	99,763.93	
		HCA 2.375% 07/15/31	100,000.00	86,924.61	
		HCA 3.125% 03/15/27	200,000.00	195,752.02	
		HCA 4.375% 03/15/42	100,000.00	83,251.92	
		HCA 5.6% 04/01/34	200,000.00	204,182.54	
		HCA 5.625% 09/01/28	100,000.00	102,538.14	
		HD 0.9% 03/15/28	100,000.00	92,090.08	
		HD 3.3% 04/15/40	100,000.00	78,953.69	
		HD 3.625% 04/15/52	100,000.00	72,148.05	
		HD 4.95% 06/25/34	200,000.00	200,885.49	
		HES 5.8% 04/01/47	100,000.00	98,624.46	
		HES 7.125% 03/15/33	200,000.00	226,428.99	
		HIG 4.4% 03/15/48	100,000.00	83,563.83	
		HNDA 1.8% 01/13/31	100,000.00	85,543.68	
		HNDA 4.7% 01/12/28	100,000.00	100,722.84	
		HNDA 4.9% 01/10/34	100,000.00	98,277.66	
		HON 2.5% 11/01/26	100,000.00	97,670.59	
		HON 4.5% 01/15/34	300,000.00	291,857.19	
		HPE 5.25% 07/01/28	100,000.00	102,657.98	
		HPE 5% 10/15/34	200,000.00	194,290.45	
		HPQ 4% 04/15/29	100,000.00	97,816.46	
		HSBC 6.161% 03/09/29	200,000.00	207,602.46	
		HSBC 6.5% 05/02/36	200,000.00	210,981.70	
		HSBC 6.5% 09/15/37	100,000.00	104,675.27	
		HSY 2.65% 06/01/50	100,000.00	60,557.10	
		HUM 5.75% 12/01/28	200,000.00	207,415.35	
		HYNMTR 5.4% 03/29/32	200,000.00	202,123.53	
		HYNMTR 5.8% 04/01/30	100,000.00	103,683.96	
		HYUELE 5.5% 01/16/29	200,000.00	205,113.60	
		IBM 3.5% 05/15/29	100,000.00	96,849.27	
		IBM 4.15% 07/27/27	100,000.00	99,801.09	
		IBM 4.5% 02/06/28	200,000.00	201,206.07	
		IBM 4.75% 02/06/33	100,000.00	99,932.48	
		IBM 4.8% 02/10/30	200,000.00	202,427.52	
		IBM 5.1% 02/06/53	100,000.00	90,608.06	
		ICE 2.65% 09/15/40	100,000.00	71,952.00	
		ICE 5.2% 06/15/62	100,000.00	92,851.00	
		IFCCN 5.459% 09/22/32	100,000.00	101,687.32	

		IMBLN 3.875% 07/26/29	200,000.00	193,283.74	
		INTC 2.45% 11/15/29	100,000.00	90,959.87	
		INTC 5.125% 02/10/30	100,000.00	101,750.87	
		INTC 5.2% 02/10/33	100,000.00	99,989.28	
		INTC 5.625% 02/10/43	100,000.00	93,878.34	
		INTC 5.7% 02/10/53	100,000.00	91,545.67	
		IPG 3.375% 03/01/41	100,000.00	74,626.63	
		IR 5.7% 08/14/33	100,000.00	104,217.67	
		ISPIM 4% 09/23/29	200,000.00	194,085.02	
		ISPIM 8.248% 11/21/33	200,000.00	232,022.60	
		J 5.9% 03/01/33	100,000.00	103,784.90	
		J 6.35% 08/18/28	200,000.00	209,845.05	
		JAPTOB 2.25% 09/14/31	200,000.00	172,104.50	
		JCI 4.5% 02/15/47	100,000.00	84,138.34	
		JD 3.375% 01/14/30	200,000.00	190,954.16	
		JEF 2.625% 10/15/31	100,000.00	86,620.89	
		JEF 2.75% 10/15/32	200,000.00	168,193.08	
		JNJ 1.3% 09/01/30	200,000.00	173,353.41	
		JNJ 2.1% 09/01/40	100,000.00	68,323.09	
		JNJ 4.55% 03/01/28	300,000.00	304,407.03	
		JPM 1.47% 09/22/27	100,000.00	96,437.15	
		JPM 2.739% 10/15/30	200,000.00	185,824.28	
		JPM 2.963% 01/25/33	200,000.00	178,900.48	
		JPM 3.157% 04/22/42	200,000.00	150,624.39	
		JPM 3.782% 02/01/28	100,000.00	99,012.48	
		JPM 3.882% 07/24/38	200,000.00	175,186.20	
		JPM 3.897% 01/23/49	400,000.00	312,933.37	
		JPM 4.26% 02/22/48	200,000.00	167,298.55	
		JPM 4.323% 04/26/28	300,000.00	299,425.51	
		JPM 4.565% 06/14/30	100,000.00	100,238.90	
		JPM 4.979% 07/22/28	400,000.00	404,252.74	
		JPM 5.571% 04/22/28	300,000.00	305,658.73	
		JPM 5.625% 08/16/43	200,000.00	200,190.87	
		K 5.25% 03/01/33	100,000.00	101,584.24	
		KD 4.1% 10/15/41	100,000.00	79,301.39	
		KDP 3.95% 04/15/29	100,000.00	98,127.66	
		KEY 6.401% 03/06/35	250,000.00	265,813.60	
		KHC 4.875% 10/01/49	100,000.00	84,850.79	
		KHC 6.5% 02/09/40	100,000.00	106,011.07	
		KIM 1.9% 03/01/28	100,000.00	94,163.18	
		KLAC 5% 03/15/49	100,000.00	92,063.13	
		KMB 3.2% 04/25/29	100,000.00	96,729.50	
		KMI 1.75% 11/15/26	100,000.00	96,518.73	

		KMI 3.6% 02/15/51	200,000.00	136,627.55	
		KMI 5.2% 03/01/48	100,000.00	89,371.04	
		KMI 5.2% 06/01/33	100,000.00	100,274.77	
		KO 1.375% 03/15/31	100,000.00	85,377.30	
		KO 1.45% 06/01/27	100,000.00	95,341.92	
		KO 2.5% 06/01/40	100,000.00	72,300.14	
		KO 3.375% 03/25/27	100,000.00	99,012.08	
		KO 3% 03/05/51	100,000.00	66,301.45	
		KR 4.45% 02/01/47	100,000.00	82,072.48	
		LH 2.95% 12/01/29	100,000.00	93,675.55	
		LHX 1.8% 01/15/31	100,000.00	86,263.76	
		LHX 5.35% 06/01/34	100,000.00	101,561.54	
		LIN 1.1% 08/10/30	100,000.00	85,714.65	
		LIN 2% 08/10/50	100,000.00	52,010.96	
		LLY 3.375% 03/15/29	100,000.00	97,607.98	
		LLY 4.15% 03/15/59	100,000.00	78,885.06	
		LLY 5.1% 02/09/64	200,000.00	183,685.00	
		LMT 5.2% 02/15/64	200,000.00	181,490.98	
		LMT 5.7% 11/15/54	100,000.00	99,836.41	
		LNG 5.65% 04/15/34	200,000.00	203,493.56	
		LOW 2.8% 09/15/41	200,000.00	138,543.47	
		LOW 4.05% 05/03/47	100,000.00	77,123.78	
		LOW 5.15% 07/01/33	100,000.00	101,495.92	
		LOW 5.625% 04/15/53	100,000.00	95,329.87	
		LOW 5.75% 07/01/53	200,000.00	192,689.36	
		LRCX 4% 03/15/29	100,000.00	99,008.07	
		LUV 5.125% 06/15/27	100,000.00	100,683.38	
		LVS 6% 08/15/29	100,000.00	102,678.33	
		LYB 3.375% 10/01/40	100,000.00	73,365.84	
		LYB 4.2% 05/01/50	100,000.00	73,750.65	
		MA 2.95% 03/15/51	100,000.00	65,251.39	
		MA 3.3% 03/26/27	100,000.00	98,753.05	
		MA 3.95% 02/26/48	100,000.00	80,015.01	
		MAERSK 4.5% 06/20/29	100,000.00	100,317.23	
		MAR 2.75% 10/15/33	200,000.00	169,551.46	
		MAR 4.625% 06/15/30	100,000.00	99,927.63	
		MARUB 1.577% 09/17/26	200,000.00	193,002.56	
		MBGGR 2.45% 03/02/31	150,000.00	132,439.84	
		MCD 2.125% 03/01/30	100,000.00	90,570.48	
		MCD 3.5% 07/01/27	100,000.00	98,645.27	
		MCD 3.625% 09/01/49	100,000.00	72,033.84	
		MCD 4.2% 04/01/50	100,000.00	78,886.89	

		MCD 4.6% 09/09/32	100,000.00	99,653.37	
		MCO 2.75% 08/19/41	100,000.00	69,662.01	
		MDLZ 1.5% 02/04/31	100,000.00	85,054.93	
		MDLZ 2.625% 03/17/27	100,000.00	97,287.58	
		MDT 4.25% 03/30/28	100,000.00	100,156.52	
		MDT 4.375% 03/15/35	100,000.00	96,414.64	
		MET 2.4% 01/11/32	200,000.00	172,273.49	
		MET 4.8% 01/14/28	200,000.00	202,298.32	
		MET 5.25% 01/15/54	200,000.00	186,477.98	
		META 4.6% 05/15/28	100,000.00	101,567.33	
		META 4.65% 08/15/62	100,000.00	83,910.72	
		META 5.6% 05/15/53	100,000.00	98,835.73	
		MFCCN 3.703% 03/16/32	100,000.00	94,015.17	
		MITHCC 3.967% 04/13/30	200,000.00	191,977.97	
		MITHCC 5.08% 09/15/27	200,000.00	201,741.92	
		MITHCC 5.658% 02/28/33	200,000.00	204,631.46	
		MIZUHO 2.564% 09/13/31	200,000.00	173,738.62	
		MIZUHO 5.414% 09/13/28	200,000.00	203,749.70	
		MIZUHO 5.422% 05/13/36	200,000.00	201,417.43	
		MKC 2.5% 04/15/30	100,000.00	91,297.95	
		MKL 5% 05/20/49	100,000.00	87,155.32	
		MLM 4.25% 12/15/47	100,000.00	80,390.90	
		MMC 4.2% 03/01/48	100,000.00	81,554.96	
		MMC 4.75% 03/15/39	100,000.00	94,191.08	
		MMM 2.375% 08/26/29	200,000.00	184,761.88	
		MO 3.4% 02/04/41	100,000.00	73,764.81	
		MO 5.8% 02/14/39	100,000.00	100,841.81	
		MO 5.95% 02/14/49	100,000.00	98,808.28	
		MO 6.2% 11/01/28	100,000.00	105,168.51	
		MPC 3.8% 04/01/28	100,000.00	98,484.89	
		MPLX 2.65% 08/15/30	100,000.00	90,402.59	
		MPLX 4.5% 04/15/38	200,000.00	175,682.02	
		MPLX 5.2% 12/01/47	100,000.00	86,921.72	
		MQGAU 2.871% 01/14/33	100,000.00	87,323.68	
		MQGAU 4.098% 06/21/28	100,000.00	98,999.75	
		MRK 2.15% 12/10/31	200,000.00	173,706.52	
		MRK 3.4% 03/07/29	100,000.00	97,315.76	
		MRVL 5.75% 02/15/29	200,000.00	207,551.71	
		MS 2.475% 01/21/28	300,000.00	291,115.60	
		MS 3.217% 04/22/42	100,000.00	75,329.72	
		MS 3.622% 04/01/31	200,000.00	191,237.43	
		MS 4.457% 04/22/39	100,000.00	92,092.12	
		MS 5.192% 04/17/31	500,000.00	510,547.62	

		MS 5.449% 07/20/29	200,000.00	205,355.76	
		MS 5.597% 03/24/51	100,000.00	98,697.36	
		MS 5.656% 04/18/30	300,000.00	311,026.92	
		MS 5.942% 02/07/39	200,000.00	205,066.88	
		MS 6.296% 10/18/28	100,000.00	104,008.29	
		MSCI 3.25% 08/15/33	100,000.00	87,164.40	
		MSFT 1.35% 09/15/30	100,000.00	87,264.11	
		MSFT 2.525% 06/01/50	200,000.00	122,510.36	
		MSFT 2.921% 03/17/52	100,000.00	65,653.52	
		MSFT 3.3% 02/06/27	100,000.00	98,893.80	
		MSFT 4.1% 02/06/37	100,000.00	94,837.94	
		MSI 5.6% 06/01/32	100,000.00	103,923.01	
		MTB 6.082% 03/13/32	100,000.00	105,132.46	
		MTNA 4.25% 07/16/29	100,000.00	98,430.96	
		MTNA 6.55% 11/29/27	100,000.00	104,154.24	
		MU 5.8% 01/15/35	100,000.00	102,709.75	
		MU 5.875% 09/15/33	100,000.00	104,151.96	
		MUFG 4.286% 07/26/38	100,000.00	92,350.74	
		MUFG 4.7% 03/10/44	200,000.00	178,792.31	
		MUFG 5.133% 07/20/33	200,000.00	201,591.96	
		MUNRE 5.875% 05/23/42	200,000.00	204,830.50	
		MYLIFE 5.1% 04/26/48	200,000.00	199,621.94	
		NDAQ 1.65% 01/15/31	100,000.00	86,004.91	
		NDAQ 5.35% 06/28/28	177,000.00	182,207.90	
		NDAQ 5.55% 02/15/34	88,000.00	91,234.70	
		NEE 1.875% 01/15/27	100,000.00	96,367.14	
		NEE 1.9% 06/15/28	200,000.00	186,811.16	
		NEE 2.45% 02/03/32	100,000.00	87,981.70	
		NEE 3.95% 03/01/48	100,000.00	78,847.03	
		NEE 5.05% 04/01/28	100,000.00	102,164.99	
		NEE 5.25% 02/28/53	100,000.00	91,655.16	
		NEE 5.45% 03/15/35	100,000.00	101,225.75	
		NEM 5.875% 04/01/35	100,000.00	106,353.58	
		NESNVX 2.5% 09/14/41	150,000.00	102,914.30	
		NESNVX 4.95% 03/14/30	150,000.00	153,842.98	
		NESNVX 4% 09/24/48	150,000.00	120,767.32	
		NFG 3.95% 09/15/27	100,000.00	98,400.78	
		NFLX 4.875% 06/15/30	100,000.00	101,931.38	
		NFLX 5.875% 11/15/28	100,000.00	104,880.24	
		NI 4.375% 05/15/47	100,000.00	81,628.51	
		NIPLIF 2.75% 01/21/51	200,000.00	174,938.72	
		NIPLIF 2.9% 09/16/51	200,000.00	173,377.90	

		NKE 3.25% 03/27/40	100,000.00	79,175.15	
		NKE 3.375% 03/27/50	100,000.00	70,274.78	
		NNN 3.5% 04/15/51	100,000.00	68,478.64	
		NOC 4.9% 06/01/34	100,000.00	99,297.86	
		NOC 5.15% 05/01/40	100,000.00	97,271.96	
		NOMURA 1.653% 07/14/26	200,000.00	194,161.42	
		NOMURA 5.605% 07/06/29	200,000.00	206,405.72	
		NOMURA 6.087% 07/12/33	200,000.00	211,841.85	
		NOV 3.6% 12/01/29	100,000.00	96,043.25	
		NOVNVX 2.2% 08/14/30	100,000.00	90,618.58	
		NOVNVX 2% 02/14/27	100,000.00	96,965.04	
		NRG 2.45% 12/02/27	100,000.00	94,375.59	
		NRUC 2.75% 04/15/32	200,000.00	177,945.27	
		NRUC 4.3% 03/15/49	100,000.00	82,784.47	
		NSC 3% 03/15/32	100,000.00	90,033.47	
		NSC 4.15% 02/28/48	100,000.00	80,097.84	
		NTRCN 5.8% 03/27/53	100,000.00	98,427.94	
		NTRS 3.65% 08/03/28	100,000.00	98,434.04	
		NTT 2.065% 04/03/31	200,000.00	172,698.62	
		NUE 3.85% 04/01/52	100,000.00	75,476.19	
		NVDA 3.5% 04/01/50	100,000.00	74,284.64	
		NWG 5.516% 09/30/28	200,000.00	203,919.82	
		NWIDE 4.85% 07/27/27	200,000.00	201,961.31	
		O 3.25% 06/15/29	200,000.00	191,480.62	
		OC 3.95% 08/15/29	100,000.00	97,726.68	
		OGS 2% 05/15/30	100,000.00	89,436.42	
		OGS 4.25% 09/01/32	100,000.00	96,235.39	
		OHI 3.625% 10/01/29	100,000.00	94,792.19	
		OKE 5.05% 11/01/34	200,000.00	193,688.44	
		OKE 5.2% 07/15/48	100,000.00	86,638.89	
		OKE 6.1% 11/15/32	100,000.00	105,437.84	
		OMC 2.6% 08/01/31	100,000.00	88,432.77	
		ORCL 2.875% 03/25/31	200,000.00	181,709.73	
		ORCL 3.65% 03/25/41	200,000.00	156,186.77	
		ORCL 4.1% 03/25/61	100,000.00	71,109.65	
		ORCL 4.5% 05/06/28	100,000.00	100,405.02	
		ORCL 4.65% 05/06/30	200,000.00	201,016.37	
		ORCL 4.9% 02/06/33	100,000.00	99,575.95	
		ORCL 6.15% 11/09/29	100,000.00	106,272.62	
		ORCL 6.9% 11/09/52	100,000.00	110,144.88	
		ORIX 2.25% 03/09/31	100,000.00	87,661.80	
		ORIX 5% 09/13/27	100,000.00	101,149.32	
		OTIS 3.112% 02/15/40	100,000.00	76,504.35	

		OXY 5% 08/01/27	200,000.00	201,343.60	
		OXY 6.45% 09/15/36	100,000.00	101,763.20	
		OXY 6.6% 03/15/46	100,000.00	98,612.84	
		PARA 4.95% 01/15/31	100,000.00	97,420.93	
		PCG 3.3% 08/01/40	100,000.00	71,932.27	
		PCG 4.2% 06/01/41	200,000.00	153,922.71	
		PCG 4.55% 07/01/30	100,000.00	97,472.34	
		PCG 4.95% 07/01/50	100,000.00	80,129.92	
		PCG 5.45% 06/15/27	200,000.00	202,383.28	
		PCP 4.375% 06/15/45	100,000.00	84,446.37	
		PEAK 2.125% 12/01/28	100,000.00	92,754.90	
		PEAK 5.25% 12/15/32	200,000.00	202,911.65	
		PEG 4.05% 05/01/48	100,000.00	79,554.89	
		PEG 5.05% 03/01/35	100,000.00	100,612.67	
		PEG 5.2% 08/01/33	100,000.00	102,463.24	
		PEP 1.95% 10/21/31	100,000.00	86,480.30	
		PEP 3.6% 02/18/28	100,000.00	98,913.18	
		PEP 4.65% 02/15/53	100,000.00	87,059.73	
		PEP 4% 05/02/47	100,000.00	80,340.93	
		PERTIJ 2.3% 02/09/31	200,000.00	173,909.25	
		PERTIJ 3.1% 01/21/30	200,000.00	186,282.76	
		PETMK 4.55% 04/21/50	200,000.00	168,569.89	
		PFE 2.55% 05/28/40	100,000.00	71,001.64	
		PFE 2.625% 04/01/30	200,000.00	185,298.75	
		PFE 3.9% 03/15/39	100,000.00	86,488.44	
		PFE 4.45% 05/19/28	200,000.00	201,078.68	
		PFE 4.65% 05/19/30	100,000.00	100,842.58	
		PFE 4% 03/15/49	100,000.00	78,422.43	
		PFG 3.7% 05/15/29	100,000.00	97,168.30	
		PFG 5.5% 03/15/53	200,000.00	190,644.85	
		PG 3.55% 03/25/40	100,000.00	84,649.04	
		PG 4.35% 01/29/29	200,000.00	202,104.99	
		PGR 2.5% 03/15/27	100,000.00	97,131.59	
		PH 4.5% 09/15/29	100,000.00	100,471.16	
		PKG 4.05% 12/15/49	100,000.00	75,639.66	
		PLD 4.75% 06/15/33	100,000.00	99,204.52	
		PLD 4.875% 06/15/28	200,000.00	203,590.88	
		PLD 5.25% 06/15/53	100,000.00	93,137.91	
		PLNIJ 4% 06/30/50	200,000.00	140,664.46	
		PM 4.625% 11/01/29	200,000.00	201,331.97	
		PM 5.375% 02/15/33	100,000.00	102,845.82	
		PM 5.75% 11/17/32	200,000.00	209,835.08	

		PNC 2.55% 01/22/30	100,000.00	92,159.16	
		PNC 5.354% 12/02/28	200,000.00	204,382.15	
		PNC 5.401% 07/23/35	100,000.00	101,368.84	
		POHANG 5.75% 01/17/28	200,000.00	205,155.60	
		POWFIN 3.95% 04/23/30	200,000.00	191,596.81	
		PPG 2.55% 06/15/30	100,000.00	90,753.09	
		PPL 4.125% 04/15/30	100,000.00	97,828.46	
		PRU 3.935% 12/07/49	100,000.00	75,943.05	
		PRU 6.75% 03/01/53	100,000.00	104,968.10	
		PRUFIN 2.95% 11/03/33	200,000.00	187,768.80	
		PRUFIN 3.625% 03/24/32	200,000.00	185,658.88	
		PSA 1.5% 11/09/26	100,000.00	96,442.50	
		PSA 5.1% 08/01/33	100,000.00	102,208.90	
		PSPCAP 1.625% 10/26/28	250,000.00	232,159.58	
		PSX 3.3% 03/15/52	100,000.00	64,114.13	
		PSX 4.68% 02/15/45	100,000.00	83,355.33	
		PSX 4.95% 12/01/27	100,000.00	101,363.22	
		PTTEPT 2.993% 01/15/30	200,000.00	186,103.12	
		PWR 4.75% 08/09/27	200,000.00	201,290.14	
		PXD 2.15% 01/15/31	100,000.00	88,230.85	
		PYPL 4.4% 06/01/32	100,000.00	98,425.03	
		QCOM 1.65% 05/20/32	100,000.00	82,776.31	
		QCOM 6% 05/20/53	100,000.00	104,441.09	
		R 2.85% 03/01/27	100,000.00	97,366.26	
		RABOBK 4.655% 08/22/28	250,000.00	251,282.59	
		RCICN 4.5% 03/15/42	200,000.00	169,615.60	
		RDSALN 2.75% 04/06/30	100,000.00	93,263.34	
		RDSALN 2.875% 11/26/41	100,000.00	71,481.28	
		RDSALN 3.25% 04/06/50	200,000.00	135,398.35	
		RECLIN 5.625% 04/11/28	200,000.00	204,034.87	
		RGA 6% 09/15/33	100,000.00	104,534.65	
		RILIN 3.625% 01/12/52	250,000.00	171,946.13	
		RIOLN 5.125% 03/09/53	100,000.00	91,335.17	
		RIOLN 5.25% 03/14/35	200,000.00	202,078.39	
		ROP 4.9% 10/15/34	100,000.00	98,358.70	
		ROSW 2.076% 12/13/31	200,000.00	172,906.74	
		ROSW 5.218% 03/08/54	200,000.00	191,429.92	
		RPRX 2.2% 09/02/30	200,000.00	176,564.78	
		RRX 6.3% 02/15/30	100,000.00	104,531.77	
		RSG 5.2% 11/15/34	100,000.00	101,849.88	
		RSG 5% 04/01/34	100,000.00	100,814.41	
		RTX 1.9% 09/01/31	100,000.00	85,298.87	
		RTX 4.35% 04/15/47	100,000.00	82,814.66	

		RTX 5.75% 01/15/29	200,000.00	208,707.70	
		RTX 6.1% 03/15/34	100,000.00	107,356.84	
		RVTY 2.55% 03/15/31	100,000.00	87,503.60	
		RY 3.625% 05/04/27	100,000.00	99,035.35	
		RY 6% 11/01/27	100,000.00	103,613.24	
		SANLTD 3.25% 08/08/31	200,000.00	177,738.10	
		SANTAN 6.033% 01/17/35	200,000.00	210,069.70	
		SANUK 6.534% 01/10/29	200,000.00	208,103.00	
		SANUSA 6.499% 03/09/29	100,000.00	104,150.28	
		SBIIN 5.125% 11/25/29	200,000.00	202,764.74	
		SBUX 4.45% 08/15/49	100,000.00	81,591.07	
		SBUX 4.8% 02/15/33	100,000.00	99,500.62	
		SCHW 2.45% 03/03/27	100,000.00	97,070.44	
		SCHW 3.25% 05/22/29	100,000.00	96,067.78	
		SCHW 5.853% 05/19/34	100,000.00	105,645.19	
		SF 4% 05/15/30	100,000.00	95,950.28	
		SHBASS 3.95% 06/10/27	250,000.00	249,180.09	
		SHW 2.3% 05/15/30	100,000.00	90,285.66	
		SHW 3.45% 06/01/27	100,000.00	98,398.95	
		SIEGR 2.15% 03/11/31	250,000.00	221,281.03	
		SLB 2.65% 06/26/30	100,000.00	91,679.20	
		SNA 4.1% 03/01/48	100,000.00	80,573.18	
		SNX 1.75% 08/09/26	200,000.00	193,771.75	
		SO 3.7% 04/30/30	100,000.00	96,346.64	
		SO 3.7% 12/01/47	100,000.00	75,454.53	
		SO 4.25% 07/01/36	200,000.00	182,721.04	
		SO 4.65% 05/16/28	200,000.00	202,134.34	
		SO 4.7% 05/15/32	100,000.00	99,877.15	
		SO 4.85% 03/15/35	200,000.00	195,133.91	
		SOCGEN 3.653% 07/08/35	200,000.00	183,585.95	
		SOCGEN 4.027% 01/21/43	200,000.00	148,112.86	
		SOCGEN 5.634% 01/19/30	200,000.00	204,370.15	
		SON 2.25% 02/01/27	100,000.00	96,503.53	
		SPG 1.375% 01/15/27	100,000.00	95,676.71	
		SPG 2.45% 09/13/29	100,000.00	92,724.93	
		SPG 3.8% 07/15/50	300,000.00	221,947.99	
		SPGI 4.75% 08/01/28	100,000.00	101,382.20	
		SPLLLC 5.9% 09/15/37	100,000.00	104,653.85	
		SRE 3.7% 04/01/29	100,000.00	97,242.75	
		SRE 4% 02/01/48	100,000.00	73,037.16	
		SRE 5.35% 04/01/53	100,000.00	92,666.62	
		STANLN 5.005% 10/15/30	200,000.00	201,292.94	

		STLD 1.65% 10/15/27	100,000.00	94,195.36	
		STT 2.203% 02/07/28	100,000.00	96,773.86	
		STT 3.031% 11/01/34	200,000.00	184,291.77	
		STT 4.164% 08/04/33	200,000.00	191,663.32	
		STT 5.684% 11/21/29	100,000.00	104,209.96	
		STZ 2.25% 08/01/31	100,000.00	86,437.16	
		STZ 4.1% 02/15/48	100,000.00	77,330.74	
		STZ 4.35% 05/09/27	100,000.00	99,755.63	
		SUCN 3.75% 03/04/51	100,000.00	69,561.66	
		SUMI 5.55% 03/09/28	200,000.00	205,193.94	
		SUMIBK 2.296% 01/12/41	200,000.00	135,343.79	
		SUMIBK 5.52% 01/13/28	200,000.00	205,438.16	
		SUMIBK 5.71% 01/13/30	200,000.00	208,887.10	
		SUMIBK 5.716% 09/14/28	200,000.00	207,417.72	
		SUMIFL 5.353% 04/25/28	200,000.00	203,658.81	
		SUMILF 3.375% 04/15/81	200,000.00	180,798.52	
		SWK 6% 03/06/28	100,000.00	103,871.02	
		SYF 3.95% 12/01/27	200,000.00	196,734.49	
		SYK 1.95% 06/15/30	100,000.00	88,964.68	
		SYK 2.9% 06/15/50	100,000.00	65,023.42	
		SYY 6.6% 04/01/50	100,000.00	108,028.64	
		T(AT&T) 05/15/35	100,000.00	94,871.28	
		T(AT&T) 09/15/53	100,000.00	67,087.73	
		T(AT&T) 2.25% 02/01/32	100,000.00	85,848.10	
		T(AT&T) 2.55% 12/01/33	200,000.00	166,615.74	
		T(AT&T) 3.65% 09/15/59	100,000.00	66,510.46	
		T(AT&T) 3.8% 12/01/57	100,000.00	69,109.09	
		T(AT&T) 4.35% 03/01/29	100,000.00	99,809.09	
		T(AT&T) 4.85% 07/15/45	300,000.00	265,037.39	
		T(AT&T) 4.9% 08/15/37	200,000.00	190,754.70	
		TACHEM 5.25% 06/23/45	200,000.00	186,184.03	
		TAISEM 1.75% 10/25/26	200,000.00	193,381.63	
		TD 4.108% 06/08/27	100,000.00	99,560.43	
		TD 5.532% 07/17/26	100,000.00	101,151.48	
		TDY 2.25% 04/01/28	100,000.00	94,643.30	
		TELEFO 5.52% 03/01/49	150,000.00	136,989.85	
		TEMASE 2.375% 08/02/41	250,000.00	178,416.79	
		TEMASE 2.75% 08/02/61	250,000.00	155,644.17	
		TENCNT 3.68% 04/22/41	200,000.00	159,634.09	
		TENCNT 3.975% 04/11/29	200,000.00	197,136.37	
		TFC 1.95% 06/05/30	100,000.00	88,364.68	
		TFC 4.873% 01/26/29	100,000.00	101,049.45	
		TFC 5.711% 01/24/35	100,000.00	103,108.29	

		TGT 1.95% 01/15/27	100,000.00	96,761.29	
		TGT 4.8% 01/15/53	300,000.00	264,112.58	
		TMUS 2.05% 02/15/28	200,000.00	188,635.70	
		TMUS 3.375% 04/15/29	100,000.00	96,039.28	
		TMUS 3.6% 11/15/60	100,000.00	65,829.27	
		TMUS 4.5% 04/15/50	200,000.00	164,189.86	
		TMUS 4.95% 03/15/28	100,000.00	101,418.81	
		TMUS 5.2% 01/15/33	100,000.00	101,303.12	
		TMUS 5.75% 01/15/54	100,000.00	97,432.71	
		TOYOTA 1.9% 09/12/31	100,000.00	85,616.76	
		TOYOTA 3.05% 03/22/27	100,000.00	98,059.84	
		TOYOTA 3.375% 04/01/30	100,000.00	95,262.41	
		TOYOTA 4.625% 01/12/28	400,000.00	403,785.66	
		TRMB 6.1% 03/15/33	100,000.00	106,212.47	
		TRPCN 7% 06/01/65	100,000.00	100,657.30	
		TRV 4.05% 03/07/48	100,000.00	79,620.43	
		TSN 4.35% 03/01/29	100,000.00	99,164.83	
		TTEFP 2.986% 06/29/41	100,000.00	73,221.88	
		TTEFP 3.386% 06/29/60	100,000.00	64,743.83	
		TTEFP 3.455% 02/19/29	100,000.00	97,365.81	
		TTWO 4.95% 03/28/28	100,000.00	101,294.32	
		TXN 3.875% 03/15/39	100,000.00	87,659.78	
		TXN 4.15% 05/15/48	100,000.00	81,715.21	
		TXN 4.6% 02/08/29	100,000.00	101,465.44	
		UBER 4.8% 09/15/34	200,000.00	195,926.02	
		UBS 4.194% 04/01/31	250,000.00	244,168.30	
		UBS 5.428% 02/08/30	250,000.00	256,111.71	
		UBS 6.442% 08/11/28	250,000.00	259,073.03	
		UBS 9.016% 11/15/33	250,000.00	308,629.58	
		UCGIM 3.127% 06/03/32	200,000.00	180,949.02	
		UDR 2.1% 08/01/32	100,000.00	82,289.57	
		UHS 2.65% 10/15/30	100,000.00	88,553.70	
		UNANA 1.375% 09/14/30	100,000.00	86,599.21	
		UNH 4.25% 06/15/48	100,000.00	79,793.83	
		UNH 4.5% 04/15/33	200,000.00	193,669.42	
		UNH 4.75% 05/15/52	100,000.00	84,538.64	
		UNH 5.2% 04/15/63	200,000.00	175,535.43	
		UNH 5% 04/15/34	400,000.00	397,124.36	
		UNM 4% 06/15/29	100,000.00	97,908.97	
		UNM 6% 06/15/54	100,000.00	98,011.30	
		UNP 2.891% 04/06/36	200,000.00	164,502.37	
		UNP 3.799% 04/06/71	100,000.00	67,717.37	

		UNP 3.85% 02/14/72	100,000.00	68,578.47	
		UNP 4.95% 05/15/53	100,000.00	90,107.44	
		UPS 5.05% 03/03/53	100,000.00	89,997.56	
		UPS 5.3% 04/01/50	200,000.00	188,098.82	
		USB 4.548% 07/22/28	200,000.00	200,217.87	
		USB 4.967% 07/22/33	100,000.00	98,221.54	
		V 1.1% 02/15/31	100,000.00	84,925.54	
		V 1.9% 04/15/27	100,000.00	96,472.71	
		V 3.65% 09/15/47	100,000.00	77,144.49	
		VALEBZ 3.75% 07/08/30	100,000.00	94,482.18	
		VLO 2.15% 09/15/27	100,000.00	95,204.91	
		VLO 3.65% 12/01/51	100,000.00	67,145.00	
		VMC 4.7% 03/01/48	100,000.00	86,589.03	
		VMW 4.65% 05/15/27	100,000.00	100,343.16	
		VOD 5.25% 05/30/48	100,000.00	91,371.37	
		VOD 5.625% 02/10/53	100,000.00	94,598.64	
		VOYA 4.7% 01/23/48	100,000.00	95,793.16	
		VRSK 3.625% 05/15/50	100,000.00	71,017.16	
		VTR 2.5% 09/01/31	100,000.00	87,756.94	
		VTR 3% 01/15/30	100,000.00	93,428.27	
		VTRS 3.85% 06/22/40	100,000.00	73,462.34	
		VTRS 4.55% 04/15/28	100,000.00	98,873.18	
		VTRS 5.2% 04/15/48	100,000.00	79,254.95	
		VZ 2.1% 03/22/28	200,000.00	188,856.99	
		VZ 2.55% 03/21/31	100,000.00	89,400.82	
		VZ 3.15% 03/22/30	100,000.00	94,522.09	
		VZ 3.4% 03/22/41	100,000.00	76,775.62	
		VZ 3.7% 03/22/61	100,000.00	68,573.49	
		VZ 4.812% 03/15/39	200,000.00	187,007.56	
		VZ 4.862% 08/21/46	100,000.00	88,833.58	
		WBD 3.95% 03/20/28	200,000.00	184,330.00	
		WBD 5.2% 09/20/47	100,000.00	57,375.00	
		WCNCN 2.95% 01/15/52	200,000.00	126,224.87	
		WDAY 3.5% 04/01/27	100,000.00	98,577.11	
		WEC 1.8% 10/15/30	35,000.00	30,494.35	
		WEC 4.75% 01/15/28	200,000.00	201,699.54	
		WELL 2.7% 02/15/27	100,000.00	97,591.44	
		WFC 2.572% 02/11/31	100,000.00	91,275.13	
		WFC 2.879% 10/30/30	250,000.00	233,038.93	
		WFC 3.526% 03/24/28	100,000.00	98,396.81	
		WFC 4.611% 04/25/53	100,000.00	84,606.05	
		WFC 4.808% 07/25/28	100,000.00	100,642.25	
		WFC 4.897% 07/25/33	200,000.00	199,249.71	

	WFC 5.15% 04/23/31	300,000.00	305,906.54	
	WFC 5.557% 07/25/34	200,000.00	205,432.33	
	WFC 5.574% 07/25/29	200,000.00	206,119.69	
	WFC 5.95% 12/15/36	200,000.00	203,011.71	
	WLK 2.875% 08/15/41	100,000.00	67,259.65	
	WM 3.875% 01/15/29	200,000.00	196,854.83	
	WM 4.875% 02/15/34	100,000.00	100,776.10	
	WMB 3.95% 05/15/50	100,000.00	75,125.45	
	WMB 4.8% 11/15/29	200,000.00	201,430.75	
	WMB 4.85% 03/01/48	100,000.00	85,953.10	
	WMB 4% 03/15/28	100,000.00	98,782.46	
	WMT 1.05% 09/17/26	300,000.00	289,635.11	
	WMT 1.8% 09/22/31	200,000.00	173,293.74	
	WMT 2.65% 09/22/51	100,000.00	61,687.75	
	WMT 3.95% 06/28/38	100,000.00	90,704.99	
	WMT 4.05% 06/29/48	100,000.00	81,846.10	
	WPC 2.4% 02/01/31	100,000.00	87,946.32	
	WSTP 3.02% 11/18/36	200,000.00	174,755.46	
	WSTP 3.133% 11/18/41	100,000.00	72,879.08	
	WSTP 5.457% 11/18/27	100,000.00	102,877.87	
	WSTP 5.618% 11/20/35	200,000.00	200,335.94	
	WTRG 2.4% 05/01/31	100,000.00	87,976.88	
	WTRG 5.3% 05/01/52	100,000.00	90,606.93	
	WY 4% 04/15/30	100,000.00	97,143.68	
	XEL 3.6% 09/15/47	100,000.00	74,160.67	
	XEL 4.1% 06/01/32	200,000.00	191,231.64	
	XEL 4% 06/15/28	100,000.00	99,069.16	
	XOM 3.482% 03/19/30	100,000.00	96,645.94	
	XOM 4.227% 03/19/40	100,000.00	88,601.76	
	XOM 4.327% 03/19/50	100,000.00	82,187.73	
	ZBH 5.35% 12/01/28	100,000.00	102,792.05	
	ZTS 3.9% 08/20/28	100,000.00	99,027.75	
アメリカドル 小計		134,348,000.00	125,005,519.63 (18,237,055,258)	
カナダドル	BAC 3.615% 03/16/28	100,000.00	100,494.60	
	BCECN 3% 03/17/31	100,000.00	94,944.06	
	BCECN 5.15% 02/09/53	100,000.00	98,531.85	
	BMO 1.928% 07/22/31	100,000.00	98,966.67	
	BMO 4.537% 12/18/28	100,000.00	103,406.88	
	BMO 4.709% 12/07/27	100,000.00	103,154.08	
	BNP 2.538% 07/13/29	200,000.00	193,949.40	
	BNS 3.807% 11/15/28	100,000.00	101,100.86	

		BNS 5.679% 08/02/33	200,000.00	211,422.31	
		CAECN 5.541% 06/12/28	100,000.00	104,466.56	
		CM 2.25% 01/07/27	200,000.00	197,630.33	
		CM 4.95% 06/29/27	100,000.00	103,171.19	
		CNQCN 2.5% 01/17/28	100,000.00	97,823.73	
		CNQCN 4.85% 05/30/47	100,000.00	94,339.31	
		CNRCN 3.2% 07/31/28	100,000.00	100,159.46	
		CNRCN 3.6% 02/08/49	100,000.00	83,124.62	
		CNRCN 5.1% 05/02/54	100,000.00	104,481.30	
		CP 2.54% 02/28/28	100,000.00	98,565.27	
		CPXCN 4.424% 02/08/30	200,000.00	203,176.84	
		CUCN 4.851% 06/03/52	200,000.00	197,463.10	
		CVECN 3.5% 02/07/28	100,000.00	99,975.00	
		ENBCN 3.9% 02/25/30	100,000.00	100,412.25	
		ENBCN 4.73% 08/22/34	100,000.00	101,525.93	
		ENBCN 5.7% 11/09/27	100,000.00	105,103.32	
		ENBCN 6.1% 11/09/32	100,000.00	110,945.99	
		FFHCN 3.95% 03/03/31	100,000.00	99,817.75	
		FTSCN 4.09% 03/26/32	100,000.00	99,818.12	
		FTSCN 4.431% 05/31/29	100,000.00	102,772.74	
		GWOCN 2.981% 07/08/50	100,000.00	73,828.91	
		HYDONE 4.17% 06/06/44	100,000.00	92,715.29	
		HYDONE 4.25% 01/04/35	100,000.00	100,917.67	
		HYDONE 4.91% 01/27/28	100,000.00	104,403.63	
		LCN 2.284% 05/07/30	100,000.00	95,122.03	
		LCN 3.564% 12/12/29	100,000.00	100,165.48	
		MBGGR 4.64% 07/09/27	100,000.00	102,719.71	
		MFCCN 5.409% 03/10/33	100,000.00	104,823.59	
		MGCN 4.95% 01/31/31	100,000.00	103,468.44	
		MRUCN 4.27% 12/04/47	100,000.00	89,748.29	
		NACN 5.279% 02/15/34	100,000.00	104,530.11	
		NESNVX 2.192% 01/26/29	100,000.00	96,794.50	
		NGGLN 5.221% 09/16/31	100,000.00	104,917.16	
		PLD 4.2% 02/15/33	100,000.00	100,082.22	
		PPLCN 5.02% 01/12/32	100,000.00	104,129.58	
		PPLCN 5.21% 01/12/34	100,000.00	104,501.89	
		PSPCAP 4.15% 06/01/33	500,000.00	516,287.47	
		RCICN 5.25% 04/15/52	100,000.00	99,908.32	
		RCICN 6.75% 11/09/39	100,000.00	115,007.14	
		REIUCN 4.623% 10/03/31	100,000.00	100,491.97	
		REIUCN 4.628% 05/01/29	100,000.00	102,199.80	
		RY 2.328% 01/28/27	100,000.00	98,984.54	
		RY 5.096% 04/03/34	100,000.00	104,186.19	

		SLFCN 2.58% 05/10/32	100,000.00	98,907.44	
		SLFCN 5.12% 05/15/36	100,000.00	105,497.65	
		SRUUCN 3.192% 06/11/27	100,000.00	99,401.22	
		SRUUCN 4.737% 08/05/31	100,000.00	100,927.66	
		TCN 2.35% 01/27/28	100,000.00	97,713.60	
		TCN 5.1% 02/15/34	100,000.00	103,861.80	
		TCN 5.65% 09/13/52	100,000.00	105,887.91	
		TD 1.896% 09/11/28	300,000.00	289,438.00	
		TD 2.26% 01/07/27	100,000.00	98,853.84	
		TD 4.423% 10/31/35	100,000.00	100,778.63	
		TD 4.68% 01/08/29	100,000.00	104,000.89	
		TD 5.177% 04/09/34	200,000.00	208,697.03	
		TD 5.423% 07/10/26	100,000.00	102,424.81	
		TOYOTA 5.16% 07/12/28	200,000.00	210,176.90	
		TOYOTA 5.29% 07/13/26	200,000.00	204,630.14	
		TRPCN 5.92% 05/12/52	100,000.00	109,162.24	
	カナダドル 小計		8,100,000.00	8,171,037.21 (871,604,539)	
	ユーロ	AALLN 4.125% 03/15/32	100,000.00	102,843.30	
		AAPL 0.5% 11/15/31	100,000.00	87,517.06	
		ABBV 0.75% 11/18/27	200,000.00	193,368.65	
		ABBV 1.25% 11/18/31	100,000.00	91,133.62	
		ABBV 2.125% 06/01/29	100,000.00	98,477.57	
		ABESM 1.25% 02/07/28	100,000.00	96,751.40	
		ABIBB 2.125% 12/02/27	100,000.00	99,613.29	
		ABIBB 2.875% 04/02/32	100,000.00	98,986.96	
		ABNANV 0.375% 01/14/35	100,000.00	77,786.57	
		ABNANV 3.875% 01/15/32	100,000.00	103,285.17	
		ABNANV 5.125% 02/22/33	100,000.00	104,848.38	
		ACACB 0.01% 04/12/28	100,000.00	93,852.78	
		ACACB 3.25% 09/28/32	100,000.00	101,769.30	
		ACACB 3.375% 09/04/28	500,000.00	514,669.00	
		ACAFP 1.5% 10/06/31	200,000.00	177,793.98	
		ACAFP 1% 07/03/29	100,000.00	93,926.90	
		ACAFP 2% 07/17/30	100,000.00	93,954.62	
		ACAFP 3.875% 11/28/34	100,000.00	103,418.17	
		ACAFP 4.125% 03/07/30	100,000.00	105,898.41	
		ACEIM 3.875% 01/24/31	200,000.00	208,518.28	
		ACFP 3.875% 03/11/31	100,000.00	102,584.60	
		ADNA 3.5% 04/04/28	100,000.00	102,799.53	
		ADPFP 1% 12/13/27	100,000.00	96,983.90	
		AEMSPA 0.625% 07/15/31	100,000.00	86,619.05	

		AIB 5.75% 02/16/29	100,000.00	107,980.77	
		AIFP 2.875% 09/16/32	100,000.00	99,728.99	
		AIRFP 1.625% 06/09/30	200,000.00	190,894.00	
		AIRFP 2.375% 06/09/40	100,000.00	85,101.00	
		AKEFP 0.75% 12/03/29	200,000.00	185,167.75	
		AKERBP 1.125% 05/12/29	100,000.00	93,065.61	
		AKZANA 1.5% 03/28/28	100,000.00	97,904.08	
		ALOFP 0.125% 07/27/27	100,000.00	95,462.90	
		ALVGR 2.121% 07/08/50	100,000.00	94,601.43	
		ALVGR 4.252% 07/05/52	100,000.00	103,113.73	
		AMT 0.875% 05/21/29	100,000.00	93,097.21	
		AMXLMM 0.75% 06/26/27	100,000.00	96,714.85	
		ANNGR 0.375% 06/16/27	100,000.00	95,989.75	
		ANNGR 0.625% 12/14/29	100,000.00	90,345.53	
		ANNGR 5% 11/23/30	100,000.00	108,561.20	
		ANZNZ 0.2% 09/23/27	200,000.00	190,435.00	
		ARNDTN 0.375% 04/15/27	100,000.00	95,947.79	
		ARRFP 0% 06/19/28	100,000.00	93,245.12	
		ASABRE 0.336% 04/19/27	100,000.00	96,478.12	
		ASRNED 7% 12/07/43	100,000.00	117,265.60	
		ASSGEN 3.875% 01/29/29	100,000.00	103,477.20	
		ASSGEN 5.272% 09/12/33	200,000.00	219,432.28	
		ATDBCN 4.011% 02/12/36	200,000.00	199,083.78	
		ATIM 1.5% 01/25/30	100,000.00	93,535.96	
		ATOSTR 1.625% 01/25/28	100,000.00	98,004.65	
		ATOSTR 2% 01/15/30	100,000.00	95,703.30	
		ATOSTR 4.75% 01/24/31	100,000.00	107,243.55	
		AXASA 1.875% 07/10/42	100,000.00	89,573.58	
		AXASA 3.625% 01/10/33	100,000.00	104,230.46	
		BAC 0.694% 03/22/31	100,000.00	89,990.91	
		BAC 1.102% 05/24/32	200,000.00	178,149.33	
		BACR 0.877% 01/28/28	200,000.00	195,397.96	
		BACR 4.973% 05/31/36	200,000.00	210,802.58	
		BACRED 4.75% 03/14/28	100,000.00	103,639.95	
		BAMIIM 4.875% 01/17/30	200,000.00	212,159.36	
		BASGR 3.125% 06/29/28	100,000.00	102,144.54	
		BASGR 3.75% 06/29/32	100,000.00	103,536.15	
		BATSLN 3.125% 04/07/28	100,000.00	101,802.82	
		BAYNGR 0.75% 01/06/27	100,000.00	97,546.12	
		BAYNGR 1.125% 01/06/30	100,000.00	92,217.24	
		BAYNGR 1% 01/12/36	100,000.00	74,587.46	
		BBVASM 3.875% 01/15/34	200,000.00	209,685.52	
		BBVASM 5.75% 09/15/33	100,000.00	107,367.90	

		BERTEL 2% 04/01/28	100,000.00	99,179.07	
		BFCM 3.875% 01/26/28	100,000.00	103,627.67	
		BFCM 4.375% 01/11/34	100,000.00	102,886.17	
		BFCM 4% 11/21/29	100,000.00	104,742.41	
		BHP 3.25% 09/24/27	100,000.00	101,985.84	
		BKNG 4.125% 05/12/33	100,000.00	105,081.95	
		BKTSM 1.25% 12/23/32	100,000.00	96,710.26	
		BMO 0.05% 06/08/29	100,000.00	90,752.96	
		BMO 0.125% 01/26/27	200,000.00	194,176.43	
		BMO 2.75% 10/13/26	1,000,000.00	1,008,735.00	
		BMW 0.2% 01/11/33	100,000.00	82,463.41	
		BMW 0.375% 09/24/27	200,000.00	192,429.79	
		BMW 1% 05/22/28	100,000.00	96,281.98	
		BNFP 1% PERP	100,000.00	96,977.86	
		BNFP 3.071% 09/07/32	100,000.00	100,420.34	
		BNFP 3.2% 09/12/31	100,000.00	101,716.94	
		BNP 0.625% 12/03/32	100,000.00	82,420.29	
		BNP 2.5% 03/31/32	100,000.00	99,442.96	
		BNP 3.583% 01/15/31	200,000.00	204,035.12	
		BNP 3.945% 02/18/37	200,000.00	200,766.98	
		BNS 0.01% 09/14/29	100,000.00	89,996.02	
		BNS 3.25% 01/18/28	200,000.00	204,685.38	
		BNS 3.5% 04/17/29	200,000.00	204,444.30	
		BPCECB 1.75% 05/27/32	100,000.00	92,624.51	
		BPCECB 3.125% 07/20/27	200,000.00	203,962.98	
		BPCECB 3.25% 04/12/28	200,000.00	205,090.78	
		BPCECB 3% 10/17/29	100,000.00	101,698.81	
		BPCEGP 0.5% 09/15/27	100,000.00	97,963.77	
		BPCEGP 0.75% 03/03/31	100,000.00	87,563.69	
		BPCEGP 2.25% 03/02/32	100,000.00	98,967.32	
		BPCEGP 3.875% 01/25/36	100,000.00	102,565.87	
		BPCEGP 4.125% 03/08/33	200,000.00	206,621.06	
		BPLN 3.625% PERP	100,000.00	99,792.90	
		BRK 1.625% 03/16/35	100,000.00	85,782.21	
		BYLAN 1.375% 11/22/32	100,000.00	95,749.47	
		BYLAN 2.75% 05/28/32	200,000.00	199,741.67	
		BYLAN 7% 01/05/34	200,000.00	220,794.74	
		C 1.25% 04/10/29	200,000.00	190,592.35	
		C 3.713% 09/22/28	100,000.00	103,048.67	
		CABKSM 0.75% 07/09/26	100,000.00	98,644.50	
		CABKSM 5.375% 11/14/30	100,000.00	109,754.63	
		CABKSM 6.125% 05/30/34	100,000.00	109,412.40	

		CABKSM 6.25% 02/23/33	100,000.00	107,554.63	
		CAFFIL 0.01% 02/22/28	100,000.00	94,100.86	
		CAFFIL 0.01% 03/18/31	500,000.00	426,924.87	
		CAFFIL 0.125% 06/30/31	100,000.00	85,076.59	
		CAFFIL 0.5% 10/01/46	200,000.00	109,117.74	
		CAFFIL 3.125% 05/17/39	300,000.00	287,414.83	
		CAFFIL 3.125% 11/24/33	400,000.00	399,388.00	
		CAFP 1.875% 10/30/26	100,000.00	99,476.58	
		CAPFP 2% 04/15/29	100,000.00	97,895.61	
		CARLB 4.25% 10/05/33	100,000.00	107,454.55	
		CCEP 3.25% 03/21/32	100,000.00	100,750.38	
		CFF 0.01% 10/25/27	100,000.00	94,975.83	
		CFF 0.01% 10/29/35	100,000.00	71,495.77	
		CFF 0.6% 10/25/41	100,000.00	64,234.41	
		CFF 3.375% 09/16/31	100,000.00	102,642.15	
		CKHH 2% 04/13/30	100,000.00	95,745.30	
		CM 0.01% 10/07/26	200,000.00	195,048.29	
		CMCICB 3.125% 06/22/27	100,000.00	101,962.87	
		CMCSA 0.25% 05/20/27	100,000.00	96,235.84	
		CMZB 2.5% 02/25/28	700,000.00	705,381.74	
		CMZB 3.125% 04/20/29	100,000.00	102,613.43	
		CMZB 4.625% 03/21/28	200,000.00	207,289.74	
		CNPFP 1.25% 01/27/29	100,000.00	94,502.72	
		CNPFP 5.25% 07/18/53	100,000.00	107,997.36	
		COFBBB 1% 01/24/28	100,000.00	96,013.37	
		COLSM 0.75% 06/22/29	100,000.00	92,481.60	
		CONGR 3.625% 11/30/27	100,000.00	102,778.97	
		COVFP 1.125% 09/17/31	100,000.00	87,888.39	
		CPPIBC 0.75% 02/02/37	250,000.00	187,999.37	
		CPPIBC 3.125% 06/11/29	250,000.00	256,266.97	
		CRH 3.125% 02/23/33	400,000.00	401,888.80	
		CRH 3% 01/11/30	100,000.00	101,790.26	
		DAIGR 0.75% 09/10/30	100,000.00	90,221.57	
		DAIGR 2% 08/22/26	100,000.00	99,761.38	
		DANBNK 0.75% 06/09/29	100,000.00	94,719.93	
		DANBNK 3.25% 01/14/33	100,000.00	100,685.03	
		DB 2.625% 06/30/37	200,000.00	188,370.16	
		DB 4% 11/29/27	100,000.00	103,610.20	
		DECFP 1.625% 02/07/30	100,000.00	93,812.09	
		DEKA 4.125% 08/03/28	100,000.00	104,041.90	
		DELL 0.5% 10/27/26	100,000.00	97,668.64	
		DELL 4.5% 10/18/27	100,000.00	103,837.77	
		DEXGRP 0.01% 01/22/27	100,000.00	96,799.38	

		DEXGRP 0% 01/21/28	100,000.00	94,521.43	
		DGELN 1.875% 06/08/34	100,000.00	88,783.37	
		DGFP 0.5% 01/09/32	100,000.00	85,742.02	
		DGFP 0% 11/27/28	100,000.00	92,158.30	
		DHLGR 3.375% 07/03/33	100,000.00	102,574.80	
		DHR 0.75% 09/18/31	100,000.00	87,608.52	
		DNBNO 0.01% 01/21/31	100,000.00	86,654.86	
		DNBNO 2.625% 01/28/30	500,000.00	502,207.50	
		DNBNO 4.5% 07/19/28	100,000.00	104,053.41	
		DNBNO 5% 09/13/33	200,000.00	211,025.72	
		DSFIR 3.625% 07/02/34	100,000.00	101,589.75	
		DSYFP 0.375% 09/16/29	100,000.00	91,382.13	
		DT 1.75% 12/09/49	100,000.00	65,482.26	
		DWNIGY 1.5% 04/30/30	200,000.00	186,503.92	
		EDENFP 3.625% 12/13/26	100,000.00	101,745.30	
		EDPPL 1.5% 11/22/27	100,000.00	98,203.00	
		EFFP 2.875% 03/05/29	100,000.00	101,099.00	
		EJRAIL 1.85% 04/13/33	100,000.00	91,092.50	
		EJRAIL 3.245% 09/08/30	200,000.00	204,367.60	
		ENBW 1.625% 08/05/79	100,000.00	97,173.58	
		ENBW 2.125% 08/31/2081	100,000.00	86,924.10	
		ENELIM 1.25% 01/17/35	100,000.00	81,050.69	
		ENELIM 3.875% 03/09/29	100,000.00	104,304.51	
		ENELIM 6.625% PERP	100,000.00	112,567.84	
		ENFP 2.25% 06/29/29	100,000.00	98,493.90	
		ENFP 3.25% 06/30/37	100,000.00	95,928.73	
		ENGIFP 1.75% 03/27/28	100,000.00	98,400.53	
		ENGIFP 2.125% 03/30/32	100,000.00	93,587.41	
		ENGIFP 3.625% 01/11/30	100,000.00	103,255.06	
		ENGIFP 4.5% 09/06/42	100,000.00	103,032.26	
		ENIIM 4.25% 05/19/33	100,000.00	104,995.42	
		ENXFP 0.75% 05/17/31	100,000.00	88,740.55	
		EOANGR 0.375% 09/29/27	100,000.00	96,132.22	
		EOANGR 2.875% 08/26/28	100,000.00	101,427.87	
		EOANGR 3.875% 01/12/35	100,000.00	103,487.22	
		EOANGR 4% 08/29/33	100,000.00	105,114.79	
		EQNR 1.375% 05/22/32	100,000.00	89,497.94	
		ERFFP 4% 07/06/29	100,000.00	103,466.17	
		ERSTBK 4% 01/16/31	100,000.00	104,592.00	
		EVKGR 2.25% 09/25/27	100,000.00	99,885.42	
		EXOIM 0.875% 01/19/31	100,000.00	89,050.17	
		F 5.125% 02/20/29	200,000.00	210,214.00	

		FI 4.5% 05/24/31	100,000.00	106,395.03	
		FMEGR 1.5% 05/29/30	100,000.00	93,570.25	
		FREGR 0.5% 10/01/28	100,000.00	93,991.62	
		FREGR 5.125% 10/05/30	100,000.00	110,193.70	
		GBLBBB 0.125% 01/28/31	100,000.00	85,506.45	
		GFCFP 0.875% 01/25/33	100,000.00	84,022.70	
		GM 3.7% 07/14/31	100,000.00	100,321.24	
		GM 4.5% 11/22/27	100,000.00	104,169.43	
		GS 0.25% 01/26/28	100,000.00	94,823.55	
		GS 4% 09/21/29	100,000.00	104,981.50	
		GSK 1.75% 05/21/30	100,000.00	95,616.83	
		HCOB 3.5% 03/17/28	100,000.00	101,945.15	
		HEIANA 2.25% 03/30/30	200,000.00	195,691.90	
		HEIGR 3.75% 05/31/32	200,000.00	207,299.94	
		HERIM 0.25% 12/03/30	100,000.00	86,595.02	
		HERIM 4.25% 04/20/33	100,000.00	105,221.73	
		HNDA 3.75% 10/25/27	100,000.00	102,722.00	
		HOFP 4.25% 10/18/31	100,000.00	106,655.65	
		HOLNSW 0.125% 07/19/27	100,000.00	95,709.61	
		HOLNSW 0.5% 09/03/30	100,000.00	88,791.25	
		HSBC 3.313% 05/13/30	200,000.00	202,236.80	
		HSBC 4.599% 03/22/35	200,000.00	208,144.32	
		HSBC 4.787% 03/10/32	100,000.00	107,842.59	
		HSBC 6.364% 11/16/32	100,000.00	107,559.90	
		HVB 0.375% 01/17/33	100,000.00	83,138.38	
		HVB 3% 07/13/26	100,000.00	100,903.74	
		IBESM 1.375% 03/11/32	100,000.00	89,765.57	
		IBESM 3.375% 11/22/32	100,000.00	101,472.88	
		IBESM 3.625% 07/13/33	100,000.00	102,412.98	
		IBM 3.75% 02/06/35	100,000.00	102,639.65	
		IBM 3.8% 02/10/45	100,000.00	94,842.71	
		IFXGR 2% 06/24/32	100,000.00	92,709.80	
		IGIM 0.5% 02/16/33	100,000.00	80,575.32	
		IGIM 3.125% 02/08/29	100,000.00	101,162.58	
		IMBLN 2.125% 02/12/27	100,000.00	99,567.04	
		INTNED 0.5% 02/17/27	500,000.00	487,495.29	
		INTNED 1% 02/17/37	200,000.00	154,900.08	
		INTNED 3% 02/15/33	100,000.00	100,645.93	
		INTNED 4.5% 05/23/29	100,000.00	105,027.55	
		INVSA 2.75% 06/10/32	100,000.00	97,846.75	
		ISPIM 5.625% 03/08/33	150,000.00	170,687.77	
		ISPIM 5% 03/08/28	150,000.00	156,295.54	
		ITW 3% 05/19/34	100,000.00	97,363.10	

		JAPTOB 4.125% 06/17/35	100,000.00	101,032.91	
		JCI 4.25% 05/23/35	100,000.00	105,179.90	
		JDEPNA 0.5% 01/16/29	200,000.00	184,876.87	
		JPM 0.389% 02/24/28	100,000.00	97,009.48	
		JPM 1.963% 03/23/30	100,000.00	97,253.55	
		KBCBB 0.125% 01/14/29	100,000.00	94,406.70	
		KBCBB 4.375% 11/23/27	100,000.00	102,790.00	
		KERFP 3.25% 02/27/29	100,000.00	101,441.24	
		KERFP 3.375% 02/27/33	100,000.00	97,375.36	
		KO 0.95% 05/06/36	100,000.00	78,086.42	
		KPN 3.875% 02/16/36	100,000.00	101,124.63	
		LBBW 0.375% 02/21/31	100,000.00	86,239.00	
		LBBW 0.375% 02/28/28	100,000.00	95,028.10	
		LBBW 0.375% 05/07/29	100,000.00	91,084.96	
		LEGGR 0.875% 11/28/27	100,000.00	95,953.00	
		LEGGR 3.875% 01/20/35	100,000.00	98,624.95	
		LIFP 2% 05/12/29	100,000.00	97,240.45	
		LIN 1.625% 03/31/35	100,000.00	85,771.82	
		LLOYDS 3.125% 08/24/30	100,000.00	100,738.79	
		LLY 1.375% 09/14/61	100,000.00	49,992.52	
		LRFP 0.75% 05/20/30	100,000.00	90,762.30	
		LSELN 1.75% 12/06/27	200,000.00	196,898.13	
		LXSGR 0.625% 12/01/29	100,000.00	90,248.23	
		MAERSK 0.75% 11/25/31	100,000.00	86,178.67	
		MAPSM 2.875% 04/13/30	100,000.00	97,939.38	
		MBGGR 0.75% 02/08/30	100,000.00	91,755.01	
		MBGGR 3.25% 09/15/27	200,000.00	204,092.90	
		MCFP 0.375% 02/11/31	100,000.00	87,958.14	
		MDLZ 0.25% 03/17/28	100,000.00	94,718.14	
		MDT 3.125% 10/15/31	200,000.00	201,007.24	
		MDT 3.375% 10/15/34	100,000.00	100,217.18	
		MET 4% 04/05/28	100,000.00	104,247.86	
		MIZUHO 4.157% 05/20/28	100,000.00	104,948.82	
		MO 2.2% 06/15/27	100,000.00	99,970.40	
		MRKGR 1.625% 09/09/2080	100,000.00	98,918.19	
		MS 2.95% 05/07/32	200,000.00	197,157.72	
		MS 4.813% 10/25/28	100,000.00	105,101.11	
		MSFT 2.625% 05/02/33	100,000.00	98,420.80	
		MUFG 0.848% 07/19/29	200,000.00	185,457.31	
		MUFG 3.87% 06/10/36	200,000.00	202,703.46	
		MUNRE 1% 05/26/42	100,000.00	84,714.83	
		NAB 0.01% 01/06/29	100,000.00	91,696.15	

		NAB 2.125% 05/24/28	100,000.00	99,323.60	
		NAB 3.146% 02/05/31	500,000.00	509,240.75	
		NACN 3.5% 04/25/28	200,000.00	206,063.80	
		NDAFH 0.5% 05/14/27	200,000.00	194,172.65	
		NDAQ 0.875% 02/13/30	100,000.00	91,308.90	
		NDASS 1.125% 02/16/27	100,000.00	98,267.45	
		NDASS 1% 03/30/29	200,000.00	190,260.71	
		NDB 2.25% 09/20/27	500,000.00	500,302.65	
		NDB 2.625% 10/20/28	300,000.00	302,728.35	
		NDB 2.875% 03/19/30	200,000.00	202,556.68	
		NDB 4.875% 07/11/28	100,000.00	107,059.40	
		NESNVX 0.875% 06/14/41	100,000.00	68,700.17	
		NESNVX 3.5% 12/13/27	200,000.00	206,231.80	
		NESVFH 3.875% 03/16/29	100,000.00	103,478.50	
		NGGLN 0.163% 01/20/28	100,000.00	94,365.14	
		NGGLN 2.949% 03/30/30	100,000.00	100,135.92	
		NK 1% 07/15/31	100,000.00	86,835.95	
		NNGRNV 0.875% 11/23/31	100,000.00	89,097.80	
		NNGRNV 6% 11/03/43	100,000.00	111,812.63	
		NOKIA 4.375% 08/21/31	100,000.00	105,525.53	
		NOVNVX 0% 09/23/28	100,000.00	92,965.67	
		NTGYSM 3.25% 10/02/30	100,000.00	100,560.72	
		NTT 0.342% 03/03/30	100,000.00	88,434.57	
		NTT 0.399% 12/13/28	100,000.00	92,463.12	
		NWG 3.625% 01/09/29	200,000.00	206,503.26	
		NWG 5.763% 02/28/34	100,000.00	108,034.54	
		NWIDE 2% 04/28/27	100,000.00	99,553.84	
		O 5.125% 07/06/34	100,000.00	109,844.93	
		OMVAV 2.375% 04/09/32	100,000.00	97,503.59	
		OMVAV 2.5% PERP	100,000.00	99,658.75	
		OPBANK 0.375% 06/16/28	200,000.00	187,965.17	
		OPBANK 4.125% 04/18/27	100,000.00	103,149.36	
		ORAFP 1.25% 07/07/27	100,000.00	98,033.52	
		ORAFP 3.625% 11/16/31	100,000.00	103,648.42	
		ORAFP 3.875% PERP	200,000.00	198,548.24	
		ORFP 3.375% 11/23/29	100,000.00	103,644.03	
		ORIX 4.477% 06/01/28	100,000.00	104,934.90	
		ORSTED 3.75% 03/01/30	100,000.00	102,669.07	
		PEP 0.5% 05/06/28	100,000.00	94,974.02	
		PHIANA 2.625% 05/05/33	100,000.00	94,087.52	
		PLD 1.5% 02/08/34	100,000.00	85,113.18	
		PLD 4.25% 01/31/43	100,000.00	99,304.70	
		PLNIJ 1.875% 11/05/31	100,000.00	87,605.00	

		POWFIN 1.841% 09/21/28	100,000.00	95,480.00	
		PROXBB 4.125% 11/17/33	100,000.00	104,670.40	
		PROXBB 4% 03/08/30	100,000.00	104,620.76	
		PRXNA 2.031% 08/03/32	100,000.00	89,822.47	
		RABOBK 3.064% 02/01/34	200,000.00	201,806.02	
		RABOBK 3.822% 07/26/34	200,000.00	206,075.26	
		RABOBK 3.875% 11/30/32	100,000.00	101,995.05	
		RBIAV 4.625% 08/21/29	100,000.00	104,176.60	
		RBIAV 7.375% 12/20/32	100,000.00	107,633.15	
		RDSALN 1.5% 04/07/28	100,000.00	98,043.50	
		RDSALN 1.875% 04/07/32	100,000.00	92,768.30	
		REESM 4.625% PERP	200,000.00	206,092.38	
		RIFP 1.375% 04/07/29	100,000.00	95,301.06	
		RIFP 1.75% 04/08/30	100,000.00	95,062.12	
		RWE 2.75% 05/24/30	100,000.00	99,778.99	
		RWE 4.125% 02/13/35	100,000.00	105,148.81	
		RY 0.01% 10/05/28	100,000.00	92,598.38	
		RY 2.375% 09/13/27	1,000,000.00	1,003,853.50	
		SABSM 1.75% 05/30/29	200,000.00	194,345.50	
		SABSM 3.25% 06/05/34	200,000.00	202,418.00	
		SANFP 1.25% 03/21/34	100,000.00	86,352.79	
		SANFP 1.5% 04/01/30	100,000.00	95,073.42	
		SANTAN 1.625% 10/22/30	100,000.00	92,901.26	
		SANTAN 3.25% 04/02/29	300,000.00	304,431.06	
		SANTAN 3.375% 01/11/30	200,000.00	207,209.58	
		SANTAN 3.5% 01/09/30	100,000.00	102,552.30	
		SANTAN 4.25% 06/12/30	100,000.00	106,176.74	
		SANUK 2.625% 04/12/28	500,000.00	503,854.70	
		SANUK 3% 03/12/29	500,000.00	508,631.15	
		SAPGR 0.375% 05/18/29	100,000.00	92,502.85	
		SEB 3.25% 05/04/28	100,000.00	102,589.51	
		SEB 4.5% 11/27/34	200,000.00	210,644.74	
		SEB 4% 11/09/26	100,000.00	102,357.19	
		SESGFP 3.5% 01/14/29	100,000.00	100,200.64	
		SGOFP 3.875% 11/29/30	100,000.00	104,545.03	
		SHBASS 0.01% 09/30/30	100,000.00	87,219.40	
		SHBASS 3.75% 11/01/27	100,000.00	103,315.33	
		SIEGR 1% 02/25/30	100,000.00	93,244.68	
		SIEGR 3.375% 08/24/31	200,000.00	206,095.84	
		SIEGR 3.5% 02/24/36	100,000.00	100,842.73	
		SIEGR 3.625% 02/24/43	100,000.00	97,249.42	
		SMINLN 2% 02/23/27	100,000.00	99,287.00	

		SOCGEN 0.5% 06/12/29	100,000.00	93,787.62	
		SOCGEN 3.75% 05/17/35	200,000.00	199,230.45	
		SOCGEN 5.25% 09/06/32	100,000.00	105,120.71	
		SOCSFH 0.01% 12/02/26	100,000.00	97,203.48	
		SOCSFH 1.75% 05/05/34	100,000.00	89,425.77	
		SOCSFH 3.125% 02/24/32	100,000.00	101,185.90	
		SOCSFH 3.375% 07/31/30	500,000.00	515,726.90	
		SRGIM 1% 09/12/34	100,000.00	80,482.97	
		SRGIM 3.375% 12/05/26	100,000.00	101,287.25	
		SSELN 3.5% 03/18/32	100,000.00	101,662.89	
		SSELN 4% PERP	100,000.00	101,386.44	
		STANLN 1.2% 09/23/31	100,000.00	97,921.61	
		STLA 1.25% 06/20/33	100,000.00	80,233.11	
		STLA 3.75% 03/19/36	200,000.00	185,037.61	
		STLA 4.25% 06/16/31	100,000.00	102,520.82	
		SUFP 3.375% 04/13/34	100,000.00	101,303.87	
		SWEDA 1.3% 02/17/27	100,000.00	98,509.05	
		SWEDA 3.125% 07/05/28	100,000.00	102,215.21	
		SWFP 1% 07/17/28	100,000.00	95,706.75	
		T(AT&T) 1.6% 05/19/28	200,000.00	195,488.58	
		T(AT&T) 4.3% 11/18/34	100,000.00	105,557.80	
		TACHEM 0.75% 07/09/27	100,000.00	96,780.52	
		TCLAU 4.225% 04/26/33	100,000.00	105,339.79	
		TD 3.191% 02/16/29	500,000.00	511,942.95	
		TD 3.715% 03/13/30	200,000.00	209,407.50	
		TELBSS 0.75% 03/23/31	200,000.00	178,132.53	
		TELEFO 1.788% 03/12/29	100,000.00	97,068.49	
		TELEFO 4.055% 01/24/36	100,000.00	100,569.50	
		TELIAS 2.75% 06/30/83	100,000.00	98,265.11	
		TELNO 1.75% 05/31/34	100,000.00	88,732.40	
		TELNO 4.25% 10/03/35	200,000.00	212,086.98	
		TEMASE 3.25% 02/15/27	150,000.00	152,202.31	
		TENN 0.125% 12/09/27	100,000.00	95,102.09	
		TENN 0.875% 06/16/35	100,000.00	79,487.34	
		TENN 2.125% 11/17/29	200,000.00	195,354.88	
		TMO 1.75% 04/15/27	300,000.00	297,207.75	
		TMO 1.875% 10/01/49	100,000.00	64,729.15	
		TOTAL 1.491% 04/08/27	100,000.00	98,645.45	
		TOYOTA 0.25% 07/16/26	100,000.00	98,130.11	
		TOYOTA 4.05% 09/13/29	100,000.00	105,085.61	
		TRNIM 0.375% 06/23/29	100,000.00	91,370.43	
		TTEFP 1.618% 05/18/40	100,000.00	74,936.40	
		TTEFP 2.125% PERP	100,000.00	87,548.70	

		TTEFP 3.25% PERP	100,000.00	89,296.50	
		UBS 4.375% 01/11/31	200,000.00	211,252.44	
		UBS 7.75% 03/01/29	200,000.00	225,354.24	
		UCGIM 0.925% 01/18/28	100,000.00	97,981.80	
		UCGIM 1.625% 01/18/32	100,000.00	91,125.64	
		ULFP 0.625% 05/04/27	100,000.00	96,941.34	
		ULFP 0.875% 03/29/32	100,000.00	84,418.28	
		ULFP 1.375% 05/25/33	200,000.00	169,067.88	
		ULFP 1.75% 02/27/34	100,000.00	85,576.01	
		UNANA 3.25% 02/23/31	100,000.00	102,340.30	
		UNANA 3.3% 06/06/29	100,000.00	102,773.12	
		UNANA 3.5% 02/15/37	100,000.00	99,488.02	
		USB 4.009% 05/21/32	200,000.00	206,933.08	
		V 3.875% 05/15/44	200,000.00	199,727.25	
		VATFAL 0.125% 02/12/29	100,000.00	91,886.50	
		VIEFP 1.625% 09/17/30	100,000.00	93,858.39	
		VIEFP 1.94% 01/07/30	100,000.00	96,394.97	
		VOD 2.5% 05/24/39	100,000.00	85,918.46	
		VW 1.5% 01/21/41	100,000.00	66,047.70	
		VW 3.75% 09/28/27	300,000.00	307,694.52	
		VW 3.875% PERP	200,000.00	193,743.33	
		VW 4.25% 02/15/28	100,000.00	103,789.31	
		VW 4.75% 09/25/31	100,000.00	107,414.79	
		VZ 0.375% 03/22/29	100,000.00	92,124.02	
		VZ 0.75% 03/22/32	100,000.00	85,806.98	
		VZ 1.85% 05/18/40	100,000.00	76,036.64	
		VZ 4.75% 10/31/34	100,000.00	109,053.00	
		WFC 1.741% 05/04/30	100,000.00	96,067.48	
		XOM 0.524% 06/26/28	100,000.00	94,650.00	
	ユーロ 小計		59,450,000.00	58,129,520.94 (9,953,517,870)	
	イギリスポンド	AAPL 3.05% 07/31/29	100,000.00	96,485.15	
		ACAFP 5.5% 07/31/32	200,000.00	204,381.36	
		ALVGR 4.5% 03/13/43	100,000.00	87,602.64	
		ANNGR 5.5% 01/18/36	100,000.00	96,938.55	
		ARNDTN 3% 10/16/29	100,000.00	90,029.37	
		AVLN 4% 06/03/55	100,000.00	84,220.24	
		BACR 5.851% 03/21/35	100,000.00	101,145.38	
		BATSLN 5.75% 07/05/40	100,000.00	94,455.73	
		BFCM 1% 07/16/26	100,000.00	96,662.00	
		BPLN 4.25% PERP	100,000.00	98,585.93	
		BRK 2.625% 06/19/59	100,000.00	52,143.90	

		CDTFIN 2.125% 09/22/28	100,000.00	92,968.44	
		CDTFIN 5.625% 01/11/36	100,000.00	98,299.22	
		CMCSA 4% 11/26/29	100,000.00	98,116.87	
		CMCSA 5.5% 11/23/29	100,000.00	103,966.93	
		CMCSA 6% 05/21/27	100,000.00	103,033.03	
		CPGLN 4.375% 09/08/32	100,000.00	98,101.64	
		EDF 5.5% 01/25/35	100,000.00	96,996.07	
		EJRAIL 4.75% 12/08/31	100,000.00	99,463.92	
		ENELIM 1% 10/20/27	100,000.00	92,968.88	
		ENGIFP 5.625% 04/03/53	100,000.00	88,643.54	
		ENGIFP 5.75% 10/28/50	100,000.00	91,788.52	
		EQNR 4.25% 04/10/41	200,000.00	171,336.57	
		GSK 5.25% 04/10/42	100,000.00	94,599.90	
		HSBC 1.75% 07/24/27	100,000.00	97,148.02	
		HSBC 3% 05/29/30	100,000.00	93,848.62	
		HSBC 4.75% 03/24/46	100,000.00	81,366.36	
		HSBC 8.201% 11/16/34	100,000.00	110,407.71	
		HTHROW 4.625% 10/31/46	100,000.00	80,871.76	
		INFLN 3.125% 07/05/26	100,000.00	98,551.70	
		LLOYDS 6.5% 09/17/40	100,000.00	108,154.38	
		LLOYDS 6.625% 06/02/33	100,000.00	103,745.40	
		MCD 3.75% 05/31/38	100,000.00	83,013.87	
		MET 1.625% 10/12/28	100,000.00	91,707.36	
		MGNLN 6.34% 12/19/63	100,000.00	93,989.25	
		MS 2.625% 03/09/27	100,000.00	97,210.52	
		NGGLN 2.75% 02/06/35	100,000.00	79,183.72	
		NGGLN 2% 04/17/40	100,000.00	62,069.84	
		NGGLN 5.272% 01/18/43	100,000.00	89,819.20	
		NWG 3.619% 03/29/29	100,000.00	97,468.76	
		NWIDE 6.178% 12/07/27	100,000.00	102,251.13	
		0 1.875% 01/14/27	100,000.00	95,980.66	
		0 5.25% 09/04/41	100,000.00	90,261.65	
		PFE 6.5% 06/03/38	100,000.00	109,162.41	
		RABOBK 1.875% 07/12/28	100,000.00	95,072.50	
		RTOLN 5% 06/27/32	100,000.00	99,006.02	
		SANTAN 4.75% 08/30/28	100,000.00	100,482.58	
		SANTAN 5.125% 01/25/30	100,000.00	101,800.15	
		SANUK 7.482% 08/29/29	100,000.00	107,580.95	
		SGOFP 4.625% 10/09/29	100,000.00	100,433.21	
		SGROLN 5.125% 12/06/41	100,000.00	91,493.80	
		STANLN 4.375% 01/18/38	100,000.00	87,621.45	
		UBS 7% 09/30/27	100,000.00	102,810.97	
		UPS 5.125% 02/12/50	100,000.00	90,102.89	

		VIEFP 5.375% 12/02/30	100,000.00	102,878.79	
		VW 3.375% 11/16/26	100,000.00	98,282.27	
		WELL 4.8% 11/20/28	100,000.00	100,484.91	
	イギリスポンド 小計		5,900,000.00	5,577,196.59 (1,107,296,610)	
	スウェーデンクローナ	LANSBK 0.5% 09/20/28	2,000,000.00	1,889,016.48	
		LANSBK 1% 09/15/27	3,500,000.00	3,413,833.67	
		LANSBK 3% 09/19/29	2,000,000.00	2,041,171.60	
		LFBANK 3.5% 09/10/31	2,000,000.00	2,078,817.80	
		NDAFH 1% 06/16/27	4,000,000.00	3,915,038.88	
		SEB 0.5% 12/16/26	2,000,000.00	1,956,313.84	
		SHBASS 2.5% 02/01/30	4,000,000.00	3,993,898.48	
		SHBASS 2.5% 12/01/27	2,000,000.00	2,013,725.40	
		SHBASS 2% 09/01/28	1,000,000.00	990,636.04	
		SWEDA 1% 03/17/27	1,000,000.00	981,923.15	
		SWEDA 3% 03/15/28	1,100,000.00	1,121,470.46	
		SWEDA 3% 03/28/29	2,000,000.00	2,042,668.40	
	スウェーデンクローナ 小計		26,600,000.00	26,438,514.20 (405,831,192)	
	オーストラリアドル	ABIBB 4.1% 09/06/27	100,000.00	100,015.00	
		ANZ 5.906% 08/12/32	100,000.00	102,488.00	
		ANZ 6.124% 07/25/39	200,000.00	206,920.00	
		ANZ 6.405% 09/20/34	100,000.00	105,401.00	
		BNP 5.288% 02/15/29	200,000.00	204,572.00	
		CBAAU 5% 01/13/28	200,000.00	204,774.00	
		CPPIBC 4.45% 09/01/27	100,000.00	101,449.00	
		LBBW 5.25% 08/02/29	200,000.00	203,240.00	
		LLOYDS 5.189% 05/28/31	100,000.00	100,628.00	
		MQGAU 6.082% 06/07/32	100,000.00	102,250.00	
		QANAU 2.95% 11/27/29	100,000.00	92,137.00	
		TLSAU 5.65% 03/06/34	200,000.00	206,864.00	
		WSTP 2.4% 01/25/27	100,000.00	97,795.00	
		WSTP 6.934% 06/23/38	100,000.00	109,131.00	
	オーストラリアドル 小計		1,900,000.00	1,937,664.00 (185,105,041)	
社債券合計				30,760,410,510 (30,760,410,510)	
投資信託受益証券	アメリカドル	ISHARES MBS ETF	1,156,081	107,850,796.49	
	アメリカドル 小計		1,156,081	107,850,796.49 (15,734,352,699)	
投資信託受益証券合計			1,156,081	15,734,352,699 (15,734,352,699)	

合計		133,357,527,325 (133,357,527,325)	

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	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	国債証券　220銘柄	43.4%	—	21.2%
	地方債証券　18銘柄	1.0%	—	0.5%
	特殊債券　78銘柄	3.5%	—	1.7%
	社債券　971銘柄	28.0%	—	13.7%
	投資信託受益証券　1銘柄	—	24.2%	11.8%
カナダドル	国債証券　35銘柄	33.5%	—	1.0%
	地方債証券　66銘柄	31.1%	—	0.9%
	特殊債券　24銘柄	13.4%	—	0.4%
	社債券　67銘柄	22.1%	—	0.7%
メキシコペソ	国債証券　15銘柄	100.0%	—	0.4%
ユーロ	国債証券　405銘柄	54.9%	—	14.3%
	地方債証券　51銘柄	3.1%	—	0.8%
	特殊債券　161銘柄	13.4%	—	3.5%
	社債券　436銘柄	28.6%	—	7.5%
イギリスポンド	国債証券　62銘柄	74.4%	—	3.3%
	特殊債券　17銘柄	6.9%	—	0.3%
	社債券　57銘柄	18.7%	—	0.8%
スイスフラン	国債証券　21銘柄	100.0%	—	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券　7銘柄	27.8%	—	0.1%
	社債券　12銘柄	72.2%	—	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券　11銘柄	100.0%	—	0.1%
デンマーククローネ	国債証券　7銘柄	100.0%	—	0.2%
チェココルナ	国債証券　21銘柄	100.0%	—	0.2%
ハンガリーフォリント	国債証券　16銘柄	100.0%	—	0.1%
ポーランドズロチ	国債証券　15銘柄	100.0%	—	0.3%
オーストラリアドル	国債証券　27銘柄	50.9%	—	0.8%
	地方債証券　32銘柄	31.3%	—	0.5%
	特殊債券　16銘柄	8.8%	—	0.1%
	社債券　14銘柄	9.1%	—	0.1%
ニュージーランドドル	国債証券　14銘柄	100.0%	—	0.2%
シンガポールドル	国債証券　21銘柄	100.0%	—	0.2%
マレーシアリンギット	国債証券　24銘柄	100.0%	—	0.4%

タイバーツ	国債証券　25銘柄	100.0%	—	0.4%
インドネシアルピア	国債証券　21銘柄	100.0%	—	0.4%
韓国ウォン	国債証券　31銘柄	100.0%	—	1.3%
イスラエルシェケル	国債証券　13銘柄	100.0%	—	0.2%
オフショア人民元	国債証券　63銘柄	55.9%	—	6.0%
	特殊債券　71銘柄	44.1%	—	4.7%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス　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
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	(1)株式

	2025年 7月10日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 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。 (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。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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	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	5.0749円
	(1万口当たり純資産額)	(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	
ＳＭＴ　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
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	6,704,738,381円
ＤＣ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（ＳＭＡ専用）	91,770,990円
コア投資戦略ファンド（安定型）	56,616,568円

区分	2025年 7月10日現在
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
ＤＣ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
ＤＣ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
ＳＭＴ　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ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,092,830,880円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	326,492,154円
ＳＭＴ　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
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	240,446,023円
ＳＭＴ　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
Ｍｙ　ＳＭＴ　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
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	155,118,071円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	169,781,972円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	82,810,438円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	106,284,448円
１０資産分散投資ファンド	18,452,071円
グローバル１０資産バランスファンド	37,071,336円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	21,602,047円
ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー）	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
ＦＯＦｓ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
ＦＯＦｓ用　新興国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	23,196,200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）	6,734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）	13,155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）	13,090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）	23,402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）	13,155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）	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

（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	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-O	513,300	172.37	88,477,521.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	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)	
ブラジルレアル	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	
ブラジルレアル 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	
CRRC CORP 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	
WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	15.68	6,409,984.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	132,300	30.80	4,074,840.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	14.80	5,706,095.60	
COSCO SHIPPING HOLDONGS 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	
HUISHAN 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 APPTEC 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	
マレーシアリンギット 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 INDONESI 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 & TECHONOLOGY 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)	
新台湾ドル	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	
	EMEMORY 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	
	FIRSTRAND 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)	
クウェートディナール	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)	
	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.12	897,804.00	

オフショア人民元	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	
WEICHAI 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 TIANTAN 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 PIENTZEHUANG 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	
UNISPLENDOUR 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 CHUANTOU 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	
	ブラジルレアル 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。

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

	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

区分	2025年 7月10日現在
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	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,784,555,349円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,747,045円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴ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
ＳＭＴ　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
ＳＭＴ　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
ＳＢＩ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
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴ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
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	177,632,636円
ＦＯＦｓ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－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１５－０４（適格機関投資家専用）	219,067,483円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・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	
	ＳＯＳｉＬＡ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	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	13,838	1,713,144,400	
	ＧＬＰ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	
	Ｏｎｅ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	
	ＣＲＥ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	
	ＮＴＴ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	
	ＫＤＸ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

	2025年 7月10日現在
項目	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

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
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	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)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	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 3.0658円 (1万口当たり純資産額) (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	(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	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

区分	2025年 7月10日現在
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
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。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
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	
		CURBLINE 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	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,956	241,629.40	
	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	

	SEGRO 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)	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	699,950	1,413,899.00	

ニュージーランドドル				
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 & COMMERCI	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	
	LENDLEASE 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	
	OUE 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

1.通貨ごとの小計の欄における(　)内は、邦貨換算額であります。

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

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

4.外貨建有価証券の通貨別内訳

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

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　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	223,877,145
コール・ローン	396,302,560
社債券	30,935,843,199
未収利息	5,071

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	31,556,027,975
資産合計	31,556,027,975
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	976,400
未払金	142,315,695
未払解約金	3,571,339
流動負債合計	146,863,434
負債合計	146,863,434
純資産の部	
元本等	
元本	47,793,990,102
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△16,384,825,561
元本等合計	31,409,164,541
純資産合計	31,409,164,541
負債純資産合計	31,556,027,975

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

（貸借対照表に関する注記）

		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	47,793,990,102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 16,384,825,561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 0.6572円 (1万口当たり純資産額) (6,572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。

	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、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	43,639,818,203円
期中追加設定元本額	10,124,794,007円
期中一部解約元本額	5,970,622,108円
期末元本額	47,793,990,102円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	36,493,005,703円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,172,438,028円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,043,559,038円
コア投資戦略ファンド（切替型）	858,102,299円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	4,159,857,809円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	596,057,664円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	162,692,231円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,837,660,205円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	395,757,513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）	74,859,612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)
社債券	118,057,106
合計	118,057,106

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「グローバル・コモディティ（米ドル建て）　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

（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	146,850,000	－	145,873,600	△976,400
	アメリカドル	146,850,000	－	145,873,600	△976,400
合計		146,850,000	－	145,873,600	△976,400

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	BAR USD COM 043 03/31/26	8,000,000.00	8,120,800.00	
		ETFS ALL COMMODITIES	40,000,000.00	4,712,000.00	
		IPATH DOW COMM 06/12/36	15,000,000.00	5,152,500.00	
		SG ISSUER 040 07/31/25	23,000,000.00	24,780,200.00	
		SG ISSUER 041 09/30/25	22,000,000.00	22,477,400.00	
		SG ISSUER 042 11/28/25	25,000,000.00	25,962,500.00	
		SG ISSUER 043 01/30/26	24,000,000.00	23,472,000.00	
		SG ISSUER 045 06/30/26	1,000,000.00	967,700.00	
		STAR HELIOS 008 10/24/25	55,000,000.00	96,404,000.00	
	アメリカドル 小計		213,000,000.00	212,049,100.00 (30,935,843,199)	
合計				30,935,843,199 (30,935,843,199)	

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	社債券　　9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。

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	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。

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

（貸借対照表に関する注記）

		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 1.8981円 (1万口当たり純資産額) (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
ＦＯＦｓ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。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
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

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。

米国株式ＬＳ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	

	2025年 7月10日現在
項目	金額（円）
流動資産	
預金	379
コール・ローン	376,130,367
社債券	13,904,548,603
未収利息	4,813
流動資産合計	14,280,684,162
資産合計	14,280,684,162
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	167,088,000
未払金	84,192,000
未払解約金	255,538
流動負債合計	251,535,538
負債合計	251,535,538
純資産の部	
元本等	
元本	10,820,963,695
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,208,184,929
元本等合計	14,029,148,624
純資産合計	14,029,148,624
負債純資産合計	14,280,684,162

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

（貸借対照表に関する注記）

		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	10,820,963,695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 1.2965円 (1万口当たり純資産額) (12,965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為替変動リスクに対して為替ヘッジを目的として、当該規定に従い為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	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	15,903,410,443円
期中追加設定元本額	1,483,858,106円
期中一部解約元本額	6,566,304,854円
期末元本額	10,820,963,695円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	696,367,836円
コア投資戦略ファンド（成長型）	806,188,636円
コア投資戦略ファンド（切替型）	323,186,321円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	215,923,431円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	8,327,908,655円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	220,035,677円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,666,780円

区分	2025年 7月10日現在
ＦＯＦｓ用　米国株式ＬＳファンドＳ（適格機関投資家専用）	186,686,359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)
社債券	957,275,763
合計	957,275,763

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（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				
	売建	13,783,334,400	－	13,950,422,400	△167,088,000
	アメリカドル	13,783,334,400	－	13,950,422,400	△167,088,000
合計		13,783,334,400	－	13,950,422,400	△167,088,000

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカドル	STAR HELIOS 004 10/18/27	58,000,000.00	95,308,442.00	
	アメリカドル 小計		58,000,000.00	95,308,442.00 (13,904,548,603)	
合計				13,904,548,603 (13,904,548,603)	

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	社債券　　1銘柄	100.0%	100.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	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	103,461,935
社債券	13,245,640,000
未収利息	1,323
流動資産合計	13,349,103,258
資産合計	13,349,103,258
負債の部	
流動負債	
未払解約金	58,890,000
流動負債合計	58,890,000
負債合計	58,890,000
純資産の部	
元本等	
元本	10,449,715,264
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,840,497,994
元本等合計	13,290,213,258
純資産合計	13,290,213,258
負債純資産合計	13,349,103,258

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

（貸借対照表に関する注記）

		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		10,449,715,264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	1.2718円
	(1万口当たり純資産額)	(12,718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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	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	14,434,093,138円
期中追加設定元本額	1,285,316,142円
期中一部解約元本額	5,269,694,016円
期末元本額	10,449,715,264円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	657,833,165円
コア投資戦略ファンド（成長型）	786,039,265円
コア投資戦略ファンド（切替型）	312,141,304円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	212,344,019円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	8,071,524,426円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	160,038,146円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	39,302,446円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	210,492,493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)
社債券	△36,073,000

合計	△36,073,000

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

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式
該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ソシエテ・ジェネラル　０％　２０２６／０３／３１	4,200,000,000	4,233,180,000	
	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　０７／１６／２６	7,030,000,000	9,012,460,000	
合計		11,230,000,000	13,245,640,000	

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	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	54,860,091
社債券	5,287,534,800
未収利息	702
流動資産合計	5,342,395,593
資産合計	5,342,395,593
負債の部	
流動負債	
未払解約金	21,460,000
流動負債合計	21,460,000
負債合計	21,460,000
純資産の部	
元本等	
元本	6,151,389,362
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△830,453,769
元本等合計	5,320,935,593
純資産合計	5,320,935,593
負債純資産合計	5,342,395,593

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

（貸借対照表に関する注記）

		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	6,151,389,362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 830,453,769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 0.8650円 (1万口当たり純資産額) (8,650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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	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	9,181,619,333円
期中追加設定元本額	1,487,249,617円
期中一部解約元本額	4,517,479,588円
期末元本額	6,151,389,362円

区分	2025年 7月10日現在
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,753,804円
コア投資戦略ファンド（成長型）	408,010,253円
コア投資戦略ファンド（切替型）	164,453,324円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	156,411,585円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	4,609,145,751円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	83,671,021円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,397,622円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	90,329,092円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	265,216,910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)
社債券	72,691,400
合計	72,691,400

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	ＳＴＡＲ　ＨＥＬＩＯＳ　０％　１０／２０／２５	6,117,000,000	5,287,534,800	
合計		6,117,000,000	5,287,534,800	

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

該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	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

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

（貸借対照表に関する注記）

		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.	1口当たり純資産額	1.0717円

	2025年 7月10日現在
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従って債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	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	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

区分	2025年 7月10日現在
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セレクション（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)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	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	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。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	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。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期中間計算期間(2025年7月11日から2026年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （2025年 7月10日現在）	第13期中間計算期間 （2026年 1月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	504,260,862	488,956,900
投資信託受益証券	14,888,791,523	16,255,319,227
投資証券	2,305,960,931	3,217,626,341
親投資信託受益証券	11,147,456,614	10,591,111,494
未収入金	126,507,367	104,711,035
未収利息	6,452	19,218
流動資産合計	28,972,983,749	30,657,744,215
資産合計	28,972,983,749	30,657,744,215
負債の部		
流動負債		
未払解約金	47,307,187	50,929,365
未払受託者報酬	7,796,453	8,239,574
未払委託者報酬	207,152,918	218,891,955
その他未払費用	778,654	821,322
流動負債合計	263,035,212	278,882,216
負債合計	263,035,212	278,882,216
純資産の部		
元本等		
元本	20,201,163,175	19,006,737,734
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,508,785,362	11,372,124,265
（分配準備積立金）	6,020,786,340	5,609,616,593
元本等合計	28,709,948,537	30,378,861,999
純資産合計	28,709,948,537	30,378,861,999
負債純資産合計	28,972,983,749	30,657,744,215

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自　2024年 7月11日 至　2025年 1月10日	第13期中間計算期間 自　2025年 7月11日 至　2026年 1月10日
営業収益		
受取配当金	4,809,111	4,602,925
受取利息	836,623	1,635,840
有価証券売買等損益	△259,448,843	3,706,436,359
営業収益合計	△253,803,109	3,712,675,124
営業費用		
受託者報酬	8,641,854	8,239,574
委託者報酬	229,873,324	218,891,955
その他費用	834,756	821,322
営業費用合計	239,349,934	227,952,851
営業利益又は営業損失（△）	△493,153,043	3,484,722,273
経常利益又は経常損失（△）	△493,153,043	3,484,722,273
中間純利益又は中間純損失（△）	△493,153,043	3,484,722,273
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△72,138,983	135,438,134
期首剰余金又は期首欠損金（△）	9,953,748,608	8,508,785,362
剰余金増加額又は欠損金減少額	164,080,876	98,530,535
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	164,080,876	98,530,535
剰余金減少額又は欠損金増加額	950,427,437	584,475,771
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	950,427,437	584,475,771
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	8,746,387,987	11,372,124,265

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	第12期 (2025年 7月10日現在)	第13期中間計算期間 (2026年 1月10日現在)
１. 計算期間の末日における受益権の総数	20,201,163,175口	19,006,737,734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 1.4212円 (1万口当たり純資産額) (14,212円)	1口当たり純資産額 1.5983円 (1万口当たり純資産額) (15,983円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	第13期中間計算期間 (2026年 1月10日現在)
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第12期 自 2024年 7月11日 至 2025年 7月10日	第13期中間計算期間 自 2025年 7月11日 至 2026年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	22,861,763,346円	20,201,163,175円
期中追加設定元本額	636,436,125円	192,172,814円
期中一部解約元本額	3,297,036,296円	1,386,598,255円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,443,728,825
株式	907,788,979,320
派生商品評価勘定	140,326,500
未収入金	9,465,363
未収配当金	1,125,090,937
未収利息	500,028
その他未収収益	40,385,462
差入委託証拠金	310,197,445
流動資産合計	934,858,673,880
資産合計	934,858,673,880
負債の部	
流動負債	
前受金	140,398,000
未払解約金	4,444,076,122
未払利息	2,890,802
受入担保金	16,816,261,420
流動負債合計	21,403,626,344
負債合計	21,403,626,344
純資産の部	
元本等	
元本	241,204,857,517
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	672,250,190,019
元本等合計	913,455,047,536
純資産合計	913,455,047,536
負債純資産合計	934,858,673,880

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1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

	2026年 1月10日現在
	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）

		2026年 1月10日現在
１．	計算期間の末日における受益権の総数	241,204,857,517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	15,947,058,250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 3.7871円 (1万口当たり純資産額) (37,871円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	251,300,064,379円
期中追加設定元本額	7,855,827,283円
期中一部解約元本額	17,951,034,145円
期末元本額	241,204,857,517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）	195,762,498円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	2,595,756,492円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	9,564,862円
ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス・オープン	9,027,039,701円
世界経済インデックスファンド	7,025,885,571円
日本株式インデックス・オープン	2,509,151,795円
ＤＣマイセレクション２５	3,514,605,012円
ＤＣマイセレクション５０	13,560,096,860円
ＤＣマイセレクション７５	16,936,572,493円
ＤＣ日本株式インデックス・オープン	5,743,337,750円

区分	2026年 1月10日現在
ＤＣマイセレクションＳ２５	2,996,945,141円
ＤＣマイセレクションＳ５０	10,253,878,585円
ＤＣマイセレクションＳ７５	11,337,144,446円
ＤＣ日本株式インデックス・オープンＳ	9,697,516,383円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	446,489,955円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	400,944,390円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	3,632,796,845円
日本株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	141,225,074円
国内バランス６０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,205,996円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	6,343,433円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	13,783,445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）	42,492,446円
国内バランス６０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,609,535円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,525,184円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	30,107,205円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	7,555,581円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	32,202,745円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	165,484,313円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	197,807,091円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,414,819,557円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,262,690円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	5,699,998円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	191,281,493円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	104,154,683円
バランスＦ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	144,253,094円
国内バランス２５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	10,513,454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）	282,521,636円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	2,166,575,898円
日本株式ファンド・シリーズ２	2,422,305,782円
コア投資戦略ファンド（安定型）	477,327,205円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,189,337,654円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,598,660,610円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,996,495,498円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	721,172,610円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	358,526,881円
コア投資戦略ファンド（切替型）	453,749,992円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	161,942,911円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	7,526,846円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	34,828,147円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	18,404,668,073円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	167,297,498円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	69,173,817円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	332,219,972円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	50,719,744円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	15,350,037円
グローバル経済コア	631,639,768円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	37,172,379円
Ｍｙ　ＳＭＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（ノーロード）	4,569,931,135円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	29,436,924円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	447,871,443円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	131,536,432円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	77,764,338円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	94,047,871円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	47,876,300円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	64,706,717円
１０資産分散投資ファンド	103,316,421円
グローバル１０資産バランスファンド	64,544,612円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	12,950,302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	166,585,192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	56,890,429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	46,870,522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	41,819,065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	19,333,148円

区分	2026年 1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）２０６０	5,486,013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	4,036,721円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	1,391,342,917円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０６５	82,127円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７０	14,804円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７５	14,804円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０７０	9,752円
ＦＯＦｓ用　国内株式インデックス・ファンドＰ（適格機関投資家専用）	41,587,869,233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）	188,485,236円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	309,241,101円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,711,959円
ＳＭＴＡＭ日本株式インデックスファンドＶＬ－Ｐ（適格機関投資家専用）	50,778,635,885円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,621,278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）	239,206,250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）	19,280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）	16,288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）	27,723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）	34,815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）	23,063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）	26,321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）	2,685,442,342円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 1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	4,445,352,000	－	4,585,750,000	140,398,000
合計		4,445,352,000	－	4,585,750,000	140,398,000

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	100,197,261
株式	25,434,366,240
投資証券	57,299,200
派生商品評価勘定	2,764,860
未収入金	736,018,840
未収配当金	35,043,082
未収利息	1,969
差入委託証拠金	6,465,813
流動資産合計	26,372,157,265
資産合計	26,372,157,265
負債の部	

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
流動負債	
前受金	2,767,500
未払解約金	769,374,943
流動負債合計	772,142,443
負債合計	772,142,443
純資産の部	
元本等	
元本	12,046,340,343
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,553,674,479
元本等合計	25,600,014,822
純資産合計	25,600,014,822
負債純資産合計	26,372,157,265

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日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)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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。 (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）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	12,046,340,343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 2.1251円 (1万口当たり純資産額) (21,251円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

	2026年 1月10日現在
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)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。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	11,549,751,477円
期中追加設定元本額	1,109,353,334円
期中一部解約元本額	612,764,468円
期末元本額	12,046,340,343円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	150,306,670円
コア投資戦略ファンド（成長型）	365,732,239円
コア投資戦略ファンド（切替型）	135,080,587円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	8,169,825,073円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	75,746,916円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	133,019,490円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	40,246,119円
ＤＣ日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスファンド	2,868,490,217円
私募日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	54,077,337円
ＦＯＦｓ用　日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	53,815,695円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 1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	103,057,500	－	105,825,000	2,767,500
合計		103,057,500	－	105,825,000	2,767,500

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	570,541,385
株式	66,090,872,040
未収入金	164,240,946
未収配当金	39,822,300
未収利息	11,212
流動資産合計	66,865,487,883
資産合計	66,865,487,883
負債の部	
流動負債	
未払解約金	84,665,519
流動負債合計	84,665,519
負債合計	84,665,519
純資産の部	
元本等	
元本	7,758,929,194
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	59,021,893,170
元本等合計	66,780,822,364
純資産合計	66,780,822,364
負債純資産合計	66,865,487,883

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1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.収益及び費用の計上基準	受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	7,758,929,194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 8.6070円 (1万口当たり純資産額) (86,070円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	7,638,753,165円
期中追加設定元本額	440,917,646円
期中一部解約元本額	320,741,617円
期末元本額	7,758,929,194円
期末元本額の内訳	
ＤＣ日本株式エクセレント・フォーカス	5,069,931,656円
コア投資戦略ファンド（安定型）	37,100,831円
コア投資戦略ファンド（成長型）	93,742,905円
コア投資戦略ファンド（切替型）	33,328,111円
国内株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,102,060,752円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	18,682,023円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	32,910,101円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	10,159,202円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	294,406,955円
ＦＯＦｓ用　日本株式エクセレント・フォーカスＳ（適格機関投資家専用）	14,174,238円
ＦＯＦｓ用日本株式エクセレント・フォーカス（適格機関投資家専用）	58,239円
ＳＭＴ　ＥＴＦ日本株厳選投資アクティブ	52,374,181円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,339,752,435
コール・ローン	846,434,309
株式	986,483,995,399
投資信託受益証券	152,016,031
投資証券	14,933,371,298
派生商品評価勘定	268,774,005
未収入金	5,781,361
未収配当金	590,697,130
未収利息	16,634
差入委託証拠金	8,297,654,921
流動資産合計	1,021,918,493,523
資産合計	1,021,918,493,523
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,474,815
前受金	268,157,141
未払解約金	1,008,205,875

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,277,837,831
負債合計	1,277,837,831
純資産の部	
元本等	
元本	115,373,705,676
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	905,266,950,016
元本等合計	1,020,640,655,692
純資産合計	1,020,640,655,692
負債純資産合計	1,021,918,493,523

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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

	2026年 1月10日現在
	株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
１．	計算期間の末日における受益権の総数	115,373,705,676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 8.8464円 (1万口当たり純資産額) (88,464円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	117,291,679,009円
期中追加設定元本額	5,331,568,692円
期中一部解約元本額	7,249,542,025円
期末元本額	115,373,705,676円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,092,660,166円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	4,031,491円
ＳＭＴ　グローバル株式インデックス・オープン	32,590,486,047円
世界経済インデックスファンド	15,807,395,520円
外国株式インデックス・オープン	805,358,234円
ＤＣマイセレクション２５	380,730,408円
ＤＣマイセレクション５０	2,463,870,724円
ＤＣマイセレクション７５	3,643,432,899円

区分	2026年 1月10日現在
ＤＣ外国株式インデックス・オープン	14,192,628,561円
ＤＣマイセレクションＳ２５	319,623,850円
ＤＣマイセレクションＳ５０	1,866,176,614円
ＤＣマイセレクションＳ７５	2,434,839,606円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０３５	97,353,968円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０４５	86,178,093円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	8,377,450,277円
外国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	516,982,706円
マイセレクション５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,149,351円
マイセレクション７５ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,962,731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）	7,925,079円
バランス３０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,191,285円
バランス５０ＶＡ１（適格機関投資家専用）	12,690,545円
バランス２５ＶＡ２（適格機関投資家専用）	3,173,358円
バランス５０ＶＡ２（適格機関投資家専用）	13,524,898円
バランスＡ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	47,340,388円
バランスＢ（３７．５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	72,917,830円
バランスＣ（５０）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	601,416,862円
世界バランスＶＡ１（適格機関投資家専用）	42,367,871円
世界バランスＶＡ２（適格機関投資家専用）	7,150,536円
バランスＤ（３５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	60,455,109円
バランスＥ（２５）ＶＡ１（適格機関投資家専用）	20,274,830円
グローバル・バランスファンド・シリーズ１	613,231,151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）	490,646,469円
外国株式ファンド・シリーズ１	1,205,435,722円
コア投資戦略ファンド（安定型）	44,057,254円
コア投資戦略ファンド（成長型）	110,959,784円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,104,010,830円
分散投資コア戦略ファンドＳ	5,633,236,649円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,674,286,363円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	845,271,643円
コア投資戦略ファンド（切替型）	40,264,305円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	371,257,291円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	17,286,347円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	79,523,412円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	21,694,061円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	2,456,932,276円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	303,535,239円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,522,841,242円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	218,768,287円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	6,411,794円
Ｍｙ　ＳＭＴ　グローバル株式インデックス（ノーロード）	5,108,543,560円
グローバル経済コア	1,485,142,159円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	15,745,655円
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０５５	6,289,736円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	42,940,290円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	12,814,316円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	196,777,315円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	241,705,025円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	122,251,583円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	164,655,861円
１０資産分散投資ファンド	54,438,718円
グローバル１０資産バランスファンド	27,409,074円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	30,783,351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	106,712,360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	36,441,169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	29,868,999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	26,630,291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	12,230,041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	3,479,728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	2,564,536円
ＤＣマイセレクションＳ５０（２０２４－２０２６リスク抑制型）	147,548,763円
ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー）	1,239,197,946円

区分	2026年 1月10日現在
ＤＣターゲット・イヤー　ファンド２０６５	17,622円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７０	9,499円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）２０７５	9,499円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０７０	24,467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）	51,304,189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）	363,366,080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）	432,857,522円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,497,235,158円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	95,522,025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）	50,751,559円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	70,452,297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）	103,569,886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）	8,130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）	9,714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）	11,849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）	15,525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）	12,961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）	12,432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）	1,130,904,360円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	128,050,470円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	17,787,342,761	－	18,055,499,902	268,157,141
合計		17,787,342,761	－	18,055,499,902	268,157,141

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,149,396,900	－	1,150,254,851	△857,951
	アメリカドル	1,081,510,500	－	1,082,291,711	△781,211
	カナダドル	67,886,400	－	67,963,140	△76,740
合計		1,149,396,900	－	1,150,254,851	△857,951

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	476,279,955
コール・ローン	7,147,011
株式	27,952,993,850
投資信託受益証券	8,273,041
投資証券	445,711,138
派生商品評価勘定	4,907,630
未収入金	1,344,760,073
未収配当金	18,675,360
未収利息	140
差入委託証拠金	205,640,085
流動資産合計	30,464,388,283
資産合計	30,464,388,283
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	587,742
前受金	4,885,654
未払解約金	300,022,039
流動負債合計	305,495,435
負債合計	305,495,435
純資産の部	
元本等	
元本	13,081,364,409
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	17,077,528,439
元本等合計	30,158,892,848
純資産合計	30,158,892,848
負債純資産合計	30,464,388,283

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 (1)先物取引

	2026年 1月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	13,081,364,409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 2.3055円 (1万口当たり純資産額) (23,055円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	11,684,306,264円
期中追加設定元本額	2,078,731,848円
期中一部解約元本額	681,673,703円
期末元本額	13,081,364,409円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	162,243,104円
コア投資戦略ファンド（成長型）	430,616,485円
コア投資戦略ファンド（切替型）	155,286,528円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	81,354,041円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	9,588,133,665円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	165,732,781円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	49,725,340円
ＤＣ外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスファンド	2,387,232,096円
ＦＯＦｓ用　外国株式ＥＳＧリーダーズ・インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	61,040,369円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 1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	770,753,665	－	775,639,319	4,885,654
合計		770,753,665	－	775,639,319	4,885,654

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,245,330,376	－	1,245,896,142	△565,766
	アメリカドル	982,791,300	－	983,322,932	△531,632
	カナダドル	57,751,000	－	57,766,824	△15,824
	ユーロ	107,837,696	－	107,845,967	△8,271
	イギリスポンド	48,533,410	－	48,538,631	△5,221
	スイスフラン	29,482,950	－	29,486,130	△3,180
	オーストラリアドル	18,934,020	－	18,935,658	△1,638
合計		1,245,330,376	－	1,245,896,142	△565,766

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

世界債券総合インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	358,272,371
コール・ローン	416,631,473
国債証券	42,049,524,385
地方債証券	2,157,443,360
特殊債券	8,597,882,935
社債券	18,814,000,152
投資信託受益証券	9,597,654,507
派生商品評価勘定	173,902
未収入金	4,345,561
未収利息	744,940,771
前払費用	52,913,094
差入委託証拠金	87,174,074
流動資産合計	82,880,956,585
資産合計	82,880,956,585
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	28,798
前受金	4,911
未払金	510,598,717
未払解約金	20,123,110
流動負債合計	530,755,536
負債合計	530,755,536
純資産の部	
元本等	
元本	62,358,278,782
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	19,991,922,267
元本等合計	82,350,201,049
純資産合計	82,350,201,049
負債純資産合計	82,880,956,585

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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)投資信託受益証券

	2026年 1月10日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資信託受益証券は、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）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	62,358,278,782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 1.3206円 (1万口当たり純資産額) (13,206円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	113,163,718,012円
期中追加設定元本額	5,821,016,693円
期中一部解約元本額	56,626,455,923円
期末元本額	62,358,278,782円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	955,959,431円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,207,163,871円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,175,369,898円
外国債券ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	55,487,813,138円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	537,321,960円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	155,171,539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）	235,464,168円
ＦＯＦｓ用　世界債券総合インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	604,014,777円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	17,634,054	－	17,638,965	4,911
合計		17,634,054	－	17,638,965	4,911

(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

（2026年 1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	404,806,758	－	404,946,951	140,193
	アメリカドル	175,761,330	－	175,769,274	7,944
	カナダドル	12,000,763	－	12,006,299	5,536
	ユーロ	133,105,703	－	133,113,263	7,560
	イギリスポンド	24,656,300	－	24,690,293	33,993
	オフショア人民元	59,282,662	－	59,367,822	85,160
合計		404,806,758	－	404,946,951	140,193

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国株式インデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,264,673,965
コール・ローン	253,380,117
株式	316,810,585,936
投資信託受益証券	680,010,948
投資証券	295,112,809
派生商品評価勘定	591,254,177
未収入金	13,382,405
未収配当金	523,124,349
未収利息	4,979
差入委託証拠金	3,897,411,314
流動資産合計	329,328,940,999
資産合計	329,328,940,999
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	670,067
前受金	591,254,177
未払解約金	557,215,396
流動負債合計	1,149,139,640
負債合計	1,149,139,640
純資産の部	
元本等	
元本	50,344,108,180
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	277,835,693,179
元本等合計	328,179,801,359
純資産合計	328,179,801,359
負債純資産合計	329,328,940,999

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (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。 (3)投資証券

	2026年 1月10日現在
	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	50,344,108,180口
2.	計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 6.5187円 (1万口当たり純資産額) (65,187円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

	2026年 1月10日現在

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	50,833,427,807円
期中追加設定元本額	3,125,678,415円
期中一部解約元本額	3,614,998,042円
期末元本額	50,344,108,180円
期末元本額の内訳	
ＳＭＴ　新興国株式インデックス・オープン	6,243,106,662円
世界経済インデックスファンド	14,535,837,461円
ＤＣ新興国株式インデックス・オープン	6,993,761,082円
ＤＣ世界経済インデックスファンド	7,432,217,850円
新興国株式インデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	34,636,137円
コア投資戦略ファンド（安定型）	58,752,404円
コア投資戦略ファンド（成長型）	160,191,142円
分散投資コア戦略ファンドＡ	234,906,255円
分散投資コア戦略ファンドＳ	1,152,911,948円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,487,580,140円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	770,500,186円
コア投資戦略ファンド（切替型）	56,483,336円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	327,188,392円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	15,354,764円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	70,472,306円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	29,176,684円
外国株式ＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	3,485,463,033円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン	335,062,388円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,613,376,191円
ＳＭＴ　世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	251,012,579円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	8,878,674円
グローバル経済コア	1,302,178,448円
Ｍｙ　ＳＭＴ　新興国株式インデックス（ノーロード）	995,489,442円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	60,380,089円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	18,491,262円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０３０	140,433,780円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０４０	171,746,713円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０５０	87,156,061円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０６０	116,639,347円
１０資産分散投資ファンド	17,432,040円
グローバル１０資産バランスファンド	39,912,501円
ＤＣ世界経済インデックスファンド（株式特化型）	26,760,555円
ＤＣ全世界株式インデックスファンド（オール・カントリー）	224,667,653円
ＤＣターゲット・イヤーファンド（６資産・運用継続型）２０７０	17,189円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,632,567,706円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	100,615,131円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	73,913,897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）	16,642,269円
ＦＯＦｓ用　新興国株式インデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	22,109,535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）	12,437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）	11,278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）	15,741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）	21,333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）	12,260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）	11,899円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2026年 1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	8,759,741,801	－	9,350,995,978	591,254,177
合計		8,759,741,801	－	9,350,995,978	591,254,177

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,367,496,800	－	1,368,166,867	△670,067
	アメリカドル	1,367,496,800	－	1,368,166,867	△670,067
合計		1,367,496,800	－	1,368,166,867	△670,067

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,451,172,130
投資証券	115,131,986,100
派生商品評価勘定	92,051,660
未収入金	92,057,945
未収配当金	1,192,606,374
未収利息	28,518
差入委託証拠金	99,153,572
流動資産合計	118,059,056,299
資産合計	118,059,056,299
負債の部	
流動負債	

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
前受金	92,329,520
未払解約金	265,058,043
流動負債合計	357,387,563
負債合計	357,387,563
純資産の部	
元本等	
元本	45,236,747,746
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	72,464,920,990
元本等合計	117,701,668,736
純資産合計	117,701,668,736
負債純資産合計	118,059,056,299

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	45,236,747,746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 2.6019円 (1万口当たり純資産額) (26,019円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	44,725,322,251円
期中追加設定元本額	3,787,358,476円
期中一部解約元本額	3,275,932,981円
期末元本額	45,236,747,746円
期末元本額の内訳	
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,838,025,872円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	6,857,059円
ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・オープン	13,152,030,361円
Ｊリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	20,619,816,384円
コア投資戦略ファンド（安定型）	501,433,990円
コア投資戦略ファンド（成長型）	891,165,329円
分散投資コア戦略ファンドＡ	1,174,303,448円
分散投資コア戦略ファンドＳ	3,039,854,721円
コア投資戦略ファンド（切替型）	365,395,805円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	23,977,575円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	116,450,806円
ＳＭＴ　８資産インデックスバランス・オープン	19,872,068円
グローバル経済コア	1,305,014,897円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	22,914,410円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	257,118,752円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	72,653,624円
Ｍｙ　ＳＭＴ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ノーロード）	1,388,527,719円
１０資産分散投資ファンド	31,889,812円
グローバル１０資産バランスファンド	87,930,002円
ＦＯＦｓ用　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	156,493,704円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	12,327,487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）	59,504,070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）	36,198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）	32,151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）	27,979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）	39,314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）	39,633円
Ｊ－ＲＥＩＴ　パッシブ・ファンド　２０１８－０５（適格機関投資家専用）	92,985,196円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2026年 1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	2,457,667,480	－	2,549,997,000	92,329,520

合計	2,457,667,480	－	2,549,997,000	92,329,520

(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。

グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	607,408,204
コール・ローン	58,750,201
投資証券	160,526,623,649
派生商品評価勘定	6,303,478
未収入金	1
未収配当金	612,254,749
未収利息	1,154
差入委託証拠金	181,903,657
流動資産合計	161,993,245,093
資産合計	161,993,245,093
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	940,478
前受金	5,361,616
未払金	138,141,271
未払解約金	32,357,103
流動負債合計	176,800,468
負債合計	176,800,468
純資産の部	
元本等	
元本	46,811,190,563
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	115,005,254,062
元本等合計	161,816,444,625
純資産合計	161,816,444,625
負債純資産合計	161,993,245,093

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。

	2026年 1月10日現在
	(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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)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）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	46,811,190,563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 3.4568円 (1万口当たり純資産額) (34,568円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	44,973,888,461円
期中追加設定元本額	4,474,521,336円

区分	2026年 1月10日現在
期中一部解約元本額	2,637,219,234円
期末元本額	46,811,190,563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	42,725,009円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	64,830,382円
ＳＢＩ資産設計オープン（資産成長型）	1,331,865,846円
ＳＢＩ資産設計オープン（分配型）	5,099,974円
ＳＭＴ　グローバルＲＥＩＴインデックス・オープン	10,448,864,305円
グローバルリートインデックス・オープン（ＳＭＡ専用）	23,745,978,449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	1,340,463,501円
分散投資コア戦略ファンドＳ	3,853,098,706円
コア投資戦略ファンド（切替型）	412,928,779円
ＳＭＴ　インデックスバランス・オープン	99,740,144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	13,951,596円
グローバル経済コア	990,192,951円
ＳＢＩ資産設計オープン（つみたてＮＩＳＡ対応型）	18,478,291円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	379,994,982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）	687,344,949円
１０資産分散投資ファンド	16,919,835円
グローバル１０資産バランスファンド	66,617,992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）	1,106,804,005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）	162,287,514円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	102,388,860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）	51,921,420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）	56,365,120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）	20,807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）	20,466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）	21,047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）	4,295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）	30,741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）	20,411円
ＳＭＴＡＭ海外バランスファンド２０２１－０４（適格機関投資家専用）	79,697,475円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2026年 1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	978,689,920	－	984,051,536	5,361,616
合計		978,689,920	－	984,051,536	5,361,616

(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はありません。

通貨関連

（2026年 1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	16,475,760	－	16,479,495	3,735
	ユーロ	16,475,760	－	16,479,495	3,735
	売建	66,430,690	－	66,433,041	△2,351
	オーストラリアドル	22,089,690	－	22,091,601	△1,911
	香港ドル	44,341,000	－	44,341,440	△440
合計		82,906,450	－	82,912,536	1,384

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	282,518,535
コール・ローン	196,986,156
社債券	38,293,493,742
未収入金	1,932,350,579
未収利息	3,871
流動資産合計	40,705,352,883
資産合計	40,705,352,883
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,941,550
未払金	153,934,344
未払解約金	1,668,445,813
流動負債合計	1,827,321,707
負債合計	1,827,321,707
純資産の部	
元本等	
元本	50,078,549,645
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△11,200,518,469
元本等合計	38,878,031,176
純資産合計	38,878,031,176
負債純資産合計	40,705,352,883

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1 .有価証券の評価基準及び評価方法	社債券

	2026年 1月10日現在
	移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	50,078,549,645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 11,200,518,469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 0.7763円 (1万口当たり純資産額) (7,763円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	47,793,990,102円
期中追加設定元本額	6,819,705,836円

区分	2026年 1月10日現在
期中一部解約元本額	4,535,146,293円
期末元本額	50,078,549,645円
期末元本額の内訳	
コモディティ・オープン（ＳＭＡ専用）	39,127,352,456円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,172,438,028円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,043,559,038円
コア投資戦略ファンド（切替型）	832,530,121円
ＳＭＴＡＭコモディティ・オープン	4,295,306,640円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	571,270,883円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	162,692,231円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,429,234,021円
ＦＯＦｓ用　グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	365,799,065円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	78,367,162円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,801,590,000	－	1,806,531,550	△4,941,550
	アメリカドル	1,801,590,000	－	1,806,531,550	△4,941,550
合計		1,801,590,000	－	1,806,531,550	△4,941,550

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	470,964,051
投資信託受益証券	66,267,774,548
派生商品評価勘定	79,023
未収入金	117,977,574
未収利息	9,255
流動資産合計	66,856,804,451
資産合計	66,856,804,451
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	360,024,699
未払金	847,526
未払解約金	391,231,389
流動負債合計	752,103,614
負債合計	752,103,614

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	26,262,933,674
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	39,841,767,163
元本等合計	66,104,700,837
純資産合計	66,104,700,837
負債純資産合計	66,856,804,451

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	26,262,933,674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 2.5170円 (1万口当たり純資産額) (25,170円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	25,485,442,582円
期中追加設定元本額	3,614,369,652円
期中一部解約元本額	2,836,878,560円
期末元本額	26,262,933,674円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	873,872,876円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,608,390,244円
分散投資コア戦略ファンドＡ	2,624,735,322円
分散投資コア戦略ファンドＳ	9,071,007,927円
コア投資戦略ファンド（切替型）	629,573,463円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	145,424,573円
グローバル経済コア	5,489,508,531円
ＳＭＴ　ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	4,926,110,380円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	454,496,690円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	137,975,780円
グローバル１０資産バランスファンド	107,872,345円
ＦＯＦｓ用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	130,524,185円
ファンドラップ運用戦略Ｆ（中庸型）（適格機関投資家専用）	63,193,750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）	28,881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）	37,085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）	43,585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）	56,078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）	42,689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）	39,290円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	63,817,515,239	－	64,177,460,915	△359,945,676
	アメリカドル	63,817,515,239	－	64,177,460,915	△359,945,676
合計		63,817,515,239	－	64,177,460,915	△359,945,676

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	123,101,328
社債券	21,085,313,000
未収利息	2,419
流動資産合計	21,208,416,747
資産合計	21,208,416,747
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,070,194
流動負債合計	10,070,194
負債合計	10,070,194
純資産の部	
元本等	
元本	16,656,911,537
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,541,435,016
元本等合計	21,198,346,553
純資産合計	21,198,346,553
負債純資産合計	21,208,416,747

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
１．	計算期間の末日における受益権の総数	16,656,911,537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 1.2726円 (1万口当たり純資産額) (12,726円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	10,449,715,264円
期中追加設定元本額	6,313,750,677円
期中一部解約元本額	106,554,404円
期末元本額	16,656,911,537円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	851,536,321円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,015,328,943円
コア投資戦略ファンド（切替型）	447,827,635円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	338,166,575円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	13,519,765,429円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	198,027,374円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	54,054,312円
ＦＯＦｓ用　コモディティＬＳアルファ・ファンドＳ（適格機関投資家専用）	232,204,948円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	46,719,828
社債券	5,342,391,600
未収利息	918
流動資産合計	5,389,112,346
資産合計	5,389,112,346
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,980
流動負債合計	19,980
負債合計	19,980
純資産の部	
元本等	
元本	6,316,773,670
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△927,681,304
元本等合計	5,389,092,366
純資産合計	5,389,092,366
負債純資産合計	5,389,112,346

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1月10日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券

	2026年 1月10日現在
	移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2026年 1月10日現在
１．	計算期間の末日における受益権の総数	6,316,773,670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 927,681,304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 0.8531円 (1万口当たり純資産額) (8,531円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	6,151,389,362円
期中追加設定元本額	482,276,959円
期中一部解約元本額	316,892,651円
期末元本額	6,316,773,670円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,753,804円
コア投資戦略ファンド（成長型）	408,010,253円
コア投資戦略ファンド（切替型）	187,073,777円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	154,298,745円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	4,956,556,099円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	80,558,894円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	20,397,622円
ＦＯＦｓ用　米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドＳ（適格機関投資家専用）	91,248,278円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド（適格機関投資家専用）	64,876,198円

（デリバティブ取引に関する注記）
該当事項はありません。

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2026年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,369,802,980
国債証券	11,673,105,400
派生商品評価勘定	268,516,165
未収入金	31,245,899
未収利息	243,095
差入委託証拠金	2,387,812,002
流動資産合計	26,730,725,541
資産合計	26,730,725,541
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,705,315
前受金	189,174,938
未払金	74,518,127
未払解約金	60,067
流動負債合計	361,458,447
負債合計	361,458,447
純資産の部	
元本等	
元本	23,917,664,183
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,451,602,911
元本等合計	26,369,267,094
純資産合計	26,369,267,094
負債純資産合計	26,730,725,541

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2026年 1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 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	(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。 (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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2026年 1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）

		2026年 1月10日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	23,917,664,183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 1.1025円 (1万口当たり純資産額) (11,025円)

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2026年 1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。

（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	2026年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2025年 7月11日
期首元本額	21,206,036,229円
期中追加設定元本額	2,813,287,481円
期中一部解約元本額	101,659,527円
期末元本額	23,917,664,183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	2,625,091,266円
分散投資コア戦略ファンドＳ	8,824,057,118円
コア投資戦略ファンド（切替型）	295,363,515円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	205,240,164円
ヘッジファンドＳＭＴＢセレクション（ＳＭＡ専用）	10,212,473,197円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	127,441,758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）	173,448,507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）	221,128,587円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2026年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	15,757,884,906	－	15,969,209,692	211,324,786
	売建	17,870,975,648	－	17,893,125,496	△22,149,848
合計		33,628,860,554	－	33,862,335,188	189,174,938

(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はありません。

通貨関連

（2026年 1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	7,210,148,022	－	7,232,728,814	22,580,792
	アメリカドル	1,755,738,488	－	1,764,619,655	8,881,167
	カナダドル	942,038,357	－	941,554,482	△483,875
	イギリスポンド	1,550,795,549	－	1,550,724,248	△71,301
	ノルウェークローネ	1,330,745,739	－	1,342,970,718	12,224,979
	オーストラリアドル	1,630,829,889	－	1,632,859,711	2,029,822
	売建	6,991,544,508	－	7,032,478,498	△40,933,990
	ユーロ	218,699,792	－	217,697,814	1,001,978
	スイスフラン	4,789,935,391	－	4,820,313,659	△30,378,268
	スウェーデンクローナ	1,488,866,340	－	1,501,044,038	△12,177,698
	ニュージーランドドル	494,042,985	－	493,422,987	619,998
合計		14,201,692,530	－	14,265,207,312	△18,353,198

(注)時価の算定方法

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

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

２【ファンドの現況】

【コア投資戦略ファンド（切替型）】

【純資産額計算書】

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	30,473,772,731円
Ⅱ　負債総額	53,451,869円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	30,420,320,862円
Ⅳ　発行済口数	18,878,738,334口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6114円
（1万口当たり純資産額）	（16,114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

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	926,943,860,327円
Ⅱ　負債総額	17,770,956,762円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	909,172,903,565円
Ⅳ　発行済口数	236,545,159,907口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.8435円
（1万口当たり純資産額）	（38,435円）

日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	26,320,253,008円
Ⅱ　負債総額	4,667,393円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,315,585,615円
Ⅳ　発行済口数	12,330,034,866口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1343円
（1万口当たり純資産額）	（21,343円）

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	81,418,233,291円
Ⅱ　負債総額	2,087,569,999円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	79,330,663,292円
Ⅳ　発行済口数	9,030,944,231口

Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	8.7843円
（1万口当たり純資産額）	（87,843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

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	1,012,879,060,605円
Ⅱ　負債総額	387,013,164円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,012,492,047,441円
Ⅳ　発行済口数	115,567,335,119口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	8.7611円
（1万口当たり純資産額）	（87,611円）

外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	29,279,208,547円
Ⅱ　負債総額	5,115,900円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	29,274,092,647円
Ⅳ　発行済口数	12,829,202,877口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.2818円
（1万口当たり純資産額）	（22,818円）

世界債券総合インデックスマザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	82,984,660,376円
Ⅱ　負債総額	40,716,893円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,943,943,483円
Ⅳ　発行済口数	63,371,479,695口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3089円
（1万口当たり純資産額）	（13,089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

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	340,446,206,332円
Ⅱ　負債総額	790,735,390円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	339,655,470,942円
Ⅳ　発行済口数	49,802,760,323口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.8200円

（1万口当たり純資産額）	（68,200円）

Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	118,326,303,451円
Ⅱ　負債総額	212,056,373円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	118,114,247,078円
Ⅳ　発行済口数	46,585,918,464口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5354円
（1万口当たり純資産額）	（25,354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

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	161,806,754,542円
Ⅱ　負債総額	17,145,351円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	161,789,609,191円
Ⅳ　発行済口数	47,160,360,346口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.4306円
（1万口当たり純資産額）	（34,306円）

グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	42,153,102,257円
Ⅱ　負債総額	375,760,164円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	41,777,342,093円
Ⅳ　発行済口数	50,092,885,535口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8340円
（1万口当たり純資産額）	（8,340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

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	77,586,940,577円
Ⅱ　負債総額	229,176,224円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	77,357,764,353円
Ⅳ　発行済口数	25,625,442,765口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0188円
（1万口当たり純資産額）	（30,188円）

コモディティＬＳアルファ・マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	22,487,421,131円
Ⅱ　負債総額	486,700,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,000,721,131円
Ⅳ　発行済口数	17,868,651,706口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2312円
（1万口当たり純資産額）	（12,312円）

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	5,873,703,452円
Ⅱ　負債総額	－円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,873,703,452円
Ⅳ　発行済口数	6,904,205,856口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8507円
（1万口当たり純資産額）	（8,507円）

ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）

純資産額計算書

（2026年 1月30日現在）

Ⅰ　資産総額	27,395,302,048円
Ⅱ　負債総額	314,913,254円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,080,388,794円
Ⅳ　発行済口数	24,820,450,979口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0911円
（1万口当たり純資産額）	（10,911円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

①受益証券の不発行

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

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

②受益権の譲渡

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

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

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

③受益権の譲渡の対抗要件

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

④受益権の再分割

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

⑤償還金

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

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2026年 1月30日現在）

資本金の額　　：20億円
発行可能株式総数　：12,000株
発行済株式総数　　：3,000株
最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

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

［DO（実行）］

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

各運用部の部長は、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2026年 4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。

2026年1月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	524	17,150,486
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	35	96,212
単位型公社債投資信託	49	151,005
合計	608	17,397,702

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306条の規定に

基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（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。

また、第40期事業年度の中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	前事業年度 （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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	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				
	利益剰余金				
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク
未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。
金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針８．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。
未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制
当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理
営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理
有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理
当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2.金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、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)				
その他有価証券	－	4,517	－	4,517
資産計	1,530	20,565	－	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	－	(530)
通貨関連取引	－	21	－	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	－	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額1,017百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は18,596百万円であります。
(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）は上記に含めておりません。
(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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)				
その他有価証券	－	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おりません。

デリバティブ取引
株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の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いこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券 (その他有価証券)	-	-	△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	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	－	△262	△262
合計		14,490	－	△530	△530

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

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	トータルリターンスワップ取引 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				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	2,126	－	1
	英ポンド		4,586	－	7
	スイスフラン		28	－	0
	香港ドル		83	－	0
	ユーロ		63	－	0
	シンガポールドル		448	－	1
合計			7,337	－	10

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				
	米ドル	投資有価証券関係会社株式	1,947	－	13
	英ポンド		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㈱	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
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 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㈱	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
① 運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
② 投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

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

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記
(1) 親会社情報
前事業年度（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おりません。
２．1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度（自 2023年4月1日	当事業年度（自 2024年4月1日

	至　2024年3月31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

中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第40期中間会計期間末 （2025年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		17,328
金銭の信託		21,058
未収委託者報酬		12,730
未収運用受託報酬		6,346
短期差入証拠金		2,629
その他		3,480
流動資産合計		63,574
固定資産		
有形固定資産	※1	480
無形固定資産		
ソフトウェア		7,654
その他		84
無形固定資産合計		7,738
投資その他の資産		
投資有価証券		6,744
関係会社株式		6,416
繰延税金資産		1,262
その他		31
投資その他の資産合計		14,455
固定資産合計		22,674
資産合計		86,248
負債の部		
流動負債		
未払金		8,801
未払法人税等		1,519
賞与引当金		526
その他	※2	1,602
流動負債合計		12,450
固定負債		
退職給付引当金		1,141
資産除去債務		154
その他		65
固定負債合計		1,361
負債合計		13,812

（単位：百万円）

	第40期中間会計期間末 （2025年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	51,174
利益剰余金合計	53,774
株主資本合計	73,013
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	503
繰延ヘッジ損益	△1,081
評価・換算差額等合計	△577
純資産合計	72,436
負債・純資産合計	86,248

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第40期中間会計期間 （自　2025年4月1日 至　2025年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		25,098
運用受託報酬		5,803
その他営業収益		198
営業収益合計		31,100
営業費用		19,072
一般管理費	※1	7,553
営業利益		4,473
営業外収益	※2	3,157
営業外費用	※3	2,992
経常利益		4,638
税引前中間純利益		4,638
法人税、住民税及び事業税		1,524
過年度法人税等		△150
法人税等調整額		△89
法人税等合計		1,284
中間純利益		3,354

中間株主資本等変動計算書
第40期中間会計期間（自 2025年4月1日　至 2025年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本	
		資本剰余金

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	48,819	51,419	70,658
当中間期変動額					
剰余金の配当			△999	△999	△999
中間純利益			3,354	3,354	3,354
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	－	－	2,354	2,354	2,354
当中間期末残高	500	2,100	51,174	53,774	73,013

	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	454	△1,056	△601	70,057
当中間期変動額				
剰余金の配当				△999
中間純利益				3,354
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	48	△24	23	23
当中間期変動額合計	48	△24	23	2,378
当期末残高	503	△1,081	△577	72,436

注記事項
（重要な会計方針）

第40期中間会計期間
（自　2025年4月1日
至　2025年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法
(1) 有価証券
子会社株式及び関連会社株式
移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
時価法によっております。
（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法によっております。
なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な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
時価法によっております。
(3) 金銭の信託
時価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法
(1) 有形固定資産
定額法によっております。
(2) 無形固定資産
定額法によっております。

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

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

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

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

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

7．グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

第40期中間会計期間末 （2025年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額　1,259百万円
※2　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第40期中間会計期間 （自　2025年4月1日 至　2025年9月30日）	
※1　減価償却実施額	
有形固定資産	62百万円
無形固定資産	1,102百万円
※2　営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	2,976百万円
※3　営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	2,762百万円
為替差損	215百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第40期中間会計期間（自 2025年4月1日　至 2025年9月30日）
１．発行済株式に関する事項

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

２．自己株式に関する事項
該当事項はありません。

３．配当に関する事項
（１）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2025年6月20日 定時株主総会	普通株式	999	333,333	2025年3月31日	2025年6月23日

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

（リース取引関係）
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）
第40期中間会計期間末（2025年9月30日）
金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項
中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。
なお、市場価格のない株式等、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31 号 2021年6月17日。以下、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2及び（注２）、（注３）参照）。

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

（１）時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区　分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	2,966	18,092	－	21,058
投資有価証券(*2)				
その他有価証券	－	3,217	－	3,217
資産計	2,966	21,309	－	24,276
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(114)	(134)	－	(249)
通貨関連取引	－	(4)	－	(4)
デリバティブ取引計	(114)	(138)	－	(253)

(*1)負債に計上されているものについては、（　）で示しております。
(*2)投資有価証券のうち、非上場株式（中間貸借対照表計上額912百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,987百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額627百万円）は上記に含めておりません。
(*3)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

（２）時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債
現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注１）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明
金銭の信託
金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸に

ついては取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券
私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付しておりません。

デリバティブ取引
株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	912
関係会社株式	6,416

（注３）時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報
第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

（単位：百万円）

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	1,976	-	10	-	1,987	-	1,987	-

（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1,987百万円であります。

（有価証券関係）
第40期中間会計期間末（2025年9月30日）
１．子会社株式及び関連会社株式
市場価格のある子会社株式及び関連会社株式はありません。
なお、市場価格のない子会社株式及び関連会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	6,077
関連会社株式	338
合計	6,416

２．その他有価証券

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	2,833	2,106	727
小計	2,833	2,106	727
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	2,371	2,406	△35
小計	2,371	2,406	△35
合計	5,204	4,512	692

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額912百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額627百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）
第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）
１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
(1)通貨関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)

店頭	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ	 6,208 127 83 46 152 342	 － － － － － －	 △6 0 0 0 0 0	 △6 0 0 0 0 0
合計		6,960	－	△5	△5

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	11,572	－	△114	△114
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,235	－	△134	△134
合計		16,807	－	△249	△249

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	投資有価証券	 739 830 31 27 52	 － － － － －	 △0 1 0 0 0
合計			1,681	－	0

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針４．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

３．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）

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

［関連情報］

第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,312百万円

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］
第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）
該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］
第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）
該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］
第40期中間会計期間（自　2025年4月1日　至　2025年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第40期中間会計期間 （自　2025年4月1日 至　2025年9月30日）
1株当たり純資産額　24,145,344円27銭
1株当たり中間純利益　1,118,322円76銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期中間会計期間 （自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）
中間純利益	3,354百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式に係る中間純利益	3,354百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

４【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

と。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2026年 4月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第２【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2025年3月末日現在）

③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2025年3月末日現在）
④事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
⑥ファンド名を「コア投資戦略ファンド」と表示する場合があります。
(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやＳＮＳのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

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」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）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、コア投資戦略ファンド（切替型）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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2025年12月１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	成 田 慎 一 郎

中間監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2025年４月１日から2026年３月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2025年４月１日から2025年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

　当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2025年９月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2025年４月１日から2025年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任
　監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

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

財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

2026年3月24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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア投資戦略ファンド（切替型）の2025年7月11日から2026年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、コア投資戦略ファンド（切替型）の2026年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年7月11日から2026年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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