

外国株式SMTBセレクション  
(SMA専用)

追加型投信／海外／株式

投資信託説明書  
(請求目論見書)

2024年3月27日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

※本書は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書です。

外国株式SMTBセレクション（SMA専用）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年3月26日に関東財務局長に提出しており、2024年3月27日にその届出の効力が生じております。

発行者名 : 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

代表者の役職・氏名 : 代表取締役社長 菱田 賀夫

本店の所在の場所 : 東京都港区芝公園一丁目1番1号

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

## 目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	2
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	3
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	12
3【投資リスク】	31
4【手数料等及び税金】	34
5【運用状況】	38
第2【管理及び運営】	57
1【申込(販売)手続等】	57
2【換金(解約)手続等】	58
3【資産管理等の概要】	60
4【受益者の権利等】	64
第3【ファンドの経理状況】	65
1【財務諸表】	68
2【ファンドの現況】	209
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	211
第三部【委託会社等の情報】	212
第1【委託会社等の概況】	212
1【委託会社等の概況】	212
2【事業の内容及び営業の概況】	213
3【委託会社等の経理状況】	214
4【利害関係人との取引制限】	248
5【その他】	248
約款	

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

外国株式SMTBセレクション（SMA専用）

### (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】

ありません。

### (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】

2024年3月27日から2024年9月25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、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、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。

### <申込みコース>

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

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

### <受益権の取得申込みの受付の中止等>

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

### <受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

###### <信託金限度額>

上限 5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド  ファンド・オブ・ファンズ	あり(部分ヘッジ)  なし	日経225  TOPIX  その他( )	ブル・ベア型  条件付運用型  その他( )
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニア				ロング・ショート型/絶対収益追求型  その他( )
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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



## <商品分類表定義>

### [単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われの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)…「MMF等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)…「MMF等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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの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. 主として世界の株式<sup>\*1</sup>及び株式代替資産<sup>\*2</sup>を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド<sup>\*3</sup>」)に投資します。

- 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。
- 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。

※1 「世界の株式」には、わが国の株式を含むことがあります。

※2 当ファンドにおいて「株式代替資産」とは、委託会社が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

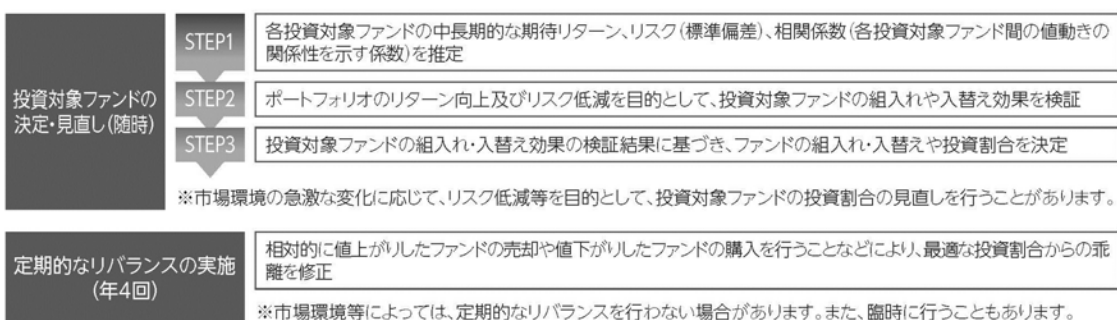
※3 投資対象ファンドの概要につきましては、後掲「2 投資方針 (2) 投資対象 (参考) 投資対象ファンドの概要」をご参照ください。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

## 2. 各投資対象ファンドへの投資割合については、定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また、投資対象ファンドは適宜見直しを行います。

- 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。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変更を行います。また適宜リバランスを行います。
- 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ることや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。

### ポートフォリオ構築プロセス

- 運用に当たっては三井住友信託銀行から投資助言を受けます。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



## ? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

投資者の皆様からお預かりした資金を、直接株式や債券といった資産に投資するのではなく、株式や債券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

- 原則として毎年6月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

- 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。
- 外貨建資産への実質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。

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】

2015年7月24日

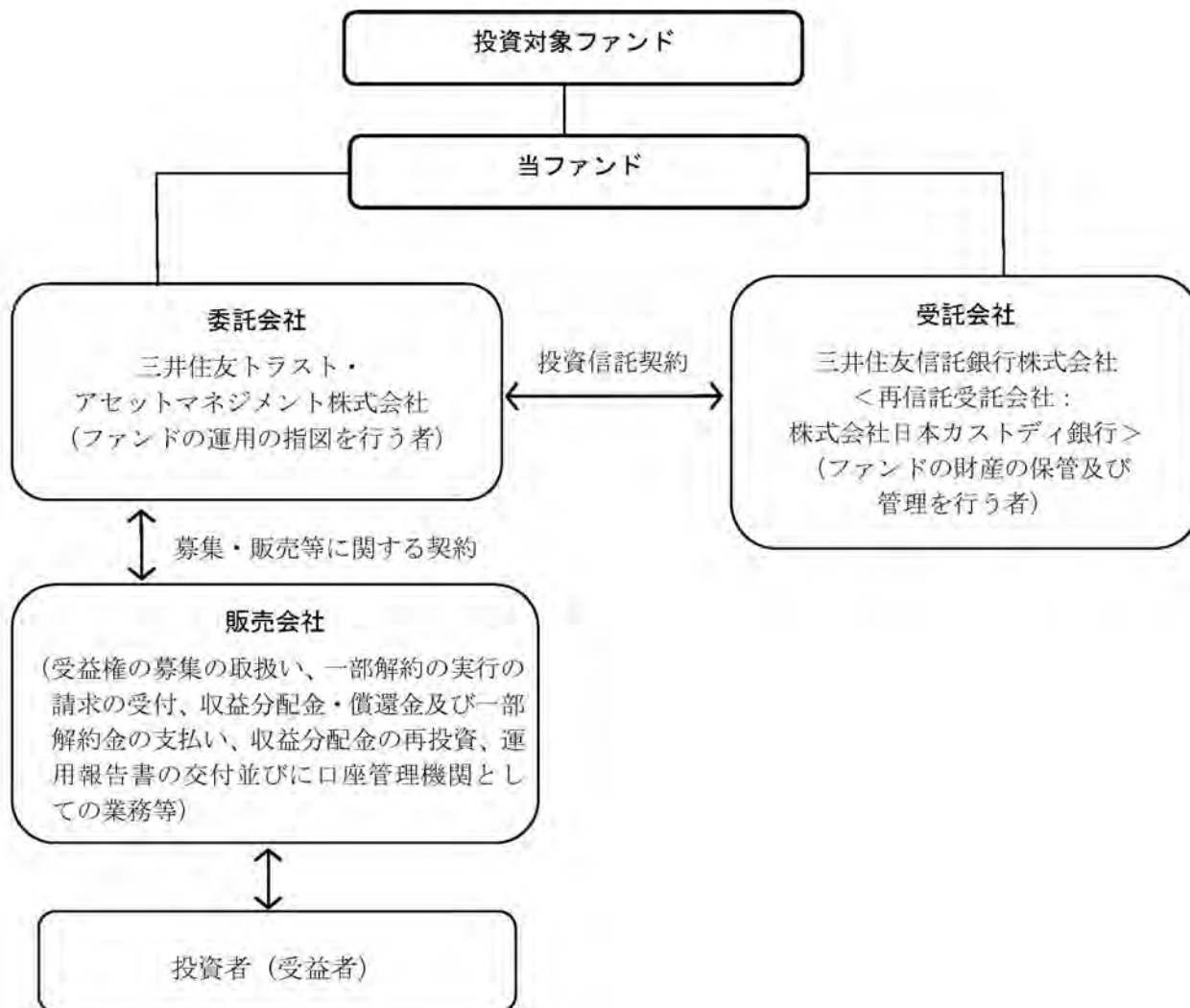
当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2023年9月27日

信託期間の延長（終了日を2025年6月25日から無期限へ変更）

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2024年 1月31日現在)

イ. 資本金の額: 20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

ハ. 大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	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こともあります。

#### ③投資態度

イ. 主として、世界の株式<sup>※1</sup>及び株式代替資産<sup>※2</sup>を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。

※1 世界の株式には、わが国の株式を含むことがあります。

※2 当ファンドにおいて、株式代替資産とは、委託会社が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

ロ. 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。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変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

ハ. 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ることや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。

ニ. 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。

ホ. 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。

ヘ. 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

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、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、2024年1月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

1. 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	MSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>(以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。) への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
決算日	年 1 回：5 月 29 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000 年 5 月 30 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

2. 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	<p>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 ESG リーダーズ指数（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。</p> <p>②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>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。</p> <p>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。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数（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 ESG リーダーズ指数」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の投資の妥当性、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. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）

収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	一部解約を行う日の前営業日における投資信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額に0.3%の率を乗じて得た額とします。
設定日	2008年12月12日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

#### 4. グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	モルガン・スタンレー・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	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うことを基本とします。
主要投資対象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ（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株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 ②有力な無形資産（特許、著作権、ブランド等）を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。 ③実質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資金状況、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合もあります。
主な投資制限	①株式の実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 ③新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④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10%以下とします。 ⑤同一銘柄の新株引受権証券並びに新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑦デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 ⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託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投資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	該当事項はありません。
決算日	年1回：4月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②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、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。</p> <p>③収益の分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.814%（税抜0.74%）</p> <p>マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けた者が受ける報酬は、委託者との間で別に定める取決めに基づく金額を、委託者から支払うものとします。</p>
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

#### 5. 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	<p>「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。</p> <p>&lt;マザーファンドの投資対象&gt;</p> <p>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。</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>②MSCI オール・カンントリー・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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

	<p>&lt;マザーファンドの投資態度&gt;</p> <p>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。</p> <p>②MSCI オール・カンントリー・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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	MSCI オール・カンントリー・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	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>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。</p> <p>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</p>



	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。

#### 6. ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOF s 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。

	<p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ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、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
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	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
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。

#### 7. 世界エクイティ・ファンド (適格機関投資家向け)

運用会社	日興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があります。 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運用指図権限を日興アセットマネジメント ヨーロッパ 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

	<p>だし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。</p> <p>③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行いません。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704% (税抜 0.64%)</li> <li>・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%)</li> <li>・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594% (税抜 0.54%)</li> </ul>
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

#### 8. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>④純資産総額の 10%を超えての借入れは、行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年 12 月 31 日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>年率 0.525%</p> <p>その他の費用</p> <p>ファンド管理費用：上限年率 0.15%</p> <p>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。</p>
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	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> <li>・ 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</li> <li>・ 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）</li> <li>・ 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）</li> <li>・ 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）</li> </ul>

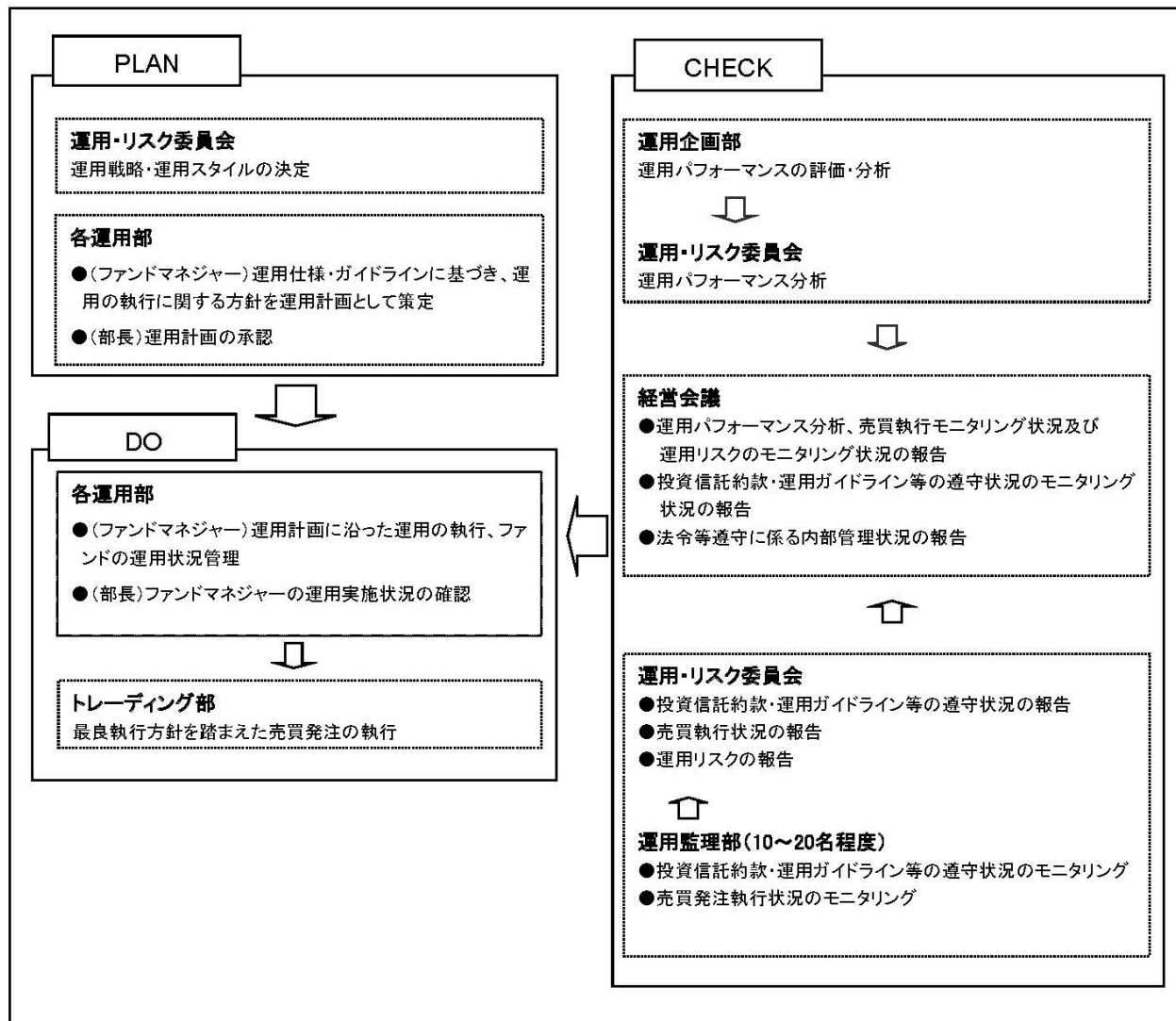
#### 9. マネープールマザーファンド

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、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、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も投資します。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>①主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</li> <li>②公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</li> <li>③株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>④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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>⑧資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに不適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</li> </ol>
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（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時

	<p>において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②同一銘柄の株式への投資割合は、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。</p> <p>③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。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>⑤投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>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、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11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	2010年2月26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

(3) 【運用体制】

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



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

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

#### (4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年6月25日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### (5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

##### イ. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

##### ロ. 株式への投資

株式への直接投資は行いません。

##### ハ. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

##### ニ. 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。

##### ホ. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

##### ヘ. 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。

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、目的及び範囲

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取引の指図をすることができます。

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

<その他の投資制限>

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様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、全て投資者の皆様様に帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### ① 株価変動リスク

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

##### ② 為替変動リスク

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

##### ③ 金利変動リスク

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

##### ④ 信用リスク

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

##### ⑤ 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。

##### ⑥ 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。

##### ⑦ ESG 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の方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ある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。  
これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止、取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

#### (2) リスクの管理体制

##### 委託会社におけるリスク管理体制

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

## 【参考情報】

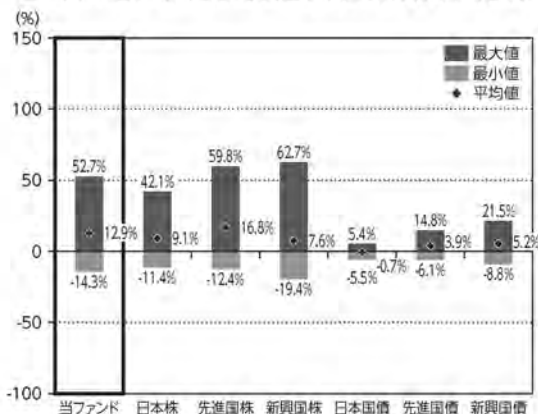
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



\*2019年2月～2024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

<b>日本株</b> TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能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準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利、ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商標は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商標の設定、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。
<b>先進国株</b> 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。
<b>新興国株</b> 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。
<b>日本国債</b> NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィナンシャルリサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率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ナンシャルリサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィナンシャルリサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。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あり、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> JP ERIIグローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ボンド・インデックス(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

ありません。

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

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

##### (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

##### (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

- ①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.605%（税抜 0.55%）（※）を乗じて得た額とします（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 0.33% (税抜 0.3%)	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 0.22% (税抜 0.2%)	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

※「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
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。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.814% (税抜 0.74%)
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）	<ul style="list-style-type: none"> <li>・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704% (税抜 0.64%)</li> <li>・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%)</li> <li>・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594% (税抜 0.54%)</li> </ul>
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率 0.525%
マネープールマザーファンド	ありません。

当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬率の概算値は下記の通りです。ただし、この値は目安であり、投資対象ファンドの実際の組入状況等により実質的な信託報酬率は変動します。

◎実質的な信託報酬率：年率 0.605%～1.2%程度（税抜 0.55%～1.1%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率 0.0%～0.595%程度（税抜 0.0%～0.55%程度））

(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があります。）。
- 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があります。）。
- 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0.055%（税抜0.05%）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。

#### (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）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。

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

※上記は、2024年1月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

#### (参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率 <sup>1)</sup>	その他費用の比率 <sup>2)</sup>
0.99%	0.61%	0.38%

※対象期間は2022年6月28日～2023年6月26日です。

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

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。



## 5 【運用状況】

以下は、2024年1月31日現在の状況について記載してあります。

### 【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

#### （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	116,302,677,211	59.21
投資証券	ルクセンブルク	29,399,571,414	14.97
親投資信託受益証券	日本	48,633,820,326	24.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	2,086,686,303	1.06
合計（純資産総額）		196,422,755,254	100.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### （2）【投資資産】

#### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額（円） 単価	帳簿価額（円） 金額	評価額（円） 単価	評価額（円） 金額	投資比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	5,073,214,982	5.0322	25,529,432,433	5.7975	29,411,963,858	14.97
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）	22,859,963,834	1.1598	26,513,991,893	1.2864	29,407,057,476	14.97
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	13,763,844,295	1,826.61	25,141,175,627	2,136	29,399,571,414	14.97
日本	投資信託受益証券	グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）	13,654,695,053	1.9309	26,366,233,009	2.148	29,330,284,973	14.93
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ストックファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	18,790,027,827	1.3897	26,112,539,251	1.5462	29,053,141,026	14.79
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）	20,488,785,381	1.2784	26,194,448,802	1.3916	28,512,193,736	14.52
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	6,361,227,949	1.3206	8,400,637,630	1.5427	9,813,466,356	5.00
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	2,387,247,255	3.8311	9,145,831,375	3.9411	9,408,380,156	4.79
日本	親投資信託受益証券	マネーボールマザーファンド	9,951	1.0008	9,958	1.0006	9,956	0.00

（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	59.21
投資証券	14.97
親投資信託受益証券	24.76

合計	98.94
----	-------

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 1 期計算期間末 (2016 年 6 月 27 日)	83,097,705,301	83,097,705,301	7,644	7,644
第 2 期計算期間末 (2017 年 6 月 26 日)	90,650,701,791	90,650,701,791	9,930	9,930
第 3 期計算期間末 (2018 年 6 月 25 日)	98,910,162,407	98,910,162,407	10,816	10,816
第 4 期計算期間末 (2019 年 6 月 25 日)	113,449,127,834	113,449,127,834	11,113	11,113
第 5 期計算期間末 (2020 年 6 月 25 日)	121,435,623,826	121,435,623,826	10,895	10,895
第 6 期計算期間末 (2021 年 6 月 25 日)	127,944,180,345	127,944,180,345	15,592	15,592
第 7 期計算期間末 (2022 年 6 月 27 日)	115,276,432,871	115,276,432,871	16,144	16,144
第 8 期計算期間末 (2023 年 6 月 26 日)	153,441,548,098	153,441,548,098	18,993	18,993
2023 年 1 月末日	133,341,439,501	—	16,580	—
2 月末日	137,893,469,676	—	16,940	—
3 月末日	138,311,004,068	—	16,752	—
4 月末日	138,706,850,054	—	17,136	—
5 月末日	146,931,156,884	—	18,051	—
6 月末日	155,360,627,363	—	19,234	—
7 月末日	146,826,787,891	—	19,323	—
8 月末日	153,042,965,449	—	19,758	—
9 月末日	161,169,564,459	—	19,233	—
10 月末日	168,458,626,741	—	18,558	—
11 月末日	185,867,223,339	—	19,870	—
12 月末日	190,649,917,267	—	20,139	—
2024 年 1 月末日	196,422,755,254	—	21,284	—

## ②【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 1 期計算期間	2015 年 7 月 24 日～2016 年 6 月 27 日	0
第 2 期計算期間	2016 年 6 月 28 日～2017 年 6 月 26 日	0
第 3 期計算期間	2017 年 6 月 27 日～2018 年 6 月 25 日	0
第 4 期計算期間	2018 年 6 月 26 日～2019 年 6 月 25 日	0
第 5 期計算期間	2019 年 6 月 26 日～2020 年 6 月 25 日	0
第 6 期計算期間	2020 年 6 月 26 日～2021 年 6 月 25 日	0
第 7 期計算期間	2021 年 6 月 26 日～2022 年 6 月 27 日	0
第 8 期計算期間	2022 年 6 月 28 日～2023 年 6 月 26 日	0

## ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 1 期計算期間	2015 年 7 月 24 日～2016 年 6 月 27 日	△23.6
第 2 期計算期間	2016 年 6 月 28 日～2017 年 6 月 26 日	29.9
第 3 期計算期間	2017 年 6 月 27 日～2018 年 6 月 25 日	8.9
第 4 期計算期間	2018 年 6 月 26 日～2019 年 6 月 25 日	2.7
第 5 期計算期間	2019 年 6 月 26 日～2020 年 6 月 25 日	△2.0
第 6 期計算期間	2020 年 6 月 26 日～2021 年 6 月 25 日	43.1
第 7 期計算期間	2021 年 6 月 26 日～2022 年 6 月 27 日	3.5
第 8 期計算期間	2022 年 6 月 28 日～2023 年 6 月 26 日	17.6
第 9 期中間計算期間	2023 年 6 月 27 日～2023 年 12 月 26 日	5.5

(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 1 期計算期間	2015 年 7 月 24 日～2016 年 6 月 27 日	126,093,324,843	17,381,346,697	108,711,978,146
第 2 期計算期間	2016 年 6 月 28 日～2017 年 6 月 26 日	25,620,095,279	43,040,023,741	91,292,049,684
第 3 期計算期間	2017 年 6 月 27 日～2018 年 6 月 25 日	30,797,173,447	30,638,095,389	91,451,127,742
第 4 期計算期間	2018 年 6 月 26 日～2019 年 6 月 25 日	31,491,912,896	20,859,263,672	102,083,776,966
第 5 期計算期間	2019 年 6 月 26 日～2020 年 6 月 25 日	42,158,524,192	32,781,101,015	111,461,200,143
第 6 期計算期間	2020 年 6 月 26 日～2021 年 6 月 25 日	16,401,038,627	45,805,791,473	82,056,447,297
第 7 期計算期間	2021 年 6 月 26 日～2022 年 6 月 27 日	21,792,471,284	32,445,893,017	71,403,025,564
第 8 期計算期間	2022 年 6 月 28 日～2023 年 6 月 26 日	23,098,117,154	13,712,585,207	80,788,557,511
第 9 期中間計算期間	2023 年 6 月 27 日～2023 年 12 月 26 日	23,854,355,007	10,008,078,239	94,634,834,279

(注 1) 第 1 期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注 2) 当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

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	468,405,705,091	70.11
	イギリス	25,383,785,975	3.80
	カナダ	22,425,375,011	3.36
	スイス	20,823,440,313	3.12
	フランス	20,241,518,713	3.03
	ドイツ	15,611,026,295	2.34
	オランダ	12,866,658,159	1.93
	オーストラリア	12,487,210,617	1.87
	アイルランド	12,134,785,043	1.82
	デンマーク	6,312,925,552	0.94
	スウェーデン	5,624,189,119	0.84
	スペイン	4,635,111,683	0.69
	イタリア	3,621,837,134	0.54
	香港	2,768,402,803	0.41
	シンガポール	2,002,484,794	0.30
	フィンランド	1,957,838,604	0.29
	ジャージー	1,647,330,326	0.25
	ベルギー	1,369,044,702	0.20
	イスラエル	1,334,639,163	0.20
	ノルウェー	1,165,718,642	0.17
	バミューダ	882,382,632	0.13
	キュラソー	803,064,992	0.12
	ケイマン	794,574,111	0.12
	ニュージーランド	520,479,683	0.08
	リベリア	385,491,987	0.06
	ルクセンブルク	360,461,086	0.05
オーストリア	353,160,771	0.05	
ポルトガル	320,371,462	0.05	
パナマ	174,508,964	0.03	
マン島	89,011,277	0.01	
	小計	647,502,534,704	96.92
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	67,652,935	0.01
	香港	56,587,356	0.01
	小計	124,240,291	0.02

投資証券	アメリカ	10,879,921,350	1.63
	オーストラリア	790,574,269	0.12
	フランス	265,442,656	0.04
	シンガポール	247,198,830	0.04
	イギリス	198,321,181	0.03
	香港	124,086,478	0.02
	カナダ	56,874,622	0.01
	ベルギー	55,778,020	0.01
	小計	12,618,197,406	1.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,848,909,389	1.17
合計(純資産総額)		668,093,881,790	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,588,478,382	0.84
	買建	カナダ	197,751,405	0.03
	買建	ドイツ	1,003,358,296	0.15
	買建	イギリス	444,659,601	0.07
	買建	オーストラリア	349,224,617	0.05

(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	—	92,942,136	△0.01

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
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	1,210,717	25,867.06	31,317,695,367	27,745.30	33,591,708,802	5.03

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	546,594	49,157.59	26,869,244,438	60,287.45	32,952,760,905	4.93
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	191,277	57,718.06	11,040,138,365	92,623.03	17,716,656,648	2.65
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	719,107	17,797.62	12,798,394,204	23,460.44	16,870,573,818	2.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	459,452	18,396.54	8,452,330,051	22,347.92	10,267,797,918	1.54
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	172,117	38,923.39	6,699,378,671	59,028.85	10,159,869,092	1.52
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	405,242	18,500.01	7,496,984,981	22,582.52	9,151,388,609	1.37
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	221,215	28,791.44	6,369,098,594	28,269.10	6,253,549,952	0.94
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	34,367	117,145.34	4,025,934,010	178,264.00	6,126,399,163	0.92
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	62,580	63,702.25	3,986,487,021	95,166.79	5,955,538,281	0.89
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	20,219.51	4,529,313,691	26,008.63	5,826,117,084	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	101,297	47,524.29	4,814,068,080	57,123.98	5,786,488,055	0.87
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	72,060	71,301.26	5,137,969,447	74,307.65	5,354,609,655	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	124,044	33,218.92	4,120,608,544	40,893.48	5,072,591,143	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギ ー	309,867	15,498.57	4,802,497,723	15,470.61	4,793,833,833	0.72
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	187,036	22,753.62	4,255,747,155	23,426.51	4,381,601,379	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	64,870	55,202.83	3,581,007,844	65,687.78	4,261,166,581	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	183,167	21,496.03	3,937,364,492	23,237.64	4,256,370,546	0.64
デンマー ク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	253,029	12,275.65	3,106,095,742	16,056.37	4,062,727,751	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	77,067	43,156.27	3,325,924,461	52,690.10	4,060,668,322	0.61
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	31,384	108,453.91	3,403,717,797	128,183.96	4,022,925,432	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需 品流通・	34,608	75,252.98	2,604,355,243	103,394.18	3,578,266,024	0.54

			小売り						
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	198,157	16,348.48	3,239,566,475	17,950.93	3,557,103,030	0.53
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	207,970	19,087.11	3,969,547,446	16,950.96	3,525,292,212	0.53
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	137,931	20,351.06	2,807,042,269	24,333.94	3,356,405,506	0.50
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	35,550	62,133.38	2,208,841,740	92,655.49	3,293,902,954	0.49
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	126,574	18,573.65	2,350,941,572	25,387.45	3,213,391,476	0.48
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	31,711.27	2,367,627,174	42,454.56	3,169,742,471	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,373	22,713.57	3,233,799,193	22,150.20	3,153,591,279	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	321,355	8,866.65	2,849,343,921	8,838.24	2,840,214,222	0.43

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.56
		素材	3.76
		資本財	6.71
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.70
		耐久消費財・アパレル	1.51
		消費者サービス	2.09
		メディア・娯楽	6.29
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.61
		生活必需品流通・小売り	1.70
		食品・飲料・タバコ	3.42
		家庭用品・パーソナル用品	1.62
		ヘルスケア機器・サービス	4.23
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
		銀行	5.37
金融サービス	6.70		

		保険	3.04
		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	10.59
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.48
		電気通信サービス	1.19
		公益事業	2.51
		半導体・半導体製造装置	7.10
		不動産管理・開発	0.33
		小計	96.92
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.89
合計			98.83

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	153	アメリカドル	36,192,848.65	5,340,254,818	37,875,150	5,588,478,382	0.84
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	7	カナダドル	1,736,739.5	191,145,549	1,796,760	197,751,405	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	15	スイスフラン	1,667,125	285,361,786	1,704,900	291,827,733	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	95	ユーロ	4,339,874	694,249,644	4,447,900	711,530,563	0.11
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	19	オーストラリアドル	3,520,483	342,050,128	3,594,325	349,224,617	0.05
	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	31	イギリスポンド	2,363,861.25	442,822,128	2,373,670	444,659,601	0.07

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

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

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	630,000.00	92,817,900	92,942,136	△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	10,516,293,552	69.07
	イギリス	540,015,867	3.55
	フランス	529,970,900	3.48
	カナダ	511,078,575	3.36
	アイルランド	426,107,127	2.80
	スイス	383,197,162	2.52
	オランダ	345,411,698	2.27
	デンマーク	257,784,990	1.69
	ドイツ	199,557,941	1.31
	オーストラリア	196,901,283	1.29
	スウェーデン	121,374,713	0.80
	スペイン	72,392,414	0.48
	イタリア	68,945,703	0.45
	香港	64,138,564	0.42
	ノルウェー	45,276,041	0.30
	フィンランド	44,032,407	0.29
	ジャージー	42,771,689	0.28
	キュラソー	34,587,564	0.23
	シンガポール	23,010,436	0.15
	バミューダ	17,388,610	0.11
	ニュージーランド	13,355,552	0.09
	ベルギー	10,314,229	0.07
	ポルトガル	6,260,336	0.04
	オーストリア	5,251,140	0.03
イスラエル	5,098,098	0.03	
ルクセンブルク	4,113,377	0.03	
ケイマン	2,101,363	0.01	
	小計	14,486,731,331	95.15
投資信託受益証券	オーストラリア	4,332,582	0.03
	香港	1,976,066	0.01
	小計	6,308,648	0.04
投資証券	アメリカ	248,430,411	1.63
	オーストラリア	33,613,786	0.22

	イギリス	5,868,988	0.04
	シンガポール	5,400,913	0.04
	フランス	4,182,949	0.03
	カナダ	2,558,157	0.02
	小計	300,055,204	1.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	431,556,313	2.83
合計(純資産総額)		15,224,651,496	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	328,734,022	2.16
	買建	ドイツ	82,387,749	0.54

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	7,037,808	0.05

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	24,175	49,545.59	1,197,764,708	60,287.45	1,457,449,213	9.57
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	8,467	62,726.80	531,107,889	92,623.03	784,239,254	5.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	20,311	18,223.28	370,133,061	22,347.92	453,908,664	2.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	17,897	18,298.40	327,486,631	22,582.52	404,159,495	2.65
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	9,792	37,313.76	365,376,361	28,269.10	276,811,071	1.82
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテ	2,766	70,110.41	193,925,415	95,166.79	263,231,366	1.73

			クノロジ ー・ライ フサイエ ンス						
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	5,508	34,101.18	187,829,340	40,893.48	225,241,302	1.48
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	8,255	24,177.61	199,586,220	23,426.51	193,385,869	1.27
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	2,883	56,416.68	162,649,311	65,687.78	189,377,883	1.24
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	8,079	21,956.83	177,389,234	23,237.64	187,736,970	1.23
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	3,436	44,441.61	152,701,397	52,690.10	181,043,201	1.19
デンマー ク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	11,146	12,059.36	134,413,711	16,056.37	178,964,322	1.18
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	1,378	101,021.80	139,208,047	128,183.96	176,637,498	1.16
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	8,699	16,664.19	144,961,874	17,950.93	156,155,166	1.03
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウ ェア・サ ービス	1,561	72,916.48	113,822,634	92,655.49	144,635,232	0.95
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウ ェア・サ ービス	3,335	31,154.58	103,900,532	42,454.56	141,585,963	0.93
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバ コ	14,160	8,937.86	126,560,192	8,838.24	125,149,549	0.82
フランス	株式	LVMH	耐久消費 財・アパ レル	947	129,711.33	122,836,634	125,096.53	118,466,423	0.78
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバ コ	4,713	27,068.42	127,573,502	25,027.43	117,954,282	0.77
アイルラ ンド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウ ェア・サ ービス	2,151	44,435.00	95,579,700	54,785.31	117,843,213	0.77
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	7,026	14,701.27	103,291,169	15,848.63	111,352,477	0.73
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サ ービス	2,498	42,343.36	105,773,725	43,475.60	108,602,068	0.71
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	5,313	21,162.13	112,434,432	19,830.75	105,360,795	0.69

			ンス						
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,673	55,127.49	92,228,293	60,178.26	100,678,242	0.66
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	14,109	5,974.63	84,296,062	6,883.20	97,115,175	0.64
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	961	68,581.48	65,906,808	95,571.08	91,843,814	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	14,356	4,990.08	71,637,685	6,332.84	90,914,337	0.60
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	14,411	5,232.00	75,398,476	6,266.44	90,305,789	0.59
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	6,272	12,907.04	80,952,994	14,303.49	89,711,533	0.59
アメリカ	株式	DANAHER CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,405	31,197.75	75,030,595	36,142.37	86,922,406	0.57

(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	3.00
		素材	3.85
		資本財	5.85
		商業・専門サービス	1.78
		運輸	2.40
		自動車・自動車部品	2.24
		耐久消費財・アパレル	2.25
		消費者サービス	1.62
		メディア・娯楽	7.50
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.22
		生活必需品流通・小売り	0.85
		食品・飲料・タバコ	2.68
		家庭用品・パーソナル用品	2.86
		ヘルスケア機器・サービス	2.45
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.70
		銀行	3.40
		金融サービス	7.45
		保険	3.38
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.08
		ソフトウェア・サービス	16.28
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.58		
電気通信サービス	1.10		

		公益事業	1.62
		半導体・半導体製造装置	8.71
		不動産管理・開発	0.28
		小計	95.15
投資信託受益証券	—	—	0.04
投資証券	—	—	1.97
合計			97.17

(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	9	アメリカドル	2,148,463.45	317,005,782	2,227,950	328,734,022	2.16
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	11	ユーロ	500,680.2	80,093,811	515,020	82,387,749	0.54

(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	22,000.00	3,242,960	3,245,371	0.02
	ユーロ	買建	12,000.00	1,917,000	1,919,416	0.01
	イギリスポンド	買建	10,000.00	1,873,900	1,873,021	0.01

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

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

#### 新興国株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	インド	28,818,560,433	16.94
	台湾	26,420,580,438	15.53
	ケイマン	22,780,668,310	13.39
	韓国	19,898,598,841	11.70
	中国	16,229,988,021	9.54

	ブラジル	8,787,719,952	5.17
	サウジアラビア	7,084,573,890	4.17
	南アフリカ	4,559,960,715	2.68
	メキシコ	4,293,621,050	2.52
	インドネシア	3,145,986,856	1.85
	タイ	2,816,758,250	1.66
	マレーシア	2,235,530,607	1.31
	アラブ首長国連邦	2,101,529,866	1.24
	カタール	1,437,650,105	0.85
	ポーランド	1,426,519,934	0.84
	香港	1,354,498,910	0.80
	クウェート	1,349,393,679	0.79
	トルコ	1,151,411,793	0.68
	フィリピン	1,009,816,050	0.59
	ギリシャ	840,631,911	0.49
	チリ	763,871,774	0.45
	バミューダ	642,846,826	0.38
	アメリカ	536,735,840	0.32
	ハンガリー	434,964,203	0.26
	チェコ	246,470,299	0.14
	ルクセンブルク	221,541,458	0.13
	イギリス	180,000,073	0.11
	コロンビア	166,776,817	0.10
	エジプト	153,909,493	0.09
	ペルー	37,919,966	0.02
	シンガポール	26,182,880	0.02
	オランダ	18,262,488	0.01
	ロシア	125	0.00
	キプロス	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	161,173,481,853	94.75
投資信託受益証券	ブラジル	373,932,784	0.22
	メキシコ	134,020,704	0.08
	小計	507,953,488	0.30
投資証券	メキシコ	172,206,902	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	8,243,016,865	4.85
合計(純資産総額)		170,096,659,108	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	8,254,816,069	4.85

(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	—	604,856,299	0.36

(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	3,979,389	2,640.42	10,507,285,981	3,040.76	12,100,401,914	7.11
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	771,665	7,804.00	6,022,079,494	8,239.87	6,358,419,284	3.74
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,083,100	5,797.93	6,279,739,229	5,166.60	5,595,950,959	3.29
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,643,588	1,547.53	4,091,055,103	1,342.60	3,549,282,571	2.09
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	494,885	4,139.77	2,048,710,486	5,038.58	2,493,518,406	1.47
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	97,780	16,178.60	1,581,943,838	18,485.06	1,807,469,558	1.06
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,461.51	1,310,753,678	2,954.93	1,573,495,380	0.93
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	847,011	1,678.00	1,421,285,037	1,819.17	1,540,862,930	0.91
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	84.16	1,279,371,380	87.74	1,333,873,748	0.78
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	14,195.20	1,240,234,624	15,182.21	1,326,469,688	0.78
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,662.08	1,228,300,714	2,585.11	1,192,786,371	0.70
ブラジル	株式	VALE SA	素材	550,487	2,104.32	1,158,401,717	2,049.28	1,128,105,492	0.66
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・	241,804	4,286.44	1,036,478,821	4,561.15	1,102,905,088	0.65

			半導体製造装置							
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	2,790.22	858,084,397	3,472.02	1,067,757,562	0.63	
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	152,359	6,010.05	915,686,406	6,800.38	1,036,100,468	0.61	
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	833,450	2,155.03	1,796,116,141	1,234.09	1,028,558,978	0.60	
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	2,056,248	464.68	955,515,014	483.11	993,399,729	0.58	
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	3,336.21	1,046,337,424	2,877.67	902,525,210	0.53	
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	133,027	6,310.21	839,428,306	6,631.81	882,211,119	0.52	
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	1,039.24	756,610,200	1,201.32	874,613,626	0.51	
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	84.58	792,560,394	90.71	849,907,345	0.50	
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	490,774	1,381.34	677,926,464	1,659.16	814,273,081	0.48	
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	634,100	1,118.86	709,469,940	1,256.44	796,712,863	0.47	
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	70.05	760,208,960	71.89	780,166,415	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	30,591	25,352.28	775,551,643	25,006.88	764,985,512	0.45	
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	871.19	679,780,770	966.24	753,942,899	0.44	
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	52.76	709,076,583	55.66	748,001,894	0.44	
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	358,975	1,668.81	599,063,582	2,073.35	744,283,329	0.44	
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	379,500	1,991.78	755,883,936	1,951.15	740,464,461	0.44	
インド	株式	LARSEN & TOUBRO LTD	資本財	107,590	5,414.75	582,572,953	6,503.78	699,742,336	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	5.31
		素材	7.00
		資本財	4.39
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.99
		自動車・自動車部品	3.45
		耐久消費財・アパレル	1.15
		消費者サービス	1.95



		メディア・娯楽	5.57
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.02
		生活必需品流通・小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	3.35
		家庭用品・パーソナル用品	0.71
		ヘルスケア機器・サービス	0.98
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.45
		銀行	16.61
		金融サービス	2.64
		保険	2.43
		ソフトウェア・サービス	2.67
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.59
		電気通信サービス	2.74
		公益事業	2.65
		半導体・半導体製造装置	10.19
		不動産管理・開発	1.41
		小計	94.75
投資信託受益証券	—	—	0.30
投資証券	—	—	0.10
合計			95.15

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	1,134	アメリカドル	56,445,086	8,328,472,439	55,945,890	8,254,816,069	4.85

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

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

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,100,000.00	604,092,100	604,856,299	0.36

(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。

## マネープールマザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	207,603,737,941	100.00
合計（純資産総額）		207,603,737,941	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

該当事項はありません。

##### ロ. 種類別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

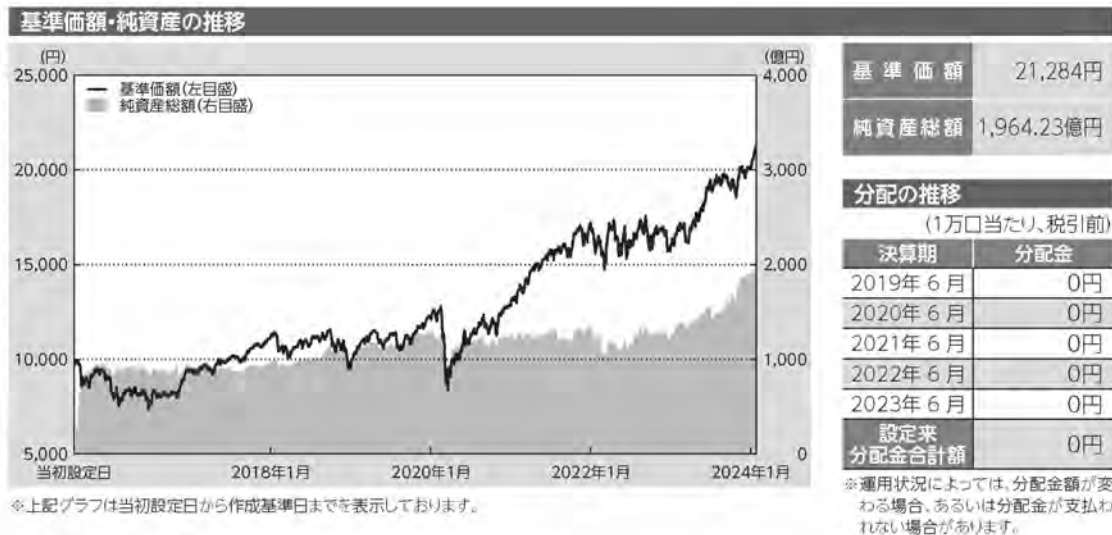
該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 運用実績

当初設定日：2015年7月24日  
作成基準日：2024年1月31日



### 主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
外国株式インデックス マザーファンド	15.0%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	15.0%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	15.0%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	14.9%
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)	14.8%
ブランドワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	14.5%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	5.0%
新興国株式インデックス マザーファンド	4.8%
マネーボールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。



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、販売会社と投資一任契約を締結されている投資者等に限るものとし、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、原則として午後3時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みとします。なお、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。

#### <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>

ありません。

#### <申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### <受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

#### <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、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2 【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、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、原則として午後3時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。なお、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。

#### <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

アイルランドの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などにに基づき、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投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

###### ①国内投資信託受益証券（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。

###### ③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。

###### ④マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

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

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

###### B. 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

###### ⑤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。(2015年7月24日設定)

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

## (4) 【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

ただし、第1計算期間は2015年7月24日から2016年6月27日までとします。

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

## (5) 【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

### (1) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

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

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

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

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

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

### (2) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)に係る書面決議の手続き

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

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

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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

##### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

- 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は除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、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。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- 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スャル・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、）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、）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8期計算期間(2022年6月28日から2023年6月26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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年9月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式SMTBセレクション（SMA専用）の2022年6月28日から2023年6月26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、外国株式SMTBセレクション（SMA専用）の2023年6月26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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファン드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

1 【財務諸表】

【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (2022年6月27日現在)	第8期 (2023年6月26日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,755,895,129	1,495,533,974
投資信託受益証券	34,204,129,915	61,316,692,270
投資証券	12,248,292,069	15,780,131,156
親投資信託受益証券	66,488,979,538	74,967,957,036
未収入金	-	1,300,146,284
流動資産合計	115,697,296,651	154,860,460,720
資産合計	115,697,296,651	154,860,460,720
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	64,127,609	1,003,268,721
未払受託者報酬	32,332,721	37,684,290
未払委託者報酬	323,327,150	376,842,831
未払利息	4,498	3,667
その他未払費用	1,071,802	1,113,113
流動負債合計	420,863,780	1,418,912,622
負債合計	420,863,780	1,418,912,622
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	71,403,025,564	80,788,557,511
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	43,873,407,307	72,652,990,587
(分配準備積立金)	29,020,216,105	46,197,119,278
元本等合計	115,276,432,871	153,441,548,098
純資産合計	115,276,432,871	153,441,548,098
負債純資産合計	115,697,296,651	154,860,460,720

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期		第8期	
	自 2021年6月26日 至 2022年6月27日		自 2022年6月28日 至 2023年6月26日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		17,173		11,794
有価証券売買等損益		5,398,428,948		23,725,047,314
その他収益		7,047,910		-
<b>営業収益合計</b>		<b>5,405,494,031</b>		<b>23,725,059,108</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,026,205		1,299,138
受託者報酬		67,003,430		72,436,150
委託者報酬		670,034,157		724,361,423
その他費用		2,162,916		2,205,030
<b>営業費用合計</b>		<b>740,226,708</b>		<b>800,301,741</b>
営業利益又は営業損失(△)		4,665,267,323		22,924,757,367
経常利益又は経常損失(△)		4,665,267,323		22,924,757,367
当期純利益又は当期純損失(△)		4,665,267,323		22,924,757,367
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(△)		1,738,005,465		1,118,079,592
期首剰余金又は期首欠損金(△)		45,887,733,048		43,873,407,307
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,394,595,661		15,494,563,851
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,394,595,661		15,494,563,851
剰余金減少額又は欠損金増加額		18,336,183,260		8,521,658,346
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		18,336,183,260		8,521,658,346
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		43,873,407,307		72,652,990,587



(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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第8期計算期間は2022年6月28日から2023年6月26日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第7期 (2022年6月27日現在)	第8期 (2023年6月26日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	71,403,025,564 口	80,788,557,511 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) 1.6144 円 (16,144 円)	1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) 1.8993 円 (18,993 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第7期 自 2021年6月26日 至 2022年6月27日	第8期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日																																																												
分配金の計算過程	分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">969,072,839 円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">1,958,189,019 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">16,227,734,675 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">26,092,954,247 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E=A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">45,247,950,780 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">71,403,025,564 口</td> </tr> <tr> <td>1 万口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G=E/F×10,000</td> <td style="text-align: right;">6,336 円</td> </tr> <tr> <td>1 万口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I=F×H/10,000</td> <td style="text-align: right;">- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	金額	費用控除後の配当等収益額	A	969,072,839 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	1,958,189,019 円	収益調整金額	C	16,227,734,675 円	分配準備積立金額	D	26,092,954,247 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,247,950,780 円	当ファンドの期末残存口数	F	71,403,025,564 口	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,336 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	<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項目</th> <th style="text-align: center;">A</th> <th style="text-align: right;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">1,310,217,362 円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">20,496,460,413 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">26,818,707,232 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">24,390,441,503 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E=A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">73,015,826,510 円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">80,788,557,511 口</td> </tr> <tr> <td>1 万口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G=E/F×10,000</td> <td style="text-align: right;">9,037 円</td> </tr> <tr> <td>1 万口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I=F×H/10,000</td> <td style="text-align: right;">- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目	A	金額	費用控除後の配当等収益額	A	1,310,217,362 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,496,460,413 円	収益調整金額	C	26,818,707,232 円	分配準備積立金額	D	24,390,441,503 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,015,826,510 円	当ファンドの期末残存口数	F	80,788,557,511 口	1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,037 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
項目	A	金額																																																											
費用控除後の配当等収益額	A	969,072,839 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	1,958,189,019 円																																																											
収益調整金額	C	16,227,734,675 円																																																											
分配準備積立金額	D	26,092,954,247 円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,247,950,780 円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	71,403,025,564 口																																																											
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,336 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																																																											
項目	A	金額																																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,310,217,362 円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,496,460,413 円																																																											
収益調整金額	C	26,818,707,232 円																																																											
分配準備積立金額	D	24,390,441,503 円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,015,826,510 円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	80,788,557,511 口																																																											
1 万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,037 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8期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26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 8 期 (2023 年 6 月 26 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 7 期 自 2021 年 6 月 26 日 至 2022 年 6 月 27 日	第 8 期 自 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	82,056,447,297 円	71,403,025,564 円
期中追加設定元本額	21,792,471,284 円	23,098,117,154 円
期中一部解約元本額	32,445,893,017 円	13,712,585,207 円

### (有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	第 7 期 (2022 年 6 月 27 日現在)	第 8 期 (2023 年 6 月 26 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	194,103,768	9,846,836,329
投資証券	△1,286,639,592	2,659,134,781

親投資信託受益証券	4,680,510,097	11,047,965,717
合計	3,587,974,273	23,553,936,827

(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	世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	13,187,254,772	15,327,546,221	
	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)	11,142,354,938	15,419,904,998	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	7,864,243,398	15,141,027,814	
	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)	12,185,619,807	15,428,213,237	
投資信託受益証券合計		44,379,472,915	61,316,692,270	
投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	8,699,080.02	15,780,131,156	
投資証券合計		8,699,080.02	15,780,131,156	
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	3,781,789,917	14,460,051,926	
	外国株式インデックス マザーファンド	10,522,285,492	52,659,829,973	
	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	5,975,380,828	7,848,065,179	
	マネープールマザーファンド	9,951	9,958	
親投資信託受益証券合計		20,279,466,188	74,967,957,036	
合計			152,064,780,462	

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年6月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,827,133,885
コール・ローン	1,332,333,514
株式	584,651,710,684
投資信託受益証券	175,504,226
投資証券	11,650,427,261
派生商品評価勘定	1,735,495
未収入金	5,782,522
未収配当金	728,844,767
前払金	38,218,425
差入委託証拠金	4,422,823,676
流動資産合計	606,834,514,455
資産合計	606,834,514,455
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	39,891,360
未払解約金	1,226,721,957
未払利息	3,266
流動負債合計	1,266,616,583
負債合計	1,266,616,583
純資産の部	
元本等	
元本	121,001,727,313
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	484,566,170,559
元本等合計	605,567,897,872
純資産合計	605,567,897,872
負債純資産合計	606,834,514,455

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 6月 26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		121,001,727,313 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.0046 円 (50,046 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

		2023年 6月 26日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監視部が、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

		2023年 6月 26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年6月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月28日
期首元本額	125,411,738,792円
期中追加設定元本額	16,252,825,733円
期中一部解約元本額	20,662,837,212円
期末元本額	121,001,727,313円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,804,745,137円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,126,239円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,772,840,998円
世界経済インデックスファンド	11,879,442,348円
外国株式インデックス・オープン	891,840,627円
DCマイセレクション25	648,446,125円
DCマイセレクション50	3,523,577,334円
DCマイセレクション75	4,339,847,465円
DC外国株式インデックス・オープン	12,400,862,889円
DCマイセレクションS25	421,117,229円
DCマイセレクションS50	1,862,252,409円
DCマイセレクションS75	1,824,636,167円
DCターゲット・イヤーフンド2025	29,168,424円
DCターゲット・イヤーフンド2035	149,928,228円
DCターゲット・イヤーフンド2045	114,878,652円
DC世界経済インデックスファンド	9,320,005,134円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,044,683,627円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,046,222円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,528,471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)	23,447,684円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	8,979,164円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	36,612,540円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,074,741円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	23,547,978円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	201,705,629円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	139,908,236円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,074,444,503円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	75,357,334円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	20,628,861円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	125,163,071円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	41,389,882円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	872,509,556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)	951,332,208円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,125,664,047円
コア投資戦略ファンド(安定型)	274,918,240円
コア投資戦略ファンド(成長型)	710,788,744円
分散投資コア戦略ファンドA	1,677,632,553円
分散投資コア戦略ファンドS	8,247,590,532円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,408,548,422円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,003,643,881円
コア投資戦略ファンド(切替型)	339,465,119円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	525,674,768円

世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,491,776 円
SMT インデックスバランス・オープン	128,425,746 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	179,062,205 円
外国株式SMT Bセクション（SMA専用）	10,522,285,492 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	238,976,675 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	951,856,892 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	162,273,314 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,071,771 円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	833,593,094 円
グローバル経済コア	535,732,278 円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,447,693 円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,235,959 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	288,399,668 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	61,645,058 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	128,578,578 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	114,061,477 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	44,669,167 円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	50,487,959 円
10資産分散投資ファンド	54,327,756 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）	130,185,122 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）	24,630,425 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）	466,828,729 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,441,218,407 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,392,067 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）	82,116,060 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	83,139,853 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）	75,978,751 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	214,968,295 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	209,372,552 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	208,311,048 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	209,262,076 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	207,193,300 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）	103,512,005 円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	134,994,647 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月26日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		12,003,069,938
投資信託受益証券		△10,667,648
投資証券		△47,747,520
合計		11,944,654,770

(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

（2023年6月26日現在）

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



市場取引	株価指数先物取引				
	買建	8,757,542,874	—	8,719,324,449	△38,218,425
合計		8,757,542,874	—	8,719,324,449	△38,218,425

(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

(2023年6月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	31,477,600	—	31,562,960	85,360
	アメリカドル	31,477,600	—	31,562,960	85,360
	売建	295,530,000	—	295,552,800	△22,800
	アメリカドル	215,160,000	—	215,169,000	△9,000
	スウェーデンクローナ	80,370,000	—	80,383,800	△13,800
合計		327,007,600	—	327,115,760	62,560

(注)時価の算定方法

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

- ① 計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ② 計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	32.58	762,111.36	
	BAKER HUGHES CO	77,332	29.77	2,302,173.64	
	CHENIERE ENERGY INC	19,971	148.56	2,966,891.76	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	80.59	683,564.38	
	CHEVRON CORP	143,594	151.35	21,732,951.90	

CONOCOPHILLIPS	96,113	100.46	9,655,511.98
COTERRA ENERGY INC	64,000	23.72	1,518,080.00
DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	47.15	2,369,570.40
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	125.40	1,663,681.80
EOG RESOURCES INC	46,173	106.82	4,932,199.86
EQT CORPORATION	27,026	39.18	1,058,878.68
EXXON MOBIL	323,843	102.40	33,161,523.20
HALLIBURTON CO	70,302	30.89	2,171,628.78
HESS CORP	21,535	131.61	2,834,221.35
HF SINCLAIR CORP	13,429	42.50	570,732.50
KINDER MORGAN INC	157,856	16.32	2,576,209.92
MARATHON OIL CORP	50,360	21.95	1,105,402.00
MARATHON PETROLEUM CORP	35,232	111.64	3,933,300.48
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,802	56.07	3,240,958.14
ONEOK INC	35,533	57.69	2,049,898.77
OVINTIV INC	20,998	34.97	734,300.06
PHILLIPS 66	37,618	90.86	3,417,971.48
PIONEER NATURAL RESOURCES	19,500	198.66	3,873,870.00
SCHLUMBERGER	111,773	46.59	5,207,504.07
TARGA RESOURCES CORP	17,298	69.92	1,209,476.16
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,282.66	683,657.78
VALERO ENERGY CORP	28,597	111.30	3,182,846.10
WILLIAMS COS	98,553	30.59	3,014,736.27
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,457	286.26	4,997,240.82
ALBEMARLE CORP	9,440	220.18	2,078,499.20
ALCOA CORP	15,500	32.84	509,020.00
AMCOR PLC	110,292	9.87	1,088,582.04
AVERY DENNISON CORP	6,638	167.85	1,114,188.30
BALL CORP	25,605	55.81	1,429,015.05
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	109.46	939,385.72
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	70.56	1,166,145.12
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	15.83	680,690.00
CORTEVA INC	55,406	57.23	3,170,885.38
CROWN HOLDINGS INC	9,940	85.74	852,255.60
DOW INC	55,796	51.36	2,865,682.56
DUPONT DE NEMOURS INC	38,372	67.78	2,600,854.16

EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	78.55	693,753.60
ECOLAB INC	19,940	178.15	3,552,311.00
FMC CORP	10,507	105.73	1,110,905.11
FREEPORT-MCMORAN INC	111,600	38.37	4,282,092.00
INT'L PAPER CO	25,191	30.60	770,844.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	75.28	1,453,430.96
LINDE PLC	39,250	370.59	14,545,657.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	88.33	1,744,075.85
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,892	442.38	2,164,122.96
MOSAIC CO/THE	27,732	34.21	948,711.72
NEWMONT CORPORATION	61,808	41.58	2,569,976.64
NUCOR CORP	20,956	153.79	3,222,823.24
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	128.82	990,239.34
PPG INDUSTRIES INC	19,305	138.89	2,681,271.45
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,000	258.26	1,291,300.00
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	82.17	859,169.52
SEALED AIR CORP	11,690	38.06	444,921.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,339	247.04	4,777,506.56
STEEL DYNAMICS INC	13,766	102.68	1,413,492.88
VULCAN MATERIALS CO	10,153	214.43	2,177,107.79
WESTLAKE CORP	2,222	112.80	250,641.60
WESTROCK CO	21,356	27.23	581,523.88
3 M COMPANY	43,028	100.72	4,333,780.16
AECOM	10,456	84.99	888,655.44
AERCAP HOLDINGS NV	15,704	60.60	951,662.40
ALLEGION PLC	7,601	115.50	877,915.50
AMETEK INC	17,753	156.06	2,770,533.18
AXON ENTERPRISE INC	5,367	188.71	1,012,806.57
BOEING CO	45,873	205.41	9,422,772.93
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	127.52	1,403,995.20
CARLISLE COS INC	4,378	241.66	1,057,987.48
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	48.05	3,274,991.90
CATERPILLAR	41,312	234.44	9,685,185.28
CUMMINS INC	11,372	232.02	2,638,531.44
DEERE&CO	22,675	404.45	9,170,903.75
DOVER CORP	10,657	141.13	1,504,022.41

EATON CORP	31,311	194.46	6,088,737.06
EMERSON ELECTRIC CO	46,386	86.68	4,020,738.48
FASTENAL CO	44,011	56.89	2,503,785.79
FERGUSON PLC	16,011	150.62	2,411,576.82
FORTIVE CORP	29,113	71.03	2,067,896.39
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	67.57	696,646.70
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	129.07	672,583.77
GENERAL DYNAMICS CORP	18,106	212.39	3,845,533.34
GENERAL ELECTRIC CO	87,133	103.78	9,042,662.74
GRACO INC	13,378	83.55	1,117,731.90
GRAINGER (WW) INC	3,667	737.90	2,705,879.30
HEICO CORP	3,640	173.74	632,413.60
HEICO CORP-CLASS A	6,394	139.26	890,428.44
HONEYWELL INTL INC	52,641	200.09	10,532,937.69
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	46.35	1,464,381.90
HUBBELL INC	4,432	317.07	1,405,254.24
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	216.96	764,133.12
IDEX CORP	5,916	203.04	1,201,184.64
ILLINOIS TOOL WORKS	24,371	242.25	5,903,874.75
INGERSOLL-RAND INC	31,562	63.37	2,000,083.94
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	50.45	640,715.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	53,782	64.99	3,495,292.18
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	191.90	2,817,475.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	311.71	787,379.46
LOCKHEED MARTIN CORP	18,184	459.36	8,353,002.24
MASCO CORP	19,462	55.26	1,075,470.12
NORDSON CORP	4,121	235.74	971,484.54
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,590	454.05	5,262,439.50
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	86.37	2,924,315.46
OWENS CORNING	6,460	124.06	801,427.60
PACCAR INC	42,159	78.44	3,306,951.96
PARKER HANNIFIN CORP	10,335	370.12	3,825,190.20
PENTAIR PLC	14,533	60.12	873,723.96
QUANTA SERVICES INC	11,465	186.61	2,139,483.65
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,466	96.91	11,383,630.06
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,188	313.27	2,878,324.76

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	43.12	596,263.36
SMITH (A. O.) CORP	9,016	69.49	626,521.84
SNAP-ON INC	4,000	273.62	1,094,480.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	87.81	1,106,230.38
TEXTRON	16,934	64.91	1,099,185.94
TORO CO	8,812	97.41	858,376.92
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	186.16	3,469,650.08
TRANSDIGM GROUP INC	4,356	850.26	3,703,732.56
UNITED RENTALS INC	5,364	404.38	2,169,094.32
WABTEC CORP	15,480	102.32	1,583,913.60
WATSCO INC	2,656	365.27	970,157.12
XYLEM INC	18,991	111.03	2,108,570.73
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,866	213.83	7,027,736.78
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	107.44	1,220,948.16
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	158.01	1,539,333.42
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	63.46	676,991.28
CINTAS CORP	7,433	482.59	3,587,091.47
CLARIVATE PLC	27,357	8.80	240,741.60
COPART INC	35,164	89.19	3,136,277.16
COSTAR GROUP INC	32,116	86.75	2,786,063.00
EQUIFAX INC	10,391	224.03	2,327,895.73
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	114.50	1,220,684.50
LEIDOS HOLDINGS	11,220	84.72	950,558.40
PAYCHEX INC	26,437	108.38	2,865,242.06
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	306.20	1,296,757.00
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	176.75	605,015.25
REPUBLIC SERVICES INC	18,327	146.53	2,685,455.31
ROBERT HALF INTL INC	7,185	70.53	506,758.05
ROLLINS INC	17,468	41.39	723,000.52
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	58.49	1,130,904.15
TRANSUNION	15,741	74.22	1,168,297.02
VERISK ANALYTICS INC	12,079	224.35	2,709,923.65
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	136.10	2,691,377.50
WASTE MANAGEMENT INC	32,506	165.59	5,382,668.54
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	90.45	756,795.15
CSX CORP	164,261	32.74	5,377,905.14

DELTA AIR LINES INC	14,609	42.86	626,141.74
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	114.45	1,405,446.00
FEDEX CORP	19,274	232.34	4,478,121.16
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.20	361,635.20
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	175.18	1,235,369.36
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	54.00	735,642.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,967	218.00	3,916,806.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,111	326.63	2,649,295.93
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	33.93	459,174.69
U-HAUL HOLDING CO	6,606	46.74	308,764.44
UBER TECHNOLOGIES INC	144,596	43.34	6,266,790.64
UNION PACIFIC CORP	48,838	199.89	9,762,227.82
UNITED PARCEL SERVICE B	58,304	169.29	9,870,284.16
APTIV PLC	21,362	97.40	2,080,658.80
BORGWARNER INC	19,781	45.23	894,694.63
FORD MOTOR COMPANY	306,411	14.02	4,295,882.22
GENERAL MOTORS CO	112,798	36.18	4,081,031.64
LEAR CORP	5,287	136.39	721,093.93
LUCID GROUP INC	61,234	5.47	334,949.98
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	13.53	694,576.08
TESLA INC	227,557	256.60	58,391,126.20
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	506.12	1,064,370.36
DR HORTON INC	25,466	120.40	3,066,106.40
GARMIN LTD	12,854	101.56	1,305,452.24
HASBRO INC	10,572	60.00	634,320.00
LENNAR CORP-CL A	20,844	122.30	2,549,221.20
LULULEMON ATHLETICA INC	9,374	374.25	3,508,219.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	97.82	407,224.66
NIKE B	96,874	109.52	10,609,640.48
NVR INC	247	6,160.21	1,521,571.87
PULTE GROUP INC	16,747	76.27	1,277,293.69
VF CORP	25,718	18.23	468,839.14
WHIRLPOOL CORP	3,785	140.59	532,133.15
AIRBNB INC-CLASS A	32,980	124.73	4,113,595.40
ARAMARK	16,686	39.29	655,592.94
BOOKING HOLDINGS INC	2,968	2,623.93	7,787,824.24

CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	45.21	793,887.60
CARNIVAL CORPORATION	84,361	15.80	1,332,903.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,159	2,043.68	4,412,305.12
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	161.30	1,485,089.10
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	316.82	902,303.36
DOORDASH INC - A	19,212	72.64	1,395,559.68
EXPEDIA GROUP INC	11,638	104.79	1,219,546.02
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,810	137.11	2,853,259.10
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	107.54	407,253.98
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	57.28	1,464,076.80
MARRIOTT INTL A	21,339	171.45	3,658,571.55
MCDONALD'S CORP	58,058	289.91	16,831,594.78
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	41.38	941,560.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	97.92	1,675,998.72
STARBUCKS CORP	90,925	98.34	8,941,564.50
VAIL RESORTS INC	3,014	243.63	734,300.82
WYNN RESORTS LTD	6,702	104.20	698,348.40
YUM BRANDS INC	21,705	135.60	2,943,198.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,339	81.90	4,777,964.10
ALPHABET INC-CL A	474,294	122.34	58,025,127.96
ALPHABET INC-CL C	428,504	123.02	52,714,562.08
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,838	326.28	2,557,382.64
COMCAST CORP-CL A	335,595	40.09	13,454,003.55
ELECTRONIC ARTS INC	21,551	125.25	2,699,262.75
FOX CORP - CLASS A	21,544	32.67	703,842.48
FOX CORP- CLASS B	10,345	30.63	316,867.35
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	38.48	1,097,103.28
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	70.76	647,666.28
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	75.56	1,162,037.24
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	29.72	403,716.48
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	87.76	1,019,156.88
MATCH GROUP INC	22,730	41.24	937,385.20
META PLATFORMS INC-CLASS A	176,691	288.73	51,015,992.43
NETFLIX INC	35,692	424.02	15,134,121.84
NEWS CORP-CLASS A	33,479	18.76	628,066.04
OMNICOM GROUP	16,538	93.18	1,541,010.84

PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	15.36	499,322.88
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	26.24	1,200,926.08
ROBLOX CORP -CLASS A	34,155	37.85	1,292,766.75
ROKU INC	9,122	62.57	570,763.54
SEA LTD-ADR	28,338	58.91	1,669,391.58
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	3.83	231,592.44
SNAP INC - A	83,375	10.82	902,117.50
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	141.85	1,825,183.95
THE WALT DISNEY CO	144,810	88.10	12,757,761.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	76.24	2,795,797.04
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	11.79	2,091,699.27
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	23.99	526,220.65
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	65.67	303,132.72
AMAZON.COM	737,070	129.33	95,325,263.10
AUTOZONE INC	1,495	2,423.73	3,623,476.35
BATH & BODY WORKS INC	19,806	37.21	736,981.26
BEST BUY COMPANY INC	15,285	79.13	1,209,502.05
BURLINGTON STORES INC	5,108	157.98	806,961.84
CARMAX INC	13,591	86.21	1,171,680.11
CHEWY INC - CLASS A	6,878	39.25	269,961.50
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	134.57	666,121.50
EBAY	41,952	43.37	1,819,458.24
ETSY INC	10,294	88.93	915,445.42
GENUINE PARTS CO	11,319	159.67	1,807,304.73
HOME DEPOT	80,884	300.81	24,330,716.04
LKQ CORP	19,286	54.42	1,049,544.12
LOWES COMPANIES	47,875	215.22	10,303,657.50
MERCADOLIBRE INC	3,552	1,226.49	4,356,492.48
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,912	924.76	4,542,421.12
POOL CORP	3,304	352.34	1,164,131.36
ROSS STORES INC	28,076	108.66	3,050,738.16
TJX COMPANIES INC	91,766	82.06	7,530,317.96
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	218.70	1,951,241.40
ULTA BEAUTY INC	3,920	453.45	1,777,524.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	21.46	536,500.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,279	524.44	18,501,718.76



DOLLAR GENERAL CORP	17,687	171.15	3,027,130.05
DOLLAR TREE INC	17,931	143.67	2,576,146.77
KROGER CO	56,285	46.14	2,596,989.90
SYSCO CORP	39,357	72.45	2,851,414.65
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,243	131.83	4,777,914.69
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	31.40	1,876,683.80
WALMART INC	117,948	155.46	18,336,196.08
ALTRIA GROUP INC	142,110	43.42	6,170,416.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,835	72.90	3,195,571.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	65.04	1,561,350.24
BUNGE LIMITED	11,604	94.04	1,091,240.16
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.59	723,467.71
COCA-COLA CO	326,933	61.20	20,008,299.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	65.04	1,001,225.76
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.09	1,373,963.36
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	242.38	3,136,397.20
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	58.84	779,159.28
GENERAL MILLS INC	46,616	81.32	3,790,813.12
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	259.09	3,114,002.71
HORMEL FOODS CORP	23,338	40.47	944,488.86
JM SMUCKER CO	7,850	150.32	1,180,012.00
KELLOGG CO	22,290	65.16	1,452,416.40
KEURIG DR PEPPER INC	72,932	31.18	2,274,019.76
KRAFT HEINZ CO/THE	63,627	35.91	2,284,845.57
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	114.69	1,362,058.44
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	93.79	1,949,894.10
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	66.18	970,794.42
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,308	73.10	7,917,314.80
MONSTER BEVERAGE CORP	64,176	59.11	3,793,443.36
PEPSICO INC	109,961	186.07	20,460,443.27
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,090	96.30	11,949,867.00
TYSON FOODS INC	23,306	49.50	1,153,647.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	97.12	1,878,883.52
CLOROX COMPANY	9,570	156.14	1,494,259.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,289	77.11	4,803,104.79
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,174	191.94	3,488,317.56

KIMBERLY-CLARK CORP	26,373	136.97	3,612,309.81
PROCTER & GAMBLE CO	187,873	148.46	27,891,625.58
ABBOTT LABORATORIES	139,490	108.05	15,071,894.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	328.83	1,954,236.69
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,715	187.67	2,573,894.05
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	45.04	1,802,185.52
BECTON DICKINSON & CO	22,473	256.55	5,765,448.15
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,067	53.97	6,210,165.99
CARDINAL HEALTH	21,902	91.72	2,008,851.44
CENTENE CORP	45,335	66.33	3,007,070.55
CVS HEALTH CORP	101,145	69.60	7,039,692.00
DAVITA INC	4,627	97.73	452,196.71
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	38.44	683,232.56
DEXCOM INC	30,645	126.75	3,884,253.75
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,456	90.34	4,377,515.04
ELEVANCE HEALTH INC	19,014	450.40	8,563,905.60
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	79.82	2,388,294.22
HCA HEALTHCARE INC	16,567	295.40	4,893,891.80
HENRY SCHEIN INC	11,747	78.90	926,838.30
HOLOGIC INC	18,875	81.46	1,537,557.50
HUMANA INC	9,946	445.95	4,435,418.70
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	487.78	3,293,002.78
INSULET CORP	5,246	287.85	1,510,061.10
INTUITIVE SURGICAL INC	28,238	327.26	9,241,167.88
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	234.83	1,537,666.84
MASIMO CORP	4,147	162.00	671,814.00
MCKESSON CORP	10,876	415.76	4,521,805.76
MEDTRONIC PLC	105,263	87.48	9,208,407.24
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	287.94	1,308,687.30
NOVOCURE LTD	7,933	41.77	331,361.41
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	141.49	1,227,991.71
RESMED INC	12,255	215.27	2,638,133.85
STERIS PLC	8,018	210.81	1,690,274.58
STRYKER CORP	26,887	297.88	8,009,099.56
TELEFLEX INC	3,934	237.30	933,538.20
THE CIGNA GROUP	23,653	274.85	6,501,027.05

THE COOPER COS INC	4,134	372.78	1,541,072.52
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,171	477.00	35,379,567.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	151.43	707,480.96
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	200.76	2,259,553.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,923	143.99	2,436,742.77
ABBVIE INC	140,386	135.92	19,081,265.12
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	119.42	2,840,404.70
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	192.69	1,858,109.67
AMGEN	42,448	227.11	9,640,365.28
AVANTOR INC	49,647	19.67	976,556.49
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	365.80	677,827.40
BIO-TECHNE CORP	12,980	76.62	994,527.60
BIOGEN INC	11,851	284.52	3,371,846.52
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	93.50	1,382,210.50
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	169,623	65.04	11,032,279.92
CATALENT INC	13,739	44.06	605,340.34
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	207.81	873,633.24
DANAHER CORP	54,898	238.18	13,075,605.64
ELI LILLY & CO	64,441	458.84	29,568,108.44
EXACT SCIENCES CORP	14,756	92.62	1,366,700.72
GILEAD SCIENCES INC	99,953	77.47	7,743,358.91
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	102.56	1,838,490.56
ILLUMINA INC	12,687	201.67	2,558,587.29
INCYTE CORP	15,212	62.45	949,989.40
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	214.06	3,237,871.56
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	124.86	620,679.06
JOHNSON & JOHNSON	207,999	165.48	34,419,674.52
MERCK & CO	203,377	114.60	23,307,004.20
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,288.25	2,329,156.00
MODERNA INC	26,107	118.50	3,093,679.50
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	96.39	649,861.38
PFIZER	452,231	38.30	17,320,447.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,615	779.73	6,717,373.95
REPLIGEN CORP	4,353	149.57	651,078.21
REVVITY INC	10,545	115.97	1,222,903.65
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	30.95	931,068.85

SEAGEN INC	10,981	198.22	2,176,653.82
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.62	702,114.42
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,671	524.21	16,078,044.91
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	222.36	804,498.48
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,685	347.00	7,177,695.00
VIATRIS INC	89,720	9.76	875,667.20
WATERS CORP	4,749	259.84	1,233,980.16
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	367.00	2,116,489.00
ZOETIS INC	36,859	168.37	6,205,949.83
BANK OF AMERICA CORP	574,499	27.75	15,942,347.25
CITIGROUP	153,036	46.02	7,042,716.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	25.47	1,006,625.34
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	25.54	1,389,886.80
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	1,208.38	1,147,961.00
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.00	487,388.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.21	1,165,083.52
JPMORGAN CHASE & CO	234,597	138.85	32,573,793.45
KEY CORP	71,223	9.35	665,935.05
M & T BANK CORP	13,674	115.87	1,584,406.38
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,049	123.03	3,942,988.47
REGIONS FINL CORP	70,810	16.95	1,200,229.50
TRUIST FINANCIAL CORP	104,155	30.00	3,124,650.00
US BANCORP	122,203	31.88	3,895,831.64
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	36.51	521,107.23
WELLS FARGO & CO	298,905	40.61	12,138,532.05
ALLY FINANCIAL INC	21,529	26.37	567,719.73
AMERICAN EXPRESS	50,389	168.07	8,468,879.23
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	317.02	2,758,708.04
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	73.00	2,325,342.00
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	90.41	1,155,439.80
BANK NEW YORK CO	61,254	42.84	2,624,121.36
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,354	335.25	34,649,428.50
BLACKROCK INC	11,937	680.45	8,122,531.65
BLACKSTONE INC	56,921	87.84	4,999,940.64
BLOCK INC	43,057	62.86	2,706,563.02
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,514	106.60	3,146,192.40

CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	30.00	470,070.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	135.33	1,201,053.75
CME GROUP INC	28,271	181.67	5,135,992.57
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,872	61.47	852,711.84
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,002	115.42	2,424,050.84
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	25.43	711,607.69
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	394.05	1,240,469.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	46,912	52.75	2,474,608.00
FISERV INC	49,788	120.49	5,998,956.12
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	238.56	1,431,837.12
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	25.53	665,567.10
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	38.99	168,280.84
GLOBAL PAYMENTS INC	20,864	98.84	2,062,197.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,705	314.71	8,404,330.55
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,833	111.09	4,869,407.97
INVESCO LTD	26,420	16.01	422,984.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	162.80	848,676.40
KKR & CO INC	49,157	53.59	2,634,323.63
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	208.24	1,329,820.64
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	263.00	843,441.00
MASTERCARD INC-CLASS A	67,952	379.81	25,808,849.12
MOODY' S CORP	13,065	337.28	4,406,563.20
MORGAN STANLEY	100,851	83.58	8,429,126.58
MSCI INC	6,518	465.15	3,031,847.70
NASDAQ INC	28,971	49.64	1,438,120.44
NORTHERN TRUST CORP	15,902	71.28	1,133,494.56
PAYPAL HOLDINGS INC	86,747	66.94	5,806,844.18
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	106.33	1,904,051.31
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	97.19	1,505,084.34
S&P GLOBAL INC	26,047	390.36	10,167,706.92
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,051	53.17	6,436,281.67
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	56.98	544,159.00
STATE STREET CORP	26,059	71.07	1,852,013.13
SYNCHRONY FINANCIAL	36,117	32.70	1,181,025.90
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.54	438,145.14
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	69.38	628,652.18

VISA INC-CLASS A SHARES	130,009	229.55	29,843,565.95
AFLAC	46,816	67.14	3,143,226.24
ALLSTATE CORP	20,709	107.53	2,226,838.77
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	116.03	733,193.57
AMERICAN INT'L GROUP	59,547	55.22	3,288,185.34
AON PLC	16,687	331.43	5,530,572.41
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	72.41	2,152,459.66
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,019	212.46	3,828,316.74
ASSURANT INC	4,726	123.81	585,126.06
BROWN & BROWN INC	19,873	66.43	1,320,163.39
CHUBB LTD	33,210	193.24	6,417,500.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,530	95.71	1,294,956.30
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	211.10	457,242.60
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	345.66	1,136,530.08
FNF GROUP	20,461	33.72	689,944.92
GLOBE LIFE INC	8,106	106.28	861,505.68
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	70.47	1,742,793.57
LOEWS CORP	16,741	57.90	969,303.90
MARKEL GROUP INC	1,007	1,324.05	1,333,318.35
MARSH & MCLENNAN COS	39,396	183.73	7,238,227.08
METLIFE INC	54,127	53.33	2,886,592.91
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	72.40	1,342,006.40
PROGRESSIVE CORP	47,071	132.77	6,249,616.67
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,190	83.89	2,448,749.10
TRAVELERS COS INC/THE	18,521	173.72	3,217,468.12
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,448	232.52	1,964,328.96
WR BERKLEY CORP	17,572	58.21	1,022,866.12
WEYERHAEUSER CO	59,710	30.41	1,815,781.10
ACCENTURE PLC-CL A	50,658	298.43	15,117,866.94
ADOBE INC	36,682	484.72	17,780,499.04
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	88.63	1,017,826.92
ANSYS INC	6,794	319.54	2,170,954.76
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	162.60	389,264.40
ATLASSIAN CORP-CL A	11,855	162.41	1,925,370.55
AUTODESK INC	17,467	202.00	3,528,334.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	19,292	51.72	997,782.24

BILL HOLDINGS, INC.	7,443	108.19	805,258.17
BLACK KNIGHT INC	11,543	57.00	657,951.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,364	225.32	4,813,736.48
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	126.06	1,024,111.44
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	63.41	1,286,145.03
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,936	62.04	2,477,629.44
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,367	143.65	2,638,419.55
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	153.17	474,827.00
DATADOG INC - CLASS A	20,137	93.67	1,886,232.79
DOCUSIGN INC	14,969	50.08	749,647.52
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	26.33	607,380.44
DYNATRACE INC	14,790	50.58	748,078.20
EPAM SYSTEMS INC	4,768	214.00	1,020,352.00
FAIR ISAAC CORP	2,115	776.05	1,641,345.75
FORTINET INC	51,829	71.59	3,710,438.11
GARTNER INC	6,340	338.19	2,144,124.60
GEN DIGITAL INC	43,555	17.71	771,359.05
GODADDY INC - CLASS A	11,388	72.35	823,921.80
HUBSPOT INC	3,646	512.21	1,867,517.66
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,616	129.43	9,269,258.88
INTUIT INC	22,381	452.69	10,131,654.89
MICROSOFT CORP	564,159	335.02	189,004,548.18
MONDAY.COM LTD	2,028	169.52	343,786.56
MONGODB INC	5,325	389.99	2,076,696.75
OKTA INC	11,505	69.25	796,721.25
ORACLE CORP	128,416	118.64	15,235,274.24
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,074	14.03	2,049,418.22
PALO ALTO NETWORKS INC	24,051	243.94	5,867,000.94
PTC INC	8,226	140.86	1,158,714.36
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,729	460.81	4,022,410.49
SALESFORCE INC	79,382	210.09	16,677,364.38
SERVICENOW INC	16,202	542.99	8,797,523.98
SNOWFLAKE INC-CLASS A	20,742	178.25	3,697,261.50
SPLUNK INC	13,355	100.98	1,348,587.90
SYNOPSYS INC	12,010	419.56	5,038,915.60
TWILIO INC - A	12,842	64.03	822,273.26

TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	396.93	1,325,349.27
UIPATH INC - CLASS A	28,419	15.73	447,030.87
UNITY SOFTWARE INC	21,912	37.47	821,042.64
VERISIGN INC	7,790	221.33	1,724,160.70
VMWARE INC-CLASS A	18,801	137.83	2,591,341.83
WIX.COM LTD	5,010	77.59	388,725.90
WORKDAY INC-CLASS A	16,701	222.25	3,711,797.25
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,031	66.62	1,334,465.22
ZSCALER INC	7,204	142.70	1,028,010.80
AMPHENOL CORPORATION	47,254	80.19	3,789,298.26
APPLE INC	1,262,821	186.68	235,743,424.28
ARISTA NETWORKS INC	20,777	148.82	3,092,033.14
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	135.08	585,977.04
CDW CORP/DE	10,882	177.40	1,930,466.80
CISCO SYSTEMS	326,126	50.33	16,413,921.58
COGNEX CORP	14,352	53.35	765,679.20
CORNING	64,989	33.86	2,200,527.54
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	50.87	1,143,608.47
F5 INC	4,851	144.45	700,726.95
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	16.52	1,609,576.64
HP INC	68,329	29.61	2,023,221.69
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	29.91	757,351.11
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	157.98	2,186,127.24
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,014	278.61	3,625,830.54
NETAPP INC	18,303	73.21	1,339,962.63
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	60.32	1,000,286.56
TE CONNECTIVITY LTD	24,490	133.11	3,259,863.90
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	399.09	1,556,051.91
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	49.55	877,926.90
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	37.86	976,409.40
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	264.33	1,100,141.46
AT&T INC	569,565	15.45	8,799,779.25
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	16.59	257,410.44
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	17.39	328,131.91
T-MOBILE US INC	48,037	132.80	6,379,313.60
VERIZON COMMUNICATIONS	338,242	35.51	12,010,973.42



AES CORP	54,375	20.43	1,110,881.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	51.83	1,076,923.74
AMEREN CORPORATION	20,898	80.83	1,689,185.34
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,907	83.49	3,331,835.43
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,127	145.76	2,350,671.52
ATMOS ENERGY CORP	11,302	114.42	1,293,174.84
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.47	1,351,357.02
CMS ENERGY CORP	23,697	58.59	1,388,407.23
CONSOLIDATED EDISON INC	27,140	90.74	2,462,683.60
CONSTELLATION ENERGY	25,114	90.36	2,269,301.04
DOMINION ENERGY INC	66,179	51.82	3,429,395.78
DTE ENERGY COMPANY	15,851	110.00	1,743,610.00
DUKE ENERGY CORP	60,751	89.72	5,450,579.72
EDISON INTL	30,339	67.76	2,055,770.64
ENERGY CORP	16,181	97.13	1,571,660.53
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	40.01	816,163.99
EVERGY INC	18,475	57.31	1,058,802.25
EVERSOURCE ENERGY	27,450	69.73	1,914,088.50
EXELON CORP	81,368	39.87	3,244,142.16
FIRSTENERGY CORP	45,523	38.49	1,752,180.27
NEXTERA ENERGY INC	161,421	74.17	11,972,595.57
NISOURCE INC	32,351	26.72	864,418.72
NRG ENERGY INC	19,068	34.69	661,468.92
PG&E CORP	143,296	16.89	2,420,269.44
PPL CORPORATION	58,459	26.38	1,542,148.42
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	61.50	2,427,282.00
SEMPRA ENERGY	24,582	143.75	3,533,662.50
SOUTHERN CO	85,837	70.45	6,047,216.65
UGI CORP	18,019	26.45	476,602.55
VISTRA CORP	31,797	25.10	798,104.70
WEC ENERGY GROUP INC	26,142	87.90	2,297,881.80
XCEL ENERGY INC	43,741	62.10	2,716,316.10
ADVANCED MICRO DEVICES	127,756	110.01	14,054,437.56
ANALOG DEVICES	40,091	185.94	7,454,520.54
APPLIED MATERIALS	68,040	136.07	9,258,202.80
BROADCOM INC	33,103	822.15	27,215,631.45

	ENPHASE ENERGY INC	11,020	158.69	1,748,763.80
	ENTEGRIS INC	12,483	103.54	1,292,489.82
	FIRST SOLAR INC	7,921	184.52	1,461,582.92
	INTEL CORP	333,366	33.00	11,001,078.00
	KLA CORP	10,913	456.95	4,986,695.35
	LAM RESEARCH CORP	10,752	608.76	6,545,387.52
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	85.35	936,972.30
	MARVELL TECHNOLOGY INC	70,922	57.82	4,100,710.04
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	81.97	3,630,369.33
	MICRON TECHNOLOGY	86,632	65.28	5,655,336.96
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	506.00	1,786,686.00
	NVIDIA CORP	197,051	422.09	83,173,256.59
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,458	188.69	3,860,220.02
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	87.52	3,016,639.36
	QORVO INC	8,556	97.32	832,669.92
	QUALCOMM	89,339	113.43	10,133,722.77
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	102.02	1,364,211.44
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	4,156	243.65	1,012,609.40
	TERADYNE INC	12,318	105.16	1,295,360.88
	TEXAS INSTRUMENTS	72,562	167.68	12,167,196.16
	WOLFSPEED INC	10,256	49.45	507,159.20
	CBRE GROUP INC-A	25,904	75.23	1,948,757.92
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.90	384,930.00
	ZILLOW GROUP INC-C	13,427	48.07	645,435.89
	アメリカドル 小計	27,087,416		3,007,351,690.01 (431,524,893,999)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	18.01	988,028.60
	CAMECO CORP	31,793	39.45	1,254,233.85
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,954	70.35	6,187,563.90
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	21.15	2,353,846.95
	ENBRIDGE	159,030	47.74	7,592,092.20
	IMPERIAL OIL	16,488	63.38	1,045,009.44
	KEYERA CORP	18,607	29.37	546,487.59
	PARKLAND CORP	14,075	32.35	455,326.25
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	39.76	1,815,680.16
	SUNCOR ENERGY	109,226	37.51	4,097,067.26

TC ENERGY CORP	83,423	51.81	4,322,145.63
TOURMALINE OIL CORP	25,009	60.05	1,501,790.45
AGNICO EAGLE MINES	40,863	64.79	2,647,513.77
BARRICK GOLD CORP	133,727	21.69	2,900,538.63
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	61.89	813,172.71
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	31.55	1,368,008.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,363	183.59	2,820,493.17
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	12.35	640,310.45
KINROSS GOLD CORP	108,451	6.09	660,466.59
LUNDIN MINING CORP	62,243	10.32	642,347.76
NUTRIEN LTD	41,509	77.56	3,219,438.04
PAN AMERICAN SILVER CORP	38,411	19.05	731,729.55
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	52.14	1,845,026.04
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	107.00	375,035.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	37,268	56.21	2,094,834.28
CAE INC	25,999	28.00	727,972.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	104.30	543,715.90
WSP GLOBAL INC	9,951	168.61	1,677,838.11
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	20,047	48.53	972,880.91
RB GLOBAL INC	14,445	73.06	1,055,351.70
THOMSON REUTERS CORP	13,293	176.17	2,341,827.81
AIR CANADA	13,805	22.88	315,858.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,034	155.32	7,150,000.88
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	72,867	105.57	7,692,569.19
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	139.54	814,494.98
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	68.63	1,390,032.02
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	103.52	317,806.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.98	682,818.42
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	99.38	2,292,994.74
QUEBECOR INC -CL B	15,200	31.52	479,104.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	170.53	769,601.89
DOLLARAMA INC	22,000	86.36	1,899,920.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	61,467	63.48	3,901,925.16
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	35.51	541,634.03
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.39	1,502,944.07
METRO INC	18,840	71.91	1,354,784.40

WESTON (GEORGE) LTD	5,226	152.35	796,181.10
SAPUTO INC	20,898	29.63	619,207.74
BANK MONTREAL	57,263	115.70	6,625,329.10
BANK NOVA SCOTIA	93,348	63.28	5,907,061.44
CANADIAN IMPERIAL BANK	73,910	55.25	4,083,527.50
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	94.62	2,582,085.18
ROYAL BANK OF CANADA	109,566	122.32	13,402,113.12
TORONTO-DOMINION BANK	146,523	78.00	11,428,794.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	41.77	1,211,371.77
BROOKFIELD CORP	114,442	41.32	4,728,743.44
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	20.21	658,421.59
IGM FINANCIAL INC	7,685	39.26	301,713.10
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	35.81	154,018.81
ONEX CORP	6,603	70.09	462,804.27
TMX GROUP LTD	23,425	28.47	666,909.75
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	965.07	1,692,732.78
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	37.19	884,675.72
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	86.87	606,091.99
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	195.74	2,594,533.70
MANULIFE FINANCIAL CORP	143,336	24.02	3,442,930.72
POWER CORP OF CANADA	43,577	34.36	1,497,305.72
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,433	66.40	3,215,951.20
CGI INC - CL A	16,084	134.11	2,157,025.24
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,660.96	4,268,179.84
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	100.86	704,406.24
OPEN TEXT CORP	20,463	52.87	1,081,878.81
SHOPIFY INC - CLASS A	95,607	84.11	8,041,504.77
BCE INC	6,203	58.82	364,860.46
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	58.57	1,632,990.17
TELUS CORP	32,908	25.35	834,217.80
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	10.61	549,788.98
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	22.80	556,206.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	41.88	473,034.60
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	34.35	354,629.40
EMERA INC	23,223	53.38	1,239,643.74
FORTIS INC	35,547	55.43	1,970,370.21

	HYDRO ONE LTD	28,888	37.13	1,072,611.44	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	26.79	478,308.66	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	191.87	516,130.30	
	カナダドル 小計	3,270,596		185,202,551.68 (20,177,818,005)	
ユーロ	ENI	174,687	12.79	2,235,294.85	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.54	418,037.48	
	NESTE OIL OYJ	32,766	34.70	1,136,980.20	
	OMV AG	12,549	37.57	471,465.93	
	REPSOL SA	111,112	12.95	1,438,900.40	
	TENARIS SA	40,648	12.80	520,497.64	
	TOTALENERGIES SE	188,735	52.05	9,823,656.75	
	AIR LIQUIDE	41,239	158.58	6,539,680.62	
	AKZO NOBEL	12,357	70.42	870,179.94	
	ARCELORMITTAL	41,072	24.57	1,009,139.04	
	ARKEMA	4,369	80.12	350,044.28	
	BASF SE	69,088	42.23	2,917,931.68	
	COVESTRO AG	14,454	49.00	708,246.00	
	CRH PLC	55,581	48.83	2,714,020.23	
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	94.44	1,294,489.08	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	16.67	267,336.79	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	14,240	73.08	1,040,659.20	
	OCI NV	7,248	22.35	161,992.80	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	30.32	591,361.28	
	SOLVAY SA	5,356	98.96	530,029.76	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	10.55	444,882.95	
	SYMRISE AG	10,018	93.42	935,881.56	
	UMICORE	17,605	25.73	452,976.65	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	27.16	1,149,519.84	
	VOESTALPINE AG	7,152	32.04	229,150.08	
	WACKER CHEMIE AG	1,770	120.25	212,842.50	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	30.97	483,813.34	
	AIRBUS SE	46,560	126.74	5,901,014.40	
	ALSTOM	24,388	26.87	655,305.56	
	BOUYGUES ORD	16,606	29.60	491,537.60	
	BRENTAG SE	12,514	70.06	876,730.84	

CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.87	1,043,209.75
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	41,219	30.74	1,267,072.06
DASSAULT AVIATION SA	2,130	178.20	379,566.00
EIFPAGE	5,924	94.74	561,239.76
FERROVIAL SE	37,026	28.55	1,057,092.30
GEA GROUP AG	13,382	37.84	506,374.88
IMCD NV	4,641	127.30	590,799.30
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	57.16	708,669.68
KNORR-BREMSE AG	5,022	65.40	328,438.80
KONE OYJ-B	26,369	47.39	1,249,626.91
LEGRAND SA	21,768	87.02	1,894,251.36
METSO CORPORATION	51,970	10.61	551,661.55
MTU AERO ENGINES AG	3,962	237.30	940,182.60
PRYSMIAN SPA	21,155	35.08	742,117.40
RATIONAL AG	483	629.00	303,807.00
RHEINMETALL AG	3,660	255.90	936,594.00
SAFRAN SA	26,468	139.48	3,691,756.64
SAINT-GOBAIN	40,093	54.05	2,167,026.65
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,646	158.10	6,742,332.60
SIEMENS	60,788	156.98	9,542,500.24
SIEMENS ENERGY AG	36,841	14.65	539,720.65
THALES SA	8,524	134.65	1,147,756.60
VINCI S. A.	41,377	104.00	4,303,208.00
WARTSILA OYJ	41,917	10.26	430,278.00
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.41	612,031.93
RANDSTAD NV	10,558	47.27	499,076.66
TELEPERFORMANCE	4,734	153.15	725,012.10
WOLTERS KLUWER	20,644	117.30	2,421,541.20
ADP	2,382	132.10	314,662.20
AENA SME SA	5,508	144.95	798,384.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.21	417,654.37
DEUTSCHE POST AG-REG	81,221	43.19	3,507,934.99
GETLINK	21,115	15.45	326,332.32
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,705	108.62	2,900,697.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	100.40	501,096.40
CONTINENTAL AG	8,168	66.82	545,785.76

DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	108.40	1,018,960.00	
FERRARI NV	10,170	282.60	2,874,042.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	67,331	72.03	4,849,851.93	
MICHELIN	55,356	26.26	1,453,648.56	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	54.14	635,874.30	
RENAULT SA	17,362	35.67	619,302.54	
STELLANTIS NV	175,794	15.11	2,657,302.10	
VALEO SA	16,596	19.19	318,477.24	
VOLKSWAGEN AG-PFD	17,164	122.36	2,100,187.04	
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	150.75	374,764.50	
ADIDAS AG	12,635	176.88	2,234,878.80	
HERMES INTERNATIONAL	2,516	1,901.40	4,783,922.40	
KERING	5,997	502.20	3,011,693.40	
LVMH	22,026	830.10	18,283,782.60	
MONCLER SPA	18,054	62.44	1,127,291.76	
PUMA SE	9,220	51.90	478,518.00	
SEB SA	2,282	88.40	201,728.80	
ACCOR	14,436	32.83	473,933.88	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,321	68.34	2,413,837.14	
DELIVERY HERO SE	13,414	34.71	465,599.94	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,938	180.05	2,689,586.90	
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	12.43	193,653.39	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	35.44	287,347.52	
SODEXO	6,173	102.40	632,115.20	
BOLLORE SE	83,646	5.50	460,471.23	
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.04	1,223,095.68	
SCOUT24 SE	7,492	57.34	429,591.28	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	19.28	1,269,454.41	
VIVENDI SE	61,243	8.26	506,234.63	
D'IETEREN GROUP	2,217	157.20	348,512.40	
INDITEX	87,326	33.90	2,960,351.40	
PROSUS	64,875	62.89	4,079,988.75	
ZALANDO SE	17,664	26.65	470,745.60	
CARREFOUR	52,544	16.40	861,984.32	
HELLOFRESH SE	13,805	20.52	283,278.60	
JERONIMO MARTINS	14,298	25.26	361,167.48	

KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.97	340,908.92
KONINKLIJKE AHOLD NV	77,838	30.24	2,353,821.12
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,606	52.40	3,542,554.40
DANONE (GROUPE)	51,543	56.09	2,891,046.87
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	51,242	12.29	630,020.39
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	80.20	762,862.40
HEINEKEN NV	20,157	95.46	1,924,187.22
JDE PEET'S BV	7,000	27.32	191,240.00
KERRY GROUP PLC-A	13,050	87.10	1,136,655.00
PERNOD-RICARD	16,694	196.75	3,284,544.50
REMY COINTREAU	2,519	139.90	352,408.10
BEIERSDORF AG	7,430	120.60	896,058.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	63.68	559,110.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	72.00	1,039,608.00
LOREAL	19,143	406.40	7,779,715.20
AMPLIFON SPA	11,650	33.30	387,945.00
BIOMERIEUX	3,044	90.84	276,516.96
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	103.85	356,205.50
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	96.10	198,927.00
ESSILORLUXOTTICA	22,662	167.56	3,797,244.72
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	44.84	761,607.40
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	25.19	848,625.91
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	18.74	1,346,144.15
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	51.24	1,105,093.08
ARGENX SE	4,177	363.20	1,517,086.40
BAYER	76,626	50.50	3,869,613.00
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	56.58	578,247.60
GRIFOLS SA	27,685	11.46	317,408.52
IPSEN	3,532	108.60	383,575.20
MERCK KGAA	10,555	152.95	1,614,387.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	38.22	376,619.88
QIAGEN N.V.	17,038	41.41	705,543.58
RECORDATI SPA	10,171	43.13	438,675.23
SANOFI	90,096	98.60	8,883,465.60
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	309.30	564,163.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,524	231.50	584,306.00



UCB (GROUPE)	9,389	83.68	785,671.52
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.47	373,055.37
AIB GROUP PLC	88,299	3.81	336,419.19
BANCO BILBAO VIZCAYA	472,469	6.65	3,142,863.78
BANCO SANTANDER SA	1,306,699	3.06	4,006,339.13
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	8.69	768,181.57
BNP PARIBAS	89,945	54.85	4,933,483.25
CAIXABANK	336,789	3.65	1,229,279.85
COMMERZBANK AG	81,889	9.62	787,772.18
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	10.47	1,041,272.91
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	30.43	772,191.68
FINECOBANK SPA	41,585	11.97	497,772.45
ING GROEP NV-CVA	293,860	11.70	3,438,749.72
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.33	2,912,924.17
KBC GROEP NV	21,452	60.74	1,302,994.48
MEDIOBANCA	25,262	10.76	271,819.12
SOCIETE GENERALE	53,019	22.70	1,203,531.30
UNICREDIT SPA	149,896	20.14	3,019,654.92
ADYEN NV	1,746	1,540.20	2,689,189.20
AMUNDI SA	4,626	52.05	240,783.30
DEUTSCHE BANK NAMEN	157,109	9.16	1,439,903.98
DEUTSCHE BOERSE	15,678	167.70	2,629,200.60
EDENRED	20,131	59.88	1,205,444.28
EURAZEO SA	3,357	62.70	210,483.90
EURONEXT NV	6,480	63.35	410,508.00
EXOR NV	7,825	79.34	620,835.50
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	71.44	608,311.60
NEXI SPA	48,458	6.92	335,329.36
SOFINA	1,238	191.00	236,458.00
WENDEL	2,023	92.90	187,936.70
WORLDLINE SA	20,332	31.81	646,760.92
AEGON	148,741	4.51	670,821.91
AGEAS	11,086	36.91	409,184.26
ALLIANZ SE-REG	31,825	209.15	6,656,198.75
ASSICURAZIONI GENERALI	82,625	18.26	1,508,732.50
AXA SA	145,657	26.41	3,846,801.37

HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	190.30	847,786.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,181	330.60	3,696,438.60
NN GROUP NV	16,208	32.49	526,597.92
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.52	438,345.27
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	41.07	1,587,560.85
TALANX AG	5,053	50.80	256,692.40
BECHTLE AG	7,659	36.12	276,643.08
CAPGEMINI SA	13,474	169.35	2,281,821.90
DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	39.68	2,093,794.56
NEMETSCHEK SE	5,455	68.92	375,958.60
SAP SE	82,544	122.58	10,118,243.52
NOKIA OYJ	451,941	3.75	1,694,778.75
CELLNEX TELECOM SA	47,754	36.34	1,735,380.36
DEUTSCHE TELEKOM	256,698	19.55	5,020,499.48
ELISA A	10,227	49.07	501,838.89
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.74	356,602.50
KPN (KON.)	282,927	3.21	909,610.30
ORANGE	149,082	10.36	1,545,682.17
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	219,958.41
TELEFONICA	431,420	3.64	1,571,231.64
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.59	256,461.57
ACCIONA SA	2,181	154.00	335,874.00
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	29.96	162,892.52
E.ON SE	186,604	11.37	2,121,687.48
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	18.72	407,306.20
ELIA GROUP SA/NV	3,125	113.60	355,000.00
ENAGAS	21,663	17.71	383,760.04
ENDESA	25,972	20.85	541,516.20
ENEL	630,812	6.05	3,820,828.28
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.48	1,224,979.08
ENGIE	145,658	14.11	2,055,525.69
FORTUM OYJ	32,550	12.39	403,457.25
IBERDROLA SA	460,276	11.67	5,373,722.30
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.60	266,266.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	15.91	488,086.98
RWE STAMM	50,344	39.73	2,000,167.12

	SNAM SPA	147,559	4.70	693,674.85
	TERNA SPA	123,882	7.61	942,742.02
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,274	28.18	1,613,981.32
	VERBUND AG	6,430	69.45	446,563.50
	ASM INTERNATIONAL NV	3,965	376.70	1,493,615.50
	ASML HOLDING NV	32,209	640.80	20,639,527.20
	INFINEON TECHNOLOGIES	105,329	35.70	3,760,771.94
	STMICROELECTRONICS NV	55,076	42.63	2,348,165.26
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	50.70	267,442.50
	VONOVIA SE	52,580	17.32	910,685.60
	ユーロ 小計	14,490,227		370,847,435.87 (58,030,206,764)
イギリスポンド	BP PLC	1,399,834	4.54	6,364,345.28
	SHELL PLC-NEW	546,298	23.18	12,665,919.13
	ANGLO AMERICAN PLC	101,345	22.48	2,278,235.60
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.52	433,658.40
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	55.64	607,811.36
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	18.86	332,011.44
	GLENORE PLC	833,513	4.32	3,606,193.99
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	16.79	282,962.16
	MONDI PLC	41,710	11.85	494,263.50
	RIO TINTO PLC REG	88,610	49.71	4,405,246.15
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	53.82	1,793,120.94
	BAE SYSTEMS PLC	240,104	9.37	2,251,695.31
	BUNZL PLC	29,127	29.77	867,110.79
	DCC PLC	6,622	43.52	288,189.44
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.54	983,433.26
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.35	432,882.60
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	101.70	560,773.80
	EXPERIAN PLC	74,115	29.07	2,154,523.05
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.69	592,964.10
	RELX PLC	149,499	26.04	3,892,953.96
	RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	6.22	1,321,625.60
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.07	298,224.94
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	37.73	262,298.96
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	21.40	637,206.40

PERSIMMON PLC	25,686	10.59	272,014.74
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.00	265,952.72
COMPASS GROUP PLC	142,427	21.82	3,107,757.14
ENTAIN PLC	49,630	12.30	610,449.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	52.62	779,354.82
PEARSON	55,305	8.21	454,496.49
WHITBREAD PLC	17,434	32.71	570,266.14
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	5.91	428,685.19
INFORMA PLC	110,598	6.93	766,444.14
WPP PLC	85,821	8.40	721,239.68
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.43	297,414.35
KINGFISHER PLC	153,717	2.25	345,863.25
NEXT PLC	11,044	66.12	730,229.28
OCADO GROUP PLC	54,753	5.37	294,352.12
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.57	381,517.62
TESCO PLC	601,050	2.48	1,495,412.40
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	19.53	502,702.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	169,799	26.25	4,457,223.75
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.41	420,443.60
DIAGEO	179,481	33.05	5,931,847.05
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.72	1,213,772.55
HALEON PLC	405,046	3.27	1,324,500.42
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,052	60.82	3,409,082.64
UNILEVER PLC	200,460	40.90	8,198,814.00
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	12.36	847,834.20
ASTRAZENECA	123,190	114.22	14,070,761.80
GSK PLC	332,472	14.25	4,738,390.94
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	18.55	305,221.70
BARCLAYS	1,252,105	1.45	1,818,306.88
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,607,565	6.02	9,680,756.43
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,254,644	0.42	2,223,765.34
NATWEST GROUP PLC	518,371	2.29	1,188,106.33
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.57	1,249,344.63
3I GROUP PLC	74,757	18.57	1,388,237.49
ABRDN PLC	153,430	2.06	316,832.95
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.72	255,369.88

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,689	84.22	2,753,067.58
	M&G PLC	131,539	1.89	249,595.25
	SCHRODERS PLC	82,861	4.30	357,048.04
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	10.60	433,900.40
	WISE PLC - A	49,048	5.29	259,562.01
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	21.16	343,955.80
	AVIVA PLC	240,378	3.86	928,339.83
	LEGAL & GENERAL GROUP	490,759	2.23	1,094,392.57
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.30	270,407.30
	PRUDENTIAL	212,226	10.78	2,287,796.28
	SAGE GROUP PLC	76,660	8.71	668,168.56
	HALMA PLC	31,069	22.59	701,848.71
	BT GROUP PLC	614,465	1.27	783,442.87
	VODAFONE GROUP PLC	1,818,722	0.72	1,322,029.02
	CENTRICA PLC	453,631	1.18	537,779.55
	NATIONAL GRID PLC	286,962	10.38	2,980,100.37
	SEVERN TRENT PLC	17,468	26.83	468,666.44
	SSE PLC	81,692	18.25	1,491,287.46
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	9.98	504,990.72
	イギリスポンド 小計	22,164,303		141,306,792.78 (25,815,337,972)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	12.49	217,301.02
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	668.50	383,719.00
	GIVAUDAN-REG	748	2,958.00	2,212,584.00
	HOLCIM LTD	44,847	59.56	2,671,087.32
	SIG GROUP AG	26,203	24.64	645,641.92
	SIKA AG-BR	11,714	240.50	2,817,217.00
	ABB LTD	128,677	34.30	4,413,621.10
	GEBERIT AG-REG	2,530	454.70	1,150,391.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	191.40	391,987.20
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	200.70	620,564.40
	VAT GROUP AG	1,956	350.50	685,578.00
	ADECCO GROUP AG-REG	15,639	28.80	450,403.20
	SGS SA	12,650	84.18	1,064,877.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	258.60	1,183,612.20
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,941	146.15	5,983,527.15

	SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	258.00	640,614.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	48.40	190,599.20	
	DUFREY AG-REG	7,820	38.57	301,617.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,703.00	476,840.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,000.00	872,000.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,900.00	893,800.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	220,234	108.78	23,957,054.52	
	ALCON INC	38,399	72.28	2,775,479.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	233.20	906,448.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	137.75	1,176,385.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	80.00	148,000.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,166	529.80	3,266,746.80	
	NOVARTIS	163,524	90.69	14,829,991.56	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	297.80	659,627.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,824	276.50	15,435,336.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	93.05	231,415.35	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	54.62	835,085.18	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	817.80	1,499,027.40	
	UBS GROUP AG	249,657	17.72	4,425,170.32	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,366	135.70	592,466.20	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	123.80	365,829.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	529.80	1,281,586.20	
	SWISS RE LTD	24,445	88.50	2,163,382.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,854	424.80	5,035,579.20	
	TEMENOS AG - REG	5,150	69.16	356,174.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	49.90	732,831.40	
	SWISSCOM	2,237	556.20	1,244,219.40	
	BKW AG	1,744	152.10	265,262.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	76.15	432,455.85	
	スイスフラン 小計	1,173,645		110,883,135.51 (17,757,934,151)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	308.70	6,869,192.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	382.50	2,058,997.50	
	SCA SV CELLULOSA B	53,887	138.55	7,466,043.85	
	ALFA LAVAL AB	25,745	379.40	9,767,653.00	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	246.00	18,690,342.00	

ATLAS COPCO A	207,097	153.85	31,861,873.45	
ATLAS COPCO B	127,608	134.05	17,105,852.40	
BEIJER REF AB	26,868	134.30	3,608,372.40	
EPIROC AB-A	53,479	195.75	10,468,514.25	
EPIROC AB-B	28,804	166.20	4,787,224.80	
HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	94.18	3,645,896.16	
INDUTRADE AB	22,644	242.40	5,488,905.60	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	205.90	2,883,011.80	
LIFCO AB-B SHS	17,970	223.60	4,018,092.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	100.90	12,395,363.20	
SAAB AB-B	6,388	592.00	3,781,696.00	
SANDVIK AB	87,644	203.70	17,853,082.80	
SKANSKA B	25,507	141.60	3,611,791.20	
SKF AB-B	21,050	188.20	3,961,610.00	
VOLVO AB-A SHS	13,514	219.40	2,964,971.60	
VOLVO B	114,238	212.80	24,309,846.40	
SECURITAS B	28,375	84.00	2,383,500.00	
VOLVO CAR AB-B	49,839	42.68	2,127,128.52	
EVOLUTION AB	15,096	1,340.20	20,231,659.20	
EMBRACER GROUP AB	53,147	26.01	1,382,353.47	
HENNES & MAURITZ B	55,229	155.38	8,581,482.02	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	285.70	14,134,721.80	
GETINGE AB-B SHS	17,796	182.65	3,250,439.40	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	210.80	3,021,818.00	
NORDEA BANK ABP	258,570	112.26	29,027,068.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	114.75	15,060,363.75	
SVENSKA HANDELSBK A	120,736	88.62	10,699,624.32	
SWEDBANK AB-A	72,526	178.30	12,931,385.80	
EQT AB	31,471	208.80	6,571,144.80	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	288.60	3,410,674.80	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	287.70	3,213,033.60	
INVESTOR AB-A SHS	26,088	209.90	5,475,871.20	
INVESTOR AB-B SHS	140,493	208.95	29,356,012.35	
KINNEVIK AB - B	18,792	140.35	2,637,457.20	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	445.30	3,241,784.00	
ERICSSON (LM) B	214,689	54.18	11,631,850.02	

	HEXAGON AB-B SHS	168,352	127.10	21,397,539.20	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	88.26	4,127,214.12	
	TELIA CO AB	230,643	23.10	5,327,853.30	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	37.94	2,151,198.00	
	SAGAX AB-B	17,402	211.30	3,677,042.60	
	スウェーデンクローナ 小計	2,959,643		422,648,552.48 (5,663,490,603)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	27,755	246.30	6,836,056.50	
	EQUINOR ASA	73,436	308.55	22,658,677.80	
	NORSK HYDRO	100,517	62.32	6,264,219.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	376.90	4,710,496.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	487.20	4,211,844.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	74.85	1,430,907.45	
	MOWI ASA	31,968	170.15	5,439,355.20	
	ORKLA	69,804	77.26	5,393,057.04	
	SALMAR ASA	5,423	423.40	2,296,098.20	
	DNB BANK ASA	71,795	190.95	13,709,255.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	172.50	3,204,015.00	
	TELENOR ASA	51,193	109.50	5,605,633.50	
	ノルウェークローネ 小計	490,725		81,759,615.58 (1,085,767,694)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	475.00	4,029,425.00	
	NOVOZYMES A/S	17,111	318.90	5,456,697.90	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,630.00	1,230,650.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	81,654	180.06	14,702,619.24	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,690.00	2,560,110.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	11,805.00	5,123,370.00	
	DSV A/S	14,203	1,358.50	19,294,775.50	
	PANDORA A/S	7,957	576.20	4,584,823.40	
	CARLSBERG AS-B	8,329	1,067.50	8,891,207.50	
	COLOPLAST-B	9,208	860.80	7,926,246.40	
	DEMANT A/S	8,512	280.30	2,385,913.60	
	GENMAB A/S	5,250	2,618.00	13,744,500.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,448	1,088.40	143,068,003.20	
	DANSKE BANK A/S	56,132	159.00	8,924,988.00	
TRYG A/S	29,772	149.20	4,441,982.40		



	ORSTED A/S	15,439	625.60	9,658,638.40
	デンマーククローネ 小計	394,906		256,023,950.54 (5,379,063,200)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	29.80	614,744.20
	SANTOS	265,406	7.30	1,937,463.80
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	31.95	441,293.40
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	157,787	33.74	5,323,733.38
	BHP GROUP LTD	408,249	44.60	18,207,905.40
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	20.09	698,529.30
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	21.41	2,967,254.72
	IGO LTD	56,345	15.06	848,555.70
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	38.73	1,430,996.04
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	71.96	1,036,871.64
	NEWCREST MINING LIMITED	73,939	25.88	1,913,541.32
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	12.30	1,250,024.40
	ORICA LTD	38,288	14.90	570,491.20
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.90	1,026,476.50
	RIO TINTO LTD	28,272	113.13	3,198,411.36
	SOUTH32 LTD	346,773	3.72	1,289,995.56
	REECE LTD	16,814	18.26	307,023.64
	BRAMBLES LTD	108,007	14.05	1,517,498.35
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	22.67	1,006,003.92
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.84	459,229.44
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.20	527,000.00
	TRANSURBAN GROUP	249,674	14.22	3,550,364.28
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	38.03	1,757,366.30
	IDP EDUCATION LTD	17,793	21.71	386,286.03
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.07	922,805.91
	REA GROUP LTD	3,586	132.70	475,862.20
	SEEK LTD	28,001	21.59	604,541.59
	WESFARMERS LTD	92,975	48.07	4,469,308.25
	COLES GROUP LTD	108,486	18.40	1,996,142.40
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.27	689,079.27
WOOLWORTHS GROUP LTD	101,437	39.86	4,043,278.82	
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.44	731,702.40	
COCHLEAR LIMITED	4,783	227.96	1,090,332.68	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	54.92	664,916.44	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	34.74	1,294,099.74	
	CSL LIMITED	39,127	282.00	11,033,814.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	236,293	22.82	5,392,206.26	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,440	98.51	13,243,684.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	247,090	25.78	6,369,980.20	
	WESTPAC BANKING	272,224	20.75	5,648,648.00	
	ASX LTD	14,549	61.63	896,654.87	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,094	172.78	5,026,861.32	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.65	941,640.30	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.60	835,858.80	
	QBE INSURANCE GROUP	126,465	15.40	1,947,561.00	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.48	1,278,766.72	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	76.80	1,059,916.80	
	XERO LTD	11,340	111.34	1,262,595.60	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.32	1,332,577.44	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	8.46	1,281,410.82	
	オーストラリアドル 小計	5,455,363		126,801,306.11 (12,143,761,086)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.46	697,620.06	
	EBOS GROUP LTD	14,283	36.80	525,614.40	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	24.00	959,520.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.12	886,364.16	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.41	414,169.33	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.40	596,937.60	
	ニュージーランドドル 小計	484,999		4,080,225.55 (360,365,520)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	48.15	10,303,907.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	81.15	8,683,050.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	11.60	1,067,200.00	
	MTR CORP	125,000	36.20	4,525,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	13.64	1,636,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	52.05	9,056,700.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	28.00	5,544,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	20.75	3,027,425.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.20	2,764,864.20	

	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.00	6,756,000.00	
	HANG SENG BANK	59,400	111.90	6,646,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,400	301.40	28,452,160.00	
	AIA GROUP LTD	931,200	78.15	72,773,280.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	41.15	1,543,125.00	
	CLP HOLDINGS	137,500	61.55	8,463,125.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.75	6,106,434.75	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	40.70	4,558,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	42.95	7,065,103.20	
	ESR GROUP LTD	157,000	13.10	2,056,700.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	12.24	2,117,520.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	23.15	2,899,028.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	19.52	2,662,040.00	
	SINO LAND CO	315,400	9.39	2,961,606.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	97.65	10,253,250.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	52.35	2,120,175.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	18.72	1,800,864.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	40.20	4,944,600.00	
	香港ドル 小計	5,828,553		220,789,217.75 (4,044,858,469)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	33.25	266,000.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.64	748,992.00	
	SEATRUM LTD	2,152,791	0.12	269,098.87	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.61	532,114.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.41	802,740.12	
	GENTING SINGAPORE LTD	634,000	0.93	592,790.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.92	700,112.00	
	DBS GROUP	140,400	31.43	4,412,772.00	
	OCBC BANK	257,100	12.32	3,167,472.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	105,700	27.99	2,958,543.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.58	632,280.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.96	384,472.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.50	1,702,357.50	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.27	730,845.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.72	287,616.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.39	303,525.00	

シンガポールドル 小計		4,931,566		18,491,729.49 (1,963,636,754)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	20.75	1,233,110.25
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	760.50	1,632,033.00
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.43	2,991,573.30
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	27.50	3,094,080.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.37	1,827,815.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	124.20	1,552,872.60
	NICE LTD	4,991	750.00	3,743,250.00
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	139.40	1,394,000.00
	AZRIELI GROUP	1,537	215.60	331,377.20
イスラエルシェケル 小計		400,926		17,800,111.35 (704,576,467)
合 計		89,132,868		584,651,710,684 (584,651,710,684)

(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	83,290	833,732.90	
		LENDLEASE GROUP	64,786	453,502.00	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,287,234.90 (123,278,486)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,850,750.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,850,750.00 (52,225,740)	
投資信託受益証券合計			463,076	175,504,226 (175,504,226)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,363,827.24	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	842,123.28	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,446	6,966,079.38	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	752,528.24	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,055,284.84	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	579,838.50	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	820,309.14	
		CROWN CASTLE INC	35,462	3,880,961.28	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,440,338.65	

	EQUINIX INC	7,399	5,520,467.89
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	919,654.30
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,464	1,837,375.04
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,145,204.10
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,542,821.28
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	854,445.90
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	551,152.00
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	872,256.55
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	921,993.52
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,473,561.92
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,258,904.22
	KIMCO REALTY CORP	47,897	882,262.74
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,339,159.80
	PROLOGIS INC	73,426	8,583,499.40
	PUBLIC STORAGE	12,878	3,651,943.24
	REALTY INCOME CORP	53,932	3,169,044.32
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	725,638.00
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	1,914,695.64
	SIMON PROPERTY GROUP	25,472	2,744,353.28
	SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,279,704.51
	UDR INC	23,815	958,077.45
	VENTAS INC	31,565	1,403,695.55
	VICI PROPERTIES INC	82,862	2,538,063.06
	WELLTOWER INC	39,775	3,034,037.00
	WP CAREY INC	16,024	1,062,230.96
	アメリカドル 小計	935,613	69,885,532.22 (10,027,875,018)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	233,549.73
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	284,861.10
	カナダドル 小計	20,377	518,410.83 (56,480,859)
ユーロ	COVIVIO (FP)	4,962	213,167.52
	GECINA SA	3,139	294,595.15
	KLEPIERRE	17,225	375,332.75
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	476,748.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	321,558.60

	ユーロ 小計		48,695	1,681,402.02 (263,105,788)
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC		79,414	236,256.65
	LAND SECURITIES GROUP PLC		56,289	314,993.24
	SEGRO PLC		103,383	727,402.78
	イギリスポンド 小計		239,086	1,278,652.67 (233,597,056)
オーストラリアドル	DEXUS		94,090	721,670.30
	GOODMAN GROUP		133,807	2,626,631.41
	GPT GROUP		167,884	674,893.68
	MIRVAC GROUP		266,683	586,702.60
	SCENTRE GROUP		381,283	953,207.50
	STOCKLAND		207,412	831,722.12
	VICINITY CENTERS		305,149	546,216.71
	オーストラリアドル 小計		1,556,308	6,941,044.32 (664,743,814)
香港ドル	LINK REIT		208,900	9,212,490.00
	香港ドル 小計		208,900	9,212,490.00 (168,772,816)
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT		284,138	758,648.46
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		338,529	646,590.39
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		283,189	461,598.07
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA		220,000	354,200.00
	シンガポールドル 小計		1,125,856	2,221,036.92 (235,851,910)
	投資証券合計		4,134,835	11,650,427,261 (11,650,427,261)
	合計			11,825,931,487 (11,825,931,487)

(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 605 銘柄	97.7%	—	—	72.3%
	投資証券 34 銘柄	—	—	2.3%	1.7%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.7%	—	—	3.4%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.5%	—	—	9.7%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79 銘柄	99.1%	—	—	4.3%
	投資証券 3 銘柄	—	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 44 銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.9%	—	—	2.0%
	投資信託受 益証券 2 銘柄	—	1.0%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	5.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 27 銘柄	94.8%	—	—	0.7%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	1.2%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	89.3%	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	10.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

貸借対照表

	2023年6月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	206,428,486
コール・ローン	4,747,531
株式	11,367,563,200
投資信託受益証券	5,826,601
投資証券	237,430,115
派生商品評価勘定	74,125
未収配当金	14,591,712
前払金	1,138,109
差入委託証拠金	108,859,670
流動資産合計	11,946,659,549
資産合計	11,946,659,549
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,204,114
未払解約金	32,431
未払利息	11
流動負債合計	1,236,556
負債合計	1,236,556
純資産の部	
元本等	
元本	9,095,211,203
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	2,850,211,790
元本等合計	11,945,422,993
純資産合計	11,945,422,993
負債純資産合計	11,946,659,549

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等</p>



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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年6月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		9,095,211,203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)	1.3134円 (13,134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

	2023年6月26日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 6月 26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	2023年 6月 26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 6月 28日
期首元本額	1,562,498,874 円
期中追加設定元本額	7,654,087,485 円
期中一部解約元本額	121,375,156 円
期末元本額	9,095,211,203 円
期末元本額の内訳	

コア投資戦略ファンド（安定型）	174,450,525 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	414,398,493 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	185,653,993 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	104,285,474 円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	5,975,380,828 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	155,144,883 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,192,199 円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	1,978,096,873 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）	73,607,935 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月26日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	1,568,114,395	
投資信託受益証券	△398,523	
投資証券	△5,787,349	
合計	1,561,928,523	

(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

(2023年6月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	313,480,164	—	312,342,055	△1,138,109
合計		313,480,164	—	312,342,055	△1,138,109

(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

(2023年6月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,263,220	—	5,271,340	8,120
	アメリカドル	2,861,600	—	2,869,360	7,760
	スイスフラン	2,401,620	—	2,401,980	360

合計	5,263,220	—	5,271,340	8,120
----	-----------	---	-----------	-------

(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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	3,223	29.77	95,948.71	
	CHENIERE ENERGY INC	760	148.56	112,905.60	
	HALLIBURTON CO	2,609	30.89	80,592.01	
	HF SINCLAIR CORP	505	42.50	21,462.50	
	KINDER MORGAN INC	6,746	16.32	110,094.72	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,414	111.64	157,858.96	
	ONEOK INC	1,294	57.69	74,650.86	
	PHILLIPS 66	1,384	90.86	125,750.24	
	SCHLUMBERGER	4,523	46.59	210,726.57	
	TARGA RESOURCES CORP	634	69.92	44,329.28	
	VALERO ENERGY CORP	1,173	111.30	130,554.90	
	WILLIAMS COS	3,872	30.59	118,444.48	
	AMCOR PLC	4,384	9.87	43,270.08	
	AVERY DENNISON CORP	251	167.85	42,130.35	
	BALL CORP	934	55.81	52,126.54	
	ECOLAB INC	810	178.15	144,301.50	
	INT'L PAPER CO	1,067	30.60	32,650.20	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	738	75.28	55,556.64	
	LINDE PLC	1,503	370.59	556,996.77	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	850	88.33	75,080.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	181	442.38	80,070.78		
NEWMONT CORPORATION	2,540	41.58	105,613.20		
NUCOR CORP	768	153.79	118,110.72		

PPG INDUSTRIES INC	783	138.89	108,750.87
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	750	247.04	185,280.00
STEEL DYNAMICS INC	551	102.68	56,576.68
WESTROCK CO	968	27.23	26,358.64
3 M COMPANY	1,647	100.72	165,885.84
AECOM	408	84.99	34,675.92
ALLEGION PLC	283	115.50	32,686.50
AXON ENTERPRISE INC	214	188.71	40,383.94
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	427	127.52	54,451.04
CARRIER GLOBAL CORP	2,450	48.05	117,722.50
CATERPILLAR	1,629	234.44	381,902.76
CUMMINS INC	451	232.02	104,641.02
DOVER CORP	420	141.13	59,274.60
EATON CORP	1,226	194.46	238,407.96
EMERSON ELECTRIC CO	1,767	86.68	153,163.56
FASTENAL CO	1,665	56.89	94,721.85
FERGUSON PLC	634	150.62	95,493.08
FORTIVE CORP	1,205	71.03	85,591.15
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	67.57	29,595.66
GENERAC HOLDINGS INC	205	129.07	26,459.35
GRACO INC	519	83.55	43,362.45
GRAINGER (WW) INC	133	737.90	98,140.70
IDEX CORP	222	203.04	45,074.88
ILLINOIS TOOL WORKS	954	242.25	231,106.50
INGERSOLL-RAND INC	1,181	63.37	74,839.97
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,230	64.99	144,927.70
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	587	191.90	112,645.30
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	311.71	33,664.68
MASCO CORP	695	55.26	38,405.70
OTIS WORLDWIDE CORP	1,222	86.37	105,544.14
OWENS CORNING	349	124.06	43,296.94
PENTAIR PLC	573	60.12	34,448.76
QUANTA SERVICES INC	418	186.61	78,002.98
ROCKWELL AUTOMATION INC	336	313.27	105,258.72
TORO CO	322	97.41	31,366.02
TRANE TECHNOLOGIES PLC	674	186.16	125,471.84

UNITED RENTALS INC	208	404.38	84,111.04
XYLEM INC	724	111.03	80,385.72
AUTOMATIC DATA PROCESS	1,318	213.83	281,827.94
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	364	158.01	57,515.64
CERIDIAN HCM HOLDING INC	453	63.46	28,747.38
CINTAS CORP	283	482.59	136,572.97
CLARIVATE PLC	1,200	8.80	10,560.00
PAYCHEX INC	1,003	108.38	108,705.14
PAYLOCITY HOLDING CORP	129	176.75	22,800.75
ROBERT HALF INTL INC	369	70.53	26,025.57
TRANSUNION	597	74.22	44,309.34
WASTE MANAGEMENT INC	1,258	165.59	208,312.22
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	90.45	33,828.30
CSX CORP	6,244	32.74	204,428.56
DELTA AIR LINES INC	457	42.86	19,587.02
EXPEDITORS INTL WASH INC	490	114.45	56,080.50
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	245	175.18	42,919.10
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	54.00	28,512.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	685	218.00	149,330.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	326	326.63	106,481.38
UNION PACIFIC CORP	1,910	199.89	381,789.90
UNITED PARCEL SERVICE B	2,222	169.29	376,162.38
APTIV PLC	936	97.40	91,166.40
BORGWARNER INC	783	45.23	35,415.09
LEAR CORP	205	136.39	27,959.95
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,989	13.53	26,911.17
TESLA INC	8,819	256.60	2,262,955.40
DECKERS OUTDOOR CORP	81	506.12	40,995.72
HASBRO INC	452	60.00	27,120.00
LULULEMON ATHLETICA INC	366	374.25	136,975.50
NIKE B	3,823	109.52	418,694.96
NVR INC	10	6,160.21	61,602.10
PULTE GROUP INC	693	76.27	52,855.11
VF CORP	1,103	18.23	20,107.69
WHIRLPOOL CORP	169	140.59	23,759.71
ARAMARK	725	39.29	28,485.25

BOOKING HOLDINGS INC	116	2,623.93	304,375.88
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	802	137.11	109,962.22
MCDONALD'S CORP	2,258	289.91	654,616.78
VAIL RESORTS INC	144	243.63	35,082.72
YUM BRANDS INC	866	135.60	117,429.60
ALPHABET INC-CL A	18,414	122.34	2,252,768.76
ALPHABET INC-CL C	16,641	123.02	2,047,175.82
COMCAST CORP-CL A	13,005	40.09	521,370.45
ELECTRONIC ARTS INC	807	125.25	101,076.75
FOX CORP - CLASS A	918	32.67	29,991.06
FOX CORP- CLASS B	492	30.63	15,069.96
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	38.48	44,636.80
OMNICOM GROUP	623	93.18	58,051.14
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,923	3.83	7,365.09
SNAP INC - A	3,077	10.82	33,293.14
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	471	141.85	66,811.35
THE WALT DISNEY CO	5,648	88.10	497,588.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	772	23.99	18,520.28
ADVANCE AUTO PARTS	179	65.67	11,754.93
AUTOZONE INC	57	2,423.73	138,152.61
BEST BUY COMPANY INC	593	79.13	46,924.09
BURLINGTON STORES INC	211	157.98	33,333.78
CARMAX INC	544	86.21	46,898.24
EBAY	1,625	43.37	70,476.25
GENUINE PARTS CO	410	159.67	65,464.70
HOME DEPOT	3,131	300.81	941,836.11
LKQ CORP	787	54.42	42,828.54
LOWES COMPANIES	1,829	215.22	393,637.38
MERCADOLIBRE INC	140	1,226.49	171,708.60
POOL CORP	117	352.34	41,223.78
TJX COMPANIES INC	3,510	82.06	288,030.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	324	218.70	70,858.80
ULTA BEAUTY INC	150	453.45	68,017.50
KROGER CO	1,998	46.14	92,187.72
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,395	131.83	183,902.85
BUNGE LIMITED	445	94.04	41,847.80

CAMPBELL SOUP CO (US)	623	45.59	28,402.57
COCA-COLA CO	12,707	61.20	777,668.40
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	706	65.04	45,918.24
CONAGRA BRANDS INC	1,400	34.09	47,726.00
DARLING INGREDIENTS INC	500	58.84	29,420.00
GENERAL MILLS INC	1,894	81.32	154,020.08
HORMEL FOODS CORP	878	40.47	35,532.66
JM SMUCKER CO	330	150.32	49,605.60
KELLOGG CO	942	65.16	61,380.72
KEURIG DR PEPPER INC	2,826	31.18	88,114.68
LAMB WESTON HOLDINGS INC	450	114.69	51,610.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	728	93.79	68,279.12
PEPSICO INC	4,258	186.07	792,286.06
CHURCH & DWIGHT CO INC	755	97.12	73,325.60
CLOROX COMPANY	359	156.14	56,054.26
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,437	77.11	187,917.07
KIMBERLY-CLARK CORP	1,059	136.97	145,051.23
PROCTER & GAMBLE CO	7,297	148.46	1,083,312.62
ALIGN TECHNOLOGY INC	218	328.83	71,684.94
AMERISOURCEBERGEN CORP	537	187.67	100,778.79
DAVITA INC	138	97.73	13,486.74
DENTSPLY SIRONA INC	879	38.44	33,788.76
DEXCOM INC	1,252	126.75	158,691.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,931	90.34	174,446.54
ELEVANCE HEALTH INC	728	450.40	327,891.20
HCA HEALTHCARE INC	637	295.40	188,169.80
HOLOGIC INC	728	81.46	59,302.88
HUMANA INC	378	445.95	168,569.10
IDEXX LABORATORIES INC	271	487.78	132,188.38
INSULET CORP	202	287.85	58,145.70
LABORATORY CRP OF AMER	269	234.83	63,169.27
MOLINA HEALTHCARE INC	179	287.94	51,541.26
QUEST DIAGNOSTICS	343	141.49	48,531.07
STERIS PLC	292	210.81	61,556.52
TELEFLEX INC	160	237.30	37,968.00
THE CIGNA GROUP	909	274.85	249,838.65



THE COOPER COS INC	150	372.78	55,917.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	649	143.99	93,449.51
AGILENT TECHNOLOGIES	971	119.42	115,956.82
AMGEN	1,680	227.11	381,544.80
AVANTOR INC	2,087	19.67	41,051.29
BIO-TECHNE CORP	460	76.62	35,245.20
BIOGEN INC	467	284.52	132,870.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,431	65.04	418,272.24
DANAHER CORP	2,141	238.18	509,943.38
ELI LILLY & CO	2,497	458.84	1,145,723.48
GILEAD SCIENCES INC	3,829	77.47	296,632.63
ILLUMINA INC	483	201.67	97,406.61
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	201	124.86	25,096.86
JOHNSON & JOHNSON	8,033	165.48	1,329,300.84
MERCK & CO	7,846	114.60	899,151.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	65	1,288.25	83,736.25
REPLIGEN CORP	163	149.57	24,379.91
WATERS CORP	175	259.84	45,472.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	215	367.00	78,905.00
ZOETIS INC	1,416	168.37	238,411.92
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	25.47	36,753.21
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,183	10.21	42,708.43
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,187	123.03	146,036.61
REGIONS FINL CORP	2,716	16.95	46,036.20
TRUIST FINANCIAL CORP	4,058	30.00	121,740.00
US BANCORP	4,757	31.88	151,653.16
WEBSTER FINANCIAL CORP	434	36.51	15,845.34
ALLY FINANCIAL INC	1,066	26.37	28,110.42
AMERICAN EXPRESS	1,934	168.07	325,047.38
AMERIPRISE FINANCIAL INC	317	317.02	100,495.34
BANK NEW YORK CO	2,565	42.84	109,884.60
BLACKROCK INC	454	680.45	308,924.30
CBOE GLOBAL MARKETS INC	324	135.33	43,846.92
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	779	115.42	89,912.18
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	25.43	28,659.61
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	114	394.05	44,921.70

FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,832	52.75	96,638.00
FISERV INC	1,927	120.49	232,184.23
FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	25.53	26,321.43
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,710	111.09	189,963.90
INVESCO LTD	833	16.01	13,336.33
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	208.24	48,311.68
MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	263.00	30,508.00
MASTERCARD INC-CLASS A	2,631	379.81	999,280.11
MOODY' S CORP	503	337.28	169,651.84
MORGAN STANLEY	3,858	83.58	322,451.64
NASDAQ INC	1,005	49.64	49,888.20
NORTHERN TRUST CORP	577	71.28	41,128.56
PRICE T ROWE GROUP INC	659	106.33	70,071.47
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	695	97.19	67,547.05
S&P GLOBAL INC	1,033	390.36	403,241.88
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,681	53.17	248,888.77
STATE STREET CORP	1,064	71.07	75,618.48
SYNCHRONY FINANCIAL	1,464	32.70	47,872.80
VISA INC-CLASS A SHARES	5,024	229.55	1,153,259.20
AFLAC	1,764	67.14	118,434.96
ALLSTATE CORP	792	107.53	85,163.76
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,094	72.41	79,216.54
ASSURANT INC	131	123.81	16,219.11
HARTFORD FINANCIAL SVCS	954	70.47	67,228.38
MARSH & MCLENNAN COS	1,563	183.73	287,169.99
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	72.40	53,141.60
PROGRESSIVE CORP	1,843	132.77	244,695.11
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,081	83.89	90,685.09
TRAVELERS COS INC/THE	691	173.72	120,040.52
WILLIS TOWERS WATSON PLC	323	232.52	75,103.96
WEYERHAEUSER CO	2,160	30.41	65,685.60
ACCENTURE PLC-CL A	1,952	298.43	582,535.36
ADOBE INC	1,407	484.72	682,001.04
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	483	88.63	42,808.29
ANSYS INC	253	319.54	80,843.62
AUTODESK INC	626	202.00	126,452.00

BLACK KNIGHT INC	485	57.00	27,645.00
CADENCE DESIGN SYSTEMS	852	225.32	191,972.64
DOCUSIGN INC	624	50.08	31,249.92
FAIR ISAAC CORP	78	776.05	60,531.90
GARTNER INC	244	338.19	82,518.36
GEN DIGITAL INC	1,758	17.71	31,134.18
HUBSPOT INC	133	512.21	68,123.93
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,840	129.43	367,581.20
INTUIT INC	867	452.69	392,482.23
MICROSOFT CORP	21,863	335.02	7,324,542.26
PTC INC	347	140.86	48,878.42
SALESFORCE INC	3,092	210.09	649,598.28
SERVICENOW INC	639	542.99	346,970.61
SPLUNK INC	491	100.98	49,581.18
SYNOPSYS INC	471	419.56	197,612.76
TWILIO INC - A	549	64.03	35,152.47
VMWARE INC-CLASS A	729	137.83	100,478.07
WORKDAY INC-CLASS A	631	222.25	140,239.75
ZSCALER INC	269	142.70	38,386.30
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,794	16.52	62,676.88
HP INC	2,748	29.61	81,368.28
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	526	157.98	83,097.48
NETAPP INC	661	73.21	48,391.81
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	575	60.32	34,684.00
TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	49.55	36,320.15
WESTERN DIGITAL CORP	987	37.86	37,367.82
LIBERTY GLOBAL PLC-A	550	16.59	9,124.50
LIBERTY GLOBAL PLC-C	799	17.39	13,894.61
VERIZON COMMUNICATIONS	13,067	35.51	464,009.17
AMERICAN WATER WORKS CO INC	627	145.76	91,391.52
ATMOS ENERGY CORP	407	114.42	46,568.94
CMS ENERGY CORP	902	58.59	52,848.18
CONSOLIDATED EDISON INC	1,023	90.74	92,827.02
EDISON INTL	1,106	67.76	74,942.56
ESSENTIAL UTILITIES INC	767	40.01	30,687.67
EVERSOURCE ENERGY	1,192	69.73	83,118.16

	EXELON CORP	3,100	39.87	123,597.00	
	SEMPRA ENERGY	964	143.75	138,575.00	
	UGI CORP	712	26.45	18,832.40	
	APPLIED MATERIALS	2,596	136.07	353,237.72	
	INTEL CORP	12,927	33.00	426,591.00	
	LAM RESEARCH CORP	422	608.76	256,896.72	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,649	57.82	153,165.18	
	NVIDIA CORP	7,636	422.09	3,223,079.24	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	838	188.69	158,122.22	
	TEXAS INSTRUMENTS	2,832	167.68	474,869.76	
	CBRE GROUP INC-A	948	75.23	71,318.04	
	アメリカドル 小計	467,323		58,929,362.67 (8,455,774,249)	
カナダドル	CAMECO CORP	1,280	39.45	50,496.00	
	ENBRIDGE	6,213	47.74	296,608.62	
	KEYERA CORP	573	29.37	16,829.01	
	PARKLAND CORP	413	32.35	13,360.55	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,603	39.76	63,735.28	
	AGNICO EAGLE MINES	1,589	64.79	102,951.31	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	12.35	19,685.90	
	KINROSS GOLD CORP	3,375	6.09	20,553.75	
	LUNDIN MINING CORP	1,764	10.32	18,204.48	
	NUTRIEN LTD	1,537	77.56	119,209.72	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	242	107.00	25,894.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,322	56.21	74,309.62	
	CAE INC	1,167	28.00	32,676.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	311	104.30	32,437.30	
	RB GLOBAL INC	570	73.06	41,644.20	
	THOMSON REUTERS CORP	496	176.17	87,380.32	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,746	155.32	271,188.72	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	820	68.63	56,276.60	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	546	39.98	21,829.08	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	170.53	24,385.79	
	DOLLARAMA INC	1,027	86.36	88,691.72	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,390	63.48	151,717.20	
	METRO INC	705	71.91	50,696.55	

	BANK MONTREAL	2,249	115.70	260,209.30	
	BANK NOVA SCOTIA	3,587	63.28	226,985.36	
	NATIONAL BANK OF CANADA	976	94.62	92,349.12	
	TORONTO-DOMINION BANK	5,761	78.00	449,358.00	
	BROOKFIELD CORP	4,364	41.32	180,320.48	
	INTACT FINANCIAL CORP	509	195.74	99,631.66	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,814	66.40	120,449.60	
	OPEN TEXT CORP	684	52.87	36,163.08	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,782	84.11	318,104.02	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,039	58.57	60,854.23	
	TELUS CORP	1,700	25.35	43,095.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	2,113	10.61	22,418.93	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	407	41.88	17,045.16	
	FORTIS INC	1,389	55.43	76,992.27	
	HYDRO ONE LTD	1,129	37.13	41,919.77	
	FIRSTSERVICE CORP	103	191.87	19,762.61	
	カナダドル 小計	63,032		3,746,420.31 (408,172,492)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	10.54	15,135.44	
	NESTE OIL OYJ	1,231	34.70	42,715.70	
	OMV AG	448	37.57	16,831.36	
	REPSOL SA	4,227	12.95	54,739.65	
	TENARIS SA	1,751	12.80	22,421.55	
	TOTALENERGIES SE	7,329	52.05	381,474.45	
	AKZO NOBEL	535	70.42	37,674.70	
	COVESTRO AG	600	49.00	29,400.00	
	CRH PLC	2,209	48.83	107,865.47	
	DSM-FIRMENICH AG	507	94.44	47,881.08	
	EVONIK INDUSTRIES AG	657	16.67	10,952.19	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	377	73.08	27,551.16	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	816	30.32	24,741.12	
	STORA ENSO OYJ R	2,074	10.55	21,880.70	
	SYMRISE AG	390	93.42	36,433.80	
	UMICORE	562	25.73	14,460.26	
	UPM KYMMENE OYJ	1,554	27.16	42,206.64	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	722	30.97	22,360.34	

BOUYGUES ORD	586	29.60	17,345.60
BRENTAG SE	540	70.06	37,832.40
CNH INDUSTRIAL NV	3,006	12.87	38,702.25
EIFFAGE	291	94.74	27,569.34
GEA GROUP AG	399	37.84	15,098.16
KINGSPAN GROUP PLC	515	57.16	29,437.40
KNORR-BREMSE AG	224	65.40	14,649.60
METSO CORPORATION	2,196	10.61	23,310.54
PRYSMIAN SPA	664	35.08	23,293.12
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,675	158.10	264,817.50
WARTSILA OYJ	1,323	10.26	13,580.59
TELEPERFORMANCE	171	153.15	26,188.65
WOLTERS KLUWER	760	117.30	89,148.00
ADP	92	132.10	12,153.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,000	9.21	18,422.00
DEUTSCHE POST AG-REG	3,112	43.19	134,407.28
GETLINK	1,366	15.45	21,111.53
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,087	108.62	118,069.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	160	100.40	16,064.00
MICHELIN	1,982	26.26	52,047.32
VALEO SA	653	19.19	12,531.07
ADIDAS AG	502	176.88	88,793.76
HERMES INTERNATIONAL	98	1,901.40	186,337.20
KERING	233	502.20	117,012.60
LVMH	854	830.10	708,905.40
MONCLER SPA	637	62.44	39,774.28
PUMA SE	276	51.90	14,324.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,393	68.34	95,197.62
JUST EAT TAKEAWAY	784	12.43	9,749.82
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,667	19.28	51,433.09
PROSUS	2,387	62.89	150,118.43
ZALANDO SE	838	26.65	22,332.70
CARREFOUR	2,101	16.40	34,466.90
HELLOFRESH SE	519	20.52	10,649.88
JERONIMO MARTINS	863	25.26	21,799.38
KESKO OYJ-B SHS	689	16.97	11,695.77

KONINKLIJKE AHOLD NV	3,024	30.24	91,445.76
DANONE (GROUPE)	2,057	56.09	115,377.13
JDE PEET' S BV	322	27.32	8,797.04
KERRY GROUP PLC-A	466	87.10	40,588.60
BEIERSDORF AG	355	120.60	42,813.00
HENKEL AG & CO KGAA	380	63.68	24,198.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	72.00	37,800.00
LOREAL	746	406.40	303,174.40
MERCK KGAA	375	152.95	57,356.25
BNP PARIBAS	3,334	54.85	182,869.90
COMMERZBANK AG	2,731	9.62	26,272.22
CREDIT AGRICOLE SA	3,742	10.47	39,178.74
FINECOBANK SPA	1,888	11.97	22,599.36
ING GROEP NV-CVA	11,581	11.70	135,520.86
KBC GROEP NV	838	60.74	50,900.12
MEDIOBANCA	1,829	10.76	19,680.04
SOCIETE GENERALE	2,317	22.70	52,595.90
DEUTSCHE BOERSE	548	167.70	91,899.60
NEXI SPA	1,449	6.92	10,027.08
WORLDLINE SA	855	31.81	27,197.55
ASSICURAZIONI GENERALI	3,133	18.26	57,208.58
AXA SA	5,754	26.41	151,963.14
MUENCHENER RUECKVERSICH.	433	330.60	143,149.80
NN GROUP NV	822	32.49	26,706.78
POSTE ITALIANE SPA	1,615	9.52	15,378.03
DASSAULT SYSTEMES SA	2,064	39.68	81,899.52
NOKIA OYJ	16,542	3.75	62,032.50
ELISA A	535	49.07	26,252.45
KPN (KON.)	9,816	3.21	31,558.44
ORANGE	5,809	10.36	60,227.71
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	3,486	2.59	9,056.62
ENEL	25,448	6.05	154,138.53
IBERDROLA SA	17,906	11.67	209,052.55
NATURGY ENERGY GROUP SA	460	26.60	12,236.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,048	15.91	16,673.68
TERNA SPA	4,688	7.61	35,675.68

	VERBUND AG	197	69.45	13,681.65	
	ASML HOLDING NV	1,246	640.80	798,436.80	
	STMICROELECTRONICS NV	2,113	42.63	90,087.75	
	LEG IMMOBILIEN SE	314	50.70	15,919.80	
	VONOVIA SE	2,300	17.32	39,836.00	
	ユーロ 小計	210,159		6,956,560.29 (1,088,562,554)	
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	3,929	22.48	88,323.92	
	ANTOFAGASTA PLC	1,001	14.52	14,539.52	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	55.64	22,923.68	
	ENDEAVOUR MINING PLC	600	18.86	11,316.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	471	16.79	7,910.44	
	MONDI PLC	1,612	11.85	19,102.20	
	ASHTED GROUP PLC	1,285	53.82	69,158.70	
	DCC PLC	249	43.52	10,836.48	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	247	101.70	25,119.90	
	INTERTEK GROUP PLC	554	42.69	23,650.26	
	RELX PLC	5,937	26.04	154,599.48	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.07	10,641.28	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	37.73	10,715.32	
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	21.40	27,584.60	
	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.00	9,248.28	
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,840	5.91	16,801.44	
	INFORMA PLC	4,350	6.93	30,145.50	
	WPP PLC	3,240	8.40	27,228.96	
	KINGFISHER PLC	5,110	2.25	11,497.50	
	OCADO GROUP PLC	1,843	5.37	9,907.96	
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.57	11,635.72	
	TESCO PLC	22,008	2.48	54,755.90	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	19.53	25,428.06	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	965	23.41	22,590.65	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,167	60.82	131,796.94	
	UNILEVER PLC	7,680	40.90	314,112.00	
	ASTRAZENECA	4,802	114.22	548,484.44	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	62,265	6.02	374,959.83	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	200,998	0.42	85,062.35	



	3I GROUP PLC	3,009	18.57	55,877.13
	ABRDN PLC	6,887	2.06	14,221.65
	SCHRODERS PLC	2,334	4.30	10,057.20
	ST JAMES' S PLACE PLC	1,915	10.60	20,299.00
	ADMIRAL GROUP PLC	656	21.16	13,880.96
	LEGAL & GENERAL GROUP	17,456	2.23	38,926.88
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	5.30	12,300.64
	PRUDENTIAL	8,672	10.78	93,484.16
	SAGE GROUP PLC	3,200	8.71	27,891.20
	BT GROUP PLC	20,577	1.27	26,235.67
	VODAFONE GROUP PLC	77,207	0.72	56,121.76
	NATIONAL GRID PLC	11,392	10.38	118,305.92
	イギリスポンド 小計	509,385		2,657,679.48 (485,531,464)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	12.49	7,356.61
	GIVAUDAN-REG	28	2,958.00	82,824.00
	SIG GROUP AG	1,000	24.64	24,640.00
	SIKA AG-BR	459	240.50	110,389.50
	ABB LTD	4,728	34.30	162,170.40
	GEBERIT AG-REG	104	454.70	47,288.80
	VAT GROUP AG	83	350.50	29,091.50
	SGS SA	475	84.18	39,985.50
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	160	258.60	41,376.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	10,900.00	65,400.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	233.20	36,612.40
	LONZA GROUP AG-REG	234	529.80	123,973.20
	NOVARTIS	6,337	90.69	574,702.53
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	93.05	13,399.20
	JULIUS BAER GROUP LTD	700	54.62	38,234.00
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	135.70	21,712.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	92	529.80	48,741.60
	SWISS RE LTD	935	88.50	82,747.50
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	471	424.80	200,080.80
	TEMENOS AG - REG	200	69.16	13,832.00
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	508	49.90	25,349.20
	SWISSCOM	80	556.20	44,496.00

	スイスフラン 小計	17,650		1,834,402.74 (293,779,598)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	963	308.70	297,278.10
	HOLMEN AB-B SHARES	294	382.50	112,455.00
	SCA SV CELLULOSA B	1,564	138.55	216,692.20
	ALFA LAVAL AB	1,073	379.40	407,096.20
	ASSA ABLOY AB-B	2,915	246.00	717,090.00
	ATLAS COPCO A	8,623	153.85	1,326,648.55
	ATLAS COPCO B	4,574	134.05	613,144.70
	BEIJER REF AB	1,031	134.30	138,463.30
	EPIROC AB-A	1,948	195.75	381,321.00
	EPIROC AB-B	1,045	166.20	173,679.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,379	94.18	129,874.22
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,447	100.90	448,702.30
	SANDVIK AB	3,113	203.70	634,118.10
	SKF AB-B	1,022	188.20	192,340.40
	HENNES & MAURITZ B	1,899	155.38	295,066.62
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,790	285.70	511,403.00
	NORDEA BANK ABP	9,852	112.26	1,105,985.52
	SVENSKA HANDELSBK A	4,600	88.62	407,652.00
	EQT AB	1,233	208.80	257,450.40
	KINNEVIK AB - B	912	140.35	127,999.20
TELE2 AB-B SHS	1,519	88.26	134,066.94	
TELIA CO AB	7,952	23.10	183,691.20	
	スウェーデンクローナ 小計	63,748		8,812,217.95 (118,083,720)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	1,087	246.30	267,728.10
	EQUINOR ASA	2,821	308.55	870,419.55
	NORSK HYDRO	4,021	62.32	250,588.72
	MOWI ASA	1,166	170.15	198,394.90
	ORKLA	2,110	77.26	163,018.60
	SALMAR ASA	202	423.40	85,526.80
	DNB BANK ASA	2,716	190.95	518,620.20
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	172.50	104,190.00
	TELENOR ASA	2,114	109.50	231,483.00
	ノルウェークローネ 小計	16,841		2,689,969.87

				(35,722,799)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	277	475.00	131,575.00
	NOVOZYMES A/S	604	318.90	192,615.60
	ROCKWOOL A/S-B SHS	50	1,630.00	81,500.00
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	2,937	180.06	528,836.22
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	11,690.00	93,520.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	11,805.00	212,490.00
	DSV A/S	580	1,358.50	787,930.00
	PANDORA A/S	241	576.20	138,864.20
	COLOPLAST-B	348	860.80	299,558.40
	GENMAB A/S	210	2,618.00	549,780.00
	NOVO NORDISK A/S-B	5,116	1,088.40	5,568,254.40
	ORSTED A/S	553	625.60	345,956.80
	デンマーククローネ 小計	10,942		8,930,880.62 (187,637,801)
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,948	33.74	200,685.52
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	20.09	24,449.53
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,932	21.41	105,594.12
	IGO LTD	2,596	15.06	39,095.76
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,323	38.73	51,239.79
	MINERAL RESOURCES LTD	565	71.96	40,657.40
	NEWCREST MINING LIMITED	2,644	25.88	68,426.72
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	12.30	49,679.70
	ORICA LTD	1,151	14.90	17,149.90
	PILBARA MINERALS LTD	9,000	4.90	44,100.00
	BRAMBLES LTD	4,243	14.05	59,614.15
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	22.67	36,680.06
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.84	18,036.48
	TRANSURBAN GROUP	10,361	14.22	147,333.42
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,768	38.03	67,237.04
	IDP EDUCATION LTD	654	21.71	14,198.34
	REA GROUP LTD	235	132.70	31,184.50
	SEEK LTD	857	21.59	18,502.63
	COLES GROUP LTD	3,916	18.40	72,054.40
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	6.27	21,148.71
COCHLEAR LIMITED	213	227.96	48,555.48	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	705	54.92	38,718.60	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,432	34.74	49,747.68	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	9,241	22.82	210,879.62	
	ASX LTD	680	61.63	41,908.40	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,137	172.78	196,450.86	
	QBE INSURANCE GROUP	4,375	15.40	67,375.00	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	13.48	60,120.80	
	XERO LTD	534	111.34	59,455.56	
	TELSTRA GROUP LTD	12,031	4.32	51,973.92	
	オーストラリアドル 小計	99,945		1,952,254.09 (186,967,374)	
ニュージーランドドル	EBOS GROUP LTD	527	36.80	19,393.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	5.12	29,204.48	
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.41	14,992.99	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	5.40	21,621.60	
	ニュージーランドドル 小計	12,574		85,212.67 (7,525,983)	
香港ドル	MTR CORP	4,000	36.20	144,800.00	
	WH GROUP LTD	24,000	4.20	100,800.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	11,500	24.00	276,000.00	
	HANG SENG BANK	2,400	111.90	268,560.00	
	AIA GROUP LTD	36,200	78.15	2,829,030.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	30,000	6.75	202,500.00	
	SINO LAND CO	10,000	9.39	93,900.00	
	SWIRE PACIFIC A	1,500	52.35	78,525.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	3,800	18.72	71,136.00	
	香港ドル 小計	123,400		4,065,251.00 (74,475,398)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	4,300	6.64	28,552.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	3,800	27.99	106,362.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	9.58	22,992.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	3.27	25,506.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	1,300	6.72	8,736.00	
	シンガポールドル 小計	19,600		192,148.00 (20,404,196)	
イスラエルシェ	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,525	27.50	124,437.50	

ケル				
	イスラエルシェケル 小計	4,525		124,437.50 (4,925,572)
	合 計	1,619,124		11,367,563,200 (11,367,563,200)

(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	2,944	29,469.44	
		LENDLEASE GROUP	1,761	12,327.00	
	オーストラリアドル 小計		4,705	41,796.44 (4,002,845)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	11,000	99,550.00	
	香港ドル 小計		11,000	99,550.00 (1,823,756)	
投資信託受益証券合計			15,705	5,826,601 (5,826,601)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,432	266,394.96	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	29,375.20	
		BOSTON PROPERTIES	522	26,883.00	
		CROWN CASTLE INC	1,334	145,992.96	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	950	98,942.50	
		EQUINIX INC	284	211,895.24	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,586	30,562.22	
		IRON MOUNTAIN INC	950	51,271.50	
		PROLOGIS INC	2,894	338,308.60	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	341	76,070.28	
	WELLTOWER INC	1,473	112,360.44		
	アメリカドル 小計		13,226	1,388,056.90 (199,172,284)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	278	13,285.62	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	550	10,114.50	
カナダドル 小計		828	23,400.12 (2,549,443)		
ユーロ	GECINA SA	121	11,355.85		
	KLEPIERRE	568	12,376.72		

		ユーロ 小計	689	23,732.57 (3,713,672)
	イギリスポンド	SEGRO PLC	3,574	25,146.66
		イギリスポンド 小計	3,574	25,146.66 (4,594,043)
	オーストラリアドル	DEXUS	2,715	20,824.05
		GOODMAN GROUP	5,701	111,910.63
		GPT GROUP	4,863	19,549.26
		MIRVAC GROUP	9,992	21,982.40
		SCENTRE GROUP	15,450	38,625.00
		STOCKLAND	6,045	24,240.45
		VICINITY CENTERS	9,869	17,665.51
		オーストラリアドル 小計	54,635	254,797.30 (24,401,937)
	シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	14,785	28,239.35
		シンガポールドル 小計	14,785	28,239.35 (2,998,736)
		投資証券合計	87,737	237,430,115 (237,430,115)
		合計		243,256,716 (243,256,716)

(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 286 銘柄	97.7%	—	—	72.8%
	投資証券 11 銘柄	—	—	2.3%	1.7%
カナダドル	株式 39 銘柄	99.4%	—	—	3.5%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.6%	0.0%
ユーロ	株式 95 銘柄	99.7%	—	—	9.4%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
イギリスポンド	株式 41 銘柄	99.1%	—	—	4.2%

	投資証券 1 銘柄	—	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式 22 銘柄	100.0%	—	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式 22 銘柄	100.0%	—	—	1.0%
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%	—	—	1.6%
オーストラリアドル	株式 30 銘柄	86.8%	—	—	1.6%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.9%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	11.3%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 4 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 9 銘柄	97.6%	—	—	0.6%
	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	2.4%	—	0.0%
シンガポールドル	株式 5 銘柄	87.2%	—	—	0.2%
	投資証券 1 銘柄	—	—	12.8%	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。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年6月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,334,573,784
コール・ローン	138,419,956
株式	154,212,098,791
投資信託受益証券	468,229,279
投資証券	122,387,482
派生商品評価勘定	97,000
未収入金	19,502,042
未収配当金	570,739,713
前払金	138,806,749
差入委託証拠金	1,141,939,921
流動資産合計	161,146,794,717

資産合計	161,146,794,717
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	135,086,509
未払解約金	94,214,685
未払利息	339
流動負債合計	229,301,533
負債合計	229,301,533
純資産の部	
元本等	
元本	42,085,141,962
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	118,832,351,222
元本等合計	160,917,493,184
純資産合計	160,917,493,184
負債純資産合計	161,146,794,717

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>



3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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)

		2023年6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		42,085,141,962 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.8236 円 (38,236 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

		2023年6月26日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2023年6月26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	

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年6月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月28日
期首元本額	30,648,883,622円
期中追加設定元本額	12,760,954,844円
期中一部解約元本額	1,324,696,504円
期末元本額	42,085,141,962円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,771,401,830円
世界経済インデックスファンド	8,979,343,164円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,885,117,891円
DC世界経済インデックスファンド	7,017,345,231円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	115,816,539円
コア投資戦略ファンド (安定型)	109,036,912円
コア投資戦略ファンド (成長型)	264,234,197円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,065,737,895円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	754,911,156円
コア投資戦略ファンド (切替型)	122,627,005円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	395,081,050円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,371,902円
SMT インデックスバランス・オープン	97,062,598円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	65,789,313円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	3,781,789,917円
SMT 世界経済インデックス・オープン	225,892,383円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	901,813,201円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	154,884,157円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,141,236円
グローバル経済コア	403,731,013円

My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	155,881,734 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	100,944,337 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	22,104,370 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	82,093,780 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	72,391,706 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	28,163,577 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	31,611,409 円
10資産分散投資ファンド	13,160,558 円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,376,077,727 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	101,367,436 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	78,403,569 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)	10,655,605 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)	49,325,061 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年6月26日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		8,894,870,326
投資信託受益証券		44,479,347
投資証券		△2,559,329
合計		8,936,790,344

(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

(2023年6月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,201,807,836	—	6,066,721,327	△135,086,509
合計		6,201,807,836	—	6,066,721,327	△135,086,509

(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

(2023年6月26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	為替予約取引				

取引	買建	35,770,000	—	35,867,000	97,000
	アメリカドル	35,770,000	—	35,867,000	97,000
合計		35,770,000	—	35,867,000	97,000

(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

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.34	187,353.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.44	125,959.20	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	—	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	—	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	—	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,749	71.25	1,122,116.25	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	25.27	1,613,009.37	
	NIO INC - ADR	235,578	8.43	1,985,922.54	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	38.39	1,157,804.01	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	5.59	443,108.12	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	56.28	3,739,918.56	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	28.82	353,996.06	
	IQIYI INC-ADR	59,454	5.00	297,270.00	
	JOYY INC	6,185	29.18	180,478.30	
	KANZHUN LTD	38,815	14.75	572,521.25	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	7.45	845,925.15	
	VK CO LTD	19,368	0.00	—	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	13.35	70,074.15	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	—	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	15.59	167,218.34	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—		

	PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	69.80	5,651,985.20	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	73,380	16.38	1,201,964.40	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	—	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	12,386	74.28	920,032.08	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.15	464,485.00	
	CREDICORP LTD	10,882	144.30	1,570,272.60	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.37	156,362.21	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	16.30	338,273.90	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.62	368,791.20	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	37.77	295,927.95	
	KE HOLDINGS INC	113,384	14.94	1,693,956.96	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.62	94,965.13	
	アメリカドル 小計	2,137,054		25,619,691.53 (3,676,169,537)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,657,761	11.89	31,600,778.29	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	83.22	40,685,592.24	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	247.03	8,646,050.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	36.50	6,517,148.00	
	ALFA S. A. B. -A	313,500	10.93	3,426,555.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	120.50	12,291,000.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	480.73	16,140,509.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	307.67	18,454,046.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	175.45	7,489,083.25	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	590,690	17.22	10,171,681.80	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	67.71	56,015,128.80	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	177.93	14,568,018.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	186.07	58,265,959.80	
	GRUMA S. A. B. -B	25,960	269.63	6,999,594.80	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	91.94	16,714,692.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.91	7,073,838.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	51.98	7,417,546.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	137.97	56,885,031.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	399,400	41.67	16,642,998.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,969,540	18.54	92,135,271.60	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.20	3,581,820.00	

	メキシコペソ 小計	12,259,530		491,722,343.68 (4,119,305,589)
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	18.04	2,924,284.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	638,000	33.90	21,628,200.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	30.16	21,957,686.40
	PRIIO SA	130,000	38.21	4,967,300.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	18.11	1,369,116.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.83	1,275,302.00
	GERDAU SA-PREF	214,790	25.13	5,397,672.70
	SUZANO SA	121,779	45.94	5,594,527.26
	VALE SA	557,687	65.90	36,751,573.30
	WEG SA	255,844	36.60	9,363,890.40
	CCR SA	248,600	14.15	3,517,690.00
	LOCALIZA RENT A CAR	93,140	67.50	6,286,950.00
	RUMO SA	244,300	21.82	5,330,626.00
	LOJAS RENNER S. A.	216,447	22.31	4,828,932.57
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.58	1,093,690.00
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	18.38	3,179,740.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.31	1,499,706.00
	RAIA DROGASIL SA	189,280	29.07	5,502,369.60
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	14.30	2,170,740.00
	AMBEV SA	756,200	15.49	11,713,538.00
	JBS SA	110,000	17.18	1,889,800.00
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	17.49	1,754,386.92
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.33	4,525,516.82
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	33.37	3,193,509.00
	HYPERA SA	54,500	43.74	2,383,830.00
	BANCO BRADESCO S. A.	326,023	14.66	4,779,497.18
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	16.59	13,739,539.38
	BANCO DO BRASIL S. A.	156,500	51.02	7,984,630.00
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	28.67	22,370,656.27
	ITAUSA SA	774,657	9.66	7,483,186.62
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,060,409	14.43	15,301,701.87
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	30.59	3,331,251.00
	TOTVS SA	57,900	29.77	1,723,683.00
	TELEFONICA BRASIL S. A.	89,400	42.72	3,819,168.00

	TIM SA	96,100	14.53	1,396,333.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	44.92	1,662,040.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	40.08	8,484,936.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.91	2,734,686.57	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	55.76	2,815,880.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	33.70	916,640.00	
	ENEVA SA	102,200	12.32	1,259,104.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	45.95	2,125,187.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	31.50	5,200,650.00	
	ブラジルリアル 小計	12,029,898		277,229,347.36 (8,311,308,110)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	5,950.00	538,016,850.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,491.00	202,723,815.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	56,115.00	1,192,499,865.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	54.05	133,027,211.40	
	FALABELLA SA	70,837	1,856.10	131,480,555.70	
	CENCOSUD SA	306,432	1,545.00	473,437,440.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,485.00	47,891,725.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	81.40	617,272,724.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	23,855.00	147,734,015.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	36.92	426,432,239.48	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	106.82	372,942,268.30	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	52.90	135,491,606.20	
	チリペソ 小計	28,285,639		4,418,950,315.28 (786,462,682)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	69,778	31,040.00	2,165,909,120.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	27,760.00	1,709,044,400.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	16,980.00	857,676,780.00	
	コロンビアペソ 小計	181,854		4,732,630,300.00 (162,352,882)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	25.10	130,545.10	
	MYTILINEOS S. A.	20,295	32.96	668,923.20	
	OPAP SA	38,972	15.85	617,706.20	
	JUMBO SA	19,341	24.00	464,184.00	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.52	402,093.70	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.49	637,214.89	

	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	5.64	415,624.16	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	15.01	393,367.07	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	10.04	561,155.68	
	TERNA ENERGY SA	13,651	20.78	283,667.78	
	ユーロ 小計	944,528		4,574,481.78 (715,814,908)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	76.75	10,943,782.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	36.08	9,339,957.44	
	HEKTAS TICARET T.A.S	133,067	29.90	3,978,703.30	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	346,418	23.38	8,099,252.84	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	55.40	6,538,529.60	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	52.90	5,267,041.40	
	KOC HOLDING AS	89,884	103.60	9,311,982.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	43.94	13,126,987.12	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	603.40	4,333,015.40	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	184.70	15,997,790.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	753.50	12,334,795.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	231.60	7,319,254.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	168.00	13,646,304.00	
	AKBANK T.A.S.	586,183	19.79	11,600,561.57	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	46.50	9,828,798.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	13.65	5,247,919.95	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	12.84	4,765,270.68	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	35.50	5,079,730.50	
	トルコリラ 小計	3,406,398		156,759,677.00 (890,974,976)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	658.50	8,760,025.50	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	79.60	4,832,516.00	
	CEZ AS	25,283	1,042.00	26,344,886.00	
	チェココルナ 小計	99,296		39,937,427.50 (264,022,339)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	3,018.00	134,370,414.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,455.00	243,005,155.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	12,025.00	481,252,525.00	
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		858,628,094.00 (362,802,997)	



ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	102,979	65.67	6,762,630.93
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	112.45	2,269,915.70
	LPP SA	124	13,480.00	1,671,520.00
	CD PROJEKT SA	6,704	152.00	1,019,008.00
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	16.35	590,382.79
	ALLEGRO.EU SA	83,795	32.00	2,681,440.00
	PEPCO GROUP NV	22,887	36.58	837,206.46
	DINO POLSKA SA	9,471	462.80	4,383,178.80
	BANK PEKAO SA	27,684	108.30	2,998,177.20
	M BANK SA	1,423	385.80	548,993.40
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	35.26	4,594,272.22
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	372.80	2,737,470.40
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	40.14	3,473,274.06
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	277,921	7.17	1,994,361.09
	ポーランドズロチ 小計	813,441		36,561,831.05 (1,288,329,240)
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	7,220	0.00	—
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	—
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	—
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	—
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	—
	ロシアルーブル 小計	760,525,356		76.00 (130)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	5.54	1,822,660.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	7.68	1,858,560.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,411,400	4.43	19,542,502.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	560,500	23.05	12,919,525.00

COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	350,000	7.56	2,646,000.00
PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.44	17,505,920.00
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	286,000	20.60	5,891,600.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.34	1,135,600.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	20.45	4,856,875.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	6.12	3,399,660.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.73	3,443,440.00
CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.23	930,240.00
CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.21	3,410,100.00
DONGYUE GROUP	147,000	5.19	762,930.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	52.10	2,815,484.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	12.26	2,868,840.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.63	1,685,320.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	14.48	1,375,600.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	10.34	1,871,540.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.80	10,679,000.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.62	995,500.00
BOC AVIATION LTD	23,800	60.30	1,435,140.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	3.73	731,080.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	10.02	2,434,860.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	4.93	631,040.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.93	3,480,580.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.28	3,659,760.00
CITIC LTD	1,038,000	9.81	10,182,780.00
CRRC CORP LTD-H	936,000	4.28	4,006,080.00
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.20	1,497,600.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.50	1,365,000.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	9.81	1,569,600.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	10.88	4,447,744.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	28.65	1,784,895.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	2.93	1,128,266.82
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.66	1,211,240.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	4.96	1,230,080.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.48	1,734,932.56
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.48	2,679,040.00
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	6.87	3,559,003.50

COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	4.70	1,178,637.80	
JD LOGISTICS INC	326,200	12.20	3,979,640.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.78	2,505,160.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	98.70	1,727,250.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.36	905,581.32	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.99	1,856,900.00	
BYD CO LTD-H	158,000	256.00	40,448,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.34	888,440.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	29.55	1,725,720.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.23	8,750,040.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	8.66	4,275,875.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.43	1,587,463.92	
LI AUTO INC-CLASS A	189,942	132.20	25,110,332.40	
MINTH GROUP LTD	176,000	20.85	3,669,600.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	39.60	6,619,615.20	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	16.80	3,931,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	81.20	16,142,560.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.45	1,511,100.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	410,800	23.75	9,756,500.00	
LI NING CO LTD	380,000	42.95	16,321,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	74.05	9,041,505.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	7.84	1,293,600.00	
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	26.40	1,161,600.00	
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	234,000	16.94	3,963,960.00	
Jiumaojiu INTERNATIONAL HOLD	235,000	12.64	2,970,400.00	
MEITUAN-CLASS B	815,350	124.70	101,674,145.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	29.25	7,151,625.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	16.74	2,792,232.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	13.34	1,053,860.00	
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	275.40	24,140,737.80	
BAIDU INC-CLASS A	371,850	138.20	51,389,670.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	120.20	3,197,320.00	
CHINA LITERATURE LTD	51,600	35.05	1,808,580.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.84	2,333,120.00	
KINGSOFT CORP LTD	171,200	32.55	5,572,560.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	54.15	20,165,460.00	

NETEASE INC	313,630	147.10	46,134,973.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,000,100	337.00	337,033,700.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,659,588	84.05	223,538,371.40
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	8.12	844,480.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	119.50	1,075,500.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	14.70	3,704,400.00
JD.COM INC - CL A	378,061	140.10	52,966,346.10
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	17.00	1,098,200.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.66	2,730,600.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	28.95	2,663,400.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.47	3,504,480.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	47.55	9,198,547.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	18.74	1,006,338.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	133.00	2,021,600.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.27	2,408,280.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	538,000	30.05	16,166,900.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	50.05	12,312,300.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	2.72	669,120.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.25	11,939,850.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	7.82	1,524,900.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	12.02	5,000,320.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	68.70	7,969,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.80	544,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,039,000	5.13	5,330,070.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	16.78	805,440.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	33.30	2,913,750.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	19.84	496,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	43.15	3,253,510.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	12.50	825,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	10.10	4,031,920.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	14.34	1,841,256.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	23.60	4,512,320.00
3SBIO INC	445,500	7.24	3,225,420.00
AKESO INC	61,000	33.25	2,028,250.00
BEIGENE LTD	110,905	109.00	12,088,645.00

CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	12.48	3,082,560.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.65	9,231,264.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	6.54	2,217,060.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.58	1,739,880.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	18.00	2,376,000.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	42.50	216,750.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	12.22	1,490,840.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	30.45	6,181,350.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	23.35	781,057.50
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	20.45	1,492,850.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.33	6,563,430.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	63,688	61.40	3,910,443.20
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	631,000	37.75	23,820,250.00
ZAI LAB LTD	128,250	19.96	2,559,870.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	4,735,000	3.01	14,252,350.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,174,200	3.11	40,971,762.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	5.04	6,912,234.00
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.02	6,292,104.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,086,620	5.00	75,433,100.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.38	892,500.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	35.15	21,860,593.45
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.82	1,901,808.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	4.13	36,048,766.95
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,576,000	4.87	7,675,120.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.79	657,280.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.13	1,994,790.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	13.32	4,677,984.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	14.10	4,029,427.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.10	1,464,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	10.58	937,388.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.01	1,789,572.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.33	2,481,780.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,296,000	12.96	16,796,160.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	19.20	7,422,720.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.00	1,472,192.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	225,300	20.20	4,551,060.00

PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.98	5,596,440.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.29	11,122,805.52	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	49.30	49,497,200.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	21.15	2,455,515.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	5.01	1,382,760.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	11.20	1,419,040.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	10.32	5,087,760.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	17.28	1,235,520.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	22.70	3,643,350.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	20.60	1,380,200.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.11	490,590.00	
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	8.05	9,563,400.00	
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	73.10	8,735,450.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	9.99	24,017,958.00	
ZTE CORP-H	82,908	29.20	2,420,913.60	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.86	6,090,520.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	28.85	1,716,575.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.78	1,085,800.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.86	2,656,080.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	8.66	4,039,024.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	7.76	3,507,520.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.68	1,784,880.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	197,600	26.00	5,137,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	16.32	4,200,768.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	95.85	11,214,450.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	6.85	3,055,100.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.55	3,203,200.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	5.80	3,178,400.00	
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	25.45	1,628,800.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.71	5,384,790.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	24.85	2,236,500.00	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	18.08	777,440.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	8.53	7,642,769.11	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	85,000	17.70	1,504,500.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.13	707,267.00	

	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	16.46	9,621,528.40	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	7.69	1,730,250.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	31.75	17,180,274.25	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	37.95	4,516,050.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	10.10	3,186,550.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,852,654	1.59	2,945,719.86	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	9.34	3,184,940.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	7.21	522,725.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	3.63	653,400.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	18.58	6,382,230.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	8.59	2,753,954.00	
	香港ドル 小計	135,520,729		1,909,436,448.66 (34,980,875,739)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.09	864,566.12	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.40	1,891,760.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.17	2,569,188.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.74	3,591,024.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.46	711,370.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.05	689,509.30	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	6.82	731,656.42	
	MISC BHD	217,540	7.19	1,564,112.60	
	GENTING BHD	271,600	4.08	1,108,128.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.48	916,856.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.57	476,416.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.74	1,011,071.60	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	21.78	2,488,277.88	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	130.90	942,480.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.96	1,172,740.80	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.35	667,680.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.30	1,062,297.80	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.86	1,343,698.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	0.86	434,214.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.62	1,088,534.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,204,302	5.21	6,274,413.42	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	18.80	2,280,289.60	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.44	290,079.52	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	8.74	7,704,353.70	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,503,200	3.88	9,712,416.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.40	1,184,473.80	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.65	1,433,885.85	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.25	2,116,500.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.13	1,106,427.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	4.99	1,355,044.48	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	16.74	2,484,216.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.20	4,064,330.00	
	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.73	749,931.00	
	マレーシアリングット 小計	12,703,192		66,081,941.39 (2,027,631,856)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	9.15	15,675,780.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	149.00	29,919,200.00	
	PTT PCL-NVDR	1,731,900	31.75	54,987,825.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	44.50	13,065,422.50	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	34.25	7,069,200.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	37.25	18,108,491.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	38.00	7,702,600.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	325.00	42,380,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	71.50	46,825,350.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.30	6,781,100.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.40	5,990,300.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	4.88	3,954,264.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.50	12,151,723.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	37.75	6,878,050.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.90	11,677,876.50	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	20.90	16,561,160.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	35.25	6,260,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	61.75	59,057,700.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	35.00	8,326,850.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	63.75	2,951,625.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	19.90	11,072,360.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	30.00	8,793,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	28.25	53,338,825.00	



	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	228.00	18,855,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	130.00	10,816,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.40	8,509,810.00	
	SCB X PCL-NVDR	185,600	107.50	19,952,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	50.50	5,125,750.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	38.50	3,457,300.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	47.75	3,643,325.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	99.00	49,104,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	211.00	43,001,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	71.75	8,742,737.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	6.15	12,396,050.70	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	35.25	11,315,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	135.50	9,647,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	58.00	12,754,200.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	57.75	3,938,550.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	44.50	17,929,050.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	36.50	12,995,825.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	62.25	23,555,400.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.35	7,281,200.00	
	タイパーツ 小計	20,974,790		732,550,550.70 (2,981,480,741)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	53.95	12,836,863.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	615.00	33,462,150.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	43.00	25,203,289.00	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	909.50	33,001,207.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	199.70	30,580,061.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	240.20	14,654,602.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	126.50	12,088,340.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	398,724	106.20	42,344,488.80	
	BDO UNIBANK INC	394,773	140.00	55,268,220.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	53.40	8,612,725.80	
	PLDT INC	10,460	1,342.00	14,037,320.00	
	ACEN CORP	821,840	5.18	4,257,131.20	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	326.00	17,336,680.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	24.40	31,253,960.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	2,074,750	33.00	68,466,750.00	

	フィリピンペソ 小計	6,420,372		403,403,788.30 (1,037,917,606)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,230.00	4,821,929,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,375.00	4,696,037,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	2,010.00	1,981,458,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	740.00	2,140,234,660.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	8,275.00	2,020,755,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,150.00	5,113,385,550.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,300.00	1,916,460,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,125.00	2,418,787,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,775.00	22,203,707,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	113.00	15,214,309,152.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,610.00	5,582,007,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,845,000	5,200.00	9,594,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,175.00	6,698,295,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,300.00	3,132,430,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,270.00	4,942,098,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	2,050.00	8,586,425,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,050.00	78,638,165,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,075.00	30,966,594,400.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	9,025.00	11,663,007,500.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,400.00	59,186,170,800.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,055.00	2,996,833,000.00		
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,475,800	3,950.00	33,479,410,000.00		
	インドネシアルピア 小計	195,443,308		317,992,499,062.00 (3,052,727,990)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	62,300.00	322,714,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	70,000.00	447,090,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	182,600.00	1,684,302,400.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	43,250.00	790,437,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	32,850.00	367,558,650.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	486,500.00	585,746,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	133,500.00	253,383,000.00	
	LG CHEM LTD	8,087	709,000.00	5,733,683,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	370,000.00	324,490,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	170,400.00	394,646,400.00	

POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	375,000.00	1,784,250,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	11,785	392,000.00	4,619,720,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	95,400.00	223,045,200.00	
SKC CO LTD	5,430	107,600.00	584,268,000.00	
CJ CORP	1,230	71,800.00	88,314,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	4,308	57,600.00	248,140,800.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	18,110.00	1,485,074,330.00	
ECOPRO BM CO LTD	8,232	263,000.00	2,165,016,000.00	
GS HOLDINGS CORP	6,593	36,950.00	243,611,350.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	134,400.00	783,014,400.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	128,100.00	270,931,500.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	9,667	115,900.00	1,120,405,300.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	38,400.00	375,091,200.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	82,100.00	236,694,300.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	54,500.00	731,172,000.00	
LG CORP	16,658	87,700.00	1,460,906,600.00	
LG ENERGY SOLUTION	5,668	563,000.00	3,191,084,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	13,780	37,450.00	516,061,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,910	104,000.00	1,238,640,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	28,000.00	518,448,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	6,620.00	630,018,780.00	
SK INC	6,394	158,200.00	1,011,530,800.00	
HMM CO LTD	35,545	18,570.00	660,070,650.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	186,000.00	519,498,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	44,008	23,650.00	1,040,789,200.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,110.00	151,950,960.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	33,500.00	236,711,000.00	
HANON SYSTEMS	19,000	9,110.00	173,090,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	217,000.00	2,202,116,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	22,724	199,900.00	4,542,527,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	109,800.00	663,411,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	109,100.00	376,285,900.00	
KIA CORP	43,979	83,400.00	3,667,848,600.00	
COWAY CO LTD	9,036	43,450.00	392,614,200.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	125,400.00	378,331,800.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	123,300.00	2,127,418,200.00	

KANGWON LAND INC	28,528	17,050.00	486,402,400.00	
HYBE CO LTD	2,474	301,000.00	744,674,000.00	
KAKAO CORP	52,020	49,700.00	2,585,394,000.00	
KAKAO GAMES CORP	3,021	34,750.00	104,979,750.00	
KRAFTON INC	5,809	201,500.00	1,170,513,500.00	
NAVER CORP	21,578	188,900.00	4,076,084,200.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	301,500.00	816,763,500.00	
NETMARBLE CORP	2,465	51,900.00	127,933,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	51,200.00	235,776,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	72,300.00	315,444,900.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	179,800.00	293,433,600.00	
EMART	3,594	78,400.00	281,769,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	273,500.00	502,966,500.00	
KT&G CORP	18,829	82,800.00	1,559,041,200.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	125,300.00	393,692,600.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	101,100.00	380,338,200.00	
LG H&H CO LTD	1,321	493,500.00	651,913,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	69,500.00	1,067,520,000.00	
HLB INC	22,765	31,100.00	707,991,500.00	
CELLTRION INC	17,544	163,900.00	2,875,461,600.00	
CELLTRION PHARM INC	2,066	81,000.00	167,346,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,179	314,000.00	370,206,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	747,000.00	1,998,225,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	84,500.00	270,146,500.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	77,800.00	163,380,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,195	57,900.00	763,990,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	39,950.00	2,047,397,550.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,180.00	288,399,400.00	
KAKAOBANK CORP	35,459	23,650.00	838,605,350.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	46,950.00	3,032,923,050.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	34,400.00	2,331,563,200.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	11,930.00	919,254,220.00	
KAKAOPAY CORP	3,065	47,100.00	144,361,500.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	50,400.00	231,940,800.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	42,050.00	713,798,750.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,120.00	220,826,800.00	

	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,490.00	114,895,430.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	35,600.00	567,713,200.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	74,900.00	754,542,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	223,000.00	922,997,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	63,900.00	775,170,900.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	121,500.00	885,006,000.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,780	209,000.00	790,020,000.00	
	L&F CO LTD	4,327	253,500.00	1,096,894,500.00	
	LG DISPLAY CO LTD	38,301	16,470.00	630,817,470.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	306,500.00	826,324,000.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	56,500.00	122,379,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	142,400.00	1,314,779,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	768,162	71,600.00	55,000,399,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	132,120	59,400.00	7,847,928,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	683,000.00	6,026,109,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	10,880.00	240,720,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	18,310.00	810,034,400.00	
	SK HYNIX INC	87,413	113,600.00	9,930,116,800.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	45,250.00	527,615,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,475,508		174,627,072,090.00 (19,174,052,515)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	223,240	87.50	19,533,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	44.20	20,074,579.20	
	CHINA STEEL	1,779,261	29.65	52,755,088.65	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	68.10	36,914,354.10	
	FORMOSA PLASTICS CORP	708,824	92.80	65,778,867.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	78.60	60,581,107.20	
	TAIWAN CEMENT	913,419	38.70	35,349,315.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	1,035.00	19,206,495.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	652,028	33.05	21,549,525.40	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,930.00	17,370,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	46.25	23,227,351.25	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	27.90	12,973,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	40.45	15,613,700.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	158.00	28,947,970.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	32.60	15,387,200.00	

WAN HAI LINES LIMITED	74,635	60.20	4,493,027.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	61.50	13,345,500.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	41.00	7,259,501.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	500.00	19,968,500.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	199.00	14,019,152.00	
GIANT MANUFACTURING	35,713	222.00	7,928,286.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	341.50	10,586,500.00	
POU CHEN	273,780	31.80	8,706,204.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	53,000	824.00	43,672,000.00	
MOMO.COM INC	6,000	682.00	4,092,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	284.50	25,190,768.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	77.40	60,092,973.00	
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	325.00	8,125,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	18.75	11,128,875.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	25.10	66,295,048.70	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,929,455	26.40	50,937,612.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,605,202	27.90	44,785,135.80	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	22.35	33,935,368.35	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,671,622	37.75	63,103,730.50	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,756,318	17.25	30,296,485.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,920,011	19.15	36,768,210.65	
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	14.20	11,076,000.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,442,787	28.20	40,686,593.40	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	45.70	31,532,314.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	264,375	201.50	53,271,562.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,814,633	24.35	44,186,313.55	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	44.40	67,978,930.80	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	12.70	32,718,070.20	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,270,906	61.40	78,033,628.40	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	9.01	17,406,112.66	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	358.00	25,060,000.00	
ACER INC	617,803	33.70	20,819,961.10	
ADVANTECH CO LTD	69,336	418.00	28,982,448.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	314.50	39,970,434.00	
AUO CORP	1,268,072	20.10	25,488,247.20	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	190.00	22,553,000.00	

CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	16.50	22,936,320.00	
COMPAL ELECTRONICS	805,760	29.35	23,649,056.00	
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	364.00	110,256,692.00	
E INK HOLDINGS INC	144,000	222.00	31,968,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	113.00	219,022,024.00	
INVENTEC CO LTD	280,511	44.75	12,552,867.25	
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,130.00	32,035,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	105.00	37,112,460.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	176.00	17,600,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	278.00	5,838,000.00	
PEGATRON CORP	340,474	77.00	26,216,498.00	
QUANTA COMPUTER INC	408,270	151.50	61,852,905.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	59.40	12,004,740.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	187.00	39,457,000.00	
WISTRON CORP	344,000	84.10	28,930,400.00	
WIWYNN CORP	16,000	1,215.00	19,440,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	260,692	54.80	14,285,921.60	
YAGEO CORPORATION	61,588	491.00	30,239,708.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	106.50	14,688,693.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	126.00	73,623,690.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	77.00	16,632,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	101.50	24,887,800.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	126.50	65,060,847.50	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,240.00	26,880,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,625.00	21,125,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	493.50	20,727,000.00	
MEDIATEK INC	241,804	693.00	167,570,172.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	74.60	19,321,400.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	450.00	43,220,250.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,155.00	9,240,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	31.95	18,403,200.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	391.00	24,220,104.00	
SILERGY CORP	53,000	377.00	19,981,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,955,389	581.00	2,298,081,009.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,899,000	53.90	102,356,100.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	88.20	16,581,600.00	

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	170.00	5,440,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	28.95	10,103,550.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	35.85	11,116,583.10	
	新台湾ドル 小計	55,145,981		5,304,413,837.56 (24,582,775,488)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	164,999	359.50	59,317,140.50	
	COAL INDIA LTD	295,619	225.90	66,780,332.10	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	269.45	16,012,066.25	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	89.33	53,333,225.88	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	156.85	84,661,042.30	
	PETRONET LNG LTD	83,779	218.90	18,339,223.10	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	485,097	2,515.25	1,220,140,229.25	
	ACC LTD	14,288	1,768.00	25,261,184.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	426.20	31,339,764.60	
	ASIAN PAINTS LTD	64,662	3,297.70	213,235,877.40	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	675.35	19,888,382.15	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,716.05	80,384,930.15	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	243,575	408.50	99,500,387.50	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	568.60	39,673,496.40	
	JSW STEEL LTD	99,332	746.15	74,116,571.80	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,810.15	48,758,489.55	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,656.75	77,470,830.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	25,144.85	34,875,906.95	
	SRF LTD	19,164	2,316.30	44,389,573.20	
	TATA STEEL LTD	1,137,948	109.60	124,719,100.80	
	ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	8,067.00	134,638,230.00	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	667.05	46,460,699.55	
	VEDANTA LTD	107,173	276.25	29,606,541.25	
	ABB LTD INDIA	5,256	4,238.40	22,277,030.40	
	ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	2,233.10	76,532,803.20	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	120.00	60,888,600.00	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	368.90	25,972,773.40	
	HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,284.00	45,795,144.00	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	10,646	3,640.20	38,753,569.20	
	LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,388.10	256,935,679.00	
	SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,677.60	40,545,540.00	



INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	627.60	14,430,406.80
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	714.45	74,718,609.90
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	642.55	16,998,660.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,473.60	65,429,193.60
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,619.20	44,547,564.80
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,399.00	21,185,569.00
BHARAT FORGE LTD	30,322	807.20	24,475,918.40
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,537.35	63,219,519.20
HERO MOTOCORP LTD	22,772	2,779.55	63,295,912.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,373.05	206,111,281.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,323.55	198,861,997.95
MRF LTD	432	99,506.10	42,986,635.20
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	82.95	43,236,443.25
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	506.85	30,050,629.65
TATA MOTORS LTD	277,381	559.25	155,125,324.25
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	3,161.65	66,875,220.80
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,301.70	53,700,331.80
PAGE INDUSTRIES LTD	886	37,699.80	33,402,022.80
TITAN CO LTD	56,531	2,939.15	166,153,088.65
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	380.40	62,574,658.80
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	478.95	21,040,273.50
ZOMATO LTD	842,242	74.11	62,418,554.62
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,307.30	61,835,598.80
TRENT LTD	37,950	1,724.45	65,442,877.50
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,744.45	107,061,314.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	20,292	4,971.00	100,871,532.00
ITC LTD	480,447	444.65	213,630,758.55
MARICO LTD	81,711	528.65	43,196,520.15
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	22,511.40	115,843,664.40
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	840.70	78,386,027.30
UNITED SPIRITS LTD	32,483	906.55	29,447,463.65
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	766.20	61,570,299.60
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,630.95	42,404,700.00
DABUR INDIA LTD	79,726	563.10	44,893,710.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,035.75	65,662,407.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,642.15	342,163,709.30

APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	19,568	5,041.35	98,649,136.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	578.90	69,578,569.90
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	699.00	24,755,085.00
CIPLA LTD	88,546	991.20	87,766,795.20
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,463.45	75,960,385.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	4,993.60	91,487,745.60
LUPIN LTD	26,552	858.00	22,781,616.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	991.85	143,972,978.60
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,864.50	22,784,190.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	737.50	22,223,825.00
AXIS BANK LTD	359,795	958.30	344,791,548.50
BANDHAN BANK LTD	74,811	235.90	17,647,914.90
BANK OF BARODA	248,313	192.20	47,725,758.60
ICICI BANK LTD	812,223	923.80	750,331,607.40
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,828.70	307,430,071.80
STATE BANK OF INDIA	268,868	554.70	149,141,079.60
YES BANK LTD	2,352,478	15.98	37,592,598.44
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	6,988.80	308,709,273.60
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,501.60	82,588,000.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	6,694	6,828.35	45,708,974.90
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,090.40	59,767,004.80
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	274,646	2,723.15	747,902,254.90
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,221.65	15,176,557.95
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	857.25	52,030,788.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,670.75	64,465,888.75
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	178,719	626.95	112,047,877.05
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,274.05	42,847,575.55
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	89,699	556.25	49,895,068.75
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,262.30	91,814,652.80
HCL TECHNOLOGIES LTD	161,045	1,165.25	187,657,686.25
INFOSYS LTD	533,921	1,265.65	675,757,113.65
LTIMINDTREE LTD	15,699	4,961.50	77,890,588.50
MPHASIS LTD	19,317	1,831.00	35,369,427.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,217.45	460,677,708.45
TATA ELXSI LTD	4,179	7,481.60	31,265,606.40
TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,115.45	105,741,313.65

	WIPRO LTD	249,294	379.95	94,719,255.30	
	BHARTI AIRTEL LTD	358,975	856.25	307,372,343.75	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	959.50	40,855,510.00	
	ADANI POWER LTD	85,623	242.40	20,755,015.20	
	GAIL INDIA LTD	504,548	105.05	53,002,767.40	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	476.35	12,729,977.40	
	NTPC LTD	664,141	186.55	123,895,503.55	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	600,735	250.00	150,183,750.00	
	TATA POWER CO LTD	199,512	218.20	43,533,518.40	
	DLF LTD	87,983	477.15	41,981,088.45	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,499.65	19,081,546.60	
	インドルピー 小計	18,216,222		12,583,897,309.04 (22,147,659,263)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.42	983,787.88	
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	469,730	4.15	1,949,849.23	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.88	834,579.00	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	10.80	3,055,525.20	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.80	3,082,067.80	
	DUKHAN BANK	319,751	3.84	1,228,483.34	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.48	2,834,890.48	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	9.50	2,038,063.50	
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	17.17	4,456,731.05	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	15.10	11,193,660.20	
	OOEDOO QSC	72,800	10.79	785,512.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.00	1,640,704.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.51	520,799.90	
	カタールリアル 小計	4,842,933		34,604,653.58 (1,364,461,490)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	162.40	5,556,840.80	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	199.45	2,925,931.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	885.73	8,849,328.43	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	425.66	28,707,787.38	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	268.94	38,781,148.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	80.64	8,052,791.04	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	129.75	19,572,398.25	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	464.63	2,495,992.36	

	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	131.86	6,338,378.34	
	SASOL LTD	88,115	231.34	20,384,524.10	
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	29.68	11,721,344.32	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	261.63	13,160,773.89	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	92.75	3,759,064.75	
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	138.30	3,942,933.00	
	NASPERS LTD-N SHS	33,040	2,994.19	98,928,037.60	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	15.59	7,414,261.02	
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	88.64	3,328,786.56	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	70.37	12,407,356.92	
	BID CORP LTD	58,066	415.51	24,127,003.66	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	263.27	9,325,549.94	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	225.60	19,226,534.40	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	183.51	10,309,958.82	
	ABSA GROUP LTD	140,135	161.37	22,613,584.95	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,505.96	21,987,016.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	224.19	14,148,855.09	
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	173.28	35,283,100.32	
	FIRSTRAND LTD	816,636	66.53	54,330,793.08	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	409.96	7,045,982.52	
	REMGRO LTD	74,679	142.71	10,657,440.09	
	DISCOVERY LIMITED	98,821	147.10	14,536,569.10	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	11.85	11,549,673.60	
	OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	33.43	2,411,406.19	
	SANLAM LTD	307,490	57.88	17,797,521.20	
	MTN GROUP LTD	255,377	135.98	34,726,164.46	
	VODACOM GROUP	129,637	115.87	15,021,039.19	
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	63,952	109.60	7,009,139.20	
	南アフリカランド 小計	5,366,466		628,435,010.07 (4,807,527,827)	
アラブ首長国連 邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.19	1,657,670.74	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	4.22	1,820,702.12	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.95	1,753,886.90	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.14	3,837,440.20	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.70	1,987,856.70	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.47	2,872,537.68	

	EMIRATES NBD PJSC	270,260	14.90	4,026,874.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	13.70	9,919,060.30	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	22.34	12,477,694.24	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.13	3,723,513.03	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.59	7,306,122.12	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	5,964,783		51,383,358.03 (2,011,144,633)	
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.62	200,499.32	
	BOUBAYAN BANK K. S. C	162,047	0.63	102,899.84	
	GULF BANK	144,000	0.26	37,584.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.74	958,098.92	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,205,064	0.93	1,126,734.84	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.51	152,867.45	
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.83	118,565.70	
	クウェートディナール 小計	3,566,133		2,697,250.07 (1,261,503,857)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	5.76	844,992.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	29.81	2,653,090.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	12.63	808,320.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.28	651,560.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.52	752,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	17.67	1,699,854.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	7.59	1,804,841.28	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	8.95	712,420.00	
	SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	16.09	159,291.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	24.67	690,760.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	28.27	585,189.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.45	895,435.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	24.01	706,854.40	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	5.53	2,043,335.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	34.63	724,805.90	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	31.70	653,020.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	14.46	1,333,212.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	23.56	490,048.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	58.60	603,580.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	62.16	696,192.00	

GEM CO LTD-A	289,800	6.85	1,985,130.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	40.60	1,007,935.60
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.26	529,046.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.65	980,875.00
HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.23	1,855,583.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	69.60	167,040.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	12.12	121,200.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.79	825,190.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.17	250,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.30	251,990.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	83.90	654,420.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	16.36	250,308.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	14.56	685,776.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	12.75	1,009,800.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.83	74,685.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	18.88	898,688.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.41	552,814.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	14.56	807,716.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	23.35	169,334.20
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	29.96	537,482.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	2.99	856,934.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	33.90	550,536.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	6.70	734,842.60
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.89	534,486.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	12.58	620,194.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	50.83	548,964.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	97.23	93,340.80
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	20.11	1,003,489.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	66.95	665,483.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	72.19	822,966.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	12.81	125,538.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	2.84	941,744.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	89.74	3,616,522.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	28.63	422,349.76
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	74.09	872,409.75
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	63.45	115,479.00

YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	90.33	370,353.00	
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	22.81	853,094.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	46.18	342,193.80	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	13.29	1,719,726.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	11.57	3,113,487.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	40.52	461,928.00	
AVICOPTER PLC-A	15,500	39.03	604,965.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	23.97	201,348.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	12.10	774,400.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	32.28	1,782,340.20	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.32	1,399,192.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.04	1,850,004.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.87	3,301,288.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	224.91	8,946,919.80	
CRRG CORP LTD-A	185,800	6.34	1,177,972.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	18.04	779,328.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	58.99	2,328,512.27	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.14	139,992.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	101.90	244,560.00	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	169.00	637,130.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	27.32	158,456.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	63.55	400,365.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	31.55	830,396.00	
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	5,320	72.13	383,731.60	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	65.80	753,804.80	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.80	649,380.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	14.96	719,576.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.88	1,283,892.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	16.87	610,694.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	22.79	1,913,904.20	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	145.40	863,676.00	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	47.86	599,877.24	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	50.65	591,338.75	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	17.59	710,636.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.71	931,872.00	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	199.88	550,069.76	

SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	16.58	694,702.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.54	2,209,618.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	63.27	1,796,425.11
SHUANGLIANG ECO-ENERGY SYS-A	170,800	13.42	2,292,136.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	9.55	239,323.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	113.15	1,131,500.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	15.80	643,060.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	145.08	594,247.68
TBEA CO LTD-A	22,519	22.20	499,921.80
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	12.17	525,744.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.49	1,294,106.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	10.70	215,187.70
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	27.00	853,200.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	53.02	437,945.20
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	87,700	30.94	2,713,438.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	8.52	768,504.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.62	530,262.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	45.77	503,470.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.43	218,337.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.26	2,088,746.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.74	189,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.66	1,956,110.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.36	1,181,280.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	47.77	2,536,587.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	47.29	251,535.51
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.17	229,548.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.43	803,751.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	9.58	209,227.20
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	82.30	888,840.00
BYD CO LTD -A	17,000	267.78	4,552,260.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	116.31	1,046,790.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	12.42	538,431.84
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	34.38	636,030.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	18.31	628,033.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	158.88	1,334,592.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	17.52	513,336.00



NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	78.69	55,083.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.09	600,234.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	22.07	866,335.78
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	75.00	210,000.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	36.16	1,572,960.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	24.96	692,889.60
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	37.47	297,212.04
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	89.32	687,764.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	23.42	2,367,762.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.81	427,482.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	49.30	394,400.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	47.14	1,235,068.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.42	350,506.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.55	420,174.00
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	33.25	814,625.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.73	467,928.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	7.10	989,740.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	522.69	1,515,801.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	119,600	20.51	2,452,996.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	37.49	611,087.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	18.66	425,448.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	7.75	476,625.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	122.15	2,530,948.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.83	754,715.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	27.98	623,702.18
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	37.71	535,331.16
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	36.78	393,546.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	257.58	412,128.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	53.00	116,600.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	61.88	1,132,404.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	157.72	473,160.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.56	390,320.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	96.25	760,375.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	5,980	18.27	109,254.60
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	49.65	2,683,930.05
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	18.76	514,024.00

GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	48.42	823,140.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	24.48	1,923,638.40
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	28.80	987,897.60
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	57.15	988,695.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	137.51	1,251,341.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	93.83	525,448.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	38.17	438,955.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	39.42	275,940.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,735.83	19,962,045.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	219.90	4,046,160.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	42.15	1,414,469.70
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.71	313,828.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	36.99	1,856,898.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	203.60	1,909,768.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	62.24	709,536.00
TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	10.27	1,515,852.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	17.33	661,312.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	171.40	7,113,100.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	40.23	406,323.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.19	80,507.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	24.01	713,097.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	19.57	1,795,527.93
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	31.44	503,040.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	73.70	209,160.60
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	42.19	410,086.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	24.12	297,882.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	14.90	154,960.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	23.01	340,548.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.74	167,421.60
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	29.60	213,386.40
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	15,500	299.10	4,636,050.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	97.82	195,640.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	125.40	35,112.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	83,180	26.63	2,215,083.40
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	54.27	1,541,268.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	66.60	698,434.20

BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	47.80	769,580.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	59.73	328,515.00	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	89.17	808,504.39	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	138.15	303,930.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	61.51	627,402.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	44.48	660,528.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	47.20	1,047,509.60	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	66.19	529,520.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	21.91	413,003.50	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	441.40	918,112.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	88,302	46.40	4,097,212.80	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	41.79	464,537.64	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	12.28	339,934.96	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	38.16	728,016.48	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.57	485,237.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	24.95	271,456.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	30.94	216,580.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	25.64	242,041.60	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	28.98	325,503.36	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	25.97	441,490.00	
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	63.30	1,042,171.20	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	52.35	520,359.00	
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	288.78	1,126,242.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.00	162,360.00	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	27.92	1,856,680.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	15.15	527,947.20	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	33.00	320,100.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.53	3,643,313.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.60	266,800.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	12.25	1,928,150.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.74	2,938,306.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	11.83	1,333,241.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.28	1,672,507.20	
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	7.98	1,177,050.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	25.44	1,483,152.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.09	277,095.00	

CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.22	776,878.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.04	2,539,312.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	33.17	6,169,620.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.92	1,072,512.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	2.74	845,564.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.38	642,372.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.85	2,806,210.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	15.77	3,240,735.00	
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.35	1,355,190.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.99	706,085.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.27	3,179,171.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.88	475,300.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.39	824,966.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.23	414,495.90	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.85	116,415.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.23	384,341.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.60	389,776.00	
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	19.85	2,800,438.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	23.65	569,965.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	14.30	1,679,206.10	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.08	57,888.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.68	341,936.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.71	891,426.00	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.43	1,103,895.97	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.71	1,960,621.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.61	1,056,303.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.53	992,886.50	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	198.00	1,069,200.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.77	433,755.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.10	697,047.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.78	396,833.28	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.54	940,688.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	7.05	2,168,580.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.64	414,960.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.86	430,882.00	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.82	2,146,936.00	

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	26.62	2,667,324.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	46.64	4,887,872.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	14.65	394,085.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	70,200	38.10	2,674,620.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	497.50	2,399,442.50
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	16.00	550,368.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	49.40	1,593,940.40
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	7.74	431,118.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	49.40	818,162.80
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	77.60	838,080.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	11.84	393,088.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	121.19	363,570.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	53.30	508,002.30
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	106.70	586,850.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	22.52	296,588.40
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	24.29	920,591.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	3.98	456,108.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	29.89	600,789.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	30.23	846,440.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.10	490,680.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	90.74	825,734.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	24.50	1,104,950.00
GOERTEK INC -A	26,900	17.94	482,586.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.66	333,000.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	73.32	513,240.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	61.48	1,211,893.76
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.72	196,896.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	30.40	1,412,080.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	96.90	167,443.20
NINESTAR CORP-A	18,543	35.15	651,786.45
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	14.59	354,537.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	77.53	369,042.80
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	148.26	954,053.10
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	26.58	757,530.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.18	431,460.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	36.77	674,361.80

WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	50.80	213,360.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	7.66	411,418.60	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	139.24	654,428.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	35.48	558,810.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	22.10	669,630.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	159.90	1,391,130.00	
ZTE CORP-A	76,400	42.82	3,271,448.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.83	2,042,124.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.78	1,178,364.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.28	1,274,064.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.10	3,975,348.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	18.65	1,036,940.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.82	1,205,974.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.43	2,198,867.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	14.85	1,370,655.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	158.00	1,121,326.00	
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	87.34	885,452.92	
ASR MICROELECTRONICS CO LT-A	33,053	76.63	2,532,851.39	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	230.98	2,638,253.56	
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	51.33	1,079,572.56	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	107.80	676,121.60	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	32.78	693,887.04	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	30.35	227,625.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	86.82	651,150.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	40.27	1,377,314.54	
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	33.55	999,790.00	
JINKO SOLAR CO LTD-A	184,413	13.35	2,461,913.55	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	27.99	2,808,516.60	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	58.08	1,222,874.40	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	294.90	914,190.00	
SG MICRO CORP-A	4,095	85.39	349,672.05	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	103.00	813,700.00	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	212.29	594,412.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	32.20	1,187,375.00	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.33	305,557.50	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	23.39	525,479.74	

	TONGWEI CO LTD-A	31,600	34.26	1,082,616.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	42.25	1,073,910.50	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	89.88	616,486.92	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	100.48	732,499.20	
	YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	40.83	579,786.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	66.42	1,130,601.24	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	12.89	705,083.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	13.94	748,578.00	
	GEMDALE CORP-A	45,500	7.29	331,695.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	4.15	2,169,620.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	13.12	1,073,216.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	13.81	176,768.00	
	オフショア人民元 小計	26,255,227		386,554,876.59 (7,689,774,815)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	11.50	516,798.50	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	32.25	13,424,836.50	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	44.10	519,277.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	14.92	476,365.76	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	129.60	4,848,724.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	36.85	1,740,830.85	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	42.20	8,897,616.80	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	137.00	1,280,813.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	88.20	12,694,978.80	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	26.50	2,261,059.50	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.82	1,429,416.42	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	47.45	2,423,698.55	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	188.80	794,281.60	
	JARIR MARKETING CO	125,000	16.54	2,067,500.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	170.00	1,093,270.00	
	ALMARAI CO	30,130	60.70	1,828,891.00	
	SAVOLA	65,641	41.65	2,733,947.65	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	167.80	1,146,577.40	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	286.20	3,353,405.40	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	242.00	1,926,804.00	
	AL RAJHI BANK	311,351	73.00	22,728,623.00	
	ALINMA BANK	161,322	33.50	5,404,287.00	

	ARAB NATIONAL BANK	86,031	26.35	2,266,916.85	
	BANK AL-JAZIRA	97,894	18.28	1,789,502.32	
	BANK ALBILAD	89,702	38.70	3,471,467.40	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	41.70	3,954,619.50	
	RIYAD BANK	234,479	33.65	7,890,218.35	
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	38.15	5,642,194.25	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	17.06	1,205,118.40	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	474,809	36.80	17,472,971.20	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	188.20	2,062,107.40	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	185.60	2,639,788.80	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	322.60	1,424,924.20	
	ELM CO	2,436	582.00	1,417,752.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	48,844	47.90	2,339,627.60	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	14.16	1,281,593.28	
	SAUDI TELECOM CO	301,319	43.50	13,107,376.50	
	ACWA POWER CO	16,922	166.80	2,822,589.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	22.54	3,653,936.86	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	15.34	1,549,201.94	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.36	432,310.32	
	サウジアラビアリアル 小計	4,019,322		170,016,220.80 (6,515,021,581)	
	合 計	1,317,711,245		154,212,098,791 (154,212,098,791)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	メキシコペソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	14,513,455.20		
		メキシコペソ 小計	97,360	14,513,455.20 (121,583,568)		
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,075,099.00		
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,409,589.00		
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,807,916.00		
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,270,000.00		
		ブラジルリアル 小計	383,600	11,562,604.00 (346,645,711)		
	投資信託受益証券合計			480,960	468,229,279	



				(468, 229, 279)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391, 700	9, 467, 389. 00
	メキシコペソ 小計		391, 700	9, 467, 389. 00 (79, 311, 157)
	香港ドル	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	19, 877	32, 399. 51
	香港ドル 小計		19, 877	32, 399. 51 (593, 559)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478, 733	5, 553, 302. 80
	南アフリカランド 小計		478, 733	5, 553, 302. 80 (42, 482, 766)
投資証券合計			890, 310	122, 387, 482 (122, 387, 482)
合計				590, 616, 761 (590, 616, 761)

(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 34 銘柄	100. 0%	—	—	2. 4%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	95. 3%	—	—	2. 7%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	2. 8%	—	0. 1%
	投資証券 1 銘柄	—	—	1. 8%	0. 1%
ブラジルリアル	株式 43 銘柄	96. 0%	—	—	5. 4%
	投資信託受 4 銘柄 益証券	—	4. 0%	—	0. 2%
チリペソ	株式 12 銘柄	100. 0%	—	—	0. 5%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100. 0%	—	—	0. 1%
ユーロ	株式 10 銘柄	100. 0%	—	—	0. 5%
トルコリラ	株式 18 銘柄	100. 0%	—	—	0. 6%
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. 2%
ポーランドズロチ	株式 14 銘柄	100. 0%	—	—	0. 8%
ロシアルーブル	株式 14 銘柄	100. 0%	—	—	0. 0%

香港ドル	株式	196 銘柄	100.0%	—	—	22.6%
	投資証券	1 銘柄	—	—	0.0%	0.0%
マレーシアリングgit	株式	33 銘柄	100.0%	—	—	1.3%
タイバーツ	株式	42 銘柄	100.0%	—	—	1.9%
フィリピンペソ	株式	15 銘柄	100.0%	—	—	0.7%
インドネシアルピア	株式	22 銘柄	100.0%	—	—	2.0%
韓国ウォン	株式	101 銘柄	100.0%	—	—	12.4%
新台幣ドル	株式	90 銘柄	100.0%	—	—	15.9%
インドルピー	株式	114 銘柄	100.0%	—	—	14.3%
カタールリアル	株式	13 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
南アフリカランド	株式	36 銘柄	99.1%	—	—	3.1%
	投資証券	1 銘柄	—	—	0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式	11 銘柄	100.0%	—	—	1.3%
クウェートディナール	株式	7 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オフショア人民元	株式	356 銘柄	100.0%	—	—	5.0%
サウジアラビアリアル	株式	41 銘柄	100.0%	—	—	4.2%

(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。

## マネープールマザーファンド

### 貸借対照表

	2023年6月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	222,939,335,808
流動資産合計	222,939,335,808
資産合計	222,939,335,808
負債の部	
流動負債	
未払解約金	223,760,760
未払利息	546,659
流動負債合計	224,307,419
負債合計	224,307,419

純資産の部	
元本等	
元本	222,527,923,604
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	187,104,785
元本等合計	222,715,028,389
純資産合計	222,715,028,389
負債純資産合計	222,939,335,808

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年6月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	222,527,923,604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 1.0008円 (1万口当たり純資産額) (10,008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

	2023年6月26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

	2023年6月26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	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	2023年6月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月28日
期首元本額	387,817,379,817円
期中追加設定元本額	100,836,642,774円
期中一部解約元本額	266,126,098,987円
期末元本額	222,527,923,604円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961円
GARSファンド	9,961円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (円コース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (ブラジル・リアルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (豪ドルコース)	988円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (米ドルコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (トルコ・リラコース)	9,960円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (年1回決算型) (メキシコ・ペソコース)	9,960円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円

外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (毎月決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,991円
米国REIT・リサーチ・オープン 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,991円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (毎月決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (年2回決算型)	9,990円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	11,680,434,693円
225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	284,256,594円
225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	24,564,941,201円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	690,795,563円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	12,287,411,494円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	11,335,004,900円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	17,893,684,018円
225ベアファンド9 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	302,563,067円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	4,044,833,778円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,906,615,833円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	22,126,405,859円
TOPIXベアファンドF (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	64,438,796,383円
TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	29,984,348,102円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,350,760,490円

専用)	
リスクプレミア α ファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872 円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	1,014,256,792 円

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(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

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。

## 【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、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9期中間計算期間(2023年6月27日から2023年12月26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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年3月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田信之  
業務執行社員

## 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」に掲げられている外国株式 SMTB セレクション (SMA 専用) の 2023 年 6 月 27 日から 2023 年 12 月 26 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、外国株式 SMTB セレクション (SMA 専用) の 2023 年 12 月 26 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 (2023 年 6 月 27 日から 2023 年 12 月 26 日まで) の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があ

ると判断される。

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

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



【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2023年6月26日現在)	第9期中間計算期間 (2023年12月26日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,495,533,974	3,576,396,666
投資信託受益証券	61,316,692,270	112,073,826,779
投資証券	15,780,131,156	28,346,632,364
親投資信託受益証券	74,967,957,036	46,379,535,727
未収入金	1,300,146,284	-
流動資産合計	154,860,460,720	190,376,391,536
資産合計	154,860,460,720	190,376,391,536
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,003,268,721	209,445,934
未払受託者報酬	37,684,290	44,866,889
未払委託者報酬	376,842,831	448,668,803
未払利息	3,667	1,608
その他未払費用	1,113,113	1,191,072
流動負債合計	1,418,912,622	704,174,306
負債合計	1,418,912,622	704,174,306
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	80,788,557,511	94,634,834,279
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	72,652,990,587	95,037,382,951
(分配準備積立金)	46,197,119,278	40,757,377,322
元本等合計	153,441,548,098	189,672,217,230
純資産合計	153,441,548,098	189,672,217,230
負債純資産合計	154,860,460,720	190,376,391,536

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期中間計算期間 自 2022年6月28日 至 2022年12月27日	第9期中間計算期間 自 2023年6月27日 至 2023年12月26日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,294	6,107
有価証券売買等損益	△2,034,944,828	9,875,214,408
営業収益合計	△2,034,939,534	9,875,220,515
<b>営業費用</b>		
支払利息	789,047	736,761
受託者報酬	34,751,860	44,866,889
委託者報酬	347,518,592	448,668,803
その他費用	1,091,917	1,191,186
営業費用合計	384,151,416	495,463,639
営業利益又は営業損失(△)	△2,419,090,950	9,379,756,876
経常利益又は経常損失(△)	△2,419,090,950	9,379,756,876
中間純利益又は中間純損失(△)	△2,419,090,950	9,379,756,876
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(△)	302,038,633	324,390,450
期首剰余金又は期首欠損金(△)	43,873,407,307	72,652,990,587
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,143,834,085	22,345,912,950
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,143,834,085	22,345,912,950
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,082,070,399	9,016,887,012
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,082,070,399	9,016,887,012
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	45,214,041,410	95,037,382,951

(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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第9期中間計算期間は2023年6月27日から2023年12月26日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2023年6月26日現在)	第9期中間計算期間 (2023年12月26日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,788,557,511 口	94,634,834,279 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) 1.8993円 (18,993円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0043円 (20,043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9期中間計算期間 (2023年12月26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	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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 8 期	第 9 期中間計算期間
	自 2022 年 6 月 28 日 至 2023 年 6 月 26 日	自 2023 年 6 月 27 日 至 2023 年 12 月 26 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	71,403,025,564 円	80,788,557,511 円
期中追加設定元本額	23,098,117,154 円	23,854,355,007 円
期中一部解約元本額	13,712,585,207 円	10,008,078,239 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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023 年 12 月 26 日現在
	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,928,887,969
コール・ローン	588,479,768
株式	607,813,815,801
投資信託受益証券	122,504,081
投資証券	12,558,143,211
派生商品評価勘定	212,931,395
未収入金	5,292,327
未収配当金	494,636,905
差入委託証拠金	5,037,665,660
流動資産合計	631,762,357,117
資産合計	631,762,357,117
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,099,957
前受金	208,090,498
未払解約金	639,826,514
未払利息	264
流動負債合計	853,017,233
負債合計	853,017,233
純資産の部	
元本等	

元本	115,902,940,078
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	515,006,399,806
元本等合計	630,909,339,884
純資産合計	630,909,339,884
負債純資産合計	631,762,357,117

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同</p>

4. 収益及び費用の計上基準	<p>規則第 61 条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> <p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 12 月 26 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		115,902,940,078 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	5.4434 円
	(1 万口当たり純資産額)	(54,434 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

		2023 年 12 月 26 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る場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(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	2023 年 12 月 26 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023 年 6 月 27 日
期首元本額	121,001,727,313 円

期中追加設定元本額	7,076,341,753 円
期中一部解約元本額	12,175,128,988 円
期末元本額	115,902,940,078 円
期末元本額の内訳	
SBI 資産設計オープン (資産成長型)	1,555,609,362 円
SBI 資産設計オープン (分配型)	6,007,740 円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,400,025,283 円
世界経済インデックスファンド	13,019,893,223 円
外国株式インデックス・オープン	881,338,999 円
DCマイセレクション25	636,089,976 円
DCマイセレクション50	3,461,197,234 円
DCマイセレクション75	4,316,351,933 円
DC外国株式インデックス・オープン	12,750,155,435 円
DCマイセレクションS25	402,254,620 円
DCマイセレクションS50	1,903,943,445 円
DCマイセレクションS75	1,918,180,591 円
DCターゲット・イヤーフンド2025	20,624,564 円
DCターゲット・イヤーフンド2035	140,437,127 円
DCターゲット・イヤーフンド2045	109,994,581 円
DC世界経済インデックスファンド	9,513,236,711 円
外国株式インデックス・オープン (SMA専用)	975,380,753 円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	1,991,576 円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	3,142,957 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)	21,877,636 円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	6,810,007 円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	31,698,226 円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	7,257,873 円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	19,430,905 円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	155,991,181 円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	130,168,252 円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	980,280,823 円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	67,523,430 円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	16,505,978 円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	112,579,784 円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	36,645,152 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	784,470,399 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)	833,704,557 円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,180,032,746 円
コア投資戦略ファンド (安定型)	127,534,818 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	303,204,716 円
分散投資コア戦略ファンドA	1,570,591,910 円
分散投資コア戦略ファンドS	7,247,527,069 円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,486,882,910 円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	1,019,719,337 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	138,394,657 円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	472,165,577 円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	24,413,558 円
SMT インデックスバランス・オープン	117,962,133 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	77,417,800 円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	5,144,256,001 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,203,719 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,031,033,323 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	181,817,841 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,496,166 円
My SMT グローバル株式インデックス (ノーロード)	1,343,640,282 円
グローバル経済コア	537,560,747 円

SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,180,045 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,884,399 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	124,430,320 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	31,671,774 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	144,093,721 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	137,293,249 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	60,810,615 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	72,009,399 円
10資産分散投資ファンド	51,218,285 円
グローバル10資産バランスファンド	2,257,480 円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271 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）	54,895,892 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）	202,299,292 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）	624,609,557 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,438,412,419 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	98,702,742 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）	69,905,701 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	84,302,947 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）	82,469,363 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	186,731,857 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	180,617,821 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	179,700,011 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	181,779,484 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	179,977,573 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）	91,791,755 円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	116,188,483 円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年12月26日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,115,872,612	—	10,323,963,110	208,090,498
		合計	—	10,323,963,110	208,090,498

（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

（2023年12月26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	163,221,535	—	163,480,595	△259,060



	カナダドル	37,545,200	—	37,546,985	△1,785
	ユーロ	62,527,760	—	62,688,400	△160,640
	イギリスポンド	63,148,575	—	63,245,210	△96,635
	合計	163,221,535	—	163,480,595	△259,060

(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ではありません。

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

	2023年12月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	344,825,812
コール・ローン	3,178,754
株式	13,479,657,284
投資信託受益証券	6,316,060
投資証券	298,584,905
派生商品評価勘定	9,356,030
未収配当金	9,462,018
差入委託証拠金	143,910,281
流動資産合計	14,295,291,144
資産合計	14,295,291,144
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	449,844
前受金	8,906,186
未払解約金	12,398
未払利息	1
流動負債合計	9,368,429
負債合計	9,368,429
純資産の部	
元本等	
元本	9,944,568,188
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	4,341,354,527
元本等合計	14,285,922,715
純資産合計	14,285,922,715

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年12月26日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		9,944,568,188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)	1.4366円 (14,366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

	2023年12月26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ぬ。
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つた場合、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	2023年12月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	9,095,211,203円
期中追加設定元本額	1,615,393,702円
期中一部解約元本額	766,036,717円
期末元本額	9,944,568,188円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	161,342,006円
コア投資戦略ファンド(成長型)	383,688,908円
コア投資戦略ファンド(切替型)	174,406,729円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	97,504,297円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	6,495,896,500円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	162,607,345円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	40,092,169円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,357,812,924円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年12月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	474,237,045	—	483,143,231	8,906,186
合計		474,237,045	—	483,143,231	8,906,186

(注)1. 時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年12月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,199,015,376
コール・ローン	65,897,665
株式	157,451,634,049
投資信託受益証券	510,969,613
投資証券	180,422,569
派生商品評価勘定	91,947,765
未収配当金	265,566,185
差入委託証拠金	1,309,477,406
流動資産合計	163,074,930,628
資産合計	163,074,930,628
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,809
前受金	91,808,253
未払解約金	101,521,452
未払利息	29
流動負債合計	193,468,543
負債合計	193,468,543
純資産の部	

元本等	
元本	42,294,900,136
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	120,586,561,949
元本等合計	162,881,462,085
純資産合計	162,881,462,085
負債純資産合計	163,074,930,628

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月26日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該</p>

	<p>収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
--	--

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,294,900,136 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 3.8511 円 (1万口当たり純資産額) (38,511 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

	2023年12月26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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	42,085,141,962 円
期中追加設定元本額	3,388,944,996 円
期中一部解約元本額	3,179,186,822 円
期末元本額	42,294,900,136 円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,626,031,334 円

世界経済インデックスファンド	10,128,615,038 円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,090,016,757 円
DC世界経済インデックスファンド	7,335,518,017 円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	90,993,839 円
コア投資戦略ファンド (安定型)	60,817,634 円
コア投資戦略ファンド (成長型)	142,991,154 円
分散投資コア戦略ファンドA	310,316,270 円
分散投資コア戦略ファンドS	1,419,462,050 円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,178,717,564 円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	787,590,282 円
コア投資戦略ファンド (切替型)	64,979,797 円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	376,671,105 円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,572,581 円
SMT インデックスバランス・オープン	90,534,979 円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	35,711,445 円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	2,348,751,719 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	245,034,946 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,030,347,169 円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	175,643,311 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,775,781 円
グローバル経済コア	419,831,168 円
My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	255,376,632 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	57,500,179 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	14,175,859 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	96,806,359 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	92,255,912 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	40,882,025 円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	48,451,553 円
10資産分散投資ファンド	13,085,826 円
グローバル10資産バランスファンド	3,085,177 円
DC世界経済インデックスファンド (株式特化型)	43,544 円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,474,209,042 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	95,415,290 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	81,608,702 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	12,369,002 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)	25,711,094 円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年12月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,599,994,570	—	4,691,802,823	91,808,253
合計		4,599,994,570	—	4,691,802,823	91,808,253

(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

(2023年12月26日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	20,490,275	—	20,501,743	11,468
	アメリカドル	20,490,275	—	20,501,743	11,468
	売建	64,587,495	—	64,598,260	△10,765
	アメリカドル	64,002,420	—	64,010,745	△8,325
	ブラジルレアル	585,075	—	587,515	△2,440
合計		85,077,770	—	85,100,003	703

(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ではありません。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2023年12月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	217,472,148,945
流動資産合計	217,472,148,945
資産合計	217,472,148,945
負債の部	
流動負債	
未払解約金	957
未払利息	97,832
その他未払費用	15
流動負債合計	98,804
負債合計	98,804
純資産の部	
元本等	
元本	217,341,591,463
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	130,458,678
元本等合計	217,472,050,141



純資産合計	217,472,050,141
負債純資産合計	217,472,148,945

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

		2023年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		217,341,591,463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)	1.0006円 (10,006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

		2023年12月26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	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	2023年12月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	222,527,923,604円
期中追加設定元本額	139,258,476,851円
期中一部解約元本額	144,444,808,992円
期末元本額	217,341,591,463円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(円コース)	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	812,319円
オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(アジア通貨コース)	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド(米ドルコース)	1,005,802円

債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）	105,486円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（トルコ・リラコース）	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（メキシコ・ペソコース）	9,963円
国内債券SMTBセレクション（SMA専用）	1,992,033円
バンクローン・オープン（円コース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（豪ドルコース）（SMA専用）	9,961円
バンクローン・オープン（米ドルコース）（SMA専用）	9,961円
債券総合型ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	9,961円
債券総合型ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	9,961円
MLP関連証券ファンド（為替ヘッジあり）	49,791円
MLP関連証券ファンド（為替ヘッジなし）	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド（SMA専用）	9,957円
バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）	19,911円
バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）	696,865円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	9,952円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	9,951円
Sumi TRUST マルチストラテジー／SMARS（SMA専用）	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（年2回決算型）	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（年2回決算型）	1,990円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（毎月決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジあり）（年2回決算型）	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド（為替ヘッジなし）（年2回決算型）	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（毎月決算型）	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（毎月決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）	9,970円
国内株式絶対収益追求型ファンド	9,972円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド（SMA専用）	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（資産成長型）	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,983円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド（資産成長型）	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド（予想分配金提示型）	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド（毎月決算型）	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド（年2回決算型）	9,990円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり（奇数月決算型）	9,994円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし（奇数月決算型）	9,994円
オーストラリア公社債ファンド（奇数月決算型）	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり（奇数月決算型）	9,995円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし（奇数月決算型）	9,995円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド（適格機関投資家専用）	11,680,434,693円

225ベアファンド6 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	298,332,775 円
225ベアファンド7 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,790,923,699 円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	3,602,226,083 円
TOPIXベアファンド2 (建玉比率非調整型) (適格機関投資家専用)	1,564,762,066 円
TOPIXベアファンドR (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	1,331,385,495 円
225ベアファンド8 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	4,111,843,915 円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	7,042,915,026 円
225ベアファンド10 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	2,196,843,214 円
TOPIXベアファンドR2 (建玉比率非調整型/リセット型) (適格機関投資家専用)	22,126,405,859 円
TOPIXベアファンドF2 (建玉数量固定型/リセットあり) (適格機関投資家専用)	29,984,348,102 円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,350,760,490 円
リスクプレミア α ファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872 円
TOPIXベアファンドF4 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	19,193,884,540 円
TOPIXベアファンドF5 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	15,283,093,910 円
TOPIXベアファンドF6 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	14,207,510,680 円
TOPIXベアファンドF7 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,569,885,014 円
TOPIXベアファンドF8 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	14,267,456,713 円
TOPIXベアファンドF9 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	20,952,134,762 円
TOPIXベアファンドF10 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	19,600,709,531 円
TOPIXベアファンドF11 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,790 円
TOPIXベアファンドF12 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821 円
TOPIXベアファンドF13 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821 円
TOPIXベアファンドF14 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821 円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	163,955,636 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。

## 2 【ファンドの現況】

### 【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

#### 【純資産額計算書】

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	197,090,242,912円
II 負債総額	667,487,658円
III 純資産総額（I－II）	196,422,755,254円
IV 発行済口数	92,285,056,082口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.1284円
（1万口当たり純資産額）	（21,284円）

(参考)

### 外国株式インデックス マザーファンド

#### 純資産額計算書

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	668,779,394,058円
II 負債総額	685,512,268円
III 純資産総額（I－II）	668,093,881,790円
IV 発行済口数	115,237,422,864口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	5.7975円
（1万口当たり純資産額）	（57,975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

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	15,238,834,478円
II 負債総額	14,182,982円
III 純資産総額（I－II）	15,224,651,496円
IV 発行済口数	9,868,962,728口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5427円
（1万口当たり純資産額）	（15,427円）

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	170,283,903,931円
II 負債総額	187,244,823円
III 純資産総額 (I - II)	170,096,659,108円
IV 発行済口数	43,160,073,013口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.9411円
(1万口当たり純資産額)	(39,411円)

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(2024年1月31日現在)

I 資産総額	207,603,816,608円
II 負債総額	78,667円
III 純資産総額 (I - II)	207,603,737,941円
IV 発行済口数	207,484,895,321口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0006円
(1万口当たり純資産額)	(10,006円)

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1) 名義書換等

該当事項はありません。

##### (2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

##### (3) 譲渡制限

該当事項はありません。

##### (4) 振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

###### ① 受益証券の不発行

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

###### ② 受益権の譲渡

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

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

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

###### ③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

###### ④ 受益権の再分割

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

###### ⑤ 償還金

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

###### ⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額（2024年1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### (2)委託会社の機構

###### ①会社の意思決定機構

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

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

また、監査等委員以外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發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

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

す。

#### [DO (実行)]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [CHECK (検証・評価)]

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

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

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

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

委託会社の機構は 2024 年 3 月 26 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2024 年 1 月 31 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	540	14,616,414
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	219,430
単位型公社債投資信託	51	176,359
合計	654	15,012,203



### 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、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 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 37 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 38 期事業年度の中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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。

# 独立監査人の監査報告書

2023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 藤 澤 孝

## 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2022年4月1日から2023年3月31日までの第37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2023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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 289	※1 255
器具備品	※1 687	※1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
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	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	—	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	—
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	—	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	—
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	—
特別損失合計	120	—
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	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	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219



当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

## 注記事項

(重要な会計方針)

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

### 7. 収益及び費用の計上基準

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

#### (1) 投資信託委託業務

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

#### (2) 投資一任業務

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

#### (3) 投資助言業務

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

#### (4) 成功報酬

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

### 8. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「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、「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過措置に代って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	146 百万円	184 百万円
器具備品	535 "	681 "
計	681 "	866 "

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,641	利益剰余金	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	—	—	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23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
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

##### ①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

##### ②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用してしております。

##### ③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

### 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1) \*2、\*3及び(注2)参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債  
前事業年度 (2022年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1、*2)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	—	196	—	196
資産計	—	196	—	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	—	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(71)	—	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	—	(1,485)

(\*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、投資信託 (貸借対照表計上額 6,474 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 133 百万円) は上記に含めておりません。

(\*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託 (貸借対照表計上額 13,876 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 840 百万円) は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,913 百万円であります。

(\*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 (2023年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	—	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	3,844	—	3,844
資産計	1,029	16,547	—	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	—	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	—	(88)	—	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	—	(147)

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額は 960 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 14,693 百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 218 百万円) は上記に含めておりません。

(\*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(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、未払金は、短期間 (1 年以内) で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル 1 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル 1 の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(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 (2022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	21,675	—	—	—
未収委託者報酬	9,067	—	—	—
未収運用受託報酬	6,252	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	108	1,712	0

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	—	—	—
未収委託者報酬	9,147	—	—	—
未収運用受託報酬	5,815	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	594	2,144	38

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度 (2022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	4,888	3,403	1,485
小計	4,888	3,403	1,485
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,585	1,711	△126
小計	1,585	1,711	△126
合計	6,474	5,115	1,358

当事業年度 (2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022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	7	0	0

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16



## (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 (2022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)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	—	△54	△54
	英ポンド	277	—	△1	△1
	カナダドル	111	—	△1	△1
	スイスフラン	139	—	△2	△2
	香港ドル	190	—	△1	△1
	ユーロ	676	—	△18	△18
	買建 ユーロ	21	—	0	0
	合計	6,915	—	△80	△80

(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 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	—	△21	△21
	英ポンド	256	—	△6	△6
	カナダドル	109	—	△1	△1
	スイスフラン	163	—	△2	△2
	香港ドル	202	—	△0	△0
	ユーロ	651	—	△19	△19
	買建 米ドル	152	—	3	3
	合計	7,458	—	△48	△48

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## (2) 株式関連

前事業年度 (2022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	17,197	—	△1,333	△1,333
合計		17,197	—	△1,333	△1,333

(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 (2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	—	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	—	△0	△0
合計		12,378	—	△10	△10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

## 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 (2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	—	△43
	英ポンド		3,297	—	△21
	スイスフラン		79	—	△1
	香港ドル		119	—	△1
	ユーロ		125	—	△3
	人民元		13	—	△0
合計			8,057	—	△71

当事業年度 (2023年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△6
	英ポンド		3,228	—	△81
	スイスフラン		20	—	△0
	香港ドル		83	—	△0
	ユーロ	21	—	△0	
合計			5,082	—	△88

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	—	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
退職給付債務の期末残高	820	911

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	—	△6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	—
その他	18	—
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 100 百万円、当事業年度 109 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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	〃	187	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	〃	277	〃
税務上の収益認識差額	74	〃	—	〃
税務上の費用認識差額	439		412	
繰延ヘッジ損益	224	〃	225	〃
その他	76	〃	75	〃
繰延税金資産 合計	1,357	〃	1,236	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△415	〃	△21	〃
その他	△34	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△450	〃	△54	〃
繰延税金資産の純額	907	〃	1,181	〃

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、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 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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	10,395 百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395 百万円

(\*) 当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887 百万円

[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 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(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 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

(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（2022 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（2023 年 3 月 31 日）

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

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
1 株当たり純資産額	21,406,512 円 22 銭	22,044,962 円 63 銭
1 株当たり当期純利益金額	2,162,405 円 20 銭	1,816,227 円 49 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 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
当期純利益	6,487 百万円	5,448 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	6,487 百万円	5,448 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株	3,000 株

## 独立監査人の中間監査報告書

2023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 田中洋一

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023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、継続企業的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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。



## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 38 期中間会計期間末

(2023 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601
固定資産		
有形固定資産	※1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502
投資その他の資産		
投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213
固定資産合計		19,443
資産合計		77,045
負債の部		
流動負債		
未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	※2	1,624
流動負債合計		11,124
固定負債		
退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35
固定負債合計		1,121
負債合計		12,246

(単位：百万円)

## 第 38 期中間会計期間末

(2023 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		43,700
利益剰余金合計		46,300
株主資本合計		65,540
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		164
繰延ヘッジ損益		△906
評価・換算差額等合計		△741
純資産合計		64,798
負債・純資産合計		77,045

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

## 第 38 期中間会計期間

(自 2023 年 4 月 1 日

至 2023 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		21,671
運用受託報酬		5,502
その他営業収益		178
営業収益合計		27,352
営業費用		16,664
一般管理費	※1	6,965
営業利益		3,722
営業外収益	※2	1,680
営業外費用	※3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第 38 期中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
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	—	—	△1,055	△1,055	△1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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
当中間期変動額				
剰余金の配当				△3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	114	△395	△280	△280
当中間期変動額合計	114	△395	△280	△1,335
当中間期末残高	164	△906	△741	64,798

## 注記事項

(重要な会計方針)

第 38 期中間会計期間  
(自 2023 年 4 月 1 日  
至 2023 年 9 月 30 日)

### 1. 資産の評価基準及び評価方法

#### (1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

#### (2) デリバティブ

時価法によっております。

#### (3) 金銭の信託

時価法によっております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 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しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(表示方法の変更)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第 38 期中間会計期間末 (2023 年 9 月 30 日)
※1 有形固定資産の減価償却累計額 957 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 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
※1 減価償却実施額	
有形固定資産	91 百万円
無形固定資産	972 百万円
※2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589 百万円
※3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269 百万円
為替差損	784 百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 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
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38期中間会計期間末（2023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、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1) \*2、\*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

## (1) 時価をもって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)	1,206	13,995	—	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	4,137	—	4,137
資産計	1,206	18,133	—	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	—	339
通貨関連取引	—	(134)	—	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	—	205

(\*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 (中間貸借対照表計上額 1,041 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中間貸借対照表計上額は 16,243 百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等 (中間貸借対照表計上額 271 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。

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	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末(2023年9月30日)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	△343
小計	1,426	1,769	△343
合計	4,137	3,900	237

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額0百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額271百万円)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38期中間会計期間(自2023年4月1日至2023年9月30日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)	
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	—	△76	△76
	英ポンド	267	—	△1	△1
	カナダドル	126	—	△1	△1
	スイスフラン	176	—	△0	△0
	香港ドル	214	—	△2	△2
	ユーロ	719	—	△3	△3
合計	7,449	—	△84	△84	

(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	9,373	—	226	226
店頭				
トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	—	113	113
合計	13,239	—	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連



ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	—	△24
	英ポンド		3,612	—	△23
	スイスフラン		22	—	△0
	香港ドル		90	—	△1
	ユーロ	51	—	△0	
合計			5,713	—	△49

(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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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	5,057 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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
1株当たり純資産額	21,599,648 円 64 銭
1株当たり中間純利益	770,782 円 86 銭
なお、潜在株式調整後 1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第 38 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
中間純利益	2,312 百万円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る中間純利益	2,312 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) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取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因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因るため、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

2024年3月26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。

追加型証券投資信託  
外国株式 SMTB セレクション (SMA 専用)  
投資信託約款

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

投資信託約款第 19 条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」といいます。）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こともあります。

#### (2) 投資態度

①主として、世界の株式<sup>※1</sup>及び株式代替資産<sup>※2</sup>を実質的な投資対象とする投資信託証券に投資します。

※1 世界の株式には、わが国の株式を含むことがあります。

※2 この投資信託において、株式代替資産とは、委託者が株式と一定程度の類似性があると判断する資産等を指します。

②各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。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変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

③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ることや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。

④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。

⑤この投資信託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。

⑥資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

#### (3) 運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②株式への直接投資は行いません。

③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

④デリバティブの直接利用は行いません。

⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3. 収益分配方針

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。

追加型証券投資信託  
外国株式 SMTB セレクション (SMA 専用)  
投資信託約款

**(信託の種類、委託者及び受託者)**

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法（平成 18 年法律第 108 号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第 2 条 受託者は、信託法第 28 条第 1 号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第 18 条第 1 項、第 18 条第 2 項及び第 23 条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

**(信託の目的及び金額)**

第 3 条 委託者は、金 50 万円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

**(信託金の限度額)**

第 4 条 委託者は、受託者と合意のうえ、金 5,000 億円を限度として信託金を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第 5 条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 41 条第 1 項、第 41 条第 2 項、第 42 条第 1 項、第 43 条第 1 項及び第 45 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第 6 条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

**(当初の受益者)**

第 7 条 この投資信託契約締結当初及び追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 8 条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**(受益権の分割及び再分割)**

第 8 条 委託者は、第 3 条による受益権については 50 万口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 9 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受託者と協議のうえ、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。

**(追加信託の価額及び口数、基準価額の計算方法)**

第 9 条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（第 20 条に規定する借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資

産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③投資信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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ます。

④第 22 条に規定する為替予約の評価は、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るものとします。

#### （信託日時異なる受益権の内容）

第 10 条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### （受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 11 条 この信託の全ての受益権は、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ることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

②委託者は、この信託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。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 8 条の規定により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、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、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。

#### （受益権の設定に係る受託者の通知）

第 12 条 受託者は、この投資信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

#### （受益権の申込単位及び価額）

第 13 条 販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 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委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第 8 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、販売会社と別に定める分配金再投資に関する契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1 円以上 1 円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②前項の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この信託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（第 4 項又は第 5 項



の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。)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。

- ③第1項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づき収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨーク、ロンドンもしくはアイルランドの銀行休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。
- ④第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。ただし、この投資信託契約締結日前の取得申込みに係る当該価額は、1口につき1円とします。
- ⑤前項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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価額は、原則として、第31条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所等(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### (受益権の譲渡に係る記載又は記録)

第14条 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。

- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。)に社振法の規定にしたがい、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。
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### (受益権の譲渡の対抗要件)

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託者及び受託者に対抗することができません。

#### (投資の対象とする資産の種類)

第16条 この信託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。

- 1. 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。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. 金銭債権
  - ハ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

#### (運用の指図範囲等)

第17条 委託者は、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ます。

②委託者は、信託金を、前項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

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項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。

#### （利害関係人等との取引等）

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託者の利害関係人、第23条第1項に定める信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第20条、第22条及び第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者又は受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役及び委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項及び同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第20条、第22条及び第26条から第28条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

④前3項の場合、委託者及び受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

#### （運用の基本方針）

第19条 委託者は、投資信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行

います。

#### (公社債の借入れの指図、目的及び範囲)

第 20 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②前項の借入れの指図は、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。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

④第 1 項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。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 21 条 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。

#### (外国為替予約取引の指図、目的及び範囲)

第 22 条 委託者は、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取引の指図をすることができます。

#### (信託業務の委託等)

第 23 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前各項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者及び委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 投資信託財産の保存に係る業務
2. 投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により投資信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### (混蔵寄託)

第 24 条 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。以下本条において同じ。）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)

第 25 条 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、受託者が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者又は受託者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、受託者が認める場合は、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。

#### (一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図)

第 26 条 委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号に規定する投資信託又は外国投資信託の受益証券（振替受益権を含みます。）及び金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号に規定する投資証券又は外国投資証券（振替投資口を含みます。）をいいます。）に係る投資信託契約の一部解約の請求及び投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### (再投資の指図)

第 27 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金及び売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

#### (資金の借入れ)

第 28 条 委託者は、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。

②一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。

③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。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第 29 条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第 30 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替えがある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

②投資信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

③前 2 項の立替金の決済及び利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第 31 条 この信託の計算期間は、毎年 6 月 26 日から翌年 6 月 25 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は、平成 27 年 7 月 24 日から平成 28 年 6 月 27 日までとします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により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、第 5 条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告等)

第 32 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

③受託者は、前 2 項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第 37 条第 3 項に定める報告は行わないこととします。

④受益者は、受託者に対し、信託法第 37 条第 2 項に定める書類又は電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報及び当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第 38 条第 1 項に定める閲覧又は謄写の請求をすることはできないものとします。

#### (信託事務の諸費用)

第 33 条 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者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

②投資信託財産の監査費用及び当該監査費用に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬等の総額及び支弁の方法)

第 34 条 委託者及び受託者の信託報酬の総額は、第 31 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 55 の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、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投資信託財産中から支弁するものとし、委託者及び受託者間の配分は別に定めます。

③第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

#### (収益の分配方式)

第 35 条 投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当

該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い)

第 36 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末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計算期間の末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。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者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、毎計算期間終了日の翌営業日に、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、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、第 11 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載又は記録されます。

③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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。

④一部解約金（第 39 条第 4 項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第 39 条第 1 項の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 営業日目から当該受益者に支払います。

⑤第 1 項、第 3 項及び第 4 項に規定する収益分配金、償還金及び一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとし、

⑥収益分配金、償還金及び一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

#### (収益分配金、償還金及び一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第 37 条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金及び一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (収益分配金及び償還金の時効)

第 38 条 受益者が、収益分配金については第 36 条第 1 項に規定する支払開始日から 5 年間その支払いを請求しないとき、並びに信託終了による償還金については第 36 条第 3 項に規定する支払開始日から 10 年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属しま

す。

#### (投資信託契約の一部解約)

第 39 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ②受益者が前項の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。
- ③委託者は、第 1 項の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。なお、第 1 項の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者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、社振法の規定にしたが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。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌々営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨーク、ロンドンもしくはアイルランドの銀行休業日においては、第 1 項による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による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。
- ⑦前項により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、第 4 項の規定に準じて計算された価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取扱い)

第 40 条 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、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第 41 条 委託者は、信託期間中において、この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とき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）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投資信託契約の解約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發します。
- ④前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。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、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

⑤第3項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以上にあたる多数をもって行います。

⑥第3項から前項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約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、第3項から前項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。

#### (投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第42条 委託者は、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、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款の変更をしようとするときは、第46条の規定にしたがいます。

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第43条 委託者が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、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第46条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い)

第44条 委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### (受託者の辞任及び解任に伴う取扱い)

第45条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者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、委託者又は受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、又は裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### (投資信託約款の変更等)

第46条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又はこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその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、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）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の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議



の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- ③前項の書面決議において、受益者（委託者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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④第2項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。
- ⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等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。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託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。

#### （信託期間の延長）

#### 第47条 （削除）

#### （他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第48条 この信託の受益者は、委託者又は受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

#### （運用報告書に記載すべき事項の提供）

第49条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

- ②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

#### （公告）

第50条 委託者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。

#### （投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第51条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

#### （付則）

第1条 第36条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成 27 年 7 月 24 日

委託者 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

#### 1. 別に定める投資信託証券

投資信託約款第 17 条第 1 項及び別に定める運用の基本方針の「別に定める投資信託証券」とは、次の投資信託の受益証券又は投資証券（振替受益権又は振替投資口を含みます。）をいいます。

親投資信託 外国株式インデックス マザーファンド

親投資信託 外国株式 ESG リーダーズインデックスマザーファンド

親投資信託 新興国株式インデックス マザーファンド

追加型証券投資信託 グローバル株式コンセントレイト・ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 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）

追加型証券投資信託 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）

追加型証券投資信託 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

外国籍円建投資信託証券 Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

親投資信託 マネープールマザーファンド