

世界経済インデックスファンド（債券シフト型）  
追加型投信／内外／資産複合

投資信託説明書  
（請求目論見書）  
2024年4月23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。

世界経済インデックスファンド（債券シフト型）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4月22日に関東財務局長に提出しており、2024年4月23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】	2
(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】	15
3【投資リスク】	27
4【手数料等及び税金】	30
5【運用状況】	34
第2【管理及び運営】	58
1【申込(販売)手続等】	58
2【換金(解約)手続等】	59
3【資産管理等の概要】	61
4【受益者の権利等】	65
第3【ファンドの経理状況】	66
1【財務諸表】	69
2【ファンドの現況】	304
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	307
第三部【委託会社等の情報】	308
第1【委託会社等の概況】	308
1【委託会社等の概況】	308
2【事業の内容及び営業の概況】	309
3【委託会社等の経理状況】	310
4【利害関係人との取引制限】	344
5【その他】	344
約款	

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

世界経済インデックスファンド（債券シフト型）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

### (5)【申込手数料】

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

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

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

(6) 【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2024年4月23日から2024年10月22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せん。

(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、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場およ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、およ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。

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

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



###### DR(預託証券)とは

ある国の企業の株式を海外でも流通させるために、その会社の株式を銀行等に預託し、その代替として海外で発行する証券のことで、株式と同様に取引所等で取引されます。

###### <信託金限度額>

上限 5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	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	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	ファンド	( )		
大型株	年2回				TOPIX	
中小型株	年4回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 ( )	条件付運用型
債券						
一般	年6回	北米				ロング・ショート型/絶対収益追求型
公債	(隔月)	欧州				
社債	年12回	アジア				
その他債券	(毎月)	オセアニア				その他 ( )
クレジット属性 ( )	日々					
不動産投信	その他 ( )	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券) 資産配分固定型))		アフリカ				
		中近東 (中東)				
資産複合 ( )		エマージング				
資産配分						
固定型						
資産配分						
変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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



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

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

＜ファンドの特色＞

**1. 世界の債券及び株式に分散投資し、ファミリーファンド方式で運用を行います。**

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



**?** ファミリーファンド方式とは

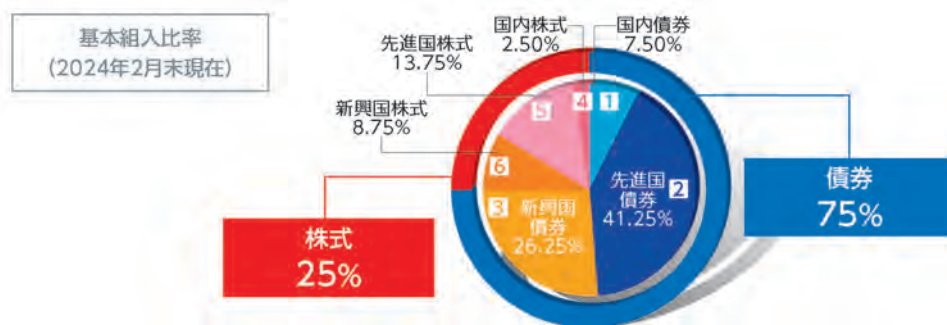
投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。

**2. 世界経済全体の発展を享受します。**

- 基本組入比率は、地域別(日本、先進国、新興国)のGDP(国内総生産)総額の比率を参考に決定します。
- ※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。
- ※地域別の基本組入比率は市場動向等を勘案して調整を行うことがあります。



(出所) IMF「世界経済見通し2023年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成  
 ※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。  
 ※GDP地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。  
 ※上記のファンドの地域別構成比は、2024年2月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



- 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- 基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合があります。

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

\*資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

※各インデックスに関する商標、著作権等の知的財産権、数値の算出、利用などその他一切の権利はそれぞれのインデックスの開発元もしくは公表元に帰属します。詳しくは下記をご覧ください。

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

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

※3「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るために JP モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ド

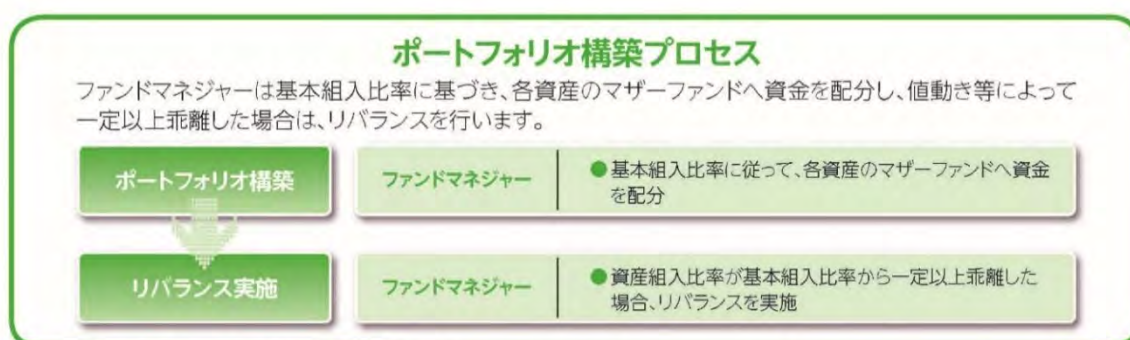


ルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利は JP モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

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

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

※6「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。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### 分配方針

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

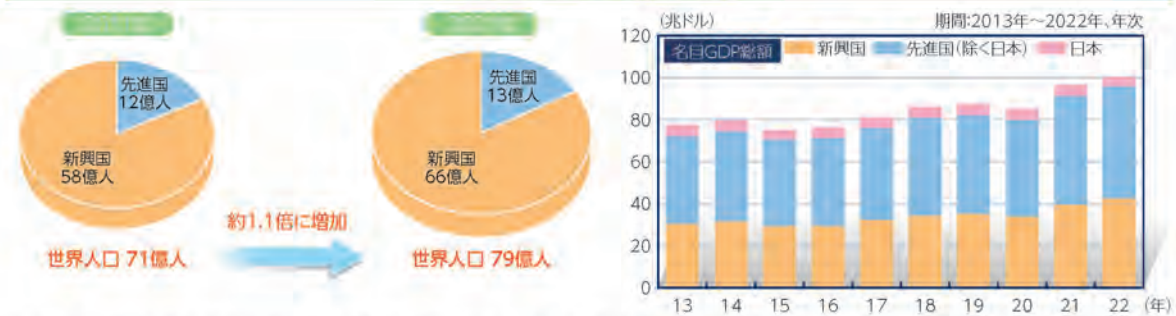
### 主な投資制限

- 株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

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

### 〈ご参考情報〉

#### 世界人口-名目GDP総額の推移



(出所)国連「World Population Prospects 2022」及びIMF「世界経済見通し2023年10月」のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成  
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。  
※IMFデータについては実績値のほか、一部の構成国において推定値が含まれます。  
※世界人口の数値は四捨五入しているため、合計値が一致しない場合があります。

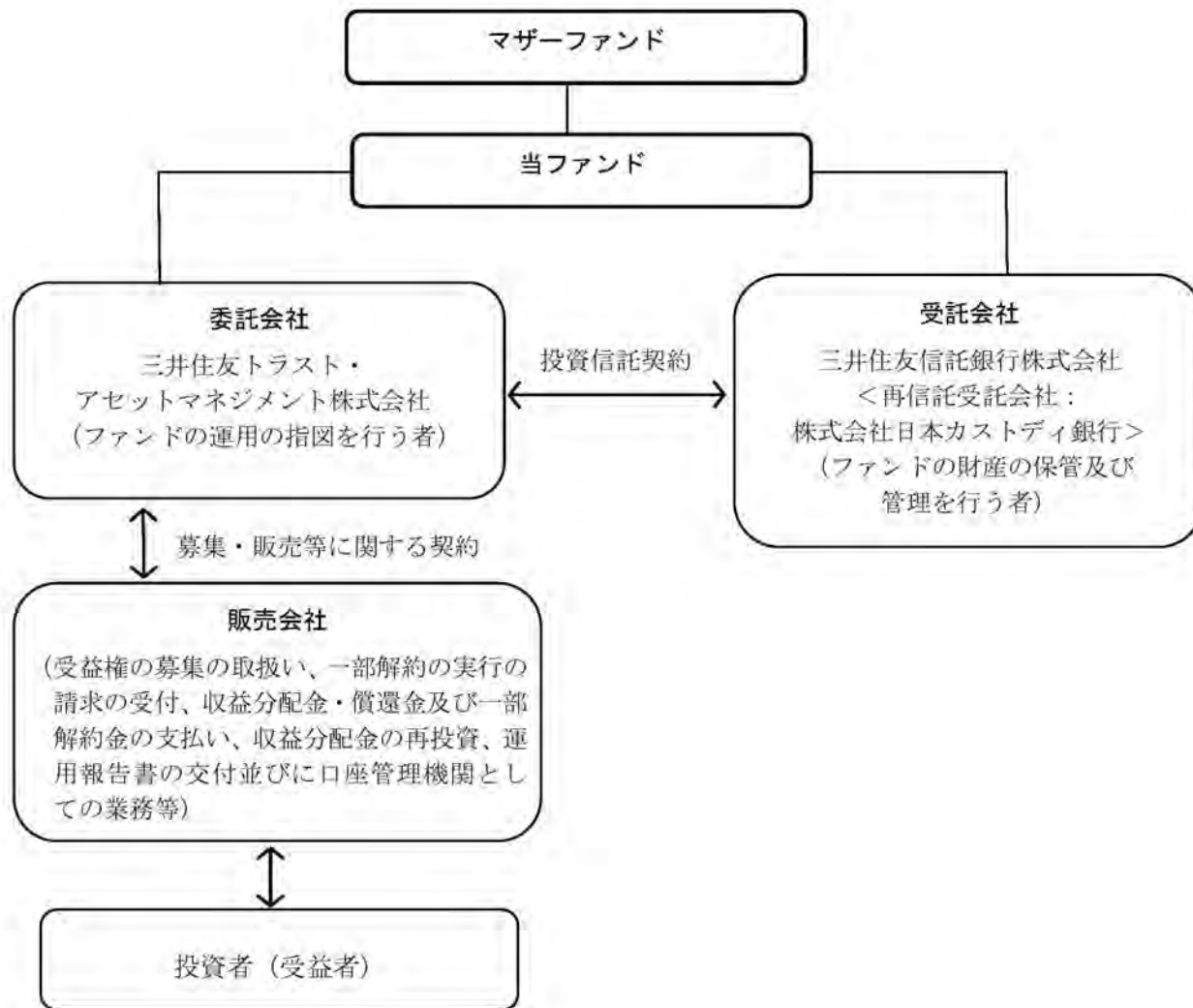
### (2) 【ファンドの沿革】

2013年11月8日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始



(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2024年 2月 29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、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」（以下、総称して又は個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称して又は個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

#### ②投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

#### ③投資態度

イ. 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の公社債及び株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

ロ. 株式（DR（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式25%、債券75%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。

ハ. 各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。

ニ. 各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。

ホ. 実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。

ヘ. 投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所（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および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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。

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

### (2)【投資対象】

#### ①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
  2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第21条、第22条及び第23条に定めるものに限りません。）
  3. 金銭債権
  4. 約束手形
- ロ. 次に掲げる特定資産以外の資産
1. 為替手形

## ②有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として次に掲げる 1. から 6. までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券並びに 7. から 28. までの有価証券（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. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 新興国債券インデックス マザーファンド
6. 新興国株式インデックス マザーファンド
7. 株券又は新株引受権証券
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
14. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
16. コマーシャル・ペーパー
17. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
18. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記 7. から 17. の証券又は証書の性質を有するもの
19. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
20. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
21. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
22. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
23. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
24. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

25. 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。）
  26. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
  27. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  28. 外国の者に対する権利で上記 27. の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記 7. の証券又は証書、上記 18. 並びに 23. の証券又は証書のうち上記 7. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記 8. から 12. までの証券及び上記 18. 並びに 23. の証券又は証書のうち上記 8. から 12. までの証券の性質を有するもの、及び上記 20. に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、上記 19. 及び 20. の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

### ③金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
  1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ロ. 上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (参考) マザーファンドの概要

#### 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

##### 2. 運用方法

###### (1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2)投資態度

①NOMURA-BPI 総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場に

における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、スワップ取引及び金利先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

①同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

①原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10% 以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2)投資態度

- ①FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことがで

きます。

⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

### 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目指して、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

原則として、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)を構成している国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

①原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交

換する取引を行うことができます。

⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10% 以下とします。

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

⑤同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。

⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

新興国の債券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。

②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上



記の運用ができない場合があります。

### 3. 運用制限

- ①株式への投資は行いません。
- ②同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1)投資対象

取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。

#### (2)投資態度

- ①主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。
- ②株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。
- ③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。
- ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

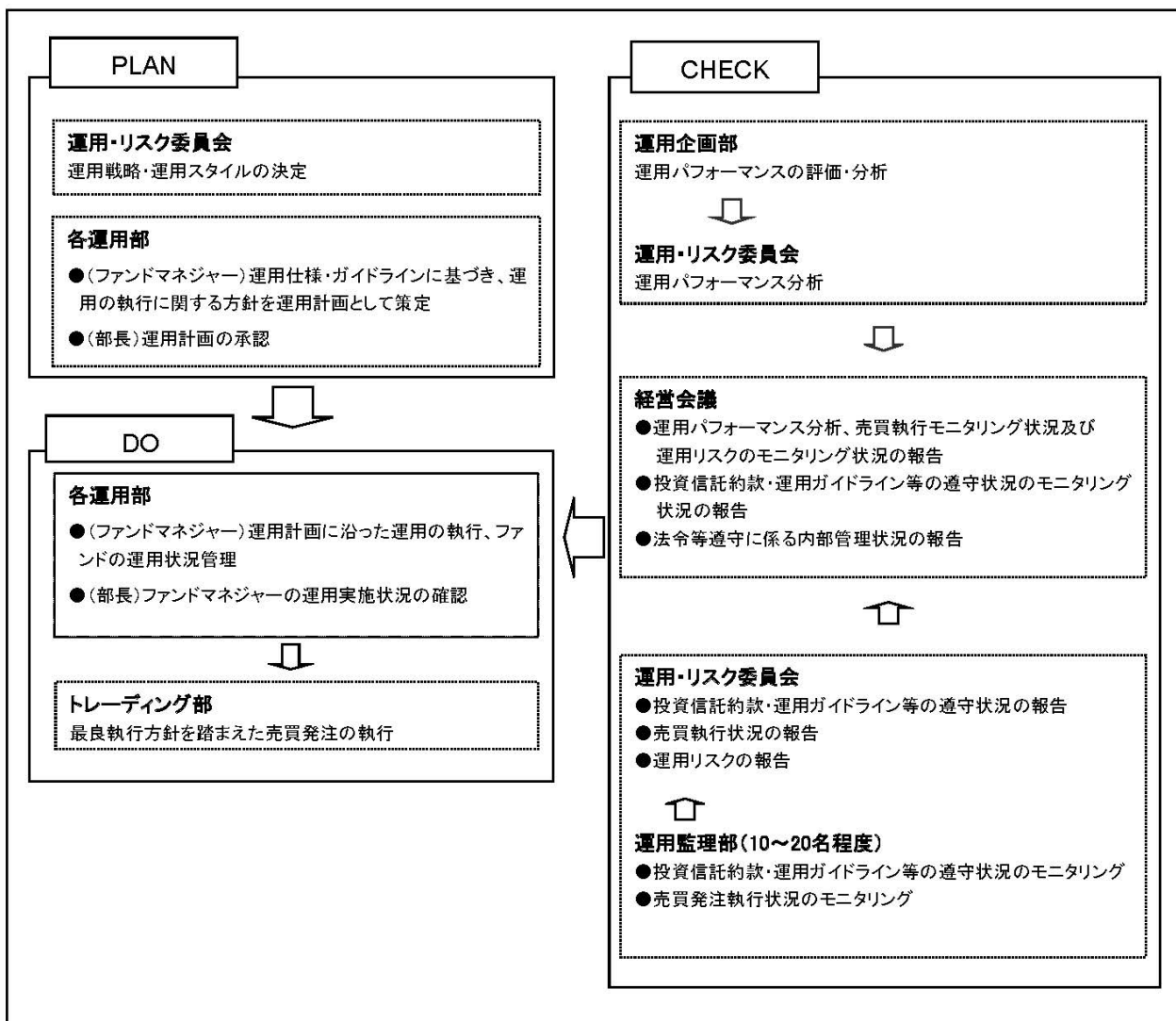
### 3. 運用制限

- ①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

- ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたいがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### (3) 【運用体制】

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



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

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

#### (4)【分配方針】

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### (5)【投資制限】

<約款に定める投資制限>

- イ. 株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の35%以下とします。
- ロ. 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ニ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ホ. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券

6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

- へ. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。
- ト. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- チ. 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引及び為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。
- リ. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時

価合計額を超えないものとします。

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

- ヌ. 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことを指図することができるものとし、売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ル. 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。この指図は、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。
- ヲ. 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ワ. 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。また、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償還金の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。また、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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。
- カ. 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。
- コ. 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。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

- 当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### ① 株価変動リスク

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

##### ② 為替変動リスク

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

##### ③ 金利変動リスク

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

##### ④ 信用リスク

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

##### ⑤ カントリーリスク

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

##### ⑥ 流動性リスク

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

##### ⑦ 有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

- ① 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。
- ② 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。  
分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払

われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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

④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が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3月～2024年2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に網羅するとともに、投資対象としての優位性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。[配当込み]指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る商標又は商標は、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商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
<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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに關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、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、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> JPMorgan EMBI Global Bond Index (配当込み、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】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

##### (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

①信託報酬の総額は、以下のイ. 及びロ. を合計した額とします。

イ. 当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.495%（税抜 0.45%）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.198% (税抜 0.18%)	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 0.242% (税抜 0.22%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

※2024年4月23日現在、合計で 49.5%（税抜 45%）以内とし、その配分は委託会社 29.7%（税抜 27%）、受託会社 19.8%（税抜 18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

### (4) 【その他の手数料等】

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

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（※）、先物取引・オプション取引に要する費用（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

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

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

## (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

### ①個人の受益者に対する課税

#### イ. 収益分配金に対する課税

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

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

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

(2037 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

#### ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

#### ハ. 損益通算について

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

### ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

### ②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(2037 年 12 月 31 日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

### ③個別元本について

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

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

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

ニ. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元

本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

#### ④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

※上記は、2024年2月29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。

比率(年率)	運用管理費用の比率	その他費用の比率
0.56%	0.49%	0.07%

※対象期間は2023年1月21日～2024年1月22日です。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5 【運用状況】

以下は、2024年2月29日現在の状況について記載してあります。

### 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

#### （1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	902,761,977	99.07
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	8,470,109	0.93
合計（純資産総額）		911,232,086	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	外国債券インデックス マザーファンド	102,485,993	3.4554	354,130,101	3.4953	358,219,291	39.31
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	106,245,186	2.2253	236,427,413	2.2524	239,306,656	26.26
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	23,468,628	5.7084	133,968,317	6.0773	142,625,892	15.65
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	18,175,483	3.9193	71,235,171	4.1840	76,046,220	8.35
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	45,236,251	1.3393	60,584,911	1.3366	60,462,773	6.64
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	9,492,016	2.6145	24,816,876	2.7498	26,101,145	2.86

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.07
合計	99.07

（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 2 期計算期間末	(2015 年 1 月 20 日)	377,394,493	377,394,493	11,741	11,741
第 3 期計算期間末	(2016 年 1 月 20 日)	537,488,921	537,488,921	10,576	10,576
第 4 期計算期間末	(2017 年 1 月 20 日)	675,724,816	675,724,816	11,185	11,185
第 5 期計算期間末	(2018 年 1 月 22 日)	737,543,812	737,543,812	12,433	12,433
第 6 期計算期間末	(2019 年 1 月 21 日)	681,031,315	681,031,315	11,631	11,631
第 7 期計算期間末	(2020 年 1 月 20 日)	704,051,491	704,051,491	12,839	12,839
第 8 期計算期間末	(2021 年 1 月 20 日)	681,395,232	681,395,232	13,300	13,300
第 9 期計算期間末	(2022 年 1 月 20 日)	744,958,908	744,958,908	14,028	14,028
第 10 期計算期間末	(2023 年 1 月 20 日)	752,984,617	752,984,617	13,850	13,850
第 11 期計算期間末	(2024 年 1 月 22 日)	890,006,388	890,006,388	16,455	16,455
	2023 年 2 月末日	773,967,456	—	14,201	—
	3 月末日	787,101,211	—	14,341	—
	4 月末日	789,744,835	—	14,491	—
	5 月末日	808,079,962	—	14,904	—
	6 月末日	848,771,780	—	15,668	—
	7 月末日	847,821,307	—	15,605	—
	8 月末日	868,931,825	—	15,840	—
	9 月末日	858,347,651	—	15,554	—
	10 月末日	850,823,033	—	15,407	—
	11 月末日	893,997,878	—	16,076	—
	12 月末日	881,628,956	—	16,087	—
	2024 年 1 月末日	892,445,205	—	16,466	—
	2 月末日	911,232,086	—	16,849	—

② 【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 2 期計算期間	2014 年 1 月 21 日～2015 年 1 月 20 日	0
第 3 期計算期間	2015 年 1 月 21 日～2016 年 1 月 20 日	0
第 4 期計算期間	2016 年 1 月 21 日～2017 年 1 月 20 日	0
第 5 期計算期間	2017 年 1 月 21 日～2018 年 1 月 22 日	0
第 6 期計算期間	2018 年 1 月 23 日～2019 年 1 月 21 日	0
第 7 期計算期間	2019 年 1 月 22 日～2020 年 1 月 20 日	0
第 8 期計算期間	2020 年 1 月 21 日～2021 年 1 月 20 日	0
第 9 期計算期間	2021 年 1 月 21 日～2022 年 1 月 20 日	0

第10期計算期間	2022年1月21日～2023年1月20日	0
第11期計算期間	2023年1月21日～2024年1月22日	0

### ③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第2期計算期間	2014年1月21日～2015年1月20日	12.0
第3期計算期間	2015年1月21日～2016年1月20日	△9.9
第4期計算期間	2016年1月21日～2017年1月20日	5.8
第5期計算期間	2017年1月21日～2018年1月22日	11.2
第6期計算期間	2018年1月23日～2019年1月21日	△6.5
第7期計算期間	2019年1月22日～2020年1月20日	10.4
第8期計算期間	2020年1月21日～2021年1月20日	3.6
第9期計算期間	2021年1月21日～2022年1月20日	5.5
第10期計算期間	2022年1月21日～2023年1月20日	△1.3
第11期計算期間	2023年1月21日～2024年1月22日	18.8

(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2期計算期間	2014年1月21日～2015年1月20日	351,798,094	109,869,385	321,421,941
第3期計算期間	2015年1月21日～2016年1月20日	400,244,016	213,448,471	508,217,486
第4期計算期間	2016年1月21日～2017年1月20日	182,370,280	86,474,117	604,113,649
第5期計算期間	2017年1月21日～2018年1月22日	162,011,209	172,898,759	593,226,099
第6期計算期間	2018年1月23日～2019年1月21日	126,811,279	134,500,317	585,537,061
第7期計算期間	2019年1月22日～2020年1月20日	89,841,976	126,994,519	548,384,518
第8期計算期間	2020年1月21日～2021年1月20日	91,394,055	127,432,640	512,345,933
第9期計算期間	2021年1月21日～2022年1月20日	80,458,652	61,746,640	531,057,945
第10期計算期間	2022年1月21日～2023年1月20日	94,963,234	82,336,981	543,684,198
第11期計算期間	2023年1月21日～2024年1月22日	89,521,782	92,348,519	540,857,461

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

(参考)

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	561,249,444,730	84.66
地方債証券	日本	32,731,503,489	4.94

特殊債券	日本	36,799,150,044	5.55
	国際機関	299,403,000	0.05
	小計	37,098,553,044	5.60
社債券	日本	29,022,233,000	4.38
	フランス	1,394,325,000	0.21
	韓国	99,507,000	0.02
	小計	30,516,065,000	4.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,375,962,921	0.21
合計(純資産総額)		662,971,529,184	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,570,000,000	100.04	6,572,628,000	99.21	6,518,688,300	0.100	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	6,030,000,000	99.96	6,027,768,800	99.31	5,988,453,300	0.005	2027/6/20	0.90
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	5,970,000,000	100.15	5,978,955,000	99.59	5,946,000,600	0.005	2026/6/20	0.90
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	5,900,000,000	100.44	5,926,373,000	99.78	5,887,197,000	0.100	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	5,860,000,000	100.78	5,905,957,400	100.40	5,883,615,800	0.400	2025/6/20	0.89
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	5,860,000,000	100.48	5,888,501,300	98.84	5,792,258,400	0.500	2033/3/20	0.87
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	5,750,000,000	100.39	5,772,942,500	99.71	5,733,382,500	0.100	2027/3/20	0.86
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	5,680,000,000	100.05	5,683,361,000	99.54	5,653,985,600	0.005	2026/9/20	0.85
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,760,000,000	98.38	5,667,065,000	97.26	5,602,348,800	0.200	2032/3/20	0.85
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,600,000,000	97.90	5,482,736,000	96.94	5,428,976,000	0.100	2031/9/20	0.82
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	5,550,000,000	98.02	5,440,214,200	96.74	5,369,292,000	0.200	2032/9/20	0.81
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	5,430,000,000	98.63	5,355,718,700	97.95	5,319,119,400	0.100	2030/9/20	0.80
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	5,250,000,000	100.65	5,284,583,600	101.12	5,308,905,000	0.800	2033/9/20	0.80
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,310,000,000	100.08	5,314,248,000	99.48	5,282,547,300	0.005	2026/12/20	0.80
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	5,320,000,000	98.19	5,223,724,000	97.24	5,173,646,800	0.100	2031/6/20	0.78
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,310,000,000	98.28	5,218,900,300	97.02	5,152,133,700	0.200	2032/6/20	0.78
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	5,150,000,000	100.32	5,166,798,000	100.01	5,150,669,500	0.100	2025/6/20	0.78



日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	5,200,000,000	100.68	5,235,469,600	99.03	5,150,028,000	0.500	2032/12/20	0.78
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	5,160,000,000	100.17	5,169,092,800	99.37	5,127,904,800	0.100	2027/12/20	0.77
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,090,000,000	100.30	5,105,270,000	99.50	5,064,855,400	0.100	2027/9/20	0.76
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	5,020,000,000	100.90	5,065,631,800	100.25	5,032,650,400	0.300	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	5,040,000,000	100.12	5,046,399,600	99.65	5,022,460,800	0.005	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,020,000,000	100.37	5,038,574,000	99.96	5,018,042,200	0.100	2025/9/20	0.76
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	5,060,000,000	98.51	4,984,772,900	97.75	4,946,301,800	0.100	2030/12/20	0.75
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	5,077,000,000	97.85	4,968,275,600	96.70	4,909,662,080	0.100	2031/12/20	0.74
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	4,880,000,000	100.35	4,897,140,600	99.74	4,867,702,400	0.100	2026/12/20	0.73
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	4,930,000,000	97.58	4,810,730,100	97.72	4,817,596,000	0.400	2033/6/20	0.73
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	4,800,000,000	100.39	4,818,720,000	99.89	4,794,768,000	0.100	2025/12/20	0.72
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	4,835,000,000	99.94	4,832,534,150	99.08	4,790,808,100	0.100	2028/6/20	0.72
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	4,760,000,000	100.42	4,780,039,600	99.84	4,752,669,600	0.100	2026/3/20	0.72

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	84.66
地方債証券	4.94
特殊債券	5.60
社債券	4.60
合計	99.79

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	662,132,398,240	99.21

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,262,540,097	0.79
合計(純資産総額)		667,394,938,337	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,906,230,000	0.74

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,591,500	1,949.30	18,696,777,691	3,621.00	34,730,821,500	5.20
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,477,000	937.25	9,819,586,911	1,542.00	16,155,534,000	2.42
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,235,600	13,269.36	16,395,625,672	12,945.00	15,994,842,000	2.40
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,700	19,788.63	7,315,860,127	36,870.00	13,630,839,000	2.04
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,800	68,425.93	11,960,852,811	70,040.00	12,242,992,000	1.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,549,300	2,005.56	7,118,334,108	3,205.00	11,375,506,500	1.70
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,900	8,178.23	6,934,324,874	12,665.00	10,738,653,500	1.61
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,223,200	5,692.47	6,963,034,634	8,344.00	10,206,380,800	1.53
日本	株式	信越化学工業	化学	1,569,300	4,422.30	6,939,915,390	6,387.00	10,023,119,100	1.50
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,111,700	163.02	8,495,732,000	182.30	9,499,962,910	1.42
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,800	5,934.04	6,544,066,304	8,400.00	9,263,520,000	1.39
日本	株式	三井物産	卸売業	1,392,500	4,709.00	6,557,290,389	6,553.00	9,125,052,500	1.37
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,242,300	5,002.25	6,214,307,124	6,516.00	8,094,826,800	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,329,400	4,457.15	5,925,346,796	6,044.00	8,034,893,600	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	864,200	5,568.12	4,811,970,587	8,790.00	7,596,318,000	1.14
日本	株式	第一三共	医薬品	1,526,200	4,532.60	6,917,654,880	4,974.00	7,591,318,800	1.14
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,259,700	1,347.78	5,741,177,085	1,782.00	7,590,785,400	1.14
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,700,500	3,122.76	5,310,259,360	4,376.00	7,441,388,000	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,550,500	4,530.99	7,025,314,811	4,387.00	6,802,043,500	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,139.04	5,894,116,380	19,485.00	6,700,891,500	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,322,200	2,087.53	4,847,672,632	2,801.00	6,504,482,200	0.97

		ープ							
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,800	4,361.40	5,904,468,686	4,554.00	6,165,205,200	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,819,400	1,517.14	4,277,444,429	1,972.50	5,561,266,500	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	950,300	5,369.65	5,102,787,574	5,363.00	5,096,458,900	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,589,300	2,752.52	4,374,587,204	3,023.00	4,804,453,900	0.72
日本	株式	SMC	機械	52,800	74,502.90	3,933,753,244	90,150.00	4,759,920,000	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,963,600	1,826.03	3,585,600,132	2,381.50	4,676,313,400	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,600	26,672.84	5,617,302,040	21,175.00	4,459,455,000	0.67
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,911,000	2,046.15	3,910,204,515	2,230.00	4,261,530,000	0.64
日本	株式	ディスコ	機械	84,900	20,724.82	1,759,537,855	48,260.00	4,097,274,000	0.61

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.30
		建設業	1.98
		食料品	3.08
		繊維製品	0.34
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.72
		医薬品	4.46
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.96
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.52
		機械	5.43
		電気機器	17.34
		輸送用機器	9.30
		精密機器	2.33
		その他製品	2.33
		電気・ガス業	1.29
		陸運業	2.57
海運業	0.82		
空運業	0.41		
倉庫・運輸関連業	0.13		
情報・通信業	7.48		

	卸売業	7.26
	小売業	4.14
	銀行業	7.25
	証券、商品先物取引業	0.89
	保険業	2.58
	その他金融業	1.17
	不動産業	1.88
	サービス業	4.52
	小計	99.21
合計		99.21

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	183円		4,754,148,050	4,906,230,000	0.74

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

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

#### 外国債券インデックス マザーファンド

#### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	149,850,079,406	46.55
	中国	26,747,071,217	8.31
	フランス	25,641,675,117	7.97
	イタリア	23,207,032,791	7.21
	ドイツ	19,915,584,393	6.19
	イギリス	16,494,579,984	5.12
	スペイン	15,367,456,335	4.77
	カナダ	6,319,071,426	1.96
	ベルギー	5,484,232,336	1.70
	オランダ	4,617,552,270	1.43
	オーストラリア	4,289,827,606	1.33
	オーストリア	3,772,042,976	1.17
	メキシコ	2,742,124,469	0.85

	アイルランド	1,797,106,841	0.56
	ポーランド	1,674,266,524	0.52
	フィンランド	1,623,908,970	0.50
	マレーシア	1,567,338,555	0.49
	シンガポール	1,278,896,486	0.40
	イスラエル	1,047,597,364	0.33
	デンマーク	854,849,662	0.27
	ニュージーランド	734,061,051	0.23
	スウェーデン	644,907,314	0.20
	ノルウェー	535,951,106	0.17
	小計	316,207,214,199	98.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,691,404,075	1.77
合計(純資産総額)		321,898,618,274	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,090,153,972	0.34
	買建	ドイツ	1,012,528,740	0.31

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

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

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	—	4,438,740,907	1.38

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 4.125% 11/15/32	14,000,000	15,265.97	2,137,235,922	14,886.31	2,084,083,914	4.125	2032/11/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	14,367.69	1,958,316,904	14,031.73	1,912,525,106	3.375	2033/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,836.02	1,784,847,367	13,430.22	1,732,499,599	2.750	2032/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	14,139.14	1,652,865,880	14,154.44	1,654,654,725	2.375	2027/5/15	0.51

アメリカ	国債証券	T 3% 07/15/25	11,150,000	14,659.46	1,634,530,080	14,698.85	1,638,922,789	3.000	2025/7/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	14,296.74	1,601,235,932	14,190.05	1,589,286,001	3.500	2033/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	12,453.66	1,566,670,984	12,213.39	1,536,444,791	1.375	2031/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,906.94	1,497,777,485	14,138.26	1,522,690,685	1.625	2026/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	15,060.14	1,506,014,361	15,052.58	1,505,258,043	4.500	2026/7/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	14,560.89	1,485,211,024	14,709.45	1,500,364,206	3.125	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,933.78	1,515,839,431	12,633.32	1,480,625,845	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.625% 10/15/26	9,520,000	15,288.24	1,455,441,013	15,113.20	1,438,776,792	4.625	2026/10/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	12,056.24	1,440,721,693	11,984.44	1,432,141,163	0.625	2030/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	14,332.22	1,441,822,150	14,228.01	1,431,338,343	2.875	2028/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	14,002.89	1,414,292,206	13,599.14	1,373,513,598	2.875	2032/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	14,374.82	1,322,484,084	14,919.56	1,372,600,162	4.125	2030/8/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	12,247.52	1,365,599,451	12,117.16	1,351,063,775	0.875	2030/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	13,632.69	1,295,105,765	13,884.00	1,318,980,490	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	14,430.51	1,298,746,208	14,600.57	1,314,051,339	2.875	2025/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,947.32	1,242,942,753	13,098.87	1,257,491,820	0.625	2027/12/31	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	13,118.00	1,246,210,107	13,165.37	1,250,711,078	1.250	2028/9/30	0.39
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	9,550,000	14,215.26	1,357,558,158	13,091.22	1,250,211,694	3.625	2053/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	14,392.51	1,217,606,887	14,632.74	1,237,929,891	2.000	2025/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	14,163.27	1,203,878,311	14,499.16	1,232,428,705	1.125	2025/2/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,778.10	1,272,035,834	11,270.52	1,217,217,016	2.875	2052/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	14,455.78	1,214,286,015	14,314.23	1,202,396,035	3.125	2028/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,936.49	1,214,337,158	14,750.65	1,199,227,999	3.875	2029/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	13,151.49	1,183,634,356	13,251.89	1,192,670,761	1.250	2028/6/30	0.37
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	14,098.04	1,158,859,034	14,188.58	1,166,301,451	2.875	2028/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/30/25	8,000,000	13,903.13	1,112,250,653	14,294.22	1,143,538,219	0.375	2025/4/30	0.36

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.23
合計	98.23

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	28	アメリカ ドル	2,987,804.93	450,172,569	2,992,937.64	450,945,914	0.14
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	18	アメリカ ドル	1,981,550.4	298,560,199	1,986,187.5	299,258,871	0.09
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	19	アメリカ ドル	2,248,896.95	338,841,303	2,256,250	339,949,187	0.11

ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-SCHATZ	買建	11	ユーロ	1,157,943.1	189,034,211	1,156,320	188,769,240	0.06
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BOBL FU	買建	15	ユーロ	1,748,371.5	285,421,648	1,740,750	284,177,438	0.09
ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO-BUND	買建	25	ユーロ	3,325,722.5	542,924,198	3,305,250	539,582,062	0.17

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

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

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	14,279,000.00	2,144,319,942	2,148,385,706	0.67
	カナダドル	買建	1,260,000.00	139,943,135	139,510,446	0.04
	メキシコペソ	買建	2,005,000.00	17,680,090	17,665,854	0.01
	ユーロ	買建	8,854,000.00	1,440,380,030	1,443,920,596	0.45
	イギリスポンド	買建	1,303,000.00	247,644,879	248,209,480	0.08
	スウェーデンクローナ	買建	1,003,000.00	14,648,815	14,622,034	0.00
	オーストラリアドル	買建	343,000.00	33,790,645	33,568,346	0.01
	オブショア人民元	買建	18,836,000.00	392,335,017	392,858,445	0.12

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

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

## 外国株式インデックス 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	492,337,117,457	70.26
	イギリス	25,759,860,424	3.68
	カナダ	22,749,422,561	3.25
	フランス	21,309,692,245	3.04
	スイス	20,880,249,456	2.98
	ドイツ	16,502,556,210	2.36
	オランダ	13,941,958,713	1.99
	アイルランド	13,131,250,587	1.87
	オーストラリア	12,649,159,281	1.81
	デンマーク	6,917,445,727	0.99
	スウェーデン	6,055,860,046	0.86
	スペイン	4,742,764,227	0.68

	イタリア	3,793,912,078	0.54
	香港	2,932,423,015	0.42
	シンガポール	2,036,746,407	0.29
	フィンランド	1,936,158,154	0.28
	ジャージー	1,608,534,471	0.23
	イスラエル	1,454,454,348	0.21
	ベルギー	1,430,987,457	0.20
	ノルウェー	1,140,447,960	0.16
	バミューダ	928,706,065	0.13
	ケイマン	874,908,889	0.12
	キュラソー	800,271,941	0.11
	ニュージーランド	545,003,748	0.08
	リベリア	380,341,229	0.05
	ルクセンブルク	368,833,657	0.05
	オーストリア	343,114,547	0.05
	ポルトガル	310,647,872	0.04
	パナマ	167,379,408	0.02
	マン島	86,470,870	0.01
	小計	678,116,679,050	96.78
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	64,893,304	0.01
	香港	57,544,987	0.01
	小計	122,438,291	0.02
投資証券	アメリカ	11,191,782,920	1.60
	オーストラリア	842,021,267	0.12
	フランス	261,314,562	0.04
	シンガポール	239,920,630	0.03
	イギリス	191,777,759	0.03
	香港	125,300,175	0.02
	カナダ	57,171,877	0.01
	ベルギー	52,157,128	0.01
	小計	12,961,446,318	1.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	9,493,152,773	1.35
合計(純資産総額)		700,693,716,432	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,004,821,570	1.00



	買建	カナダ	284,588,096	0.04
	買建	ドイツ	1,271,275,548	0.18
	買建	イギリス	565,717,766	0.08
	買建	オーストラリア	354,695,097	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	買建	—	593,057,610	0.08

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	546,594	50,197.04	27,437,404,673	61,431.17	33,577,910,247	4.79
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	26,414.03	31,979,919,762	27,334.55	33,094,406,067	4.72
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	191,277	58,938.53	11,273,586,225	117,014.84	22,382,247,952	3.19
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	719,107	18,173.95	13,069,021,042	26,090.01	18,761,513,999	2.68
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	172,117	39,746.44	6,841,039,541	72,927.29	12,552,026,958	1.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	459,452	18,785.54	8,631,057,735	20,548.37	9,440,991,807	1.35
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	405,242	18,891.20	7,655,511,535	20,706.57	8,391,175,122	1.20
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	65,049.26	4,070,782,782	114,153.61	7,143,733,465	1.02
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	29,400.24	6,503,775,569	30,441.36	6,734,086,957	0.96
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	119,622.42	4,111,063,892	194,276.91	6,676,714,614	0.95

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	101,297	48,529.20	4,915,863,353	62,097.13	6,290,253,363	0.90
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	20,647.06	4,625,087,725	27,780.53	6,223,034,214	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	72,060	72,808.96	5,246,613,735	75,075.84	5,409,965,578	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,044	33,921.35	4,207,740,355	43,035.87	5,338,341,719	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	309,867	15,826.30	4,904,048,335	15,717.89	4,870,456,784	0.70
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	56,370.11	3,656,729,596	72,148.32	4,680,262,135	0.67
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	12,527.34	3,169,780,836	18,266.79	4,622,027,607	0.66
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	23,234.75	4,345,736,522	24,340.73	4,552,594,366	0.65
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,384	110,677.64	3,473,507,097	141,929.54	4,454,316,997	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	183,167	21,950.57	4,020,621,539	24,114.73	4,417,023,391	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	44,068.82	3,396,252,379	56,894.49	4,384,688,331	0.63
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,608	76,844.23	2,659,425,310	112,695.13	3,900,153,170	0.56
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	16,694.17	3,308,068,322	19,314.38	3,827,281,044	0.55
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	20,781.39	2,866,398,228	26,819.25	3,699,207,351	0.53
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	32,381.82	2,417,691,537	45,166.34	3,372,209,718	0.48
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	126,574	18,966.39	2,400,653,112	26,599.28	3,366,777,495	0.48
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	207,970	19,120.56	3,976,504,648	15,783.81	3,282,559,694	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,373	23,193.85	3,302,179,088	22,953.06	3,267,897,122	0.47
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	347,772	7,385.49	2,568,470,067	8,982.94	3,124,016,888	0.45
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,076	57,236.11	1,950,377,777	89,871.64	3,062,466,059	0.44

(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	4.41
		素材	3.68
		資本財	6.90
		商業・専門サービス	1.62
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.77
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	2.06
		メディア・娯楽	6.15
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.81
		生活必需品流通・小売り	1.75
		食品・飲料・タバコ	3.26
		家庭用品・パーソナル用品	1.59
		ヘルスケア機器・サービス	4.26
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
		銀行	5.28
		金融サービス	6.74
		保険	3.06
		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	10.28
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.15
		電気通信サービス	1.12
		公益事業	2.41
半導体・半導体製造装置	7.77		
不動産管理・開発	0.32		
	小計	96.78	
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.85
合計			98.65

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券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	183	アメリカドル	44,147,062.65	6,651,637,929	46,491,150	7,004,821,570	1.00
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	10	カナダドル	2,512,777	278,641,842	2,566,400	284,588,096	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	21	スイスフラン	2,348,347	402,671,059	2,382,870	408,590,718	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	108	ユーロ	4,995,190.6	815,464,865	5,284,440	862,684,830	0.12
	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	344,584,876	3,623,775	354,695,097	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	39	イギリスポンド	2,976,451.25	567,758,076	2,965,755	565,717,766	0.08

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

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

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	3,450,000.00	519,201,000	519,630,480	0.07
	ユーロ	買建	450,000.00	73,416,150	73,427,130	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。

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	インドネシア	13,214,653,755	9.82
	中国	13,166,107,774	9.79
	ブラジル	13,160,560,265	9.78
	メキシコ	13,101,943,113	9.74
	マレーシア	13,065,954,702	9.71
	タイ	12,854,733,579	9.56
	南アフリカ	10,587,971,850	7.87
	ポーランド	10,244,258,435	7.62
	チェコ	8,193,805,741	6.09
	コロンビア	5,931,995,014	4.41
	ルーマニア	5,198,998,315	3.87

	ハンガリー	4,022,832,540	2.99
	ペルー	2,969,747,606	2.21
	チリ	2,246,838,320	1.67
	ウルグアイ	257,393,744	0.19
	ドミニカ共和国	213,922,106	0.16
	小計	128,431,716,859	95.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	6,070,176,644	4.51
合計(純資産総額)		134,501,893,503	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	3,296,467,145	2.45

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.65	2,386,761,286	3.73	2,441,530,823	9.850	2027/6/28	1.82
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	68,300,000	2,987.05	2,040,158,112	3,022.91	2,064,647,631	10.000	2027/1/1	1.54
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,435.43	1,863,106,433	2,546.41	1,948,004,921	0.000	2026/1/1	1.45
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,312.64	1,803,860,299	2,425.97	1,892,258,248	0.000	2026/7/1	1.41
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	209,200,000	812.58	1,699,935,719	809.46	1,693,405,905	10.500	2026/12/21	1.26
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	54,900,000	2,996.21	1,644,920,055	3,022.81	1,659,525,019	10.000	2025/1/1	1.23
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	51,800,000	3,172.42	1,643,318,447	3,187.87	1,651,319,558	3.885	2029/8/15	1.23
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	51,600,000,000	2.95	1,527,156,107	3.14	1,624,544,361	7.250	2034/10/18	1.21
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,904.62	1,492,976,377	2,979.71	1,531,574,768	10.000	2029/1/1	1.14
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	790.86	1,392,709,583	814.15	1,433,733,717	7.750	2031/5/29	1.07
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	799.85	1,402,153,583	813.09	1,425,358,875	5.750	2026/3/5	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	200,100,000	699.41	1,399,527,317	707.78	1,416,270,281	8.000	2030/1/31	1.05
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	40,900,000	3,152.09	1,289,207,228	3,171.15	1,297,003,023	3.733	2028/6/15	0.96
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25%	47,110,000,000	2.55	1,204,457,255	2.71	1,280,974,101	7.250	2050/10/26	0.95

ア		10/26/50								
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/27	58,000,000	2,150.89	1,247,520,569	2,188.61	1,269,394,843	0.000	2027/7/1	0.94
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	186,500,000	658.73	1,228,543,729	667.67	1,245,217,419	8.250	2032/3/31	0.93
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	45,300,000	2,566.91	1,162,814,158	2,673.71	1,211,193,385	0.000	2025/7/1	0.90
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	838.60	1,170,698,765	856.27	1,195,363,382	8.500	2029/5/31	0.89
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	184,000,000	638.03	1,173,990,826	646.12	1,188,863,192	8.875	2035/2/28	0.88
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	817.81	1,136,765,259	834.75	1,160,313,099	7.500	2027/6/3	0.86
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.93	1,019,188,409	0.94	1,033,884,051	5.500	2026/4/15	0.77
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	566.14	1,028,688,917	563.53	1,023,935,009	8.750	2048/2/28	0.76
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	116,900,000	859.82	1,005,135,670	866.37	1,012,795,381	8.000	2024/9/5	0.75
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000	773.70	928,443,150	790.21	948,258,078	5.500	2027/3/4	0.71
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000	731.06	902,868,210	754.55	931,872,723	7.750	2042/11/13	0.69
ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	27,500,000	3,302.30	908,133,398	3,344.16	919,646,598	2.750	2029/10/25	0.68
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,190.58	915,697,539	3,184.49	913,949,172	3.955	2025/9/15	0.68
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000	0.97	880,963,296	0.99	892,041,120	7.000	2033/2/15	0.66
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	592.62	863,451,419	598.24	871,644,422	8.500	2037/1/31	0.65
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	413.46	839,756,940	418.85	850,692,983	2.125	2026/12/17	0.63

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	95.49
合計	95.49

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	メキシコペソ	買建	58,260,000.00	509,826,749	510,654,726	0.38
	チェココルナ	買建	49,230,000.00	314,162,408	316,696,590	0.24
	ハンガリーフォリント	買建	380,490,000.00	157,562,181	157,100,514	0.12
	ポーランドズロチ	買建	10,570,000.00	394,081,771	398,090,511	0.30
	マレーシアリングgit	買建	15,990,000.00	502,312,740	504,615,618	0.38

	タイバーツ	買建	118,370,000.00	492,228,295	495,354,776	0.37
	南アフリカランド	買建	52,060,000.00	408,744,320	405,240,246	0.30
	オフショア人民元	買建	24,410,000.00	507,289,637	508,714,164	0.38

(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	30,370,271,149	16.53
	台湾	27,952,995,530	15.21
	ケイマン	24,756,015,807	13.47
	韓国	21,569,441,333	11.74
	中国	17,668,183,518	9.62
	ブラジル	9,067,708,819	4.94
	サウジアラビア	7,522,355,290	4.09
	南アフリカ	4,354,679,748	2.37
	メキシコ	4,201,157,827	2.29
	インドネシア	3,333,979,307	1.81
	タイ	2,887,820,339	1.57
	マレーシア	2,318,795,455	1.26
	アラブ首長国連邦	2,134,167,897	1.16
	ポーランド	1,594,684,900	0.87
	カタール	1,496,330,345	0.81
	香港	1,469,462,453	0.80
	クウェート	1,388,307,610	0.76
	トルコ	1,207,828,276	0.66
	フィリピン	1,078,658,493	0.59
	ギリシャ	882,403,139	0.48
	チリ	796,723,854	0.43
	バミューダ	702,819,988	0.38
	アメリカ	625,237,349	0.34
	ハンガリー	457,538,254	0.25
チェコ	244,292,666	0.13	
ルクセンブルク	237,475,720	0.13	
エジプト	187,670,665	0.10	
イギリス	185,656,463	0.10	
コロンビア	174,566,543	0.10	
ペルー	38,313,663	0.02	

	シンガポール	26,091,642	0.01
	オランダ	17,552,447	0.01
	ロシア	125	0.00
	キプロス	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	170,949,186,614	93.04
投資信託受益証券	ブラジル	386,907,099	0.21
	メキシコ	141,440,367	0.08
	小計	528,347,466	0.29
投資証券	メキシコ	185,022,966	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	12,068,283,479	6.57
合計(純資産総額)		183,730,840,525	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	12,108,177,194	6.59

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	429,038,458	0.23

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	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	2,656.37	10,570,732,560	3,325.96	13,235,328,432	7.20
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	7,951.78	6,136,113,461	8,271.60	6,382,904,214	3.47
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア	1,083,100	5,914.68	6,406,199,266	5,332.25	5,775,359,975	3.14



			ア・娯楽							
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	1,578.70	4,173,439,890	1,429.31	3,778,513,373	2.06	
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	494,885	4,232.27	2,094,491,725	5,323.47	2,634,505,451	1.43	
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	16,520.70	1,615,394,632	18,835.25	1,841,711,400	1.00	
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,516.52	1,340,044,263	3,056.28	1,627,464,585	0.89	
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	847,011	1,715.49	1,453,045,596	1,914.45	1,621,564,020	0.88	
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	14,464.00	1,263,719,680	17,854.00	1,559,903,980	0.85	
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	85.85	1,305,135,085	93.74	1,425,113,871	0.78	
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	4,312.32	1,042,737,434	5,312.97	1,284,698,607	0.70	
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	833,450	2,198.43	1,832,285,941	1,508.23	1,257,040,544	0.68	
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,721.57	1,255,748,774	2,576.91	1,189,001,235	0.65	
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	152,359	6,144.36	936,148,671	7,533.01	1,147,722,175	0.62	
ブラジル	株式	VALE SA	素材	550,487	2,139.45	1,177,744,181	2,021.70	1,112,924,028	0.61	
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	2,848.99	876,156,207	3,581.35	1,101,382,803	0.60	
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	3,403.40	1,067,408,342	3,401.47	1,066,804,604	0.58	
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	467.49	961,284,740	493.17	1,014,095,248	0.55	
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	6,429.69	855,323,701	6,938.19	922,967,931	0.50	
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	86.38	809,423,381	96.00	899,472,000	0.49	
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	1,056.59	769,243,732	1,224.71	891,643,466	0.49	
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	71.46	775,517,885	78.15	848,100,155	0.46	
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	490,774	1,410.43	692,204,032	1,704.16	836,359,383	0.46	
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	885.74	691,131,440	1,054.17	822,550,414	0.45	
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	53.83	723,355,815	59.48	799,278,249	0.44	
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	634,100	1,137.54	721,316,346	1,260.15	799,067,253	0.43	
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	379,500	2,031.89	771,105,764	2,052.05	778,752,975	0.42	
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	25,223.09	771,599,787	24,736.22	756,705,782	0.41	

インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	358,975	1,706.10	612,450,478	2,065.52	741,470,401	0.40
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,058,000	731.50	773,927,000	684.33	724,029,075	0.39

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.20
		素材	6.58
		資本財	4.43
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	3.75
		耐久消費財・アパレル	1.12
		消費者サービス	2.19
		メディア・娯楽	5.45
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.88
		生活必需品流通・小売り	1.41
		食品・飲料・タバコ	3.23
		家庭用品・パーソナル用品	0.66
		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	16.18
		金融サービス	2.48
		保険	2.44
		ソフトウェア・サービス	2.64
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.06
電気通信サービス	2.58		
公益事業	2.61		
半導体・半導体製造装置	10.38		
不動産管理・開発	1.38		
		小計	93.04
投資信託受益証券	—	—	0.29
投資証券	—	—	0.10
合計			93.43

(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	1,581	アメリカドル	79,081,079	11,915,146,173	80,362,230	12,108,177,194	6.59

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

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

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	2,220,000.00	333,999,000	334,433,898	0.18
	トルコリラ	買建	10,000,000.00	48,070,000	47,968,000	0.03
	ポーランドズロチ	買建	420,000.00	15,848,700	15,854,160	0.01
	香港ドル	買建	1,600,000.00	30,774,400	30,782,400	0.02

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

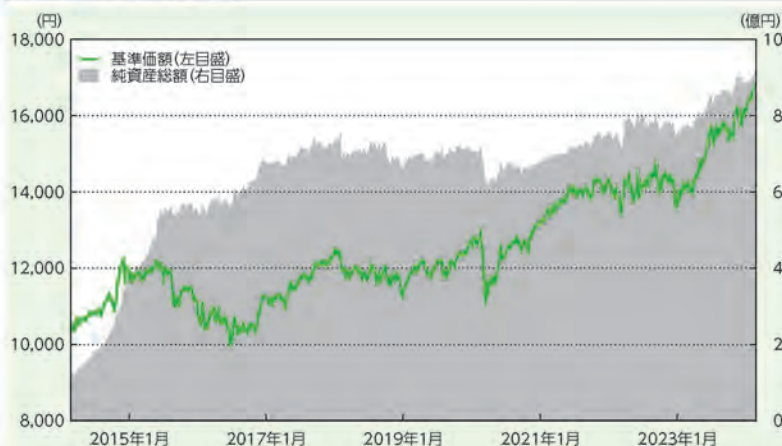
(注 2) 投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 運用実績

当初設定日：2013年11月8日  
作成基準日：2024年2月29日



### 基準価額・純資産の推移



基準価額 16,849円

純資産総額 9.11億円

### 分配の推移

(1万円当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年1月	0円
2021年1月	0円
2022年1月	0円
2023年1月	0円
2024年1月	0円
設定期 分配金合計額	0円

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

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

### 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種別	業種	利率	償還期	実質投資比率
外国債券 インデックス マザーファンド	39.3%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.3%
		T 3.375% 05/15/33	アメリカ	国債	-	3.375%	2033/05/15	0.2%
新興国債券 インデックス マザーファンド	26.3%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.5%
		BNTNF 10% 01/01/27	ブラジル	国債	-	10.000%	2027/01/01	0.4%
外国株式 インデックス マザーファンド	15.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.8%
		APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.7%
新興国株式 インデックス マザーファンド	8.3%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	0.6%
		SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	0.3%
国内債券 インデックス マザーファンド	6.6%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.1%
		第153回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2027/06/20	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	2.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.1%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.1%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

### 年間収益率の推移(暦年ベース)



※2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### <申込手続>

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

#### <申込コース>

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

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

#### <申込みの受付>

お申込みの受付は、原則として午後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営業日の基準価額とします。

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

#### <申込手数料>

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

#### <申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### <受付不可日>

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <申込受付の中止等>

収益分配金を再投資する場合を除き、取引所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、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

## 2【換金（解約）手続等】

#### <一部解約手続>

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、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営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

#### <一部解約代金の支払い>

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

#### <受付不可日>

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

ニューヨークの取引所の休業日

ロンドンの取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

###### イ. 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。

###### ロ. マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

###### (イ) 国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日のわが国の取引所の最終相場で評価します。

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

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

###### (ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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

##### <基準価額の照会方法>

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

###### (照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）



(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。(2013年11月8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1月21日から翌年1月20日までとします。

ただし、第1計算期間は2013年11月8日から2014年1月20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5億口を下回るようになった場合
  - ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
  - ・やむを得ない事情が発生した場合
- 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を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### <受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- ①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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シャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### <投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

- ①信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
- ②上記①ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。
- ③投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### 4 【受益者の権利等】

##### (1) 収益分配金に対する請求権

- ① 受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ② 収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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11期計算期間(2023年1月21日から2024年1月22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

2024年4月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田信之  
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」に掲げられている世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2023年1月21日から2024年1月22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、世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2024年1月22日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 10 期 (2023 年 1 月 20 日現在)	第 11 期 (2024 年 1 月 22 日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,462,877	10,157,570
親投資信託受益証券	746,180,481	881,186,506
未収入金	1,070,000	4,700,000
流動資産合計	756,713,358	896,044,076
資産合計	756,713,358	896,044,076
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,778,178	3,821,546
未払受託者報酬	214,356	243,545
未払委託者報酬	1,714,828	1,948,296
未払利息	3	5
その他未払費用	21,376	24,296
流動負債合計	3,728,741	6,037,688
負債合計	3,728,741	6,037,688
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	543,684,198	540,857,461
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	209,300,419	349,148,927
（分配準備積立金）	107,387,074	195,024,279
元本等合計	752,984,617	890,006,388
純資産合計	752,984,617	890,006,388
負債純資産合計	756,713,358	896,044,076



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期		第11期	
	自 2022年1月21日	至 2023年1月20日	自 2023年1月21日	至 2024年1月22日
<b>営業収益</b>				
受取利息		33		34
有価証券売買等損益		△6,393,000		145,806,025
その他収益		-		123
<b>営業収益合計</b>		<b>△6,392,967</b>		<b>145,806,182</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,847		3,731
受託者報酬		423,247		460,473
委託者報酬		3,385,882		3,683,696
その他費用		42,202		45,927
<b>営業費用合計</b>		<b>3,855,178</b>		<b>4,193,827</b>
営業利益又は営業損失(△)		△10,248,145		141,612,355
経常利益又は経常損失(△)		△10,248,145		141,612,355
当期純利益又は当期純損失(△)		△10,248,145		141,612,355
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(△)		515,884		14,090,147
期首剰余金又は期首欠損金(△)		213,900,963		209,300,419
剰余金増加額又は欠損金減少額		39,274,734		48,920,052
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		39,274,734		48,920,052
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,111,249		36,593,752
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,111,249		36,593,752
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		209,300,419		349,148,927

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第11期計算期間は2023年1月21日から2024年1月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第10期 (2023年1月20日現在)	第11期 (2024年1月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	543,684,198口	540,857,461口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,3850円 (13,850円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,6455円 (16,455円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自2022年1月21日 至2023年1月20日	第11期 自2023年1月21日 至2024年1月22日																																																												
<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>16,847,033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>B</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>101,913,345円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>90,540,041円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>209,300,419円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>543,684,198口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>3,849円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	16,847,033円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円	収益調整金額	C	101,913,345円	分配準備積立金額	D	90,540,041円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	209,300,419円	当ファンドの期末残存口数	F	543,684,198口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,849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	<p>分配金の計算過程</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>24,476,174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>B</td> <td>79,706,647円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>154,124,648円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>90,841,458円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>349,148,927円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>540,857,461口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>6,455円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>－円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>－円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	24,476,174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	79,706,647円	収益調整金額	C	154,124,648円	分配準備積立金額	D	90,841,458円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	349,148,927円	当ファンドの期末残存口数	F	540,857,461口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,455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																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	16,847,033円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	－円																																																											
収益調整金額	C	101,913,345円																																																											
分配準備積立金額	D	90,540,041円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	209,300,419円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	543,684,198口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,849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																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	24,476,174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	79,706,647円																																																											
収益調整金額	C	154,124,648円																																																											
分配準備積立金額	D	90,841,458円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	349,148,927円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	540,857,461口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,455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11期 自2023年1月21日 至2024年1月22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

第 11 期 (2024 年 1 月 22 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 10 期	第 11 期
	自 2022 年 1 月 21 日 至 2023 年 1 月 20 日	自 2023 年 1 月 21 日 至 2024 年 1 月 22 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	531,057,945 円	543,684,198 円
期中追加設定元本額	94,963,234 円	89,521,782 円
期中一部解約元本額	82,336,981 円	92,348,519 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第 10 期	第 11 期
	(2023 年 1 月 20 日現在)	(2024 年 1 月 22 日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	△6,476,825	135,525,238
合計	△6,476,825	135,525,238

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	18,210,106	71,354,479	
	国内株式インデックス マザーファンド	9,507,912	24,856,534	
	外国株式インデックス マザーファンド	24,019,932	137,108,173	
	国内債券インデックス マザーファンド	42,106,983	56,431,778	
	外国債券インデックス マザーファンド	102,644,216	354,676,823	
	新興国債券インデックス マザーファンド	106,389,287	236,758,719	
合計		302,878,436	881,186,506	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### (参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	765,911,905
国債証券	551,218,608,030
地方債証券	33,127,317,178
特殊債券	36,922,769,341
社債券	30,204,788,000
未収入金	799,943,000
未収利息	1,147,050,546
前払費用	38,715,610
流動資産合計	654,225,103,610
資産合計	654,225,103,610
負債の部	
流動負債	

未払金	3,620,826,000
未払解約金	251,534,924
未払利息	393
流動負債合計	3,872,361,317
負債合計	3,872,361,317
純資産の部	
元本等	
元本	485,264,268,572
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	165,088,473,721
元本等合計	650,352,742,293
純資産合計	650,352,742,293
負債純資産合計	654,225,103,610

## 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

### (貸借対照表に関する注記)

	2024年1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	485,264,268,572 口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 99,814,000 円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3402 円 (1万口当たり純資産額) (13,402 円)</p>

(注) 担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

### (金融商品に関する注記)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</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

	2024年 1月 22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) 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>

### (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### 元本の移動

区分	2024年 1月 22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月 21日
期首元本額	458,486,364,988円
期中追加設定元本額	54,437,388,985円
期中一部解約元本額	27,659,485,401円
期末元本額	485,264,268,572円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,190,175,294円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,123,808円
SMT 国内債券インデックス・オープン	17,261,932,188円
世界経済インデックスファンド	6,447,039,349円
DCマイセレクション25	28,539,135,352円
DCマイセレクション50	34,694,250,609円

DCマイセレクション75	11,012,219,221円
DC日本債券インデックス・オープン	411,085,396円
DC日本債券インデックス・オープンS	89,055,581,132円
DC日本債券インデックス・オープンP	63,278,853,552円
DCマイセレクションS25	16,679,620,632円
DCマイセレクションS50	19,463,696,512円
DCマイセレクションS75	4,966,945,604円
DCターゲット・イヤーフンド2025	472,874,886円
DCターゲット・イヤーフンド2035	2,794,153,960円
DCターゲット・イヤーフンド2045	1,110,112,864円
DC世界経済インデックスファンド	4,617,055,881円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	1,647,819円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	18,582,032円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	7,880,588円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	1,103,784円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	54,602,274円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	99,979,286円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	28,004,800円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	21,865,148円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,075,854,620円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	721,016,764円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	3,073,933,139円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	64,578,191円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	49,386,040円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	889,337,134円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	989,581,466円
バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,317,429,504円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	95,425,368円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,756,787,622円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,682,258,126円
分散投資コア戦略ファンドA	18,370,222,201円
分散投資コア戦略ファンドS	25,852,152,181円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	298,547,877円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,821,712,261円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	90,279,907円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	42,106,983円
SMT インデックスバランス・オープン	65,989,031円
SMT 世界経済インデックス・オープン	48,538,170円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	109,565,364円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	174,471,882円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,921,072円
グローバル経済コア	252,440,112円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	43,508,023円
DCターゲット・イヤーフンド2055	34,242,136円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	138,661,883円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	77,739,279円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	23,280,921円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	16,315,074円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	808,067,973円
10資産分散投資ファンド	323,831,572円
グローバル10資産バランスファンド	153,488,580円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2035	149,986円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2040	135,136円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2045	126,226円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2050	126,226円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2055	149,429円
DCターゲット・イヤーフンド(ライフステージ対応型)2060	207,418円

DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型） 2065	219,038 円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	95,999,377,869 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	37,567,231 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,535,178 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）	485,255,168 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	△13,750,734,570
地方債証券	△268,793,784
特殊債券	△428,621,266
社債券	△185,164,000
合計	△14,633,313,620

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第445回利付国債（2年）	1,160,000,000	1,160,881,600	
	第446回利付国債（2年）	2,650,000,000	2,652,040,500	
	第447回利付国債（2年）	2,570,000,000	2,571,978,900	
	第448回利付国債（2年）	1,060,000,000	1,060,731,400	
	第449回利付国債（2年）	1,180,000,000	1,180,708,000	
	第450回利付国債（2年）	1,050,000,000	1,050,598,500	
	第451回利付国債（2年）	1,180,000,000	1,180,708,000	
	第452回利付国債（2年）	3,140,000,000	3,141,256,000	
	第453回利付国債（2年）	1,360,000,000	1,360,340,000	
	第454回利付国債（2年）	3,230,000,000	3,236,556,900	
	第455回利付国債（2年）	460,000,000	460,041,400	
	第456回利付国債（2年）	390,000,000	390,604,500	
	第143回利付国債（5年）	4,440,000,000	4,448,436,000	



第1 4 4 回利付国債（5年）	5,150,000,000	5,160,094,000	
第1 4 5 回利付国債（5年）	5,020,000,000	5,030,391,400	
第1 4 6 回利付国債（5年）	4,800,000,000	4,809,600,000	
第1 4 7 回利付国債（5年）	5,040,000,000	5,040,000,000	
第1 4 8 回利付国債（5年）	5,970,000,000	5,969,223,900	
第1 4 9 回利付国債（5年）	5,680,000,000	5,678,466,400	
第1 5 0 回利付国債（5年）	5,310,000,000	5,306,867,100	
第1 5 1 回利付国債（5年）	4,380,000,000	4,375,839,000	
第1 5 2 回利付国債（5年）	260,000,000	260,530,400	
第1 5 3 回利付国債（5年）	5,810,000,000	5,800,123,000	
第1 5 4 回利付国債（5年）	5,090,000,000	5,093,664,800	
第1 5 5 回利付国債（5年）	2,020,000,000	2,034,927,800	
第1 5 6 回利付国債（5年）	3,650,000,000	3,662,775,000	
第1 5 7 回利付国債（5年）	1,460,000,000	1,463,314,200	
第1 5 8 回利付国債（5年）	3,610,000,000	3,603,285,400	
第1 5 9 回利付国債（5年）	950,000,000	946,884,000	
第1 6 0 回利付国債（5年）	2,950,000,000	2,953,215,500	
第1 6 1 回利付国債（5年）	1,610,000,000	1,618,790,600	
第1 6 2 回利付国債（5年）	1,630,000,000	1,636,764,500	
第1 6 3 回利付国債（5年）	3,440,000,000	3,470,134,400	
第1 6 4 回利付国債（5年）	730,000,000	728,583,800	
第1 回利付国債（40年）	740,000,000	858,074,400	
第2 回利付国債（40年）	1,030,000,000	1,151,158,900	
第3 回利付国債（40年）	650,000,000	724,574,500	
第4 回利付国債（40年）	950,000,000	1,055,896,500	
第5 回利付国債（40年）	1,150,000,000	1,225,014,500	
第6 回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,311,672,600	
第7 回利付国債（40年）	1,460,000,000	1,445,589,800	
第8 回利付国債（40年）	1,420,000,000	1,300,123,600	
第9 回利付国債（40年）	2,260,000,000	1,506,674,200	
第1 0 回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,595,830,800	
第1 1 回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,144,360,000	
第1 2 回利付国債（40年）	1,320,000,000	877,773,600	
第1 3 回利付国債（40年）	2,330,000,000	1,529,272,200	
第1 4 回利付国債（40年）	2,170,000,000	1,516,960,200	
第1 5 回利付国債（40年）	2,950,000,000	2,269,848,000	

第16回利付国債（40年）	1,970,000,000	1,656,277,500	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,584,441,600	
第339回利付国債（10年）	4,070,000,000	4,095,152,600	
第340回利付国債（10年）	4,430,000,000	4,461,187,200	
第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	5,049,166,200	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,769,710,400	
第343回利付国債（10年）	3,670,000,000	3,677,927,200	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,913,275,000	
第345回利付国債（10年）	4,280,000,000	4,289,287,600	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,761,730,000	
第347回利付国債（10年）	3,690,000,000	3,695,608,800	
第348回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,263,067,200	
第349回利付国債（10年）	5,160,000,000	5,157,987,600	
第350回利付国債（10年）	6,670,000,000	6,657,593,800	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	4,819,141,200	
第352回利付国債（10年）	4,230,000,000	4,209,484,500	
第353回利付国債（10年）	4,415,000,000	4,387,141,350	
第354回利付国債（10年）	4,420,000,000	4,388,485,400	
第355回利付国債（10年）	4,570,000,000	4,534,628,200	
第356回利付国債（10年）	4,580,000,000	4,542,902,000	
第357回利付国債（10年）	3,840,000,000	3,805,363,200	
第358回利付国債（10年）	3,970,000,000	3,927,957,700	
第359回利付国債（10年）	4,745,000,000	4,686,826,300	
第360回利付国債（10年）	4,970,000,000	4,897,090,100	
第361回利付国債（10年）	4,810,000,000	4,727,268,000	
第362回利付国債（10年）	4,850,000,000	4,753,727,500	
第363回利付国債（10年）	5,320,000,000	5,199,555,200	
第364回利付国債（10年）	5,000,000,000	4,872,250,000	
第365回利付国債（10年）	5,077,000,000	4,933,777,830	
第366回利付国債（10年）	5,160,000,000	5,042,661,600	
第367回利付国債（10年）	4,980,000,000	4,853,607,600	
第368回利付国債（10年）	5,550,000,000	5,393,878,500	
第369回利付国債（10年）	4,910,000,000	4,887,070,300	
第370回利付国債（10年）	4,860,000,000	4,826,174,400	
第371回利付国債（10年）	4,930,000,000	4,840,027,500	

第 3 7 2 回利付国債 ( 1 0 年)	5,350,000,000	5,437,740,000	
第 3 7 3 回利付国債 ( 1 0 年)	340,000,000	338,415,600	
第 1 回利付国債 ( 3 0 年)	110,000,000	125,788,300	
第 2 回利付国債 ( 3 0 年)	160,000,000	180,590,400	
第 3 回利付国債 ( 3 0 年)	120,000,000	135,138,000	
第 4 回利付国債 ( 3 0 年)	110,000,000	128,997,000	
第 5 回利付国債 ( 3 0 年)	50,000,000	56,481,000	
第 6 回利付国債 ( 3 0 年)	350,000,000	402,346,000	
第 7 回利付国債 ( 3 0 年)	380,000,000	435,506,600	
第 8 回利付国債 ( 3 0 年)	850,000,000	941,851,000	
第 9 回利付国債 ( 3 0 年)	240,000,000	257,647,200	
第 1 0 回利付国債 ( 3 0 年)	160,000,000	167,449,600	
第 1 1 回利付国債 ( 3 0 年)	260,000,000	286,098,800	
第 1 2 回利付国債 ( 3 0 年)	190,000,000	216,212,400	
第 1 3 回利付国債 ( 3 0 年)	400,000,000	451,732,000	
第 1 4 回利付国債 ( 3 0 年)	750,000,000	876,682,500	
第 1 5 回利付国債 ( 3 0 年)	340,000,000	401,302,000	
第 1 6 回利付国債 ( 3 0 年)	200,000,000	236,406,000	
第 1 7 回利付国債 ( 3 0 年)	1,130,000,000	1,325,320,500	
第 1 8 回利付国債 ( 3 0 年)	315,000,000	366,571,800	
第 1 9 回利付国債 ( 3 0 年)	530,000,000	617,280,400	
第 2 0 回利付国債 ( 3 0 年)	480,000,000	570,048,000	
第 2 1 回利付国債 ( 3 0 年)	850,000,000	991,295,500	
第 2 2 回利付国債 ( 3 0 年)	540,000,000	642,389,400	
第 2 3 回利付国債 ( 3 0 年)	430,000,000	511,915,000	
第 2 4 回利付国債 ( 3 0 年)	680,000,000	810,532,800	
第 2 5 回利付国債 ( 3 0 年)	600,000,000	700,776,000	
第 2 6 回利付国債 ( 3 0 年)	1,550,000,000	1,829,899,000	
第 2 7 回利付国債 ( 3 0 年)	1,670,000,000	1,993,762,900	
第 2 8 回利付国債 ( 3 0 年)	1,850,000,000	2,209,122,000	
第 2 9 回利付国債 ( 3 0 年)	1,670,000,000	1,971,401,600	
第 3 0 回利付国債 ( 3 0 年)	1,970,000,000	2,296,429,000	
第 3 1 回利付国債 ( 3 0 年)	1,300,000,000	1,493,986,000	
第 3 2 回利付国債 ( 3 0 年)	1,610,000,000	1,871,142,000	
第 3 3 回利付国債 ( 3 0 年)	2,200,000,000	2,452,824,000	
第 3 4 回利付国債 ( 3 0 年)	1,965,000,000	2,244,521,250	

第 3 5 回利付国債 (3 0 年)	2, 480, 000, 000	2, 751, 014, 400	
第 3 6 回利付国債 (3 0 年)	2, 420, 000, 000	2, 678, 625, 400	
第 3 7 回利付国債 (3 0 年)	2, 315, 000, 000	2, 519, 761, 750	
第 3 8 回利付国債 (3 0 年)	1, 510, 000, 000	1, 613, 404, 800	
第 3 9 回利付国債 (3 0 年)	1, 500, 000, 000	1, 625, 610, 000	
第 4 0 回利付国債 (3 0 年)	1, 190, 000, 000	1, 267, 278, 600	
第 4 1 回利付国債 (3 0 年)	1, 310, 000, 000	1, 370, 115, 900	
第 4 2 回利付国債 (3 0 年)	1, 380, 000, 000	1, 440, 540, 600	
第 4 3 回利付国債 (3 0 年)	1, 390, 000, 000	1, 449, 269, 600	
第 4 4 回利付国債 (3 0 年)	1, 320, 000, 000	1, 374, 634, 800	
第 4 5 回利付国債 (3 0 年)	1, 490, 000, 000	1, 495, 945, 100	
第 4 6 回利付国債 (3 0 年)	1, 790, 000, 000	1, 794, 313, 900	
第 4 7 回利付国債 (3 0 年)	1, 730, 000, 000	1, 762, 299, 100	
第 4 8 回利付国債 (3 0 年)	1, 780, 000, 000	1, 745, 183, 200	
第 4 9 回利付国債 (3 0 年)	1, 730, 000, 000	1, 693, 099, 100	
第 5 0 回利付国債 (3 0 年)	1, 880, 000, 000	1, 624, 696, 000	
第 5 1 回利付国債 (3 0 年)	1, 740, 000, 000	1, 333, 918, 800	
第 5 2 回利付国債 (3 0 年)	1, 650, 000, 000	1, 321, 798, 500	
第 5 3 回利付国債 (3 0 年)	1, 530, 000, 000	1, 249, 428, 600	
第 5 4 回利付国債 (3 0 年)	1, 750, 000, 000	1, 490, 790, 000	
第 5 5 回利付国債 (3 0 年)	1, 590, 000, 000	1, 349, 258, 100	
第 5 6 回利付国債 (3 0 年)	1, 610, 000, 000	1, 362, 076, 100	
第 5 7 回利付国債 (3 0 年)	1, 560, 000, 000	1, 314, 627, 600	
第 5 8 回利付国債 (3 0 年)	2, 130, 000, 000	1, 789, 498, 200	
第 5 9 回利付国債 (3 0 年)	1, 370, 000, 000	1, 120, 153, 100	
第 6 0 回利付国債 (3 0 年)	1, 380, 000, 000	1, 179, 982, 800	
第 6 1 回利付国債 (3 0 年)	1, 330, 000, 000	1, 079, 334, 900	
第 6 2 回利付国債 (3 0 年)	1, 195, 000, 000	917, 282, 000	
第 6 3 回利付国債 (3 0 年)	1, 430, 000, 000	1, 063, 362, 300	
第 6 4 回利付国債 (3 0 年)	1, 520, 000, 000	1, 124, 784, 800	
第 6 5 回利付国債 (3 0 年)	1, 385, 000, 000	1, 020, 772, 700	
第 6 6 回利付国債 (3 0 年)	1, 465, 000, 000	1, 074, 489, 600	
第 6 7 回利付国債 (3 0 年)	1, 665, 000, 000	1, 286, 662, 050	
第 6 8 回利付国債 (3 0 年)	1, 420, 000, 000	1, 093, 343, 200	
第 6 9 回利付国債 (3 0 年)	1, 580, 000, 000	1, 245, 751, 000	
第 7 0 回利付国債 (3 0 年)	1, 940, 000, 000	1, 524, 355, 000	

第7 1 回利付国債（3 0 年）	1,460,000,000	1,143,223,800	
第7 2 回利付国債（3 0 年）	1,670,000,000	1,304,303,400	
第7 3 回利付国債（3 0 年）	1,820,000,000	1,417,816,400	
第7 4 回利付国債（3 0 年）	1,920,000,000	1,617,868,800	
第7 5 回利付国債（3 0 年）	1,410,000,000	1,279,885,200	
第7 6 回利付国債（3 0 年）	1,790,000,000	1,662,480,400	
第7 7 回利付国債（3 0 年）	2,040,000,000	1,985,062,800	
第7 8 回利付国債（3 0 年）	1,480,000,000	1,372,048,800	
第7 9 回利付国債（3 0 年）	1,370,000,000	1,204,983,500	
第8 0 回利付国債（3 0 年）	1,660,000,000	1,686,078,600	
第8 1 回利付国債（3 0 年）	150,000,000	145,155,000	
第7 5 回利付国債（2 0 年）	130,000,000	133,248,700	
第7 6 回利付国債（2 0 年）	270,000,000	276,123,600	
第7 7 回利付国債（2 0 年）	290,000,000	296,910,700	
第7 8 回利付国債（2 0 年）	170,000,000	174,637,600	
第7 9 回利付国債（2 0 年）	270,000,000	277,743,600	
第8 0 回利付国債（2 0 年）	220,000,000	226,619,800	
第8 1 回利付国債（2 0 年）	390,000,000	403,092,300	
第8 2 回利付国債（2 0 年）	600,000,000	621,138,000	
第8 3 回利付国債（2 0 年）	290,000,000	301,640,600	
第8 4 回利付国債（2 0 年）	470,000,000	487,968,100	
第8 5 回利付国債（2 0 年）	290,000,000	303,079,000	
第8 6 回利付国債（2 0 年）	510,000,000	535,199,100	
第8 7 回利付国債（2 0 年）	1,790,000,000	1,874,595,400	
第8 8 回利付国債（2 0 年）	420,000,000	443,129,400	
第8 9 回利付国債（2 0 年）	350,000,000	368,431,000	
第9 0 回利付国債（2 0 年）	630,000,000	666,565,200	
第9 1 回利付国債（2 0 年）	450,000,000	477,315,000	
第9 2 回利付国債（2 0 年）	880,000,000	933,037,600	
第9 3 回利付国債（2 0 年）	410,000,000	435,374,900	
第9 4 回利付国債（2 0 年）	610,000,000	649,674,400	
第9 5 回利付国債（2 0 年）	830,000,000	893,337,300	
第9 6 回利付国債（2 0 年）	1,590,000,000	1,700,520,900	
第9 7 回利付国債（2 0 年）	900,000,000	969,579,000	
第9 8 回利付国債（2 0 年）	440,000,000	472,410,400	
第9 9 回利付国債（2 0 年）	1,510,000,000	1,627,206,200	

第100回利付国債（20年）	480,000,000	520,828,800	
第101回利付国債（20年）	715,000,000	781,723,800	
第102回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,295,061,800	
第103回利付国債（20年）	400,000,000	437,252,000	
第104回利付国債（20年）	160,000,000	173,502,400	
第105回利付国債（20年）	1,180,000,000	1,283,155,600	
第106回利付国債（20年）	680,000,000	742,580,400	
第107回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,200,089,000	
第108回利付国債（20年）	840,000,000	908,283,600	
第109回利付国債（20年）	920,000,000	998,246,000	
第110回利付国債（20年）	1,100,000,000	1,204,764,000	
第111回利付国債（20年）	970,000,000	1,071,733,600	
第112回利付国債（20年）	990,000,000	1,088,544,600	
第113回利付国債（20年）	2,020,000,000	2,230,322,400	
第114回利付国債（20年）	2,200,000,000	2,438,326,000	
第115回利付国債（20年）	700,000,000	779,905,000	
第116回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,855,033,400	
第117回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,644,931,200	
第118回利付国債（20年）	660,000,000	731,431,800	
第119回利付国債（20年）	530,000,000	580,689,200	
第120回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,375,486,200	
第121回利付国債（20年）	1,470,000,000	1,622,453,700	
第122回利付国債（20年）	900,000,000	987,471,000	
第123回利付国債（20年）	1,800,000,000	2,014,452,000	
第124回利付国債（20年）	760,000,000	845,416,400	
第125回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,399,104,400	
第126回利付国債（20年）	930,000,000	1,036,001,400	
第127回利付国債（20年）	1,020,000,000	1,129,150,200	
第128回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,408,023,600	
第129回利付国債（20年）	740,000,000	815,095,200	
第130回利付国債（20年）	1,685,000,000	1,857,510,300	
第131回利付国債（20年）	1,290,000,000	1,412,498,400	
第132回利付国債（20年）	790,000,000	865,721,500	
第133回利付国債（20年）	1,610,000,000	1,776,618,900	
第134回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,635,207,600	
第135回利付国債（20年）	130,000,000	142,611,300	

第136回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,143,618,000	
第137回利付国債（20年）	1,200,000,000	1,317,744,000	
第138回利付国債（20年）	1,330,000,000	1,438,434,900	
第139回利付国債（20年）	480,000,000	523,012,800	
第140回利付国債（20年）	2,490,000,000	2,735,663,400	
第141回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,759,216,000	
第142回利付国債（20年）	1,265,000,000	1,401,632,650	
第143回利付国債（20年）	1,660,000,000	1,811,093,200	
第144回利付国債（20年）	1,230,000,000	1,331,241,300	
第145回利付国債（20年）	2,275,000,000	2,503,364,500	
第146回利付国債（20年）	2,670,000,000	2,938,094,700	
第147回利付国債（20年）	2,780,000,000	3,032,841,000	
第148回利付国債（20年）	2,070,000,000	2,237,587,200	
第149回利付国債（20年）	2,980,000,000	3,219,025,800	
第150回利付国債（20年）	2,830,000,000	3,026,458,600	
第151回利付国債（20年）	2,515,000,000	2,634,412,200	
第152回利付国債（20年）	2,580,000,000	2,699,479,800	
第153回利付国債（20年）	2,550,000,000	2,691,678,000	
第154回利付国債（20年）	2,845,000,000	2,967,904,000	
第155回利付国債（20年）	2,400,000,000	2,445,528,000	
第156回利付国債（20年）	2,620,000,000	2,483,288,400	
第157回利付国債（20年）	3,050,000,000	2,808,592,500	
第158回利付国債（20年）	2,750,000,000	2,620,530,000	
第159回利付国債（20年）	2,010,000,000	1,932,434,100	
第160回利付国債（20年）	2,080,000,000	2,019,180,800	
第161回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,225,080,100	
第162回利付国債（20年）	1,650,000,000	1,569,744,000	
第163回利付国債（20年）	2,370,000,000	2,246,025,300	
第164回利付国債（20年）	2,010,000,000	1,871,470,800	
第165回利付国債（20年）	2,330,000,000	2,160,166,300	
第166回利付国債（20年）	1,790,000,000	1,700,696,900	
第167回利付国債（20年）	2,240,000,000	2,058,627,200	
第168回利付国債（20年）	1,250,000,000	1,126,112,500	
第169回利付国債（20年）	2,240,000,000	1,976,576,000	
第170回利付国債（20年）	2,380,000,000	2,089,378,200	
第171回利付国債（20年）	1,960,000,000	1,711,785,600	

	第172回利付国債(20年)	2,000,000,000	1,766,760,000	
	第173回利付国債(20年)	2,210,000,000	1,942,346,900	
	第174回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,308,336,800	
	第175回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,009,926,100	
	第176回利付国債(20年)	2,380,000,000	2,096,756,200	
	第177回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,016,729,000	
	第178回利付国債(20年)	2,280,000,000	1,990,873,200	
	第179回利付国債(20年)	2,685,000,000	2,333,989,950	
	第180回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,010,382,000	
	第181回利付国債(20年)	2,340,000,000	2,170,350,000	
	第182回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,258,590,800	
	第183回利付国債(20年)	2,520,000,000	2,529,450,000	
	第184回利付国債(20年)	2,220,000,000	2,111,419,800	
	第185回利付国債(20年)	2,440,000,000	2,314,169,200	
	第186回利付国債(20年)	2,320,000,000	2,352,132,000	
	第187回利付国債(20年)	160,000,000	156,291,200	
	国債証券合計	557,107,000,000	551,218,608,030	
地方債証券	第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	100,000,000	99,898,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	76,601,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,247,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,475,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	112,303,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	107,564,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	104,544,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	216,126,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,449,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,387,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	77,352,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	217,970,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	217,160,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,634,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,502,000	
	第765回東京都公募公債	100,000,000	100,204,000	
	第770回東京都公募公債	100,000,000	100,050,000	
	第781回東京都公募公債	300,000,000	298,302,000	



第800回東京都公募公債	200,000,000	196,592,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	291,285,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,218,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,920,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,261,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	198,450,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	197,722,000	
令和5年度第6回北海道公募公債	100,000,000	100,525,000	
第31回1号宮城県公募公債(10年)	200,000,000	201,430,000	
第39回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	98,919,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	238,150,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,238,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	219,660,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,452,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,714,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	105,565,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,589,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,169,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,156,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,050,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,534,000	
第260回神奈川県公募公債	208,000,000	209,333,280	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	219,864,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	218,916,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	108,780,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	151,693,090	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,692,000	
第400回大阪府公募公債(10年)	300,000,000	302,175,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,711,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	155,893,920	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,352,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	198,430,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	99,211,000	
第458回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	97,848,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	155,731,200	
第468回大阪府公募公債(10年)	182,000,000	176,722,000	

第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	193,986,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	110,148,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	109,155,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,678,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	91,929,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	94,123,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	137,163,125	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	107,827,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,594,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,701,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	103,667,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	442,816,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	92,158,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	295,686,000	
第1回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,459,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	98,884,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	82,498,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	108,723,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	106,396,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,634,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,084,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,152,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,090,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	304,367,300	
令和5年度第7回静岡県公募公債	165,000,000	165,516,450	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	110,183,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,551,000	
平成27年度第18回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,236,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,878,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,278,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	280,215,000	

平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,642,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	81,263,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	196,448,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,195,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	152,742,000	
令和5年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,524,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	109,329,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	219,400,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,101,600	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,049,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	382,176,600	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	97,782,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	100,011,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	107,629,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	108,961,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	86,465,000	
第7回埼玉県公募公債(15年)	600,000,000	561,636,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	220,494,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	185,798,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	219,660,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	184,544,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	100,696,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,892,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,319,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,067,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,845,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	97,624,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	144,937,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	107,795,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	108,256,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,863,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	110,621,000	

平成23年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	103,844,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	110,308,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,776,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,687,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	81,263,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	92,699,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	295,038,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	97,351,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	91,772,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債（グリーン ボンド・10年）	100,000,000	99,749,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	99,486,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	217,922,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,771,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	108,723,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,643,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,893,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,142,800	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,471,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,090,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	128,628,500	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	100,689,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	293,214,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	292,344,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	99,700,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	218,320,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	99,485,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,000,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,866,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,296,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,300,372	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,658,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,723,000	

第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,978,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,932,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,758,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,650,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,380,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,773,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,119,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,307,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,100,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	193,944,431	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,037,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	298,863,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,220,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,464,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	194,482,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,703,000	
第244回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,788,000	
第245回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,402,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債(10年)	100,000,000	97,804,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	99,056,760	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,696,000	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,019,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	98,991,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	220,862,000	
第15回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	76,060,000	
第19回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	102,430,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	600,000,000	555,120,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	94,864,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	194,858,000	
第1回名古屋市公募公債(12年)	100,000,000	101,354,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	117,281,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	117,168,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	108,352,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	103,495,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,236,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	294,951,000	

平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,240,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	126,964,800	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	218,006,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	110,964,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	108,834,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	76,551,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	76,217,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	102,954,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	329,280,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,696,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,104,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,224,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,707,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	99,855,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	210,566,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	295,059,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	97,427,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	104,103,000	
平成27年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,159,000	
令和5年度第3回札幌市公募公債(10年)	200,000,000	198,072,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	109,154,000	
第13回川崎市公募公債(30年)	200,000,000	194,088,000	
第17回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	107,304,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,086,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	97,803,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,708,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,911,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	109,861,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	106,876,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,091,350	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	169,860,600	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	541,007,500	

	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,613,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,314,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	290,427,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	97,253,000	
	令和5年度第2回福井県公募公債	100,000,000	98,930,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	100,709,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	98,907,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	107,819,000	
	地方債証券合計	32,953,430,000	33,127,317,178	
特殊債券	第37回新関西国際空港株式会社社債	100,000,000	99,385,000	
	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,985,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,031,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	60,835,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,646,000	
	第21回道路債券	100,000,000	117,207,000	
	第28回道路債券	200,000,000	237,046,000	
	第33回道路債券	200,000,000	239,268,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,495,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,106,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,009,000	
	第42回道路債券	200,000,000	204,904,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,288,000	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,898,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	219,804,000	
	第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,522,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,618,000	
	第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,012,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,261,000	
	第131回日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,139,000	

債券			
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,573,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,875,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,198,000	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,765,000	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,459,000	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,660,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	557,442,000	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,847,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	80,748,000	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,620,000	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,240,000	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,736,000	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,140,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	603,090,000	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,358,000	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	170,556,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	112,000,000	112,721,280	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,026,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,167,000	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	77,291,000	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	107,000,000	106,739,990	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,292,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	205,000,000	205,092,250	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,874,000	



第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,089,000	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,111,000	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,162,000	
第312回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	294,375,000	
第314回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	96,019,000	
第316回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,478,000	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,035,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	119,926,800	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,180,000	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	278,310,000	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	214,000,000	213,334,460	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,268,000	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,122,000	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	291,828,000	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	120,000,000	117,397,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	343,782,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	103,811,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	354,321,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	235,638,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	116,209,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	219,628,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	216,262,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	150,958,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	105,798,000	
第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	545,655,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,001,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	108,199,000	

第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	536,455,000	
第45回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	102,671,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	421,694,170	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,933,000	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,272,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,364,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	502,940,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,598,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,164,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,903,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,706,000	
第86回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	258,327,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,746,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,985,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,200,800	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,086,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,053,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	109,954,900	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	155,627,160	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,715,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,748,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,507,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,239,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	710,108,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,477,000	
F143回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,953,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,540,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,092,000	
第170回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,733,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,688,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,076,000	
F208回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,433,000	

F 2 1 4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,398,000	
F 2 2 6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,453,000	
F 4 4 1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,877,000	
第2 9回首都高速道路株式会社債	100,000,000	99,740,000	
第7回阪神高速道路債券	100,000,000	102,400,000	
第2 7回阪神高速道路株式会社債	100,000,000	100,140,000	
第2 8回阪神高速道路株式会社債	100,000,000	100,263,000	
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	109,838,000	
第1 8回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,069,000	
第4 0回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,877,780	
第4 6回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,086,000	
第4 7回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,500,200	
第5 3回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,474,530	
第1 1 7回都市再生債券	200,000,000	203,536,000	
第1 5 9回都市再生債券	200,000,000	122,502,000	
第1 6 1回都市再生債券	100,000,000	67,761,000	
第1 7 1回都市再生債券	200,000,000	142,704,000	
第1 9 1回都市再生債券	100,000,000	95,470,000	
第6 2回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,076,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	93,741,000	93,184,178	
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,421,000	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	65,120,000	64,859,520	
第4回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	106,365,000	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	112,992,000	112,101,623	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	126,762,000	125,327,054	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	45,064,000	44,665,634	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	161,850,000	160,309,188	
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	110,932,000	109,933,612	
第1 0回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,952,000	9,987,528	
第1 2回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,751,000	
第2 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,418,000	13,926,273	
第2 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,167,000	13,650,097	

第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,806,000	15,473,898	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,994,000	17,773,174	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,058,000	18,935,257	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,522,000	19,392,719	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,166,000	39,905,987	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,369,000	18,095,545	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,759,000	18,464,565	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,391,000	18,094,639	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,511,000	17,164,505	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,834,000	36,083,843	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,357,000	19,020,054	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,602,000	25,432,563	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,335,000	24,119,989	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,497,000	24,305,766	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,630,000	52,217,250	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,038,000	64,390,795	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,702,000	33,340,016	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,775,000	34,700,435	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,225,000	35,195,278	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,585,000	30,410,717	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,562,000	29,147,806	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,740,000	34,736,679	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	165,669,000	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,951,000	89,752,236	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,532,000	121,868,850	
第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,999,000	35,522,235	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,505,000	37,043,083	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,088,000	37,500,418	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,107,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,315,000	118,458,821	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,092,000	40,296,870	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,092,000	84,772,054	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,779,000	47,677,230	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,168,000	50,775,541	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	312,999,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,248,000	50,118,360	

第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,338,000	157,352,160	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,056,000	105,843,888	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,772,000	51,555,075	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,663,000	55,342,937	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,933,000	59,515,755	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,477,000	65,041,755	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,005,000	64,385,774	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,392,000	64,981,388	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,950,000	65,782,395	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,188,000	65,857,334	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,372,000	67,730,938	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,501,000	67,902,333	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,075,000	67,288,117	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,126,000	67,330,076	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,975,000	68,136,709	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,506,000	138,337,038	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,825,000	67,955,879	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,994,000	139,310,235	
第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,510,000	69,497,934	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,824,000	138,451,744	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,005,000	69,888,416	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,134,000	140,414,390	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,946,000	141,139,004	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,507,000	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,083,000	72,003,846	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,279,000	71,411,087	

第1 4 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,571,000	71,021,420	
第1 4 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,392,000	146,209,224	
第1 4 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,590,000	73,348,930	
第1 4 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,469,000	72,416,143	
第1 4 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,486,000	146,870,520	
第1 4 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,253,000	74,252,928	
第1 4 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	239,442,000	223,023,462	
第1 4 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,282,000	150,124,511	
第1 5 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,410,000	77,726,639	
第1 5 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,108,000	78,126,506	
第1 6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,640,000	161,060,270	
第1 6 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,356,000	81,362,032	
第1 6 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,344,000	163,201,642	
第1 6 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,998,000	164,379,121	
第1 6 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,948,000	81,905,016	
第1 6 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,004,000	165,517,033	
第1 6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	174,438,000	164,699,126	
第1 6 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,633,000	83,556,988	
第1 7 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,979,000	84,302,224	
第1 7 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	268,086,000	251,124,198	
第1 7 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,056,000	84,419,394	
第1 7 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,469,000	86,839,753	
第1 8 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,641,000	88,071,019	
第1 8 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,678,000	89,149,605	
第1 8 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,992,000	178,434,486	

第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,313,000	92,720,486	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,236,000	190,157,428	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,576,000	96,079,599	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	89,368,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,289,000	96,811,311	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,029,000	97,377,107	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,566,000	197,643,050	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,914,000	99,424,396	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,894,000	100,683,162	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	77,185,000	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	288,222,000	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	98,714,000	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,713,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,728,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,739,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,306,000	
い第876号商工債	300,000,000	299,616,000	
い第878号商工債	100,000,000	99,700,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,718,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,637,000	
第384回信金中金債（5年）	200,000,000	199,036,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	398,080,000	
第394回信金中金債（5年）	100,000,000	99,581,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	100,406,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,602,000	
第20回アンデス開発公社円貨債券（2023）	300,000,000	300,048,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	108,229,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,088,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	196,902,000	
第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	489,985,000	
第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,494,000	
第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	500,000,000	

	第106回東日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,921,000	
	第85回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	199,638,000	
	第98回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,440,000	
	第100回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,085,000	
	第101回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,166,000	
	第103回中日本高速道路株式会社債	400,000,000	402,800,000	
	第27回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,398,000	
	第54回西日本高速道路株式会社債	600,000,000	599,448,000	
	第71回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,162,000	
	第74回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,460,000	
	第77回西日本高速道路株式会社債	200,000,000	200,084,000	
	第78回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,871,000	
	第80回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,261,000	
	第82回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,592,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,731,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	188,148,000	
	特殊債券合計	37,025,236,000	36,922,769,341	
社債券	第41回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	200,000,000	200,348,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,096,000	
	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	200,000,000	199,402,000	
	第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,125,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	399,016,000	
	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債（2023）	100,000,000	99,666,000	
	第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債（2023）	400,000,000	399,760,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	97,736,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,623,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,163,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,860,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,605,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	96,257,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,079,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会	100,000,000	99,973,000	



社無担保社債			
第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,498,000	
第16回キリンホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,033,000	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,118,000	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,033,000	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,480,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,023,000	
第27回株式会社ニチレイ無担保社債	200,000,000	200,386,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,061,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,948,000	
第10回J. フロント リテイリング株式会社無担保社債	100,000,000	98,973,000	
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,772,000	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,023,000	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,621,000	
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,774,000	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,285,000	
第17回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,737,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,852,000	
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,253,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,707,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,916,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,065,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	95,746,000	
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,242,000	
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	198,866,000	
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	200,000,000	199,774,000	

第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	81,785,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,148,000	
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	100,756,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	99,976,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	197,210,000	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	286,095,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	99,991,000	
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	200,000,000	200,144,000	
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,897,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,307,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	400,000,000	399,496,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,820,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,742,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,859,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	98,817,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	97,309,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,802,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,015,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	99,823,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,579,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,824,000	
第15回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	99,260,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,718,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,810,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	97,735,000	
第23回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,130,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,566,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,888,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	97,569,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,753,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	95,931,000	
第26回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,466,000	

第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	199,994,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,511,000	
第35回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,593,000	
第22回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,823,000	
第27回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,042,000	
第28回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,678,000	
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	198,898,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	193,722,000	
第8回株式会社SUBARU無担保社債	100,000,000	100,895,000	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,950,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,527,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	85,514,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,812,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	108,837,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	196,162,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,620,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,372,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	96,811,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	99,230,000	
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	200,000,000	200,054,000	
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	100,000,000	99,906,000	
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,833,000	
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	100,000,000	97,307,000	
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	100,000,000	99,752,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	110,270,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,291,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,280,000	
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,546,000	
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	195,550,000	
第25回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,704,000	
第30回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	300,000,000	303,015,000	

第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,299,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,754,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,966,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,039,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,854,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,958,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,527,000	
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,765,000	
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	100,000,000	99,546,000	
第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,581,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,414,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	100,618,000	
第39回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,897,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,321,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,503,000	
第36回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	200,000,000	199,558,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,248,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,612,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,152,000	
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	99,157,000	
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,217,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,132,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,117,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	199,370,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	200,350,000	
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	200,000,000	199,046,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,962,000	

第 8 4 回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,810,000	
第 8 6 回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	196,738,000	
第 1 2 0 回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,258,000	
第 1 3 1 回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	86,108,000	
第 1 3 5 回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,129,000	
第 1 0 9 回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,430,000	
第 1 7 回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	89,467,000	
第 1 3 2 回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	97,113,000	
第 8 6 回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	81,236,000	
第 4 5 回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	85,771,000	
第 6 3 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,260,000	
第 8 4 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	86,997,000	
第 8 6 回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	75,468,000	
第 4 2 回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	87,440,000	
第 5 1 回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,418,000	
第 4 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,786,000	
第 5 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	217,690,000	
第 1 0 9 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,514,000	
第 1 1 5 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,475,000	
第 1 2 5 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	84,442,000	
第 1 3 3 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	76,172,000	
第 1 4 7 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,956,000	
第 1 5 9 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	74,390,000	
第 1 6 5 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,183,000	
第 1 7 2 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	67,775,000	
第 1 8 4 回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,925,000	
第 1 7 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,203,000	
第 4 6 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	72,346,000	
第 5 0 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	82,588,000	
第 5 9 回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,630,000	

第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	84,984,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,497,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,389,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,894,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	75,961,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	64,196,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	55,055,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	68,842,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	78,001,000	
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	151,738,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,905,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,938,000	
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	100,000,000	99,469,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	172,142,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	92,542,000	
第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,167,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	93,456,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	84,425,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,160,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,310,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,802,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,487,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,577,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,055,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,934,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,168,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,034,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,656,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	197,162,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,885,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	296,700,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,898,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	196,904,000	
第339回北陸電力株式会社社債	200,000,000	182,268,000	

第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,674,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,136,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	196,794,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,684,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,362,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	98,213,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,307,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,288,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,130,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,323,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	196,290,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,277,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	96,246,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	197,464,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,272,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	89,663,000	
第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,623,000	
第31回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	99,992,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	91,454,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,999,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,107,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,064,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,036,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	98,916,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,678,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,481,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	98,958,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,926,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	271,647,000	
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	96,266,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	96,135,000	
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	100,000,000	101,113,000	

第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	74,026,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,664,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,818,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	84,714,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	200,000,000	199,152,000	
社債券合計	31,000,000,000	30,204,788,000	
合計		651,473,482,549	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,174,352,794
株式	630,516,152,660
新株予約権証券	6,669,300
派生商品評価勘定	221,821,850
未収入金	129,702,150
未収配当金	840,596,859
差入委託証拠金	188,718,391
流動資産合計	637,078,014,004
資産合計	637,078,014,004
負債の部	
流動負債	
前受金	221,895,000
未払解約金	922,336,532
未払利息	2,655
流動負債合計	1,144,234,187
負債合計	1,144,234,187
純資産の部	
元本等	
元本	243,250,242,592



剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	392,683,537,225
元本等合計	635,933,779,817
純資産合計	635,933,779,817
負債純資産合計	637,078,014,004

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年1月22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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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又は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、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2024年1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,250,242,592 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.6143 円 (1万口当たり純資産額) (26,143 円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年1月22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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p> <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

	2024年 1月 22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2024年 1月 22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月 21日
期首元本額	260,822,185,787円
期中追加設定元本額	22,292,231,460円
期中一部解約元本額	39,864,174,655円
期末元本額	243,250,242,592円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	304,088,738円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	3,347,146,625円
SBI資産設計オープン (分配型)	12,548,332円

SMT TOPIXインデックス・オープン	10,842,950,996円
世界経済インデックスファンド	5,283,670,657円
日本株式インデックス・オープン	2,924,474,628円
DCマイセクション25	5,306,969,310円
DCマイセクション50	17,237,837,336円
DCマイセクション75	18,698,285,058円
DC日本株式インデックス・オープン	5,986,428,942円
DCマイセクションS25	3,167,858,065円
DCマイセクションS50	9,590,900,743円
DCマイセクションS75	8,396,832,878円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,226,337,748円
DCターゲット・イヤーフンド2025	90,960,840円
DCターゲット・イヤーフンド2035	621,631,196円
DCターゲット・イヤーフンド2045	487,566,090円
DC世界経済インデックスファンド	3,839,675,631円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	829,273,240円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,781,461円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	8,478,986円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,731,768円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	145,916,827円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,942,020円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	14,774,738円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	67,375,820円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,174,102円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	43,300,165円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	489,362,017円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	315,063,686円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,114,754,399円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	29,840,484円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,449,949円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	326,675,766円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	181,936,971円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	243,327,766円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	18,043,662円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	419,294,463円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,526,183,279円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,913,000,602円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,095,935,820円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,558,857,290円
分散投資コア戦略ファンドA	1,869,978,613円
分散投資コア戦略ファンドS	6,211,286,546円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	613,472,409円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	410,071,296円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,149,307,743円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	192,647,076円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,507,912円
SMTインデックスバランス・オープン	46,399,352円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	19,653,400,847円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	257,305,573円
SMT世界経済インデックス・オープン	53,289,182円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	223,815,058円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	38,547,774円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	11,505,429円
グローバル経済コア	227,277,401円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,152,780円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	1,326,319,795円
DCターゲット・イヤーフンド2055	30,594,636円

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	951,696,698 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	238,400,456 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	55,569,332 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	53,328,194 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	23,247,462 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	27,512,531 円
10資産分散投資ファンド	90,961,839 円
グローバル10資産バランスファンド	12,079,336 円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	34,725 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	37,911 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	39,822 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	39,822 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	34,844 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	22,400 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	19,911 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	41,603,938,903 円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	474,076,913 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,910,881 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	20,672,577 円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	346,365,787 円
SMTAM日本株式インデックスファンドVLP（適格機関投資家専用）	47,716,805,794 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,380,365 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）	204,527,233 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	94,188,756,480	
新株予約権証券	6,669,300	
合計	94,195,425,780	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年1月22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	3,167,610,000	—	3,389,505,000	221,895,000
合計		3,167,610,000	—	3,389,505,000	221,895,000

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	9,300	3,935.00	36,595,500	
ニッセイ	244,800	791.20	193,685,760	
マルハニチロ	36,300	2,922.00	106,068,600	
雪国まいたけ	20,800	961.00	19,988,800	
カネコ種苗	7,500	1,469.00	11,017,500	
サカタのタネ	27,900	3,770.00	105,183,000	
ホクト	19,600	1,771.00	34,711,600	
ホクリョウ	2,300	1,056.00	2,428,800	
住石ホールディングス	25,100	1,732.00	43,473,200	
日鉄鉱業	9,800	5,350.00	52,430,000	
三井松島ホールディングス	14,500	2,842.00	41,209,000	
I N P E X	905,300	2,001.50	1,811,957,950	
石油資源開発	28,400	5,860.00	166,424,000	
K&Oエナジーグループ	11,100	2,255.00	25,030,500	
ショーボンドホールディングス	33,300	6,688.00	222,710,400	
ミライト・ワン	80,900	1,942.00	157,107,800	
タマホーム	15,400	4,135.00	63,679,000	
サンヨーホームズ	2,000	752.00	1,504,000	
日本アクア	6,700	1,002.00	6,713,400	
ファーストコーポレーション	4,100	765.00	3,136,500	
ベステラ	3,500	1,096.00	3,836,000	
キャンディル	2,900	587.00	1,702,300	
ダイセキ環境ソリューション	3,300	1,089.00	3,593,700	
第一カッター興業	6,300	1,405.00	8,851,500	
安藤・間	141,800	1,187.00	168,316,600	
東急建設	76,700	829.00	63,584,300	
コムシスホールディングス	78,100	3,295.00	257,339,500	
ビーアールホールディングス	38,500	373.00	14,360,500	
高松コンストラクショングループ	18,200	2,900.00	52,780,000	
東建コーポレーション	7,000	9,470.00	66,290,000	
ソネック	1,700	944.00	1,604,800	

ヤマウラ	12,400	1,659.00	20,571,600	
オリエンタル白石	90,600	360.00	32,616,000	
大成建設	160,200	5,427.00	869,405,400	
大林組	612,300	1,370.00	838,851,000	
清水建設	485,500	1,030.00	500,065,000	
飛鳥建設	18,700	1,493.00	27,919,100	
長谷工コーポレーション	157,100	1,982.00	311,372,200	
松井建設	16,000	813.00	13,008,000	
銭高組	1,400	4,500.00	6,300,000	
鹿島建設	379,600	2,674.00	1,015,050,400	
不動テトラ	11,800	2,382.00	28,107,600	
大末建設	4,100	1,408.00	5,772,800	
鉄建建設	12,300	2,070.00	25,461,000	
西松建設	32,700	4,054.00	132,565,800	
三井住友建設	127,400	409.00	52,106,600	
大豊建設	5,900	3,745.00	22,095,500	
佐田建設	7,200	647.00	4,658,400	
ナカノフドー建設	8,000	519.00	4,152,000	
奥村組	27,800	5,060.00	140,668,000	
東鉄工業	21,200	3,070.00	65,084,000	
イチケン	2,500	2,331.00	5,827,500	
富士ピー・エス	5,100	453.00	2,310,300	
浅沼組	12,700	4,195.00	53,276,500	
戸田建設	231,700	952.10	220,601,570	
熊谷組	28,700	3,790.00	108,773,000	
北野建設	2,100	3,095.00	6,499,500	
植木組	3,200	1,563.00	5,001,600	
矢作建設工業	23,300	1,453.00	33,854,900	
ピーエス三菱	21,700	921.00	19,985,700	
日本ハウスホールディングス	36,600	302.00	11,053,200	
新日本建設	24,000	1,202.00	28,848,000	
東亜道路工業	6,800	7,000.00	47,600,000	
日本道路	20,100	2,152.00	43,255,200	
東亜建設工業	13,200	3,820.00	50,424,000	
日本国土開発	48,700	550.00	26,785,000	
若築建設	5,900	3,090.00	18,231,000	

東洋建設	42,800	1,279.00	54,741,200	
五洋建設	242,700	823.60	199,887,720	
世紀東急工業	22,000	1,877.00	41,294,000	
福田組	6,500	5,450.00	35,425,000	
住友林業	148,000	4,591.00	679,468,000	
日本基礎技術	6,800	475.00	3,230,000	
巴コーポレーション	12,700	561.00	7,124,700	
大和ハウス工業	473,500	4,614.00	2,184,729,000	
ライト工業	35,200	2,148.00	75,609,600	
積水ハウス	519,300	3,485.00	1,809,760,500	
日特建設	16,300	1,166.00	19,005,800	
北陸電気工事	11,700	1,190.00	13,923,000	
ユアテック	37,700	1,163.00	43,845,100	
日本リーテック	14,900	1,234.00	18,386,600	
四電工	7,200	3,440.00	24,768,000	
中電工	26,600	2,732.00	72,671,200	
関電工	107,200	1,458.00	156,297,600	
きんでん	120,500	2,478.50	298,659,250	
東京エネシス	17,000	1,037.00	17,629,000	
トーエネック	5,700	4,630.00	26,391,000	
住友電設	16,300	2,870.00	46,781,000	
日本電設工業	32,100	2,028.00	65,098,800	
エクシオグループ	86,000	3,275.00	281,650,000	
新日本空調	11,100	2,520.00	27,972,000	
九電工	37,000	5,143.00	190,291,000	
三機工業	37,500	1,838.00	68,925,000	
日揮ホールディングス	169,400	1,713.00	290,182,200	
中外炉工業	5,600	2,639.00	14,778,400	
ヤマト	9,400	930.00	8,742,000	
太平電業	10,600	4,335.00	45,951,000	
高砂熱学工業	45,900	3,380.00	155,142,000	
三晃金属工業	1,400	4,800.00	6,720,000	
朝日工業社	8,000	3,055.00	24,440,000	
明星工業	33,100	1,169.00	38,693,900	
大気社	19,700	4,300.00	84,710,000	
ダイダン	22,500	1,528.00	34,380,000	

日比谷総合設備	12,400	2,611.00	32,376,400	
フィル・カンパニー	2,600	830.00	2,158,000	
テスホールディングス	36,900	450.00	16,605,000	
インフロニア・ホールディングス	197,400	1,573.00	310,510,200	
東洋エンジニアリング	25,200	796.00	20,059,200	
レイズネクスト	24,800	1,536.00	38,092,800	
ニッポン	51,500	2,262.00	116,493,000	
日清製粉グループ本社	159,000	2,045.00	325,155,000	
日東富士製粉	3,100	5,010.00	15,531,000	
昭和産業	16,600	3,260.00	54,116,000	
鳥越製粉	10,100	664.00	6,706,400	
中部飼料	23,800	1,111.00	26,441,800	
フィード・ワン	25,100	835.00	20,958,500	
東洋精糖	2,100	2,207.00	4,634,700	
日本甜菜製糖	10,000	2,032.00	20,320,000	
DM三井製糖ホールディングス	17,000	3,135.00	53,295,000	
塩水港精糖	13,600	247.00	3,359,200	
ウェルネオシュガー	8,800	2,229.00	19,615,200	
森永製菓	73,600	2,680.50	197,284,800	
中村屋	4,300	3,125.00	13,437,500	
江崎グリコ	49,200	4,313.00	212,199,600	
名糖産業	6,800	1,707.00	11,607,600	
井村屋グループ	10,300	2,432.00	25,049,600	
不二家	11,800	2,494.00	29,429,200	
山崎製パン	115,000	3,615.00	415,725,000	
第一屋製パン	2,200	640.00	1,408,000	
モロゾフ	5,600	3,860.00	21,616,000	
亀田製菓	9,800	4,135.00	40,523,000	
寿スピリッツ	81,300	2,015.50	163,860,150	
カルビー	78,700	2,924.50	230,158,150	
森永乳業	62,500	2,945.00	184,062,500	
六甲バター	12,600	1,354.00	17,060,400	
ヤクルト本社	245,700	3,198.00	785,748,600	
明治ホールディングス	210,700	3,500.00	737,450,000	
雪印メグミルク	41,600	2,248.00	93,516,800	
プリマハム	23,100	2,321.00	53,615,100	



日本ハム	73,900	4,944.00	365,361,600	
林兼産業	3,500	558.00	1,953,000	
丸大食品	17,300	1,630.00	28,199,000	
S Foods	19,000	3,395.00	64,505,000	
柿安本店	6,700	2,531.00	16,957,700	
伊藤ハム米久ホールディングス	26,300	4,065.00	106,909,500	
サッポロホールディングス	56,600	6,738.00	381,370,800	
アサヒグループホールディングス	397,200	5,500.00	2,184,600,000	
キリンホールディングス	716,000	2,108.00	1,509,328,000	
宝ホールディングス	117,300	1,242.50	145,745,250	
オエノンホールディングス	51,400	351.00	18,041,400	
養命酒製造	5,700	1,885.00	10,744,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	134,700	2,063.00	277,886,100	
ライフドリンク カンパニー	2,500	5,160.00	12,900,000	
サントリー食品インターナショナル	121,000	4,944.00	598,224,000	
ダイドーグループホールディングス	19,400	2,930.00	56,842,000	
伊藤園	58,200	4,280.00	249,096,000	
キーコーヒー	19,300	2,119.00	40,896,700	
ユニカフェ	3,800	911.00	3,461,800	
ジャパンフーズ	1,800	1,305.00	2,349,000	
日清オイリオグループ	24,200	4,460.00	107,932,000	
不二製油グループ本社	40,000	2,466.50	98,660,000	
かどや製油	1,400	3,710.00	5,194,000	
J-オイルミルズ	19,700	2,045.00	40,286,500	
キッコーマン	113,900	9,600.00	1,093,440,000	
味の素	408,500	6,145.00	2,510,232,500	
ブルドックソース	9,100	2,226.00	20,256,600	
キューピー	92,400	2,534.00	234,141,600	
ハウス食品グループ本社	59,200	3,226.00	190,979,200	
カゴメ	73,900	3,211.00	237,292,900	
焼津水産化学工業	4,400	1,192.00	5,244,800	
アリアケジャパン	17,100	4,530.00	77,463,000	
ピエトロ	1,600	1,805.00	2,888,000	
エバラ食品工業	4,600	2,926.00	13,459,600	
やまみ	1,100	3,835.00	4,218,500	

ニチレイ	78,800	3,505.00	276,194,000	
東洋水産	86,900	8,048.00	699,371,200	
イトアンドホールディングス	8,000	2,112.00	16,896,000	
大冷	1,400	1,930.00	2,702,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,800	1,034.00	8,065,200	
日清食品ホールディングス	181,200	5,027.00	910,892,400	
永谷園ホールディングス	8,400	2,194.00	18,429,600	
一正蒲鉾	4,900	739.00	3,621,100	
フジッコ	17,700	1,963.00	34,745,100	
ロック・フィールド	19,200	1,616.00	31,027,200	
日本たばこ産業	1,044,500	3,801.00	3,970,144,500	
ケンコーマヨネーズ	11,800	1,735.00	20,473,000	
わらべや日洋ホールディングス	11,500	2,938.00	33,787,000	
なとり	10,800	2,122.00	22,917,600	
イフジ産業	1,900	1,325.00	2,517,500	
ファーマフーズ	24,700	1,064.00	26,280,800	
ユウグレナ	107,000	689.00	73,723,000	
紀文食品	14,900	1,173.00	17,477,700	
ピクルスホールディングス	10,100	1,230.00	12,423,000	
ミヨシ油脂	4,400	1,317.00	5,794,800	
理研ビタミン	14,900	2,304.00	34,329,600	
片倉工業	16,400	1,700.00	27,880,000	
グンゼ	12,500	5,270.00	65,875,000	
東洋紡	76,100	1,112.00	84,623,200	
ユニチカ	59,600	169.00	10,072,400	
富士紡ホールディングス	7,800	3,880.00	30,264,000	
倉敷紡績	13,300	2,896.00	38,516,800	
シキボウ	8,100	1,203.00	9,744,300	
日本毛織	46,500	1,481.00	68,866,500	
トーア紡コーポレーション	4,500	427.00	1,921,500	
帝国繊維	20,000	2,277.00	45,540,000	
帝人	168,400	1,340.00	225,656,000	
東レ	1,172,300	732.10	858,240,830	
住江織物	2,500	2,409.00	6,022,500	
日本フェルト	7,600	436.00	3,313,600	
イチカワ	1,800	1,767.00	3,180,600	

日東製網	1,200	1,572.00	1,886,400	
アツギ	7,100	522.00	3,706,200	
ダイニツク	3,100	718.00	2,225,800	
セーレン	34,000	2,494.00	84,796,000	
ソトー	3,800	688.00	2,614,400	
東海染工	1,300	855.00	1,111,500	
小松マテーレ	25,500	842.00	21,471,000	
ワコールホールディングス	35,900	3,455.00	124,034,500	
ホギメディカル	23,300	3,315.00	77,239,500	
T S I ホールディングス	58,600	711.00	41,664,600	
マツオカコーポレーション	3,200	1,662.00	5,318,400	
ワールド	24,800	1,730.00	42,904,000	
三陽商会	5,800	2,674.00	15,509,200	
ナイガイ	4,400	268.00	1,179,200	
オンワードホールディングス	103,300	538.00	55,575,400	
ルックホールディングス	4,300	2,544.00	10,939,200	
ゴールドウイン	31,000	9,980.00	309,380,000	
デサント	30,200	3,670.00	110,834,000	
キング	5,300	697.00	3,694,100	
ヤマトインターナショナル	9,600	310.00	2,976,000	
特種東海製紙	9,600	3,915.00	37,584,000	
王子ホールディングス	728,500	574.50	418,523,250	
日本製紙	98,700	1,280.00	126,336,000	
三菱製紙	13,900	568.00	7,895,200	
北越コーポレーション	85,900	1,351.00	116,050,900	
中越パルプ工業	4,700	1,962.00	9,221,400	
大王製紙	77,200	1,109.00	85,614,800	
阿波製紙	2,800	603.00	1,688,400	
レンゴー	159,300	945.10	150,554,430	
トーモク	10,100	2,318.00	23,411,800	
ザ・パック	13,000	3,350.00	43,550,000	
北の達人コーポレーション	73,700	235.00	17,319,500	
クラレ	254,800	1,531.50	390,226,200	
旭化成	1,183,000	1,118.00	1,322,594,000	
共和レザー	6,700	796.00	5,333,200	
巴川コーポレーション	3,600	1,079.00	3,884,400	

レゾナック・ホールディングス	169,000	3,021.00	510,549,000	
住友化学	1,297,700	338.30	439,011,910	
住友精化	8,200	5,320.00	43,624,000	
日産化学	82,100	5,866.00	481,598,600	
ラサ工業	6,700	2,199.00	14,733,300	
クレハ	38,100	2,893.00	110,223,300	
多木化学	6,800	3,155.00	21,454,000	
テイカ	15,100	1,395.00	21,064,500	
石原産業	29,000	1,550.00	44,950,000	
片倉コープアグリ	2,400	1,139.00	2,733,600	
日本曹達	20,600	5,810.00	119,686,000	
東ソー	233,400	1,864.00	435,057,600	
トクヤマ	56,500	2,483.00	140,289,500	
セントラル硝子	18,700	2,755.00	51,518,500	
東亜合成	87,700	1,355.50	118,877,350	
大阪ソーダ	12,200	9,520.00	116,144,000	
関東電化工業	33,800	890.00	30,082,000	
デンカ	63,600	2,580.50	164,119,800	
信越化学工業	1,585,700	5,872.00	9,311,230,400	
日本カーバイド工業	6,500	1,505.00	9,782,500	
堺化学工業	13,300	1,902.00	25,296,600	
第一稀元素化学工業	19,100	977.00	18,660,700	
エア・ウォーター	165,000	1,988.00	328,020,000	
日本酸素ホールディングス	169,600	3,797.00	643,971,200	
日本化学工業	6,400	1,915.00	12,256,000	
東邦アセチレン	12,000	374.00	4,488,000	
日本パーカライジング	77,900	1,170.00	91,143,000	
高压ガス工業	25,400	853.00	21,666,200	
チタン工業	1,400	1,127.00	1,577,800	
四国化成ホールディングス	22,400	1,903.00	42,627,200	
戸田工業	4,000	1,547.00	6,188,000	
ステラ ケミファ	9,500	3,285.00	31,207,500	
保土谷化学工業	5,500	3,625.00	19,937,500	
日本触媒	26,600	5,516.00	146,725,600	
大日精化工業	12,200	2,757.00	33,635,400	
カネカ	44,400	3,600.00	159,840,000	

三菱瓦斯化学	130,600	2,448.50	319,774,100
三井化学	144,200	4,463.00	643,564,600
J S R	190,500	4,051.00	771,715,500
東京応化工業	83,400	3,437.00	286,645,800
大阪有機化学工業	14,600	2,940.00	42,924,000
三菱ケミカルグループ	1,278,400	911.00	1,164,622,400
K H ネオケム	26,700	2,300.00	61,410,000
ダイセル	224,800	1,457.50	327,646,000
住友ベークライト	24,500	7,743.00	189,703,500
積水化学工業	354,500	2,206.50	782,204,250
日本ゼオン	119,900	1,300.00	155,870,000
アイカ工業	44,100	3,434.00	151,439,400
U B E	83,200	2,395.00	199,264,000
積水樹脂	26,100	2,551.00	66,581,100
タキロンシーアイ	44,600	666.00	29,703,600
旭有機材	11,600	4,045.00	46,922,000
ニチバン	9,500	1,751.00	16,634,500
リケンテクノス	37,700	864.00	32,572,800
大倉工業	8,100	2,552.00	20,671,200
積水化成成品工業	24,500	497.00	12,176,500
群栄化学工業	4,100	3,285.00	13,468,500
タイガースポリマー	5,300	871.00	4,616,300
ミライアル	3,500	1,568.00	5,488,000
ダイキアクシス	4,800	719.00	3,451,200
ダイキョーニシカワ	38,600	732.00	28,255,200
竹本容器	4,400	783.00	3,445,200
森六ホールディングス	10,000	2,834.00	28,340,000
恵和	12,600	1,400.00	17,640,000
日本化薬	133,600	1,345.50	179,758,800
カーリットホールディングス	18,800	934.00	17,559,200
日本精化	11,600	3,045.00	35,322,000
扶桑化学工業	18,500	4,415.00	81,677,500
トリケミカル研究所	21,200	3,975.00	84,270,000
A D E K A	61,000	2,885.00	175,985,000
日油	54,100	6,851.00	370,639,100
新日本理化	15,900	198.00	3,148,200

ハリマ化成グループ	9,500	868.00	8,246,000	
花王	395,400	5,757.00	2,276,317,800	
第一工業製薬	7,000	1,907.00	13,349,000	
石原ケミカル	8,000	2,146.00	17,168,000	
日華化学	4,600	903.00	4,153,800	
ニイタカ	2,100	1,884.00	3,956,400	
三洋化成工業	10,800	4,380.00	47,304,000	
有機合成薬品工業	8,500	286.00	2,431,000	
大日本塗料	21,100	1,076.00	22,703,600	
日本ペイントホールディングス	928,500	1,096.00	1,017,636,000	
関西ペイント	171,400	2,526.50	433,042,100	
神東塗料	9,600	128.00	1,228,800	
中国塗料	35,900	1,790.00	64,261,000	
日本特殊塗料	7,300	1,312.00	9,577,600	
藤倉化成	23,300	438.00	10,205,400	
太陽ホールディングス	30,400	3,105.00	94,392,000	
D I C	68,300	2,676.00	182,770,800	
サカタインクス	38,900	1,388.00	53,993,200	
a r t i e n c e	38,100	2,727.00	103,898,700	
T&K TOKA	16,700	1,476.00	24,649,200	
富士フイルムホールディングス	324,800	9,275.00	3,012,520,000	
資生堂	365,600	4,016.00	1,468,249,600	
ライオン	229,200	1,332.00	305,294,400	
高砂香料工業	13,200	3,580.00	47,256,000	
マンダム	37,800	1,287.00	48,648,600	
ミルボン	23,800	3,544.00	84,347,200	
ファンケル	76,600	2,333.50	178,746,100	
コーセー	35,600	9,460.00	336,776,000	
コタ	16,100	1,587.00	25,550,700	
シーボン	1,500	1,495.00	2,242,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	89,800	1,545.00	138,741,000	
ノエビアホールディングス	15,600	5,230.00	81,588,000	
アジュバンホールディングス	2,800	928.00	2,598,400	
新日本製薬	10,000	1,740.00	17,400,000	
I - n e	3,500	2,478.00	8,673,000	
アクシージア	8,900	905.00	8,054,500	

エステー	13,500	1,537.00	20,749,500
アグロ カネショウ	7,000	1,407.00	9,849,000
コニシ	58,000	1,392.00	80,736,000
長谷川香料	33,500	3,240.00	108,540,000
小林製薬	51,000	6,653.00	339,303,000
荒川化学工業	14,800	1,072.00	15,865,600
メック	14,400	4,370.00	62,928,000
日本高純度化学	4,300	2,535.00	10,900,500
タカラバイオ	47,200	1,218.00	57,489,600
J C U	19,600	3,815.00	74,774,000
新田ゼラチン	7,100	772.00	5,481,200
O A Tアグリオ	5,100	1,911.00	9,746,100
デクセリアルズ	43,900	4,361.00	191,447,900
アース製薬	15,900	4,470.00	71,073,000
北興化学工業	17,600	1,016.00	17,881,600
大成ラミック	5,500	2,988.00	16,434,000
クミアイ化学工業	69,600	858.00	59,716,800
日本農薬	32,100	670.00	21,507,000
アキレス	11,000	1,586.00	17,446,000
有沢製作所	30,700	1,084.00	33,278,800
日東電工	112,500	11,370.00	1,279,125,000
レック	22,400	1,057.00	23,676,800
三光合成	22,000	672.00	14,784,000
きもと	17,000	227.00	3,859,000
藤森工業	13,800	4,010.00	55,338,000
前澤化成工業	11,300	1,597.00	18,046,100
未来工業	6,300	3,635.00	22,900,500
ウェーブロックホールディングス	3,600	669.00	2,408,400
J S P	12,300	1,929.00	23,726,700
エフピコ	33,100	2,839.50	93,987,450
天馬	12,700	2,268.00	28,803,600
信越ポリマー	37,800	1,799.00	68,002,200
東リ	25,900	332.00	8,598,800
ニフコ	52,400	3,898.00	204,255,200
バルカー	14,600	4,335.00	63,291,000
ユニ・チャーム	364,800	5,136.00	1,873,612,800

ショーエイコーポレーション	3,400	601.00	2,043,400	
協和キリン	211,500	2,363.50	499,880,250	
武田薬品工業	1,549,600	4,381.00	6,788,797,600	
アステラス製薬	1,535,800	1,710.00	2,626,218,000	
住友ファーマ	129,900	467.00	60,663,300	
塩野義製薬	220,700	7,424.00	1,638,476,800	
わかもと製薬	10,800	216.00	2,332,800	
日本新薬	45,900	5,120.00	235,008,000	
中外製薬	548,100	5,598.00	3,068,263,800	
科研製薬	30,000	3,490.00	104,700,000	
エーザイ	213,000	7,009.00	1,492,917,000	
ロート製薬	169,600	3,010.00	510,496,000	
小野薬品工業	371,600	2,594.50	964,116,200	
久光製薬	38,900	4,221.00	164,196,900	
持田製薬	20,100	3,325.00	66,832,500	
参天製薬	319,100	1,476.50	471,151,150	
扶桑薬品工業	6,200	2,224.00	13,788,800	
日本ケミファ	1,200	1,599.00	1,918,800	
ツムラ	55,100	2,714.50	149,568,950	
キッセイ薬品工業	29,000	3,175.00	92,075,000	
生化学工業	29,700	771.00	22,898,700	
栄研化学	34,100	1,773.00	60,459,300	
鳥居薬品	9,400	3,745.00	35,203,000	
JCRファーマ	59,300	1,161.00	68,847,300	
東和薬品	26,900	2,574.00	69,240,600	
富士製薬工業	12,900	1,912.00	24,664,800	
ゼリア新薬工業	24,300	2,030.00	49,329,000	
そーせいグループ	56,400	1,464.00	82,569,600	
第一三共	1,525,300	4,392.00	6,699,117,600	
杏林製薬	38,000	1,801.00	68,438,000	
大幸薬品	36,100	304.00	10,974,400	
ダイト	13,500	1,946.00	26,271,000	
大塚ホールディングス	364,200	5,861.00	2,134,576,200	
ペプチドリーム	84,900	1,376.50	116,864,850	
セルソース	4,800	1,209.00	5,803,200	
あすか製薬ホールディングス	18,000	1,881.00	33,858,000	



サワイグループホールディングス	40,000	5,682.00	227,280,000	
日本コークス工業	177,600	134.00	23,798,400	
ニチレキ	22,800	2,593.00	59,120,400	
ユシロ化学工業	9,100	1,856.00	16,889,600	
ビーピー・カストロール	4,500	873.00	3,928,500	
富士石油	51,000	378.00	19,278,000	
MORESCO	3,800	1,389.00	5,278,200	
出光興産	972,500	829.80	806,980,500	
ENEOSホールディングス	2,771,900	609.00	1,688,087,100	
コスモエネルギーホールディングス	51,900	6,176.00	320,534,400	
横浜ゴム	88,600	3,437.00	304,518,200	
TOYO TIRE	100,600	2,355.00	236,913,000	
ブリヂストン	512,500	6,347.00	3,252,837,500	
住友ゴム工業	171,700	1,666.50	286,138,050	
藤倉コンポジット	11,800	1,490.00	17,582,000	
オカモト	8,300	5,070.00	42,081,000	
フコク	9,200	1,416.00	13,027,200	
ニッタ	17,800	3,815.00	67,907,000	
住友理工	27,200	1,179.00	32,068,800	
三ツ星ベルト	21,300	4,760.00	101,388,000	
バンドー化学	26,000	1,804.00	46,904,000	
日東紡績	22,200	5,040.00	111,888,000	
AGC	156,200	5,377.00	839,887,400	
日本板硝子	83,500	604.00	50,434,000	
石塚硝子	1,900	3,400.00	6,460,000	
日本山村硝子	4,500	1,390.00	6,255,000	
日本電気硝子	71,500	3,167.00	226,440,500	
オハラ	8,500	1,158.00	9,843,000	
住友大阪セメント	29,200	3,714.00	108,448,800	
太平洋セメント	103,600	2,994.00	310,178,400	
日本ヒューム	15,500	908.00	14,074,000	
日本コンクリート工業	34,600	475.00	16,435,000	
三谷セキサン	7,400	5,140.00	38,036,000	
アジアパイルホールディングス	27,400	728.00	19,947,200	
東海カーボン	161,700	1,026.00	165,904,200	
日本カーボン	9,300	4,415.00	41,059,500	

東洋炭素	12,400	4,795.00	59,458,000	
ノリタケカンパニーリミテド	9,700	7,390.00	71,683,000	
TOTO	115,600	3,941.00	455,579,600	
日本碍子	203,800	1,824.50	371,833,100	
日本特殊陶業	146,700	3,960.00	580,932,000	
MARUWA	6,500	30,400.00	197,600,000	
品川リフラクトリーズ	21,700	1,890.00	41,013,000	
黒崎播磨	3,600	12,080.00	43,488,000	
ヨータイ	10,900	1,479.00	16,121,100	
東京窯業	11,200	480.00	5,376,000	
ニッカトー	5,500	579.00	3,184,500	
フジインコーポレーテッド	47,100	3,090.00	145,539,000	
クミネ工業	3,600	1,037.00	3,733,200	
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,307.00	3,006,100	
ニチアス	44,300	3,420.00	151,506,000	
ニチハ	22,000	2,986.00	65,692,000	
日本製鉄	806,500	3,455.00	2,786,457,500	
神戸製鋼所	362,300	1,998.00	723,875,400	
中山製鋼所	41,200	865.00	35,638,000	
合同製鐵	10,100	4,975.00	50,247,500	
JFEホールディングス	501,000	2,318.50	1,161,568,500	
東京製鐵	50,600	1,760.00	89,056,000	
共英製鋼	20,500	2,081.00	42,660,500	
大和工業	34,000	7,955.00	270,470,000	
東京鐵鋼	8,500	4,485.00	38,122,500	
大阪製鐵	8,300	2,309.00	19,164,700	
淀川製鋼所	20,500	3,930.00	80,565,000	
中部鋼鈹	11,900	2,449.00	29,143,100	
丸一鋼管	54,800	3,898.00	213,610,400	
モリ工業	3,200	4,670.00	14,944,000	
大同特殊鋼	113,500	1,497.50	169,966,250	
日本高周波鋼業	4,100	596.00	2,443,600	
日本冶金工業	13,200	4,605.00	60,786,000	
山陽特殊製鋼	17,800	2,509.00	44,660,200	
愛知製鋼	10,400	3,535.00	36,764,000	
日本金属	2,600	871.00	2,264,600	

大平洋金属	15,400	1,254.00	19,311,600
新日本電工	89,700	294.00	26,371,800
栗本鐵工所	8,500	3,525.00	29,962,500
虹技	1,500	1,200.00	1,800,000
三菱製鋼	13,400	1,565.00	20,971,000
日亜鋼業	12,200	340.00	4,148,000
日本精線	2,900	5,080.00	14,732,000
エンビプロ・ホールディングス	9,700	614.00	5,955,800
シンニッタン	13,000	267.00	3,471,000
新家工業	2,600	2,911.00	7,568,600
大紀アルミニウム工業所	22,800	1,226.00	27,952,800
日本軽金属ホールディングス	52,600	1,767.00	92,944,200
三井金属鉱業	52,400	4,757.00	249,266,800
東邦亜鉛	11,600	1,131.00	13,119,600
三菱マテリアル	128,800	2,652.50	341,642,000
住友金属鉱山	208,900	4,073.00	850,849,700
DOWAホールディングス	44,500	5,211.00	231,889,500
古河機械金属	23,800	1,913.00	45,529,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	31,300	2,708.00	84,760,400
東邦チタニウム	37,300	1,800.00	67,140,000
UACJ	25,300	3,965.00	100,314,500
CKサンエツ	4,400	3,930.00	17,292,000
古河電気工業	60,000	2,448.00	146,880,000
住友電気工業	673,800	1,952.00	1,315,257,600
フジクラ	212,500	1,189.50	252,768,750
SWCC	20,100	2,897.00	58,229,700
タツタ電線	31,900	697.00	22,234,300
カナレ電気	2,100	1,703.00	3,576,300
平河ビューテック	11,600	1,400.00	16,240,000
リョービ	19,200	2,765.00	53,088,000
アーレスティ	13,200	729.00	9,622,800
AREホールディングス	67,700	2,033.00	137,634,100
稲葉製作所	9,300	1,518.00	14,117,400
宮地エンジニアリンググループ	9,000	3,420.00	30,780,000
トーカロ	51,900	1,513.00	78,524,700
アルファC o	4,400	1,473.00	6,481,200

SUMCO	320,100	2,470.00	790,647,000	
川田テクノロジーズ	4,200	7,140.00	29,988,000	
RS Technologies	12,000	3,155.00	37,860,000	
ジェイテックコーポレーション	1,600	2,392.00	3,827,200	
信和	6,600	758.00	5,002,800	
東洋製罐グループホールディングス	107,400	2,377.50	255,343,500	
ホッカンホールディングス	9,600	1,694.00	16,262,400	
コロナ	10,100	958.00	9,675,800	
横河ブリッジホールディングス	28,200	2,748.00	77,493,600	
駒井ハルテック	1,900	2,099.00	3,988,100	
高田機工	1,000	3,575.00	3,575,000	
三和ホールディングス	181,000	2,389.00	432,409,000	
文化シャッター	47,100	1,513.00	71,262,300	
三協立山	20,600	921.00	18,972,600	
アルインコ	13,700	1,058.00	14,494,600	
東洋シャッター	2,700	678.00	1,830,600	
LIXIL	281,300	1,883.50	529,828,550	
日本ファイルコン	7,700	577.00	4,442,900	
ノーリツ	29,800	1,544.00	46,011,200	
長府製作所	17,900	2,077.00	37,178,300	
リンナイ	88,200	3,339.00	294,499,800	
ダイニチ工業	5,900	703.00	4,147,700	
日東精工	26,100	546.00	14,250,600	
三洋工業	1,400	2,939.00	4,114,600	
岡部	32,200	781.00	25,148,200	
ジーテクト	22,900	1,807.00	41,380,300	
東プレ	31,700	2,166.00	68,662,200	
高周波熱錬	27,800	1,034.00	28,745,200	
東京製綱	11,700	1,352.00	15,818,400	
サンコール	14,000	473.00	6,622,000	
モリテック スチール	8,800	286.00	2,516,800	
パイオラックス	22,400	2,540.00	56,896,000	
エイチワン	18,500	823.00	15,225,500	
日本発條	159,300	1,220.00	194,346,000	
中央発條	13,300	709.00	9,429,700	
アドバネクス	1,500	969.00	1,453,500	

立川ブラインド工業	8,100	1,465.00	11,866,500	
三益半導体工業	13,900	3,425.00	47,607,500	
日本ドライケミカル	2,800	2,844.00	7,963,200	
日本製鋼所	48,600	2,443.50	118,754,100	
三浦工業	73,600	2,755.50	202,804,800	
タクマ	59,700	1,776.00	106,027,200	
ツガミ	39,300	1,195.00	46,963,500	
オークマ	15,400	6,462.00	99,514,800	
芝浦機械	17,600	3,565.00	62,744,000	
アマダ	281,400	1,598.50	449,817,900	
アイダエンジニアリング	40,900	853.00	34,887,700	
F U J I	83,000	2,528.00	209,824,000	
牧野フライス製作所	19,500	6,020.00	117,390,000	
オーエスジー	77,800	2,047.50	159,295,500	
ダイジェット工業	1,300	841.00	1,093,300	
旭ダイヤモンド工業	42,300	881.00	37,266,300	
DMG森精機	106,900	2,971.00	317,599,900	
ソディック	43,000	729.00	31,347,000	
ディスコ	84,900	41,070.00	3,486,843,000	
日東工器	8,600	1,925.00	16,555,000	
日進工具	16,400	1,062.00	17,416,800	
パンチ工業	10,700	421.00	4,504,700	
富士ダイス	9,200	693.00	6,375,600	
豊和工業	6,500	758.00	4,927,000	
リケンNPR	19,200	2,636.00	50,611,200	
東洋機械金属	8,200	716.00	5,871,200	
エンシュウ	2,600	680.00	1,768,000	
島精機製作所	28,100	1,541.00	43,302,100	
オプトラン	29,000	1,786.00	51,794,000	
NCホールディングス	2,400	1,601.00	3,842,400	
イワキポンプ	11,800	2,170.00	25,606,000	
フリーー	16,700	1,305.00	21,793,500	
ヤマシンフィルタ	42,500	328.00	13,940,000	
日阪製作所	19,300	980.00	18,914,000	
やまびこ	28,800	1,524.00	43,891,200	
野村マイクロ・サイエンス	6,000	12,930.00	77,580,000	

平田機工	8,400	6,640.00	55,776,000	
PEGASUS	19,600	448.00	8,780,800	
マルマエ	7,700	2,111.00	16,254,700	
タツモ	10,700	3,320.00	35,524,000	
ナブテスコ	110,700	2,805.00	310,513,500	
三井海洋開発	22,300	2,369.00	52,828,700	
レオン自動機	20,400	1,514.00	30,885,600	
SMC	52,800	85,390.00	4,508,592,000	
ホソカワミクロン	11,300	4,580.00	51,754,000	
ユニオンツール	7,800	3,415.00	26,637,000	
瑞光	12,700	1,821.00	23,126,700	
オイレス工業	24,400	2,081.00	50,776,400	
日精エー・エス・ビー機械	7,000	4,390.00	30,730,000	
サトーホールディングス	25,100	2,204.00	55,320,400	
技研製作所	16,600	2,179.00	36,171,400	
日本エアテック	8,300	1,236.00	10,258,800	
カワタ	3,400	1,137.00	3,865,800	
日精樹脂工業	13,200	1,151.00	15,193,200	
オカダアイヨン	3,600	2,518.00	9,064,800	
ワイエイシイホールディングス	5,800	2,563.00	14,865,400	
小松製作所	826,500	3,998.00	3,304,347,000	
住友重機械工業	104,300	3,768.00	393,002,400	
日立建機	70,200	4,164.00	292,312,800	
日工	26,300	718.00	18,883,400	
巴工業	6,900	3,670.00	25,323,000	
井関農機	16,600	1,137.00	18,874,200	
TOWA	19,600	7,070.00	138,572,000	
丸山製作所	2,000	2,553.00	5,106,000	
北川鉄工所	7,000	1,518.00	10,626,000	
ローツェ	9,200	16,560.00	152,352,000	
タカキタ	3,400	481.00	1,635,400	
クボタ	925,300	2,191.00	2,027,332,300	
荏原実業	9,300	3,015.00	28,039,500	
三菱化工機	6,200	3,560.00	22,072,000	
月島ホールディングス	23,900	1,365.00	32,623,500	
帝国電機製作所	12,400	3,080.00	38,192,000	

新東工業	35,700	1,107.00	39,519,900	
澁谷工業	16,600	2,529.00	41,981,400	
アイチ コーポレーション	24,600	1,110.00	27,306,000	
小森コーポレーション	44,400	1,350.00	59,940,000	
鶴見製作所	13,500	3,765.00	50,827,500	
日本ギア工業	4,100	521.00	2,136,100	
酒井重工業	2,400	7,050.00	16,920,000	
荏原製作所	72,400	9,355.00	677,302,000	
石井鐵工所	1,400	2,685.00	3,759,000	
西島製作所	15,200	2,414.00	36,692,800	
北越工業	17,700	2,671.00	47,276,700	
ダイキン工業	210,500	24,560.00	5,169,880,000	
オルガノ	21,200	6,310.00	133,772,000	
トーヨーカネツ	6,700	4,135.00	27,704,500	
栗田工業	98,600	5,511.00	543,384,600	
椿本チエイン	25,000	4,145.00	103,625,000	
大同工業	4,800	748.00	3,590,400	
木村化工機	13,600	726.00	9,873,600	
アネスト岩田	27,300	1,300.00	35,490,000	
ダイフク	297,600	2,994.50	891,163,200	
サムコ	4,700	4,820.00	22,654,000	
加藤製作所	5,600	1,435.00	8,036,000	
油研工業	1,800	2,235.00	4,023,000	
タダノ	101,500	1,204.00	122,206,000	
フジテック	41,200	3,656.00	150,627,200	
CKD	48,800	2,666.00	130,100,800	
平和	52,200	2,163.00	112,908,600	
理想科学工業	14,100	2,860.00	40,326,000	
SANKYO	40,600	9,148.00	371,408,800	
日本金銭機械	21,400	1,505.00	32,207,000	
マースグループホールディングス	8,900	2,732.00	24,314,800	
フクシマガリレイ	11,500	5,190.00	59,685,000	
オーイズミ	4,500	439.00	1,975,500	
ダイコク電機	8,700	3,605.00	31,363,500	
竹内製作所	32,000	4,795.00	153,440,000	
アマノ	50,100	3,478.00	174,247,800	

J U K I	27,400	453.00	12,412,200	
ジャノメ	17,900	692.00	12,386,800	
マックス	24,800	3,360.00	83,328,000	
グローリー	42,300	3,043.00	128,718,900	
新晃工業	17,800	2,913.00	51,851,400	
大和冷機工業	27,000	1,618.00	43,686,000	
セガサミーホールディングス	157,500	2,145.50	337,916,250	
T P R	22,400	1,954.00	43,769,600	
ツバキ・ナカシマ	35,400	741.00	26,231,400	
ホシザキ	104,000	5,497.00	571,688,000	
大豊工業	15,300	838.00	12,821,400	
日本精工	326,500	804.80	262,767,200	
N T N	382,600	272.50	104,258,500	
ジェイテクト	156,900	1,317.00	206,637,300	
不二越	13,000	3,565.00	46,345,000	
日本トムソン	48,100	587.00	28,234,700	
T H K	101,700	2,879.50	292,845,150	
ユーシン精機	14,000	681.00	9,534,000	
前澤給装工業	13,600	1,319.00	17,938,400	
イーグル工業	19,500	1,720.00	33,540,000	
前澤工業	6,700	1,131.00	7,577,700	
日本ピラー工業	16,400	4,930.00	80,852,000	
キッツ	59,100	1,217.00	71,924,700	
マキタ	201,100	3,936.00	791,529,600	
三井E & S	86,500	773.00	66,864,500	
日立造船	155,700	938.00	146,046,600	
三菱重工業	308,400	9,493.00	2,927,641,200	
I H I	131,300	2,792.50	366,655,250	
スター精密	32,900	1,778.00	58,496,200	
日清紡ホールディングス	132,500	1,204.00	159,530,000	
イビデン	92,000	7,989.00	734,988,000	
コニカミノルタ	394,400	413.50	163,084,400	
ブラザー工業	235,700	2,536.00	597,735,200	
ミネベアミツミ	306,800	3,082.00	945,557,600	
日立製作所	847,400	11,425.00	9,681,545,000	
三菱電機	1,962,500	2,208.50	4,334,181,250	



富士電機	107,200	6,886.00	738,179,200	
東洋電機製造	3,800	1,079.00	4,100,200	
安川電機	191,500	5,945.00	1,138,467,500	
シンフォニアテクノロジー	19,400	2,339.00	45,376,600	
明電舎	32,700	2,700.00	88,290,000	
オリジン	2,600	1,228.00	3,192,800	
山洋電気	7,700	6,380.00	49,126,000	
デンヨー	13,400	2,320.00	31,088,000	
PHCホールディングス	33,100	1,523.00	50,411,300	
KOKUSAI ELECTRIC	67,800	3,685.00	249,843,000	
ソシオネクスト	128,000	3,158.00	404,224,000	
東芝テック	22,600	3,105.00	70,173,000	
芝浦メカトロニクス	10,100	7,140.00	72,114,000	
マブチモーター	87,600	2,539.00	222,416,400	
ニデック	389,300	5,782.00	2,250,932,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,600	369.00	5,018,400	
トレックス・セミコンダクター	9,200	1,888.00	17,369,600	
東光高岳	10,800	2,235.00	24,138,000	
ダブル・スコープ	50,500	828.00	41,814,000	
ダイヘン	17,700	6,660.00	117,882,000	
ヤーマン	30,700	998.00	30,638,600	
JVCケンウッド	139,500	776.00	108,252,000	
ミマキエンジニアリング	17,100	937.00	16,022,700	
IPEX	12,400	1,784.00	22,121,600	
大崎電気工業	41,400	662.00	27,406,800	
オムロン	134,600	6,849.00	921,875,400	
日東工業	23,800	3,850.00	91,630,000	
IDEC	26,000	3,060.00	79,560,000	
正興電機製作所	4,200	1,069.00	4,489,800	
不二電機工業	2,600	1,192.00	3,099,200	
ジーエス・ユアサコーポレーション	68,900	2,094.00	144,276,600	
サクサホールディングス	2,400	2,632.00	6,316,800	
メルコホールディングス	5,600	3,400.00	19,040,000	
テクノメディカ	4,400	2,009.00	8,839,600	
日本電気	231,600	9,445.00	2,187,462,000	
富士通	162,300	20,505.00	3,327,961,500	

沖電気工業	79,700	1,046.00	83,366,200	
岩崎通信機	5,100	750.00	3,825,000	
電気興業	7,900	2,331.00	18,414,900	
サンケン電気	16,400	7,248.00	118,867,200	
ナカヨ	1,900	1,169.00	2,221,100	
アイホン	9,500	2,912.00	27,664,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,150,800	2,638.00	3,035,810,400	
セイコーエプソン	226,200	2,249.00	508,723,800	
ワコム	134,500	686.00	92,267,000	
アルバック	41,900	7,034.00	294,724,600	
アクセル	6,300	2,320.00	14,616,000	
E I Z O	12,900	5,180.00	66,822,000	
日本信号	40,200	953.00	38,310,600	
京三製作所	36,900	465.00	17,158,500	
能美防災	24,000	2,291.00	54,984,000	
ホーチキ	13,300	2,004.00	26,653,200	
星和電機	5,900	480.00	2,832,000	
エレコム	42,300	1,718.00	72,671,400	
パナソニック ホールディングス	2,082,900	1,406.00	2,928,557,400	
シャープ	297,200	1,071.50	318,449,800	
アンリツ	124,200	1,342.50	166,738,500	
富士通ゼネラル	50,000	2,171.50	108,575,000	
ソニーグループ	1,234,900	14,800.00	18,276,520,000	
T D K	279,200	7,476.00	2,087,299,200	
帝国通信工業	8,000	2,054.00	16,432,000	
タムラ製作所	70,200	557.00	39,101,400	
アルプスアルパイン	157,700	1,272.00	200,594,400	
池上通信機	3,700	861.00	3,185,700	
日本電波工業	21,400	1,284.00	27,477,600	
鈴木	9,700	1,178.00	11,426,600	
メイコー	17,600	4,500.00	79,200,000	
日本トリム	4,100	3,165.00	12,976,500	
ローランド ディー. ジー.	9,700	3,785.00	36,714,500	
フォスター電機	13,100	1,149.00	15,051,900	
S M K	4,700	2,565.00	12,055,500	
ヨコオ	15,800	1,441.00	22,767,800	

ホシデン	40,800	1,806.00	73,684,800	
ヒロセ電機	26,000	18,255.00	474,630,000	
日本航空電子工業	42,200	3,165.00	133,563,000	
TOA	20,100	1,115.00	22,411,500	
マクセル	39,100	1,635.00	63,928,500	
古野電気	23,100	2,156.00	49,803,600	
スミダコーポレーション	23,800	1,250.00	29,750,000	
アイコム	6,800	3,755.00	25,534,000	
リオン	7,400	2,460.00	18,204,000	
横河電機	192,900	2,952.00	569,440,800	
新電元工業	6,700	3,180.00	21,306,000	
アズビル	120,100	4,963.00	596,056,300	
東亜ディーケーケー	5,800	950.00	5,510,000	
日本光電工業	75,000	4,576.00	343,200,000	
チノー	7,300	2,390.00	17,447,000	
共和電業	10,800	435.00	4,698,000	
日本電子材料	11,400	1,917.00	21,853,800	
堀場製作所	33,300	12,445.00	414,418,500	
アドバンテスト	500,200	5,994.00	2,998,198,800	
小野測器	5,500	464.00	2,552,000	
エスペック	14,100	2,611.00	36,815,100	
キーエンス	174,700	66,720.00	11,655,984,000	
日置電機	8,300	6,350.00	52,705,000	
シスメックス	150,700	8,360.00	1,259,852,000	
日本マイクロニクス	31,400	4,115.00	129,211,000	
メガチップス	14,200	5,140.00	72,988,000	
OBARA GROUP	9,600	4,085.00	39,216,000	
澤藤電機	1,600	1,235.00	1,976,000	
原田工業	5,500	753.00	4,141,500	
コーセル	21,200	1,487.00	31,524,400	
イリソ電子工業	16,100	3,550.00	57,155,000	
オブテックスグループ	32,200	1,780.00	57,316,000	
千代田インテグレ	6,900	2,864.00	19,761,600	
レーザーテック	80,000	40,000.00	3,200,000,000	
スタンレー電気	111,900	2,786.00	311,753,400	
ウシオ電機	88,800	2,059.50	182,883,600	

岡谷電機産業	10,100	288.00	2,908,800
ヘリオス テクノ ホールディング	11,500	557.00	6,405,500
エノモト	3,100	1,638.00	5,077,800
日本セラミック	15,200	2,754.00	41,860,800
遠藤照明	5,400	1,397.00	7,543,800
古河電池	13,200	898.00	11,853,600
双信電機	5,700	310.00	1,767,000
山一電機	15,800	2,193.00	34,649,400
図研	15,300	4,105.00	62,806,500
日本電子	43,800	6,730.00	294,774,000
カシオ計算機	126,100	1,270.50	160,210,050
ファナック	851,300	4,285.00	3,647,820,500
日本シイエムケイ	37,400	776.00	29,022,400
エンプラス	5,100	14,510.00	74,001,000
大真空	26,400	945.00	24,948,000
ローム	322,900	2,728.50	881,032,650
浜松ホトニクス	140,100	5,987.00	838,778,700
三井ハイテック	15,500	6,902.00	106,981,000
新光電気工業	61,800	5,490.00	339,282,000
京セラ	1,084,800	2,219.50	2,407,713,600
太陽誘電	85,100	3,731.00	317,508,100
村田製作所	1,588,400	3,051.00	4,846,208,400
双葉電子工業	33,800	524.00	17,711,200
北陸電気工業	4,600	1,395.00	6,417,000
ニチコン	46,000	1,314.00	60,444,000
日本ケミコン	18,800	1,391.00	26,150,800
KOA	26,600	1,561.00	41,522,600
市光工業	32,000	572.00	18,304,000
小糸製作所	181,100	2,187.00	396,065,700
ミツバ	32,700	1,079.00	35,283,300
S C R E E Nホールディングス	59,700	14,310.00	854,307,000
キヤノン電子	19,400	2,032.00	39,420,800
キヤノン	870,700	3,770.00	3,282,539,000
リコー	437,700	1,197.00	523,926,900
象印マホービン	48,400	1,516.00	73,374,400
MUTOHホールディングス	1,700	2,135.00	3,629,500

東京エレクトロン	369,500	28,700.00	10,604,650,000	
イノテック	11,800	1,869.00	22,054,200	
トヨタ紡織	73,500	2,410.50	177,171,750	
芦森工業	2,200	2,127.00	4,679,400	
ユニプレス	31,400	1,024.00	32,153,600	
豊田自動織機	148,900	12,670.00	1,886,563,000	
モリタホールディングス	30,700	1,555.00	47,738,500	
三櫻工業	26,800	840.00	22,512,000	
デンソー	1,440,400	2,298.50	3,310,759,400	
東海理化電機製作所	49,300	2,330.00	114,869,000	
川崎重工業	142,500	3,289.00	468,682,500	
名村造船所	38,000	1,506.00	57,228,000	
日本車輛製造	6,600	2,120.00	13,992,000	
三菱ロジスネクスト	27,900	1,473.00	41,096,700	
近畿車輛	1,600	1,943.00	3,108,800	
日産自動車	2,479,900	583.70	1,447,517,630	
いすゞ自動車	507,500	2,062.00	1,046,465,000	
トヨタ自動車	9,585,900	2,982.00	28,585,153,800	
日野自動車	262,600	500.50	131,431,300	
三菱自動車工業	681,000	462.30	314,826,300	
エフテック	8,100	655.00	5,305,500	
レシップホールディングス	4,500	674.00	3,033,000	
GMB	2,300	1,256.00	2,888,800	
ファルテック	2,000	542.00	1,084,000	
武蔵精密工業	42,700	1,695.00	72,376,500	
日産車体	20,500	971.00	19,905,500	
新明和工業	50,300	1,221.00	61,416,300	
極東開発工業	28,800	2,017.00	58,089,600	
トピー工業	14,200	2,830.00	40,186,000	
ティラド	4,400	3,520.00	15,488,000	
曙ブレーキ工業	106,500	117.00	12,460,500	
タチエス	32,300	1,955.00	63,146,500	
NOK	67,900	1,979.00	134,374,100	
フタバ産業	46,900	880.00	41,272,000	
カヤバ	16,800	5,210.00	87,528,000	
大同メタル工業	34,300	553.00	18,967,900	

プレス工業	69,900	638.00	44,596,200	
ミクニ	13,400	478.00	6,405,200	
太平洋工業	40,100	1,438.00	57,663,800	
アイシン	134,700	5,514.00	742,735,800	
マツダ	577,500	1,749.00	1,010,047,500	
今仙電機製作所	7,400	636.00	4,706,400	
本田技研工業	4,257,300	1,610.00	6,854,253,000	
スズキ	320,600	6,556.00	2,101,853,600	
S U B A R U	541,700	2,969.00	1,608,307,300	
安永	5,100	663.00	3,381,300	
ヤマハ発動機	754,500	1,468.50	1,107,983,250	
T B K	11,700	405.00	4,738,500	
エクセディ	28,600	2,802.00	80,137,200	
豊田合成	51,000	2,866.00	146,166,000	
愛三工業	29,000	1,348.00	39,092,000	
盟和産業	1,700	1,016.00	1,727,200	
日本プラスト	9,300	556.00	5,170,800	
ヨロズ	16,500	930.00	15,345,000	
エフ・シー・シー	31,000	1,944.00	60,264,000	
シマノ	70,900	21,775.00	1,543,847,500	
テイ・エス テック	62,200	1,840.00	114,448,000	
ジャムコ	7,400	1,642.00	12,150,800	
テルモ	488,100	5,084.00	2,481,500,400	
クリエートメディック	3,800	892.00	3,389,600	
日機装	40,700	1,109.00	45,136,300	
日本エム・ディ・エム	13,900	776.00	10,786,400	
島津製作所	231,900	4,163.00	965,399,700	
J M S	16,200	521.00	8,440,200	
長野計器	12,700	2,158.00	27,406,600	
ブイ・テクノロジー	9,200	2,760.00	25,392,000	
東京計器	13,400	1,887.00	25,285,800	
愛知時計電機	7,600	2,476.00	18,817,600	
インターアクション	8,300	1,117.00	9,271,100	
オーバル	10,200	523.00	5,334,600	
東京精密	35,700	10,010.00	357,357,000	
マニー	69,900	2,142.50	149,760,750	

ニコン	252,400	1,477.00	372,794,800	
トプコン	84,900	1,631.00	138,471,900	
オリンパス	1,074,600	2,236.50	2,403,342,900	
理研計器	12,400	7,570.00	93,868,000	
タムロン	10,700	5,640.00	60,348,000	
HOYA	343,900	18,590.00	6,393,101,000	
シード	5,900	813.00	4,796,700	
ノーリツ鋼機	16,500	3,400.00	56,100,000	
A&Dホロンホールディングス	25,500	2,037.00	51,943,500	
朝日インテック	195,100	2,962.50	577,983,750	
シチズン時計	160,600	931.00	149,518,600	
リズム	3,600	2,854.00	10,274,400	
大研医器	8,700	510.00	4,437,000	
メニコン	60,000	2,290.50	137,430,000	
シンシア	1,400	539.00	754,600	
松風	7,900	2,799.00	22,112,100	
セイコーグループ	24,300	2,674.00	64,978,200	
ニプロ	145,500	1,224.00	178,092,000	
KYORITSU	17,200	187.00	3,216,400	
中本パックス	3,500	1,698.00	5,943,000	
スノーピーク	24,900	911.00	22,683,900	
パラマウントベッドホールディングス	36,300	2,721.00	98,772,300	
トランザクション	11,500	2,341.00	26,921,500	
粧美堂	3,100	657.00	2,036,700	
ニホンフラッシュ	16,400	938.00	15,383,200	
前田工織	14,700	3,220.00	47,334,000	
永大産業	12,300	233.00	2,865,900	
アートネイチャー	17,800	800.00	14,240,000	
バンダイナムコホールディングス	478,300	3,045.00	1,456,423,500	
アイフイスジャパン	3,200	615.00	1,968,000	
SHOEI	39,400	1,985.00	78,209,000	
フランスベッドホールディングス	22,600	1,412.00	31,911,200	
パイロットコーポレーション	24,600	4,142.00	101,893,200	
萩原工業	11,700	1,516.00	17,737,200	
フジシールインターナショナル	35,300	1,774.00	62,622,200	
タカラトミー	79,500	2,527.00	200,896,500	

広済堂ホールディングス	39,300	747.00	29,357,100	
エステールホールディングス	2,700	637.00	1,719,900	
タカノ	4,300	1,033.00	4,441,900	
プロネクサス	18,100	1,313.00	23,765,300	
ホクシン	8,800	115.00	1,012,000	
ウッドワン	3,800	1,032.00	3,921,600	
TOPPANホールディングス	214,600	4,287.00	919,990,200	
大日本印刷	190,800	4,345.00	829,026,000	
共同印刷	4,900	3,365.00	16,488,500	
NISSHA	29,900	1,578.00	47,182,200	
光村印刷	1,000	1,500.00	1,500,000	
TAKARA & COMPANY	11,200	2,884.00	32,300,800	
アシックス	148,700	4,706.00	699,782,200	
ツツミ	4,100	2,190.00	8,979,000	
ローランド	12,900	4,855.00	62,629,500	
小松ウオール工業	7,100	2,996.00	21,271,600	
ヤマハ	110,000	3,317.00	364,870,000	
河合楽器製作所	5,300	3,765.00	19,954,500	
クリナップ	19,400	734.00	14,239,600	
ピジョン	111,200	1,585.50	176,307,600	
キングジム	15,400	877.00	13,505,800	
リンテック	35,000	2,762.00	96,670,000	
イトーキ	35,800	1,495.00	53,521,000	
任天堂	1,102,200	8,103.00	8,931,126,600	
三菱鉛筆	24,800	2,006.00	49,748,800	
タカラスタンダード	36,800	1,744.00	64,179,200	
コクヨ	74,700	2,417.50	180,587,250	
ナカバヤシ	18,800	552.00	10,377,600	
グローブライド	15,700	2,047.00	32,137,900	
オカムラ	52,600	2,242.00	117,929,200	
美津濃	17,400	4,355.00	75,777,000	
東京電力ホールディングス	1,573,700	796.80	1,253,924,160	
中部電力	643,300	1,911.00	1,229,346,300	
関西電力	674,100	1,976.50	1,332,358,650	
中国電力	303,300	1,039.50	315,280,350	
北陸電力	178,500	715.40	127,698,900	



東北電力	459,600	992.00	455,923,200	
四国電力	162,600	1,082.00	175,933,200	
九州電力	402,400	1,070.00	430,568,000	
北海道電力	168,700	656.00	110,667,200	
沖縄電力	44,600	1,156.00	51,557,600	
電源開発	143,400	2,458.50	352,548,900	
エフオン	11,300	444.00	5,017,200	
イーレックス	31,100	791.00	24,600,100	
レノバ	46,500	1,223.00	56,869,500	
東京瓦斯	369,100	3,404.00	1,256,416,400	
大阪瓦斯	353,600	3,107.00	1,098,635,200	
東邦瓦斯	75,600	3,018.00	228,160,800	
北海道瓦斯	10,400	2,255.00	23,452,000	
広島ガス	36,900	395.00	14,575,500	
西部ガスホールディングス	18,200	1,937.00	35,253,400	
静岡ガス	36,300	1,025.00	37,207,500	
メタウォーター	20,900	2,136.00	44,642,400	
SBSホールディングス	15,600	2,519.00	39,296,400	
東武鉄道	191,800	4,084.00	783,311,200	
相鉄ホールディングス	62,500	2,800.50	175,031,250	
東急	489,500	1,763.00	862,988,500	
京浜急行電鉄	216,000	1,318.00	284,688,000	
小田急電鉄	288,700	2,325.00	671,227,500	
京王電鉄	83,900	4,484.00	376,207,600	
京成電鉄	112,600	7,055.00	794,393,000	
富士急行	21,500	4,560.00	98,040,000	
東日本旅客鉄道	320,700	8,465.00	2,714,725,500	
西日本旅客鉄道	207,100	6,161.00	1,275,943,100	
東海旅客鉄道	672,400	3,714.00	2,497,293,600	
西武ホールディングス	211,200	2,096.00	442,675,200	
鴻池運輸	29,700	1,941.00	57,647,700	
西日本鉄道	46,600	2,473.00	115,241,800	
ハマキョウレックス	14,900	4,155.00	61,909,500	
サカイ引越センター	19,300	2,825.00	54,522,500	
近鉄グループホールディングス	174,300	4,783.00	833,676,900	
阪急阪神ホールディングス	232,400	4,657.00	1,082,286,800	

南海電気鉄道	77,700	2,911.50	226,223,550
京阪ホールディングス	96,100	3,712.00	356,723,200
神戸電鉄	4,700	2,920.00	13,724,000
名古屋鉄道	179,800	2,307.50	414,888,500
山陽電気鉄道	13,100	2,199.00	28,806,900
アルプス物流	13,900	1,811.00	25,172,900
ヤマトホールディングス	223,200	2,619.50	584,672,400
山九	44,300	5,228.00	231,600,400
丸運	5,700	283.00	1,613,100
丸全昭和運輸	10,800	4,035.00	43,578,000
センコーグループホールディングス	92,300	1,172.00	108,175,600
トナミホールディングス	3,800	4,755.00	18,069,000
ニッコンホールディングス	55,800	3,142.00	175,323,600
日本石油輸送	1,200	2,875.00	3,450,000
福山通運	19,900	4,150.00	82,585,000
セイノーホールディングス	98,000	2,171.50	212,807,000
エスライングループ本社	3,200	888.00	2,841,600
神奈川中央交通	4,900	3,030.00	14,847,000
AZ-COM丸和ホールディングス	44,600	1,595.00	71,137,000
C&Fロジホールディングス	16,800	1,664.00	27,955,200
九州旅客鉄道	123,200	3,245.00	399,784,000
SGホールディングス	292,700	2,026.00	593,010,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	59,100	8,872.00	524,335,200
日本郵船	499,900	5,016.00	2,507,498,400
商船三井	378,500	5,200.00	1,968,200,000
川崎汽船	147,500	7,269.00	1,072,177,500
NSユニテッド海運	9,600	5,150.00	49,440,000
飯野海運	64,900	1,287.00	83,526,300
共栄タンカー	3,600	871.00	3,135,600
乾汽船	23,000	1,135.00	26,105,000
日本航空	428,100	2,827.00	1,210,238,700
ANAホールディングス	474,200	3,198.00	1,516,491,600
パスコ	2,200	1,847.00	4,063,400
トランコム	5,100	7,170.00	36,567,000
日新	13,200	2,710.00	35,772,000

三菱倉庫	42,800	4,633.00	198,292,400
三井倉庫ホールディングス	16,300	5,040.00	82,152,000
住友倉庫	47,000	2,680.00	125,960,000
澁澤倉庫	7,900	3,160.00	24,964,000
東陽倉庫	3,000	1,528.00	4,584,000
日本トランスシティ	35,100	661.00	23,201,100
ケイヒン	2,000	1,819.00	3,638,000
中央倉庫	9,300	1,175.00	10,927,500
川西倉庫	1,900	1,133.00	2,152,700
安田倉庫	11,900	1,235.00	14,696,500
ファイズホールディングス	2,100	1,239.00	2,601,900
東洋埠頭	3,300	1,400.00	4,620,000
上組	83,600	3,455.00	288,838,000
サンリツ	2,600	786.00	2,043,600
キムラユニティー	5,500	1,433.00	7,881,500
キューソー流通システム	7,000	937.00	6,559,000
東海運	6,700	293.00	1,963,100
エーアイテイナー	10,900	1,794.00	19,554,600
内外トランスライン	7,000	2,448.00	17,136,000
日本コンセプト	6,300	1,714.00	10,798,200
NEC ネットエスアイ	68,200	2,338.00	159,451,600
クロスキャット	11,100	1,137.00	12,620,700
システナ	265,000	304.00	80,560,000
デジタルアーツ	11,100	5,180.00	57,498,000
日鉄ソリューションズ	29,900	4,985.00	149,051,500
キューブシステム	10,300	1,121.00	11,546,300
コア	7,800	1,830.00	14,274,000
手間いらず	3,000	2,846.00	8,538,000
ラクーンホールディングス	14,500	670.00	9,715,000
ソリトンシステムズ	9,000	1,422.00	12,798,000
ソフトクリエイトホールディングス	14,400	1,711.00	24,638,400
T I S	191,500	3,399.00	650,908,500
テクミラホールディングス	5,400	406.00	2,192,400
グリー	47,000	589.00	27,683,000
GMOペパボ	2,300	1,193.00	2,743,900
コーエーテクモホールディングス	109,700	1,798.00	197,240,600

三菱総合研究所	8,600	4,870.00	41,882,000
電算	1,400	1,512.00	2,116,800
A G S	4,900	808.00	3,959,200
ファインデックス	13,900	969.00	13,469,100
ブレインパッド	13,100	1,216.00	15,929,600
K L a b	32,200	280.00	9,016,000
ポールトゥウィンホールディングス	29,900	520.00	15,548,000
ネクソン	391,300	2,302.50	900,968,250
アイスタイル	52,000	431.00	22,412,000
エムアップホールディングス	21,500	1,054.00	22,661,000
エイチーム	10,400	577.00	6,000,800
エニグモ	22,300	367.00	8,184,100
テクノスジャパン	9,500	639.00	6,070,500
コロプラ	68,000	611.00	41,548,000
ブロードリーフ	94,600	576.00	54,489,600
クロス・マーケティンググループ	7,000	560.00	3,920,000
デジタルハーツホールディングス	10,900	979.00	10,671,100
メディアドゥ	7,900	1,345.00	10,625,500
じげん	51,100	536.00	27,389,600
ブイキューブ	21,100	317.00	6,688,700
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	568.00	1,590,400
サイバーリンクス	4,500	823.00	3,703,500
フィックスターズ	19,800	1,523.00	30,155,400
CARTA HOLDINGS	8,200	1,497.00	12,275,400
オブティム	18,000	984.00	17,712,000
セレス	7,100	1,134.00	8,051,400
S H I F T	11,600	28,020.00	325,032,000
ティーガイア	18,300	1,986.00	36,343,800
セック	1,900	5,600.00	10,640,000
テクマトリックス	32,000	1,682.00	53,824,000
プロシップ	8,400	1,420.00	11,928,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,600	2,429.50	110,785,200
GMOペイメントゲートウェイ	35,000	9,060.00	317,100,000
ザッパラス	3,300	453.00	1,494,900
システムリサーチ	6,000	3,035.00	18,210,000
インターネットイニシアティブ	83,700	3,085.00	258,214,500

さくらインターネット	19,700	3,505.00	69,048,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,400	2,810.00	15,174,000	
SRAホールディングス	9,000	3,760.00	33,840,000	
システムインテグレータ	3,500	420.00	1,470,000	
朝日ネット	18,800	625.00	11,750,000	
eBASE	24,700	742.00	18,327,400	
アバントグループ	22,100	1,475.00	32,597,500	
アドソル日進	7,400	1,629.00	12,054,600	
ODKソリューションズ	2,600	601.00	1,562,600	
フリービット	9,200	1,500.00	13,800,000	
コムチュア	25,300	1,867.00	47,235,100	
アステリア	13,700	618.00	8,466,600	
アイル	8,200	3,290.00	26,978,000	
マークライNZ	9,500	2,994.00	28,443,000	
メディカル・データ・ビジョン	20,900	661.00	13,814,900	
gumi	25,900	402.00	10,411,800	
ショーケース	2,800	344.00	963,200	
モバイルファクトリー	2,500	655.00	1,637,500	
テラスカイ	7,600	1,575.00	11,970,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,100	1,664.00	16,806,400	
PCIホールディングス	4,400	1,003.00	4,413,200	
アイビーシー	1,800	527.00	948,600	
ネオジャパン	5,900	1,065.00	6,283,500	
PR TIMES	4,400	2,095.00	9,218,000	
ラクス	82,800	2,429.50	201,162,600	
ランドコンピュータ	5,600	900.00	5,040,000	
ダブルスタンダード	5,300	1,593.00	8,442,900	
オーブンドア	12,200	830.00	10,126,000	
アカツキ	8,300	2,647.00	21,970,100	
ベネフィットジャパン	700	1,265.00	885,500	
Ubicomホールディングス	5,500	1,547.00	8,508,500	
カナミックネットワーク	18,900	422.00	7,975,800	
ノムラシステムコーポレーション	12,900	115.00	1,483,500	
チェンジホールディングス	38,100	1,380.00	52,578,000	
シンクロ・フード	7,400	618.00	4,573,200	
オークネット	7,500	1,988.00	14,910,000	

キャピタル・アセット・プランニング	2,300	744.00	1,711,200
セグエグループ	3,700	901.00	3,333,700
エイトレッド	1,800	1,406.00	2,530,800
マクロミル	34,400	777.00	26,728,800
ビーグリー	2,500	1,254.00	3,135,000
オロ	6,300	2,886.00	18,181,800
ユーザローカル	6,300	2,083.00	13,122,900
テモナ	2,800	264.00	739,200
ニーズウェル	6,400	743.00	4,755,200
マネーフォワード	38,900	5,298.00	206,092,200
サインポスト	4,500	529.00	2,380,500
Sun Asterisk	12,500	985.00	12,312,500
プラスアルファ・コンサルティング	10,300	2,731.00	28,129,300
電算システムホールディングス	7,800	2,963.00	23,111,400
Appier Group	59,800	1,807.00	108,058,600
ソルクシーズ	9,400	396.00	3,722,400
フェイス	3,300	476.00	1,570,800
プロトコーポレーション	19,200	1,291.00	24,787,200
ハイマックス	5,500	1,416.00	7,788,000
野村総合研究所	387,900	4,417.00	1,713,354,300
CEホールディングス	6,000	644.00	3,864,000
日本システム技術	5,700	3,370.00	19,209,000
インテージホールディングス	19,800	1,725.00	34,155,000
東邦システムサイエンス	5,700	1,301.00	7,415,700
ソースネクスト	88,400	156.00	13,790,400
インフォコム	22,600	2,598.00	58,714,800
シンプレクス・ホールディングス	26,300	2,873.00	75,559,900
HEROZ	5,900	1,684.00	9,935,600
ラクスル	42,100	1,098.00	46,225,800
メルカリ	106,200	2,463.00	261,570,600
I P S	5,600	1,967.00	11,015,200
F I G	13,500	328.00	4,428,000
システムサポート	6,800	1,904.00	12,947,200
イーソル	12,700	592.00	7,518,400
東海ソフト	1,700	1,163.00	1,977,100
ウイングアーク1st	18,100	2,781.00	50,336,100

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,700	1,240.00	5,828,000	
サーバーワークス	3,600	4,085.00	14,706,000	
東名	900	2,207.00	1,986,300	
ヴィッツ	1,200	861.00	1,033,200	
トビラシステムズ	3,300	895.00	2,953,500	
S a n s a n	57,400	1,405.00	80,647,000	
L i n k-U	2,800	664.00	1,859,200	
ギフトィ	15,300	1,563.00	23,913,900	
メドレー	23,500	4,315.00	101,402,500	
ベース	6,000	3,360.00	20,160,000	
JMDC	29,900	4,029.00	120,467,100	
フォーカスシステムズ	12,700	1,021.00	12,966,700	
クレスコ	14,400	1,971.00	28,382,400	
フジ・メディア・ホールディングス	168,200	1,766.50	297,125,300	
オービック	58,500	24,550.00	1,436,175,000	
ジャストシステム	25,200	3,245.00	81,774,000	
TDCソフト	16,400	2,285.00	37,474,000	
L I N Eヤフー	2,492,400	480.00	1,196,352,000	
トレンドマイクロ	82,800	8,155.00	675,234,000	
IDホールディングス	11,800	1,749.00	20,638,200	
日本オラクル	33,500	11,970.00	400,995,000	
アルファシステムズ	4,600	3,055.00	14,053,000	
フューチャー	37,400	1,758.00	65,749,200	
C A C H o l d i n g s	10,000	1,761.00	17,610,000	
S Bテクノロジー	7,400	2,482.00	18,366,800	
トーセ	3,400	708.00	2,407,200	
オービックビジネスコンサルタント	24,600	6,780.00	166,788,000	
アイティフォー	22,900	1,209.00	27,686,100	
東計電算	4,800	3,540.00	16,992,000	
エクスネット	1,600	1,130.00	1,808,000	
大塚商会	86,800	6,168.00	535,382,400	
サイボウズ	24,100	2,149.00	51,790,900	
電通総研	21,300	5,810.00	123,753,000	
A C C E S S	20,600	785.00	16,171,000	
デジタルガレージ	28,000	3,610.00	101,080,000	

EMシステムズ	29,200	704.00	20,556,800	
ウェザーニューズ	5,400	5,350.00	28,890,000	
C I J	29,100	670.00	19,497,000	
ビジネスエンジニアリング	2,900	4,690.00	13,601,000	
日本エンタープライズ	12,200	127.00	1,549,400	
WOWOW	13,200	1,123.00	14,823,600	
スカラ	16,200	764.00	12,376,800	
インテリジェント ウェイブ	6,200	1,084.00	6,720,800	
ANYCOLOR	6,200	3,520.00	21,824,000	
I M A G I C A G R O U P	17,600	615.00	10,824,000	
ネットワンシステムズ	70,700	2,347.50	165,968,250	
システムソフト	61,300	62.00	3,800,600	
アルゴグラフィックス	16,100	3,825.00	61,582,500	
マーベラス	28,500	761.00	21,688,500	
エイベックス	29,800	1,407.00	41,928,600	
B I P R O G Y	57,300	4,422.00	253,380,600	
都築電気	9,200	2,237.00	20,580,400	
T B S ホールディングス	89,600	3,578.00	320,588,800	
日本テレビホールディングス	155,000	1,715.00	265,825,000	
朝日放送グループホールディングス	16,400	668.00	10,955,200	
テレビ朝日ホールディングス	42,500	1,769.00	75,182,500	
スカパー J S A T ホールディングス	136,000	757.00	102,952,000	
テレビ東京ホールディングス	12,600	3,110.00	39,186,000	
日本BS放送	4,200	902.00	3,788,400	
ビジョン	26,400	1,162.00	30,676,800	
スマートバリュー	2,900	421.00	1,220,900	
USEN-NEXT HOLDINGS	19,600	4,435.00	86,926,000	
ワイヤレスゲート	5,200	283.00	1,471,600	
日本通信	172,500	230.00	39,675,000	
クロップス	1,900	1,159.00	2,202,100	
日本電信電話	52,081,600	191.20	9,958,001,920	
KDDI	1,353,000	5,070.00	6,859,710,000	
ソフトバンク	2,817,100	1,990.50	5,607,437,550	
光通信	17,600	25,515.00	449,064,000	
エムティーアイ	12,000	605.00	7,260,000	
GMOインターネットグループ	64,700	2,755.00	178,248,500	



ファイバーゲート	9,400	964.00	9,061,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,800	239.00	669,200	
KADOKAWA	92,600	3,139.00	290,671,400	
学研ホールディングス	29,200	1,031.00	30,105,200	
ゼンリン	30,000	886.00	26,580,000	
昭文社ホールディングス	5,000	357.00	1,785,000	
インプレスホールディングス	10,300	176.00	1,812,800	
アイネット	10,600	2,076.00	22,005,600	
松竹	9,100	9,567.00	87,059,700	
東宝	97,400	4,779.00	465,474,600	
東映	5,800	21,200.00	122,960,000	
NTTデータグループ	457,800	2,160.00	988,848,000	
ピー・シー・エー	10,100	1,218.00	12,301,800	
ビジネスブレイン太田昭和	7,400	2,200.00	16,280,000	
DTS	37,300	3,740.00	139,502,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,000	5,758.00	460,640,000	
シーイーシー	22,100	1,694.00	37,437,400	
カプコン	156,600	5,626.00	881,031,600	
アイ・エス・ビー	9,000	1,583.00	14,247,000	
ジャステック	10,800	1,381.00	14,914,800	
SCSK	122,500	2,962.50	362,906,250	
NSW	7,800	2,964.00	23,119,200	
アイネス	13,700	1,607.00	22,015,900	
TKC	27,800	3,875.00	107,725,000	
富士ソフト	35,200	6,520.00	229,504,000	
NSD	62,500	2,817.00	176,062,500	
コナミグループ	65,600	9,055.00	594,008,000	
福井コンピュータホールディングス	10,800	2,633.00	28,436,400	
JBCホールディングス	11,600	4,025.00	46,690,000	
ミロク情報サービス	15,900	1,838.00	29,224,200	
ソフトバンクグループ	863,700	6,723.00	5,806,655,100	
高千穂交易	5,100	4,170.00	21,267,000	
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,831.00	3,295,800	
伊藤忠食品	4,200	7,770.00	32,634,000	
エレマテック	16,600	1,883.00	31,257,800	
あらた	28,200	3,240.00	91,368,000	

トーメンデバイス	2,700	5,450.00	14,715,000	
東京エレクトロン デバイス	18,400	5,980.00	110,032,000	
円谷フィールズホールディングス	31,700	1,530.00	48,501,000	
双日	205,600	3,508.00	721,244,800	
アルフレッサ ホールディングス	185,400	2,504.50	464,334,300	
横浜冷凍	50,300	1,098.00	55,229,400	
ラサ商事	6,600	1,634.00	10,784,400	
アルコニックス	24,300	1,393.00	33,849,900	
神戸物産	142,900	3,897.00	556,881,300	
ハイパー	2,800	305.00	854,000	
あい ホールディングス	29,600	2,471.00	73,141,600	
ディーブイエックス	3,400	1,082.00	3,678,800	
ダイワボウホールディングス	81,800	3,202.00	261,923,600	
マクニカホールディングス	43,700	8,574.00	374,683,800	
ラクト・ジャパン	7,200	2,192.00	15,782,400	
グリムス	7,800	2,147.00	16,746,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,000	1,103.00	30,884,000	
八洲電機	15,000	1,353.00	20,295,000	
メディアスホールディングス	11,900	756.00	8,996,400	
レスターホールディングス	15,700	3,195.00	50,161,500	
ジオリーブグループ	2,800	1,359.00	3,805,200	
大光	5,200	620.00	3,224,000	
OCHIホールディングス	2,800	1,560.00	4,368,000	
TOKAIホールディングス	100,300	989.00	99,196,700	
黒谷	3,400	607.00	2,063,800	
Cominix	2,400	827.00	1,984,800	
三洋貿易	20,900	1,239.00	25,895,100	
ビューティガレージ	5,800	2,147.00	12,452,600	
ウイン・パートナーズ	13,300	1,240.00	16,492,000	
ミタチ産業	3,100	1,169.00	3,623,900	
シップヘルスケアホールディングス	66,400	2,300.50	152,753,200	
明治電機工業	6,900	1,446.00	9,977,400	
デリカフーズホールディングス	4,800	594.00	2,851,200	
スターティアホールディングス	2,700	1,484.00	4,006,800	
コメダホールディングス	45,300	2,840.00	128,652,000	
ピーバンドットコム	1,800	384.00	691,200	

アセンテック	7,100	573.00	4,068,300	
富士興産	2,900	1,998.00	5,794,200	
協栄産業	1,100	2,670.00	2,937,000	
フルサト・マルカホールディングス	17,100	2,451.00	41,912,100	
ヤマエグループホールディングス	10,400	3,430.00	35,672,000	
小野建	18,200	1,810.00	32,942,000	
南陽	2,300	2,206.00	5,073,800	
佐鳥電機	9,000	2,362.00	21,258,000	
エコトレーディング	2,400	1,262.00	3,028,800	
伯東	10,600	6,170.00	65,402,000	
コンドーテック	14,200	1,248.00	17,721,600	
中山福	6,600	372.00	2,455,200	
ナガイレーベン	23,300	2,444.00	56,945,200	
三菱食品	17,100	5,000.00	85,500,000	
松田産業	14,100	2,612.00	36,829,200	
第一興商	71,500	2,100.00	150,150,000	
メディパルホールディングス	191,400	2,390.50	457,541,700	
S P K	8,200	1,976.00	16,203,200	
萩原電気ホールディングス	7,900	5,230.00	41,317,000	
アズワン	28,900	5,518.00	159,470,200	
スズデン	6,500	2,477.00	16,100,500	
尾家産業	2,900	1,775.00	5,147,500	
シモジマ	12,700	1,327.00	16,852,900	
ドウシシャ	17,100	2,171.00	37,124,100	
小津産業	2,700	1,623.00	4,382,100	
高速	11,000	2,235.00	24,585,000	
たけびし	7,100	2,055.00	14,590,500	
リックス	3,300	3,685.00	12,160,500	
丸文	16,500	1,780.00	29,370,000	
ハビネット	15,700	2,841.00	44,603,700	
橋本総業ホールディングス	7,300	1,296.00	9,460,800	
日本ライフライン	54,200	1,310.00	71,002,000	
タカショー	16,100	521.00	8,388,100	
I D O M	48,900	820.00	40,098,000	
進和	11,300	2,465.00	27,854,500	
エスケイジャパン	3,000	730.00	2,190,000	

ダイトロン	7,300	3,015.00	22,009,500	
シークス	26,300	1,464.00	38,503,200	
田中商事	3,500	810.00	2,835,000	
オーハシテクニカ	9,800	1,756.00	17,208,800	
白銅	5,200	2,406.00	12,511,200	
ダイコー通産	1,300	1,203.00	1,563,900	
伊藤忠商事	1,241,600	6,647.00	8,252,915,200	
丸紅	1,540,000	2,547.50	3,923,150,000	
高島	7,700	1,246.00	9,594,200	
長瀬産業	84,700	2,390.50	202,475,350	
蝶理	11,600	2,969.00	34,440,400	
豊田通商	161,800	9,734.00	1,574,961,200	
三共生興	25,600	732.00	18,739,200	
兼松	77,200	2,245.00	173,314,000	
ツカモトコーポレーション	1,700	1,210.00	2,057,000	
三井物産	1,391,700	5,978.00	8,319,582,600	
日本紙パルプ商事	8,800	5,060.00	44,528,000	
カメイ	19,700	1,922.00	37,863,400	
東都水産	600	7,080.00	4,248,000	
OUGホールディングス	1,800	2,469.00	4,444,200	
スターゼン	12,800	2,737.00	35,033,600	
山善	56,000	1,223.00	68,488,000	
椿本興業	3,800	6,590.00	25,042,000	
住友商事	1,117,900	3,384.00	3,782,973,600	
内田洋行	7,500	7,580.00	56,850,000	
三菱商事	3,660,000	2,602.50	9,525,150,000	
第一実業	17,400	1,924.00	33,477,600	
キヤノンマーケティングジャパン	42,800	4,376.00	187,292,800	
西華産業	7,300	3,130.00	22,849,000	
佐藤商事	12,800	1,582.00	20,249,600	
菱洋エレクトロ	17,500	3,990.00	69,825,000	
東京産業	16,900	747.00	12,624,300	
ユアサ商事	14,400	4,860.00	69,984,000	
神鋼商事	4,600	5,960.00	27,416,000	
トルク	6,600	288.00	1,900,800	
阪和興業	33,200	5,320.00	176,624,000	

正栄食品工業	12,300	4,665.00	57,379,500	
カナデン	13,900	1,559.00	21,670,100	
RYODEN	14,900	2,778.00	41,392,200	
岩谷産業	42,100	6,665.00	280,596,500	
ナイス	3,300	1,620.00	5,346,000	
ニチモウ	3,200	2,143.00	6,857,600	
極東貿易	11,000	2,156.00	23,716,000	
アステナホールディングス	34,800	487.00	16,947,600	
三愛オブリ	44,400	1,677.00	74,458,800	
稲畑産業	36,500	3,090.00	112,785,000	
G S I クレオス	10,600	2,278.00	24,146,800	
明和産業	24,400	667.00	16,274,800	
クワザワホールディングス	4,000	672.00	2,688,000	
ワキタ	30,600	1,578.00	48,286,800	
東邦ホールディングス	51,100	3,298.00	168,527,800	
サンゲツ	42,500	3,305.00	140,462,500	
ミツウロコグループホールディングス	23,600	1,574.00	37,146,400	
シナネンホールディングス	5,100	4,085.00	20,833,500	
伊藤忠エネクス	45,800	1,605.00	73,509,000	
サンリオ	52,400	6,167.00	323,150,800	
サンワテクノス	9,400	2,342.00	22,014,800	
リョーサン	13,100	5,210.00	68,251,000	
新光商事	24,800	1,258.00	31,198,400	
トーヨー	7,800	2,821.00	22,003,800	
三信電気	7,500	2,508.00	18,810,000	
東陽テクニカ	18,800	1,469.00	27,617,200	
モスフードサービス	27,200	3,400.00	92,480,000	
加賀電子	16,900	7,080.00	119,652,000	
ソーダニッカ	13,700	1,225.00	16,782,500	
立花エレテック	12,300	3,220.00	39,606,000	
フォーバル	7,300	1,402.00	10,234,600	
PAL TAC	24,900	4,555.00	113,419,500	
三谷産業	32,400	379.00	12,279,600	
西本Wismettacホールディングス	4,700	6,300.00	29,610,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,220.00	2,220,000	
コア商事ホールディングス	10,400	745.00	7,748,000	

K P P グループホールディングス	47,900	693.00	33,194,700	
ヤマタネ	8,200	2,587.00	21,213,400	
丸紅建材リース	1,100	2,791.00	3,070,100	
泉州電業	9,300	3,690.00	34,317,000	
トラスコ中山	38,800	2,505.00	97,194,000	
オートバックスセブン	64,300	1,613.50	103,748,050	
モリト	13,200	1,465.00	19,338,000	
加藤産業	22,900	4,710.00	107,859,000	
北恵	3,100	870.00	2,697,000	
イエローハット	29,400	1,805.00	53,067,000	
J Kホールディングス	14,200	1,056.00	14,995,200	
日伝	12,500	2,919.00	36,487,500	
北沢産業	6,600	286.00	1,887,600	
杉本商事	8,900	2,278.00	20,274,200	
因幡電機産業	47,900	3,570.00	171,003,000	
東テク	6,200	5,170.00	32,054,000	
ミスミグループ本社	278,800	2,483.50	692,399,800	
アルテック	6,600	260.00	1,716,000	
タキヒヨー	3,000	1,072.00	3,216,000	
蔵王産業	2,000	2,500.00	5,000,000	
スズケン	70,300	4,844.00	340,533,200	
ジェコス	11,100	1,099.00	12,198,900	
グローセル	18,900	670.00	12,663,000	
ローソン	39,300	8,332.00	327,447,600	
サンエー	14,200	4,545.00	64,539,000	
カワチ薬品	14,600	2,734.00	39,916,400	
エービーシー・マート	81,000	2,500.00	202,500,000	
ハードオフコーポレーション	6,000	1,775.00	10,650,000	
アスクル	38,400	2,121.00	81,446,400	
ゲオホールディングス	20,900	2,350.00	49,115,000	
アダストリア	22,400	3,320.00	74,368,000	
くら寿司	21,700	3,900.00	84,630,000	
キャンドウ	6,700	2,728.00	18,277,600	
I Kホールディングス	5,200	332.00	1,726,400	
パルグループホールディングス	36,400	2,270.00	82,628,000	
エディオン	73,400	1,620.00	118,908,000	

サーラコーポレーション	39,400	839.00	33,056,600
ワッツ	6,800	592.00	4,025,600
ハローズ	8,500	4,285.00	36,422,500
あみやき亭	4,600	4,260.00	19,596,000
大黒天物産	5,700	8,490.00	48,393,000
ハニーズホールディングス	14,800	1,662.00	24,597,600
ファーマライズホールディングス	3,400	674.00	2,291,600
アルペン	15,500	1,995.00	30,922,500
ハブ	4,600	754.00	3,468,400
クオールホールディングス	25,700	1,781.00	45,771,700
ジーンズホールディングス	11,100	4,305.00	47,785,500
ビックカメラ	98,600	1,357.00	133,800,200
DCMホールディングス	98,000	1,356.00	132,888,000
Monotaro	262,200	1,446.00	379,141,200
東京一番フーズ	3,800	522.00	1,983,600
きちりホールディングス	2,900	1,088.00	3,155,200
J. フロント リテイリング	212,300	1,393.50	295,840,050
ドトール・日レスホールディングス	33,000	2,211.00	72,963,000
マツキヨココカラ&カンパニー	336,200	2,743.50	922,364,700
ブロンコビリー	11,000	3,515.00	38,665,000
ZOZO	117,900	3,300.00	389,070,000
トレジャー・ファクトリー	9,300	1,214.00	11,290,200
物語コーポレーション	31,000	5,270.00	163,370,000
三越伊勢丹ホールディングス	311,300	1,759.00	547,576,700
Hamee	6,900	1,090.00	7,521,000
マーケットエンタープライズ	1,600	1,014.00	1,622,400
ウエルシアホールディングス	96,000	2,381.00	228,576,000
クリエイトSDホールディングス	30,700	3,115.00	95,630,500
丸善CHIホールディングス	15,800	329.00	5,198,200
ミサワ	3,000	708.00	2,124,000
ティーライフ	2,000	1,447.00	2,894,000
チムニー	3,800	1,452.00	5,517,600
シュッピン	17,000	1,057.00	17,969,000
オイシックス・ラ・大地	25,200	1,389.00	35,002,800
ネクステージ	42,400	2,329.00	98,749,600
ジョイフル本田	54,000	1,947.00	105,138,000

鳥貴族ホールディングス	7,000	3,820.00	26,740,000
ホットランド	14,400	1,972.00	28,396,800
すかいらーくホールディングス	252,700	2,405.00	607,743,500
SFPホールディングス	10,100	2,107.00	21,280,700
綿半ホールディングス	14,700	1,441.00	21,182,700
ヨシックスホールディングス	3,500	3,020.00	10,570,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,000	1,025.00	53,300,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	619.00	5,571,000
B E E N O S	8,000	1,485.00	11,880,000
あさひ	17,500	1,290.00	22,575,000
日本調剤	12,900	1,397.00	18,021,300
コスモス薬品	18,300	15,550.00	284,565,000
トーエル	6,100	781.00	4,764,100
セブン&アイ・ホールディングス	636,600	5,791.00	3,686,550,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	125,000	1,127.00	140,875,000
ツルハホールディングス	38,800	12,795.00	496,446,000
サンマルクホールディングス	15,100	2,241.00	33,839,100
フェリシモ	3,200	919.00	2,940,800
トリドールホールディングス	51,800	4,725.00	244,755,000
TOKYO BASE	24,000	338.00	8,112,000
ウイルプラスホールディングス	2,400	997.00	2,392,800
JMホールディングス	14,200	2,321.00	32,958,200
サツドラホールディングス	6,200	781.00	4,842,200
アレンザホールディングス	14,300	1,111.00	15,887,300
串カツ田中ホールディングス	5,200	1,840.00	9,568,000
バロックジャパンリミテッド	14,900	822.00	12,247,800
クスリのアオキホールディングス	49,500	3,248.00	160,776,000
力の源ホールディングス	8,300	1,485.00	12,325,500
FOOD & LIFE COMPANIES	98,700	3,164.00	312,286,800
メディカルシステムネットワーク	20,900	654.00	13,668,600
はるやまホールディングス	6,100	589.00	3,592,900
ノジマ	53,900	1,908.00	102,841,200
カップ・クリエイト	29,000	1,772.00	51,388,000
ライトオン	9,200	413.00	3,799,600
良品計画	201,800	2,337.00	471,606,600



パリティホールディングス	16,500	489.00	8,068,500	
アドヴァングループ	18,000	1,066.00	19,188,000	
アルビス	6,200	2,699.00	16,733,800	
コナカ	13,300	415.00	5,519,500	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,610.00	2,898,000	
G-7ホールディングス	20,500	1,248.00	25,584,000	
イオン北海道	54,800	943.00	51,676,400	
コジマ	31,200	747.00	23,306,400	
ヒマラヤ	4,400	940.00	4,136,000	
コーナン商事	22,800	3,920.00	89,376,000	
エコス	7,100	2,469.00	17,529,900	
ワタミ	19,500	1,052.00	20,514,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	373,000	3,321.00	1,238,733,000	
西松屋チェーン	36,600	2,098.00	76,786,800	
ゼンショーホールディングス	94,200	7,590.00	714,978,000	
幸楽苑ホールディングス	13,700	1,237.00	16,946,900	
ハークスレイ	5,000	961.00	4,805,000	
サイゼリヤ	27,400	5,160.00	141,384,000	
VTホールディングス	71,000	529.00	37,559,000	
魚力	6,600	2,338.00	15,430,800	
フジ・コーポレーション	9,300	1,719.00	15,986,700	
ユナイテッドアローズ	21,900	1,936.00	42,398,400	
ハイデイ日高	27,600	2,924.00	80,702,400	
YU-WA Creation Holdings	10,200	147.00	1,499,400	
コロワイド	79,400	2,359.00	187,304,600	
壺番屋	14,700	6,100.00	89,670,000	
PLANT	3,500	1,719.00	6,016,500	
スギホールディングス	37,300	6,700.00	249,910,000	
薬王堂ホールディングス	9,200	2,565.00	23,598,000	
スクロール	28,000	1,031.00	28,868,000	
ヨンドシーホールディングス	17,700	2,008.00	35,541,600	
木曽路	28,100	2,654.00	74,577,400	
SRSホールディングス	30,900	1,211.00	37,419,900	
千趣会	34,900	320.00	11,168,000	
リテールパートナーズ	27,700	1,860.00	51,522,000	

上新電機	18,500	2,474.00	45,769,000
日本瓦斯	98,100	2,304.50	226,071,450
ロイヤルホールディングス	32,600	2,605.00	84,923,000
いなげや	18,000	1,281.00	23,058,000
チョダ	18,200	903.00	16,434,600
ライフコーポレーション	19,400	3,830.00	74,302,000
リンガーハット	23,800	2,467.00	58,714,600
MrMaxHD	26,400	629.00	16,605,600
AOKIホールディングス	40,000	1,206.00	48,240,000
オークワ	26,700	897.00	23,949,900
コメリ	28,600	3,275.00	93,665,000
青山商事	39,800	1,784.00	71,003,200
しまむら	21,700	16,635.00	360,979,500
はせがわ	7,300	367.00	2,679,100
高島屋	127,700	2,077.50	265,296,750
松屋	31,500	981.00	30,901,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,800	1,628.00	133,170,400
近鉄百貨店	8,100	2,536.00	20,541,600
丸井グループ	122,700	2,515.00	308,590,500
アクシアル リテイリング	12,700	4,025.00	51,117,500
イオン	626,200	3,527.00	2,208,607,400
イズミ	32,800	3,616.00	118,604,800
平和堂	30,900	2,207.00	68,196,300
フジ	28,400	1,988.00	56,459,200
ヤオコー	20,900	8,624.00	180,241,600
ゼビオホールディングス	25,500	969.00	24,709,500
ケーズホールディングス	130,900	1,326.50	173,638,850
Olympicグループ	5,500	545.00	2,997,500
日産東京販売ホールディングス	16,600	463.00	7,685,800
シルバーライフ	4,000	890.00	3,560,000
Genky DrugStores	8,200	5,800.00	47,560,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,196.00	2,870,400
ブックオフグループホールディングス	9,800	1,267.00	12,416,600
ギフトホールディングス	8,000	2,644.00	21,152,000
アインホールディングス	25,500	4,525.00	115,387,500
元気寿司	10,600	3,810.00	40,386,000

ヤマダホールディングス	569,200	448.10	255,058,520	
アークランズ	55,200	1,705.00	94,116,000	
ニトリホールディングス	67,300	18,450.00	1,241,685,000	
グルメ杵屋	15,400	1,092.00	16,816,800	
愛眼	9,000	188.00	1,692,000	
ケーユーホールディングス	9,100	1,170.00	10,647,000	
吉野家ホールディングス	68,200	3,381.00	230,584,200	
松屋フーズホールディングス	8,800	5,930.00	52,184,000	
サガミホールディングス	28,000	1,546.00	43,288,000	
関西フードマーケット	12,800	1,465.00	18,752,000	
王将フードサービス	13,700	8,210.00	112,477,000	
ミニストップ	13,500	1,543.00	20,830,500	
アークス	34,000	2,927.00	99,518,000	
バローホールディングス	35,400	2,517.00	89,101,800	
ベルク	9,300	6,270.00	58,311,000	
大庄	8,100	1,345.00	10,894,500	
ファーストリテイリング	83,100	39,610.00	3,291,591,000	
サンドラッグ	62,400	4,535.00	282,984,000	
サックスパー ホールディングス	17,900	851.00	15,232,900	
ヤマザワ	2,600	1,269.00	3,299,400	
やまや	2,700	3,110.00	8,397,000	
ベルーナ	45,200	624.00	28,204,800	
いよぎんホールディングス	204,600	978.10	200,119,260	
しずおかフィナンシャルグループ	382,000	1,283.00	490,106,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	144,800	1,033.00	149,578,400	
楽天銀行	59,800	2,222.00	132,875,600	
京都フィナンシャルグループ	218,000	2,335.00	509,030,000	
島根銀行	3,900	525.00	2,047,500	
じもとホールディングス	10,000	520.00	5,200,000	
めぶきフィナンシャルグループ	853,200	436.80	372,677,760	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,000	4,220.00	92,840,000	
九州フィナンシャルグループ	332,800	867.70	288,770,560	
ゆうちょ銀行	1,889,400	1,504.50	2,842,602,300	
富山第一銀行	54,600	790.00	43,134,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	922,600	685.30	632,257,780	
西日本フィナンシャルホールディングス	97,000	1,647.00	159,759,000	

三十三フィナンシャルグループ	15,400	1,890.00	29,106,000	
第四北越フィナンシャルグループ	27,000	3,970.00	107,190,000	
ひろぎんホールディングス	244,700	956.60	234,080,020	
おきなわフィナンシャルグループ	14,700	2,397.00	35,235,900	
十六フィナンシャルグループ	22,300	3,995.00	89,088,500	
北國フィナンシャルホールディングス	18,100	4,310.00	78,011,000	
プロクレアホールディングス	19,600	1,898.00	37,200,800	
あいちフィナンシャルグループ	26,500	2,541.00	67,336,500	
あおぞら銀行	123,600	3,245.00	401,082,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,476,900	1,308.00	13,703,785,200	
りそなホールディングス	2,004,900	770.30	1,544,374,470	
三井住友トラスト・ホールディングス	618,200	2,899.00	1,792,161,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,222,500	7,373.00	9,013,492,500	
千葉銀行	479,200	1,065.50	510,587,600	
群馬銀行	333,600	709.90	236,822,640	
武蔵野銀行	24,000	2,742.00	65,808,000	
千葉興業銀行	28,400	865.00	24,566,000	
筑波銀行	75,500	246.00	18,573,000	
七十七銀行	50,000	3,485.00	174,250,000	
秋田銀行	11,500	1,956.00	22,494,000	
山形銀行	19,100	1,090.00	20,819,000	
岩手銀行	10,900	2,517.00	27,435,300	
東邦銀行	136,000	302.00	41,072,000	
東北銀行	5,500	1,165.00	6,407,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	149,700	3,440.00	514,968,000	
スルガ銀行	151,500	885.00	134,077,500	
八十二銀行	368,900	785.50	289,770,950	
山梨中央銀行	19,300	1,726.00	33,311,800	
大垣共立銀行	32,800	1,925.00	63,140,000	
福井銀行	15,400	1,695.00	26,103,000	
清水銀行	6,800	1,559.00	10,601,200	
富山銀行	1,700	1,712.00	2,910,400	
滋賀銀行	28,600	3,435.00	98,241,000	
南都銀行	25,900	2,582.00	66,873,800	
百五銀行	161,800	566.00	91,578,800	
紀陽銀行	61,500	1,673.00	102,889,500	

ほくほくフィナンシャルグループ	106,400	1,581.00	168,218,400	
山陰合同銀行	107,600	1,023.00	110,074,800	
鳥取銀行	3,600	1,418.00	5,104,800	
百十四銀行	16,900	2,420.00	40,898,000	
四国銀行	27,100	993.00	26,910,300	
阿波銀行	24,100	2,443.00	58,876,300	
大分銀行	10,300	2,639.00	27,181,700	
宮崎銀行	10,400	2,695.00	28,028,000	
佐賀銀行	10,100	1,900.00	19,190,000	
琉球銀行	36,600	1,128.00	41,284,800	
セブン銀行	538,900	307.30	165,603,970	
みずほフィナンシャルグループ	2,320,800	2,587.50	6,005,070,000	
高知銀行	3,900	947.00	3,693,300	
山口フィナンシャルグループ	168,600	1,339.00	225,755,400	
名古屋銀行	11,200	5,390.00	60,368,000	
北洋銀行	260,500	364.00	94,822,000	
大光銀行	3,400	1,311.00	4,457,400	
愛媛銀行	23,200	1,062.00	24,638,400	
トマト銀行	3,700	1,193.00	4,414,100	
京葉銀行	72,100	707.00	50,974,700	
栃木銀行	85,900	308.00	26,457,200	
北日本銀行	6,000	2,193.00	13,158,000	
東和銀行	31,600	625.00	19,750,000	
福島銀行	12,000	238.00	2,856,000	
大東銀行	4,400	752.00	3,308,800	
トモニホールディングス	139,000	392.00	54,488,000	
フィデアホールディングス	17,800	1,557.00	27,714,600	
池田泉州ホールディングス	238,500	330.00	78,705,000	
F P G	58,200	1,700.00	98,940,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,100	841.00	11,858,100	
マーキュリアホールディングス	6,000	708.00	4,248,000	
S B I ホールディングス	251,700	3,625.00	912,412,500	
ジャフコ グループ	51,300	1,710.00	87,723,000	
大和証券グループ本社	1,332,000	1,044.00	1,390,608,000	
野村ホールディングス	2,891,600	752.20	2,175,061,520	
岡三証券グループ	151,100	759.00	114,684,900	

丸三証券	57,300	878.00	50,309,400	
東洋証券	46,000	306.00	14,076,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204,400	555.00	113,442,000	
光世証券	2,900	574.00	1,664,600	
水戸証券	51,000	477.00	24,327,000	
いちよし証券	32,400	775.00	25,110,000	
松井証券	84,800	806.00	68,348,800	
マネックスグループ	168,600	761.00	128,304,600	
極東証券	23,700	1,064.00	25,216,800	
岩井コスモホールディングス	19,700	2,057.00	40,522,900	
アイザワ証券グループ	24,900	1,244.00	30,975,600	
マネーパートナーズグループ	12,400	304.00	3,769,600	
スパークス・グループ	19,200	1,800.00	34,560,000	
かんぽ生命保険	175,100	2,681.50	469,530,650	
F P パートナー	3,400	5,930.00	20,162,000	
S O M P Oホールディングス	258,800	7,697.00	1,991,983,600	
アニコム ホールディングス	58,400	575.00	33,580,000	
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	385,000	6,030.00	2,321,550,000	
第一生命ホールディングス	840,100	3,158.00	2,653,035,800	
東京海上ホールディングス	1,699,500	3,831.00	6,510,784,500	
T & Dホールディングス	462,000	2,422.00	1,118,964,000	
アドバンスクリエイト	9,900	1,015.00	10,048,500	
全国保証	45,000	5,419.00	243,855,000	
あんしん保証	6,600	244.00	1,610,400	
イントラスト	4,700	808.00	3,797,600	
日本モーゲージサービス	6,800	521.00	3,542,800	
C a s a	4,700	889.00	4,178,300	
S B I アルヒ	16,900	850.00	14,365,000	
プレミアグループ	29,100	1,793.00	52,176,300	
ネットプロテクションズホールディングス	58,500	183.00	10,705,500	
クレディセゾン	109,100	2,839.50	309,789,450	
芙蓉総合リース	15,800	13,315.00	210,377,000	
みずほリース	28,900	5,310.00	153,459,000	
東京センチュリー	128,800	1,636.50	210,781,200	
日本証券金融	63,400	1,566.00	99,284,400	

アイフル	253,900	377.00	95,720,300
リコーリース	16,400	5,070.00	83,148,000
イオンフィナンシャルサービス	99,000	1,345.50	133,204,500
アコム	307,700	368.00	113,233,600
ジャックス	18,400	5,730.00	105,432,000
オリエントコーポレーション	56,400	1,120.00	63,168,000
オリックス	1,048,100	2,844.00	2,980,796,400
三菱HCキャピタル	766,400	1,028.00	787,859,200
九州リースサービス	5,600	1,077.00	6,031,200
日本取引所グループ	448,700	3,287.00	1,474,876,900
イー・ギャランティ	28,100	2,019.00	56,733,900
アサックス	5,600	730.00	4,088,000
NECキャピタルソリューション	8,500	3,715.00	31,577,500
Robot Home	51,400	172.00	8,840,800
大東建託	63,000	16,410.00	1,033,830,000
いちご	199,900	378.00	75,562,200
日本駐車場開発	185,300	188.00	34,836,400
スター・マイカ・ホールディングス	21,100	594.00	12,533,400
SREホールディングス	8,600	2,733.00	23,503,800
ADワークスグループ	28,600	227.00	6,492,200
ヒューリック	401,500	1,612.50	647,418,750
野村不動産ホールディングス	95,900	4,107.00	393,861,300
三重交通グループホールディングス	37,900	644.00	24,407,600
サムティ	27,600	2,499.00	68,972,400
ディア・ライフ	30,000	992.00	29,760,000
地主	13,400	2,342.00	31,382,800
プレサンスコーポレーション	27,700	1,687.00	46,729,900
ハウスコム	2,600	916.00	2,381,600
JPMC	10,500	1,138.00	11,949,000
サンセイランディック	4,100	1,065.00	4,366,500
フージャースホールディングス	26,500	1,136.00	30,104,000
オープンハウスグループ	63,100	4,567.00	288,177,700
東急不動産ホールディングス	517,600	1,033.50	534,939,600
飯田グループホールディングス	165,000	2,281.50	376,447,500
イーグランド	2,200	1,551.00	3,412,200
ムゲンエステート	8,300	1,151.00	9,553,300

And Doホールディングス	10,400	1,083.00	11,263,200	
シーアールイー	10,000	1,470.00	14,700,000	
ケイアイスター不動産	8,500	3,465.00	29,452,500	
グッドコムアセット	16,900	734.00	12,404,600	
ジェイ・エス・ビー	8,800	2,515.00	22,132,000	
ロードスターキャピタル	11,500	1,962.00	22,563,000	
テンポイノベーション	4,100	1,025.00	4,202,500	
フェイスネットワーク	3,600	1,568.00	5,644,800	
霞ヶ関キャピタル	4,100	10,480.00	42,968,000	
パーク24	112,000	1,850.00	207,200,000	
パラカ	6,400	1,933.00	12,371,200	
三井不動産	795,300	3,844.00	3,057,133,200	
三菱地所	1,124,200	2,145.50	2,411,971,100	
平和不動産	28,100	3,950.00	110,995,000	
東京建物	150,500	2,343.50	352,696,750	
京阪神ビルディング	32,600	1,453.00	47,367,800	
住友不動産	248,800	4,708.00	1,171,350,400	
テーオーシー	31,900	705.00	22,489,500	
東京楽天地	3,000	6,690.00	20,070,000	
レオパレス21	172,000	414.00	71,208,000	
スターツコーポレーション	24,900	2,970.00	73,953,000	
フジ住宅	24,900	720.00	17,928,000	
空港施設	25,400	623.00	15,824,200	
明和地所	9,100	1,346.00	12,248,600	
ゴールドクレスト	14,300	2,329.00	33,304,700	
エスリード	8,300	3,610.00	29,963,000	
日神グループホールディングス	28,900	517.00	14,941,300	
日本エスコン	32,200	981.00	31,588,200	
MIRARTHホールディングス	79,000	499.00	39,421,000	
AVANTIA	7,200	899.00	6,472,800	
イオンモール	89,500	1,811.50	162,129,250	
毎日コムネット	5,200	782.00	4,066,400	
ファースト住建	5,200	1,110.00	5,772,000	
カチタス	46,500	1,790.00	83,235,000	
トーセイ	29,000	2,228.00	64,612,000	
穴吹興産	2,600	2,107.00	5,478,200	



サンフロンティア不動産	25,900	1,813.00	46,956,700
F Jネクストホールディングス	18,700	1,200.00	22,440,000
インテリックス	2,800	558.00	1,562,400
ランドビジネス	4,200	269.00	1,129,800
サンネクスタグループ	4,100	958.00	3,927,800
グランディハウス	12,400	648.00	8,035,200
日本空港ビルデング	60,900	6,064.00	369,297,600
明豊ファシリティワークス	6,400	864.00	5,529,600
L I F U L L	63,000	198.00	12,474,000
M I X I	38,600	2,533.00	97,773,800
ジェイエイシーリクルートメント	65,200	666.00	43,423,200
日本M&Aセンターホールディングス	286,400	769.70	220,442,080
メンバーズ	6,400	1,010.00	6,464,000
中広	2,400	416.00	998,400
UTグループ	23,700	2,239.00	53,064,300
アイティメディア	7,200	1,040.00	7,488,000
ケアネット	27,900	847.00	23,631,300
E・Jホールディングス	10,700	1,721.00	18,414,700
オープンアップグループ	54,000	2,215.00	119,610,000
コシダカホールディングス	54,000	1,034.00	55,836,000
アルトナー	4,300	2,309.00	9,928,700
パソナグループ	21,900	2,691.00	58,932,900
C D S	3,100	1,704.00	5,282,400
リンクアンドモチベーション	51,700	553.00	28,590,100
エス・エム・エス	63,000	2,560.00	161,280,000
サニーサイドアップグループ	3,900	575.00	2,242,500
パーソルホールディングス	1,828,300	233.50	426,908,050
リニカル	7,200	528.00	3,801,600
クックパッド	51,700	114.00	5,893,800
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,300	712.00	4,485,600
学情	9,300	1,780.00	16,554,000
スタジオアリス	9,100	2,073.00	18,864,300
エプロ	3,700	960.00	3,552,000
N J S	4,000	2,780.00	11,120,000
総合警備保障	300,100	817.50	245,331,750
カカコム	118,700	1,720.50	204,223,350

アイロムグループ	7,400	2,063.00	15,266,200	
セントケア・ホールディング	13,400	1,006.00	13,480,400	
サイネックス	2,500	867.00	2,167,500	
ルネサンス	14,300	923.00	13,198,900	
ディップ	27,600	2,522.00	69,607,200	
デジタルホールディングス	12,900	1,216.00	15,686,400	
新日本科学	16,500	1,667.00	27,505,500	
キャリアデザインセンター	2,600	2,091.00	5,436,600	
ベネフィット・ワン	62,600	2,130.00	133,338,000	
エムスリー	354,800	2,369.00	840,521,200	
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	383.00	2,910,800	
アウトソーシング	115,400	1,737.00	200,449,800	
ウェルネット	9,600	566.00	5,433,600	
ワールドホールディングス	8,200	2,943.00	24,132,600	
ディー・エヌ・エー	64,000	1,509.50	96,608,000	
博報堂DYホールディングス	229,200	1,125.50	257,964,600	
ぐるなび	34,500	272.00	9,384,000	
タカミヤ	25,000	493.00	12,325,000	
ファンコミュニケーションズ	32,300	405.00	13,081,500	
ライク	6,900	1,513.00	10,439,700	
A o b a - B B T	5,200	409.00	2,126,800	
エスプール	52,300	325.00	16,997,500	
WDBホールディングス	9,300	2,288.00	21,278,400	
ティア	7,700	470.00	3,619,000	
CDG	1,500	1,207.00	1,810,500	
アドウェイズ	25,300	527.00	13,333,100	
バリューコマース	16,000	1,533.00	24,528,000	
インフォマート	187,000	405.00	75,735,000	
J Pホールディングス	52,000	449.00	23,348,000	
エコナックホールディングス	12,300	134.00	1,648,200	
CLホールディングス	5,100	893.00	4,554,300	
プレステージ・インターナショナル	84,500	597.00	50,446,500	
アミューズ	11,100	1,548.00	17,182,800	
ドリームインキュベータ	6,300	3,275.00	20,632,500	
クイック	12,600	2,525.00	31,815,000	
TAC	7,300	198.00	1,445,400	

電通グループ	176,500	3,935.00	694,527,500	
イオンファンタジー	6,600	2,577.00	17,008,200	
シーティーエス	23,100	705.00	16,285,500	
NEXYZ. Group	4,000	711.00	2,844,000	
H. U. グループホールディングス	52,600	2,740.00	144,124,000	
アルプス技研	17,200	2,758.00	47,437,600	
日本空調サービス	19,700	828.00	16,311,600	
オリエンタルランド	949,800	5,593.00	5,312,231,400	
ダスキン	40,000	3,433.00	137,320,000	
明光ネットワークジャパン	22,200	726.00	16,117,200	
ファルコホールディングス	8,200	2,186.00	17,925,200	
ラウンドワン	169,400	665.00	112,651,000	
リゾートトラスト	78,100	2,546.00	198,842,600	
ビー・エム・エル	22,200	2,912.00	64,646,400	
リソー教育	93,100	243.00	22,623,300	
早稲田アカデミー	10,100	1,721.00	17,382,100	
ユー・エス・エス	201,400	2,885.00	581,039,000	
東京個別指導学院	21,900	449.00	9,833,100	
サイバーエージェント	396,900	933.80	370,625,220	
楽天グループ	1,537,800	658.60	1,012,795,080	
クリーク・アンド・リバー社	9,200	2,000.00	18,400,000	
SBIグローバルアセットマネジメント	35,600	625.00	22,250,000	
テー・オー・ダブリュー	36,100	328.00	11,840,800	
山田コンサルティンググループ	9,200	1,733.00	15,943,600	
セントラルスポーツ	6,900	2,507.00	17,298,300	
フルキャストホールディングス	17,300	1,773.00	30,672,900	
エン・ジャパン	29,300	2,594.00	76,004,200	
リソルホールディングス	1,100	6,110.00	6,721,000	
テクノプロ・ホールディングス	105,600	3,518.00	371,500,800	
アトラグループ	3,600	189.00	680,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,500	1,591.00	15,114,500	
Keeper 技研	11,100	6,630.00	73,593,000	
ファーストロジック	3,400	536.00	1,822,400	
三機サービス	2,100	1,325.00	2,782,500	
Gunosy	14,700	708.00	10,407,600	
デザインワン・ジャパン	4,800	130.00	624,000	

イー・ガーディアン	7,000	1,579.00	11,053,000	
リブセンス	6,500	253.00	1,644,500	
ジャパンマテリアル	55,000	2,585.00	142,175,000	
ベクトル	22,300	1,186.00	26,447,800	
ウチヤマホールディングス	5,900	383.00	2,259,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,200	1,207.00	18,346,400	
キャリアリンク	6,700	2,549.00	17,078,300	
I B J	14,100	724.00	10,208,400	
アサンテ	9,100	1,695.00	15,424,500	
バリューHR	15,900	1,480.00	23,532,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	14,700	2,387.00	35,088,900	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,400	1,031.00	7,629,400	
E R I ホールディングス	3,200	1,768.00	5,657,600	
アビスト	1,900	3,105.00	5,899,500	
シグマクシス・ホールディングス	24,400	1,377.00	33,598,800	
ウィルグループ	15,300	1,199.00	18,344,700	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,700	141.00	2,072,700	
メドピア	16,200	708.00	11,469,600	
レアジョブ	2,600	882.00	2,293,200	
リクルートホールディングス	1,328,700	6,149.00	8,170,176,300	
エラン	24,000	1,049.00	25,176,000	
土木管理総合試験所	6,400	331.00	2,118,400	
日本郵政	2,109,100	1,391.50	2,934,812,650	
ベルシステム24ホールディングス	19,400	1,830.00	35,502,000	
鎌倉新書	15,900	620.00	9,858,000	
SMN	3,600	292.00	1,051,200	
グローバルキッズCOMPANY	2,700	651.00	1,757,700	
エアトリ	13,300	1,843.00	24,511,900	
アトラエ	11,100	676.00	7,503,600	
ストライク	7,700	4,350.00	33,495,000	
ソラスト	50,000	585.00	29,250,000	
セラク	5,700	1,189.00	6,777,300	
インソース	39,300	798.00	31,361,400	
ベイカレント・コンサルティング	132,000	3,674.00	484,968,000	
Orchestra Holdings	4,100	1,014.00	4,157,400	
アイモバイル	24,600	445.00	10,947,000	

キャリアインデックス	5,100	209.00	1,065,900	
MS-Japan	6,000	1,249.00	7,494,000	
船場	2,800	860.00	2,408,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	58,300	2,170.00	126,511,000	
フルテック	1,900	1,157.00	2,198,300	
GameWith	4,500	329.00	1,480,500	
MS&Consulting	1,900	609.00	1,157,100	
ウェルビー	13,500	847.00	11,434,500	
エル・ティー・エス	2,200	2,920.00	6,424,000	
ミダックホールディングス	11,100	2,033.00	22,566,300	
キュービーネットホールディングス	8,800	1,505.00	13,244,000	
RPAホールディングス	25,400	251.00	6,375,400	
スプリックス	3,800	833.00	3,165,400	
マネジメントソリューションズ	7,800	3,095.00	24,141,000	
プロレド・パートナーズ	5,200	373.00	1,939,600	
テノ.ホールディングス	2,000	509.00	1,018,000	
フロンティア・マネジメント	5,200	1,576.00	8,195,200	
コプロ・ホールディングス	4,200	1,618.00	6,795,600	
ギークス	2,000	508.00	1,016,000	
アンビスホールディングス	19,300	2,704.00	52,187,200	
カープスホールディングス	49,500	727.00	35,986,500	
フォーラムエンジニアリング	24,800	824.00	20,435,200	
Fast Fitness Japan	6,400	1,120.00	7,168,000	
ダイレクトマーケティングミックス	19,200	451.00	8,659,200	
ポピンズ	2,900	1,151.00	3,337,900	
LITALICO	14,100	1,876.00	26,451,600	
コンフィデンス・インターワークス	1,100	1,534.00	1,687,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,100	471.00	2,873,100	
リログループ	90,100	1,567.50	141,231,750	
東祥	12,900	881.00	11,364,900	
ID&Eホールディングス	10,900	3,505.00	38,204,500	
ビーウィズ	4,700	1,923.00	9,038,100	
TREホールディングス	34,600	1,225.00	42,385,000	
人・夢・技術グループ	6,900	1,808.00	12,475,200	
NISSOホールディングス	16,000	843.00	13,488,000	

大栄環境	32,700	2,561.00	83,744,700
日本管財ホールディングス	18,900	2,634.00	49,782,600
M&A総研ホールディングス	8,700	4,630.00	40,281,000
エイチ・アイ・エス	52,300	1,812.00	94,767,600
ラックランド	8,300	2,547.00	21,140,100
共立メンテナンス	28,200	6,094.00	171,850,800
イチネンホールディングス	19,200	1,597.00	30,662,400
建設技術研究所	9,300	6,080.00	56,544,000
スペース	12,300	953.00	11,721,900
燦ホールディングス	17,100	1,124.00	19,220,400
スバル興業	1,000	15,900.00	15,900,000
東京テアトル	4,400	1,122.00	4,936,800
タナベコンサルティンググループ	5,700	1,066.00	6,076,200
ナガワ	5,700	7,600.00	43,320,000
東京都競馬	15,100	4,745.00	71,649,500
カナモト	27,900	2,913.00	81,272,700
ニシオホールディングス	16,800	4,100.00	68,880,000
トランス・コスモス	22,400	3,130.00	70,112,000
乃村工藝社	78,600	872.00	68,539,200
藤田観光	7,200	6,390.00	46,008,000
KNT-CTホールディングス	10,700	1,351.00	14,455,700
トーカイ	16,000	2,123.00	33,968,000
セコム	182,800	11,130.00	2,034,564,000
セントラル警備保障	9,800	2,547.00	24,960,600
丹青社	35,100	878.00	30,817,800
メイテックグループホールディングス	64,700	2,928.00	189,441,600
応用地質	16,900	2,178.00	36,808,200
船井総研ホールディングス	37,500	2,596.00	97,350,000
進学会ホールディングス	4,900	255.00	1,249,500
オオバ	7,700	1,015.00	7,815,500
いであ	3,400	1,768.00	6,011,200
学究社	7,300	2,080.00	15,184,000
ベネッセホールディングス	60,400	2,630.00	158,852,000
イオンディライト	19,800	3,665.00	72,567,000
ナック	7,900	1,064.00	8,405,600
ダイセキ	36,700	4,440.00	162,948,000

ステップ	6,700	1,969.00	13,192,300	
合計	268,549,100		630,516,152,660	

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	株式会社ジャパンインベストメントアドバイザー第4回新株予約権	14,100	6,669,300	
合計		14,100	6,669,300	

(注) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	641,062,311
コール・ローン	3,142,102,327
国債証券	302,748,390,009
派生商品評価勘定	43,159,724
未収利息	2,374,336,909
前払金	29,286,852
前払費用	172,649,298
差入委託証拠金	226,424,304
流動資産合計	309,377,411,734
資産合計	309,377,411,734
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,434,300
未払解約金	146,791,922
未払利息	1,612
流動負債合計	178,227,834
負債合計	178,227,834
純資産の部	
元本等	
元本	89,483,539,916
剰余金	

剰余金又は欠損金 (△)	219,715,643,984
元本等合計	309,199,183,900
純資産合計	309,199,183,900
負債純資産合計	309,377,411,734

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2024年1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	89,483,539,916 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 3.4554 円 (1万口当たり純資産額) (34,554 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年1月22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



<p>2. 金融商品の内容及びそのリスク</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p> <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

	2024年 1月 22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</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	2024年 1月 22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月 21日
期首元本額	97,859,127,765 円
期中追加設定元本額	13,853,358,073 円
期中一部解約元本額	22,228,945,922 円

期末元本額	89,483,539,916 円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,127,879,563 円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	510,882,114 円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	338,394,891 円
SBI 資産設計オープン（資産成長型）	2,394,775,482 円
SBI 資産設計オープン（分配型）	8,811,419 円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,651,935,085 円
世界経済インデックスファンド	19,436,515,798 円
DCマイセクション25	1,949,386,673 円
DCマイセクション50	1,764,841,540 円
DCマイセクション75	1,369,990,043 円
DC外国債券インデックス・オープン	2,250,088,060 円
DCマイセクションS25	1,061,425,783 円
DCマイセクションS50	970,596,795 円
DCマイセクションS75	548,143,482 円
DCターゲット・イヤーフンド2025	16,083,793 円
DCターゲット・イヤーフンド2035	100,042,091 円
DCターゲット・イヤーフンド2045	53,928,042 円
DC世界経済インデックスファンド	14,025,977,455 円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	684,461,520 円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	918,168 円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	940,568 円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	15,949,793 円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,235,921 円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	49,320,829 円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	55,345,956 円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	49,382,939 円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	810,630,332 円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	374,359,504 円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,526,427,389 円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	53,180,661 円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	31,056,146 円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	354,407,802 円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	131,348,565 円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	175,809,619 円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	637,131,615 円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,500,738,033 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	628,988,584 円
外国債券ファンド・シリーズ1	780,695,330 円
分散投資コア戦略ファンドA	518,368,608 円
分散投資コア戦略ファンドS	1,368,649,263 円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	720,913,554 円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,430,130,089 円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,697,854 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,644,216 円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,342,203,460 円
SMT インデックスバランス・オープン	163,426,528 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	377,050,936 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	508,298,451 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	809,563,655 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,751,177 円
グローバル経済コア	832,966,256 円
SBI 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,252,514 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,581,230 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	56,443,305 円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	76,351,560円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	38,127,580円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	49,138,191円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	488,591,737円
10資産分散投資ファンド	26,133,993円
グローバル10資産バランスファンド	8,793,335円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	22,068円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	12,413,848,712円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	178,714,946円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	121,835,342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）	130,881,565円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,031,252,392
合計		3,031,252,392

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

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	2,696,488,854	—	2,667,202,002	△29,286,852
合計		2,696,488,854	—	2,667,202,002	△29,286,852

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年1月22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	3,001,318,674	—	3,042,330,950	41,012,276
	アメリカドル	1,473,684,914	—	1,497,488,370	23,803,456
	カナダドル	116,988,260	—	118,693,080	1,704,820
	ユーロ	984,576,253	—	994,782,858	10,206,605
	イギリスポンド	168,485,640	—	170,657,851	2,172,211
	オフショア人民元	257,583,607	—	260,708,791	3,125,184
	合計	3,001,318,674	—	3,042,330,950	41,012,276

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.25% 05/31/25	3,900,000.00	3,678,416.00	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,573,781.25	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,875,000.00	
		T 0.25% 08/31/25	5,250,000.00	4,907,416.97	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,795,917.98	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,344,976.57	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,387,968.72	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,579,687.52	
		T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,831,621.08	
		T 0.375% 09/30/27	6,580,000.00	5,748,503.88	
		T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,785,898.43	
		T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,705,937.52	
		T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,155,908.22	
		T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,872,114.48	
		T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,616,427.74	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,106,250.00			

T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,160,007.78	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,101,619.13	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,565,136.70	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,720,263.70	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,356,781.25	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,315,781.28	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,578,205.10	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,193,359.37	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,399,062.46	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,456,259.75	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,561,953.14	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,780,449.19	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,687,890.64	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,674,735.93	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,386,406.24	
T 0.875% 09/30/26	2,900,000.00	2,658,767.58	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,050,446.30	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,559,922.60	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,358,668.72	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	8,171,289.02	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,112,812.48	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,059,899.41	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,188,859.38	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,498,222.61	
T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,561,112.45	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,118,437.52	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	2,807,627.95	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,327,578.14	
T 1.25% 06/30/28	9,000,000.00	7,974,667.98	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,529,300.41	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,363,154.28	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,453,261.71	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,563,359.93	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,864,880.16	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	2,982,035.14	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,111,074.98	

T 1.375% 11/15/31	12,580,000.00	10,292,503.87	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	3,826,289.04	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,312,382.78	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,550,351.54	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,572,540.21	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	7,006,347.67	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,655,224.60	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,301,296.89	
T 1.625% 05/15/26	10,770,000.00	10,146,097.23	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	5,037,247.64	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,949,228.53	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,613,625.00	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	3,864,539.02	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,455,389.43	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,371,640.64	
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	2,030,970.71	
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,131,212.50	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,650,429.68	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	9,924,001.53	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,466,121.07	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	3,942,597.64	
T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,736,640.64	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,900,698.03	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	1,963,371.10	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,116,796.84	
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,096,325.40	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,429,984.38	
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,248,110.35	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	2,811,460.91	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,182,128.92	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,742,548.40	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,066,140.25	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,114,431.25	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,641,709.00	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,233,109.36	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,153,646.50	

T 2. 25% 12/31/24	5,400,000.00	5,271,146.87	
T 2. 375% 02/15/42	5,500,000.00	4,066,777.33	
T 2. 375% 03/31/29	4,900,000.00	4,511,923.82	
T 2. 375% 04/30/26	2,600,000.00	2,494,019.52	
T 2. 375% 05/15/27	11,690,000.00	11,056,411.11	
T 2. 375% 05/15/29	6,010,000.00	5,523,800.37	
T 2. 375% 05/15/51	8,150,000.00	5,494,086.88	
T 2. 375% 11/15/49	4,100,000.00	2,788,480.47	
T 2. 5% 01/31/25	5,000,000.00	4,885,789.70	
T 2. 5% 02/15/45	2,810,000.00	2,044,604.30	
T 2. 5% 02/15/46	2,450,000.00	1,761,176.76	
T 2. 5% 03/31/27	7,100,000.00	6,756,648.40	
T 2. 5% 05/15/46	1,450,000.00	1,039,185.55	
T 2. 625% 01/31/26	4,690,000.00	4,534,643.75	
T 2. 625% 02/15/29	3,340,000.00	3,119,899.21	
T 2. 625% 03/31/25	7,250,000.00	7,077,529.31	
T 2. 625% 05/31/27	2,400,000.00	2,287,359.38	
T 2. 625% 12/31/25	5,820,000.00	5,632,441.42	
T 2. 75% 02/15/28	6,550,000.00	6,222,755.84	
T 2. 75% 04/30/27	5,450,000.00	5,219,971.68	
T 2. 75% 05/31/29	5,700,000.00	5,337,404.30	
T 2. 75% 06/30/25	5,500,000.00	5,364,326.16	
T 2. 75% 08/15/32	12,900,000.00	11,618,062.50	
T 2. 75% 08/15/42	7,100,000.00	5,552,421.87	
T 2. 75% 08/15/47	4,050,000.00	3,013,136.73	
T 2. 75% 08/31/25	6,900,000.00	6,713,214.86	
T 2. 75% 11/15/42	6,020,000.00	4,694,659.37	
T 2. 75% 11/15/47	3,050,000.00	2,265,339.85	
T 2. 875% 04/30/25	4,000,000.00	3,912,109.36	
T 2. 875% 04/30/29	3,300,000.00	3,112,634.77	
T 2. 875% 05/15/28	10,060,000.00	9,580,578.12	
T 2. 875% 05/15/32	10,100,000.00	9,211,121.11	
T 2. 875% 05/15/43	3,550,000.00	2,810,116.20	
T 2. 875% 05/15/49	6,080,000.00	4,597,168.74	
T 2. 875% 05/15/52	10,800,000.00	8,139,867.22	
T 2. 875% 05/31/25	3,820,000.00	3,733,975.39	

T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,328,085.52	
T 2.875% 08/15/28	8,220,000.00	7,811,408.21	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,781,511.71	
T 2.875% 11/15/46	940,000.00	720,128.12	
T 2.875% 11/30/25	9,000,000.00	8,753,027.31	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,214,225.66	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,710,639.64	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,320,355.48	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	4,829,896.50	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	3,034,346.87	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,320,382.82	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	876,934.56	
T 3.125% 02/15/43	3,800,000.00	3,135,964.85	
T 3.125% 05/15/48	4,780,000.00	3,801,033.58	
T 3.125% 08/15/25	10,200,000.00	9,988,429.66	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,501,253.12	
T 3.125% 08/31/27	6,150,000.00	5,946,641.57	
T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,804,649.42	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,052,023.44	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,514,207.05	
T 3.25% 06/30/29	3,000,000.00	2,878,183.59	
T 3.375% 05/15/33	13,630,000.00	12,835,626.56	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,558,558.78	
T 3.375% 08/15/42	2,300,000.00	1,980,066.41	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,405,935.52	
T 3.5% 01/31/30	4,000,000.00	3,870,937.52	
T 3.5% 02/15/33	11,200,000.00	10,667,125.05	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	704,474.80	
T 3.5% 04/30/30	3,500,000.00	3,382,421.87	
T 3.5% 09/15/25	2,900,000.00	2,854,347.64	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,123,296.87	
T 3.625% 02/15/53	8,350,000.00	7,322,395.47	
T 3.625% 05/15/53	1,300,000.00	1,140,953.12	
T 3.625% 08/15/43	4,700,000.00	4,169,781.25	
T 3.75% 04/15/26	2,800,000.00	2,767,296.86	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,707,207.02	



T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,438,935.55	
T 3.875% 02/15/43	1,900,000.00	1,750,894.53	
T 3.875% 08/15/33	3,560,000.00	3,487,131.25	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,364,585.93	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,498,861.34	
T 3.875% 11/30/29	8,130,000.00	8,032,503.49	
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,251,250.00	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	778,164.06	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	775,097.66	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,000,865.24	
T 3% 05/15/45	700,000.00	555,242.18	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,506,683.99	
T 3% 07/15/25	11,150,000.00	10,907,618.17	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,523,701.18	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,024,820.33	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,099,101.55	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,877,148.45	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,231,742.18	
T 3% 11/15/45	2,300,000.00	1,818,212.88	
T 4.125% 08/15/53	4,300,000.00	4,131,695.33	
T 4.125% 08/31/30	9,200,000.00	9,202,695.32	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,100,968.75	
T 4.125% 11/15/32	14,000,000.00	13,989,062.50	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	896,115.23	
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,875,203.12	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	728,394.14	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,018,769.53	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	1,905,417.96	
T 4.375% 05/15/41	650,000.00	647,524.41	
T 4.375% 08/15/26	6,000,000.00	6,019,570.32	
T 4.375% 11/15/39	960,000.00	965,981.25	
T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,134,919.92	
T 4.5% 05/15/38	550,000.00	566,124.02	
T 4.5% 07/15/26	10,000,000.00	10,058,789.10	
T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,738,283.20	
T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,427,599.22	

	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	783,266.60	
	T 4.75% 11/15/53	1,380,000.00	1,472,503.12	
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,455,439.44	
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,162,218.75	
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,513,795.92	
	T 4% 11/15/52	7,400,000.00	6,943,570.29	
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	435,046.87	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,367,031.25	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,111,103.52	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,753,789.05	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,552,972.64	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,173,662.11	
	アメリカドル 小計	1,089,870,000.00	968,068,869.80 (143,467,806,504)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,108,906.97	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,833,593.14	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,810,000.00	1,483,678.50	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,388,643.29	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,743,190.08	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,620,000.00	3,161,129.34	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,408,273.23	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	860,764.24	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,770,000.00	3,284,217.44	
	CAN 1.5% 12/01/31	3,620,000.00	3,125,278.56	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	1,987,237.60	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	742,791.61	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,422,384.87	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,243,202.80	
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	225,843.04	
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,126,292.31	
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	301,039.97	
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,549,258.25	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	926,028.34	
	CAN 2.75% 12/01/55	1,010,000.00	876,936.94	
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	533,506.65	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	384,852.25	

		CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,356,051.38	
		CAN 2% 12/01/51	3,650,000.00	2,705,084.89	
		CAN 3.25% 09/01/28	2,070,000.00	2,042,164.00	
		CAN 3.25% 12/01/33	1,310,000.00	1,282,937.41	
		CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,154,543.36	
		CAN 3.5% 12/01/45	960,000.00	961,839.47	
		CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	2,009,827.26	
		CAN 3% 04/01/26	1,340,000.00	1,311,823.52	
		CAN 3% 10/01/25	2,800,000.00	2,740,538.66	
		CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	787,150.38	
		CAN 4% 03/01/29	790,000.00	807,106.62	
		CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,653,119.99	
		CAN 5.75% 06/01/33	1,620,000.00	1,907,560.35	
		CAN 5% 06/01/37	630,000.00	727,711.01	
		カナダドル 小計	59,970,000.00	55,164,507.72 (6,087,403,426)	
	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,038,632.50	
		MBONO 5.5% 03/04/27	33,260,000.00	29,729,118.40	
		MBONO 5.75% 03/05/26	46,850,000.00	43,274,393.46	
		MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,623,130.40	
		MBONO 7.5% 05/26/33	22,590,000.00	20,151,635.40	
		MBONO 7.5% 06/03/27	31,510,000.00	29,833,352.90	
		MBONO 7.75% 05/29/31	39,030,000.00	36,035,228.10	
		MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	24,596,589.20	
		MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	7,940,839.50	
		MBONO 8.5% 05/31/29	30,830,000.00	30,032,427.90	
		MBONO 8.5% 11/18/38	21,430,000.00	20,051,408.10	
		MBONO 8% 07/31/53	16,550,000.00	14,328,659.00	
		MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	21,511,224.00	
		メキシコペソ 小計	330,140,000.00	303,146,638.86 (2,630,191,182)	
	ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,260,000.00	1,074,394.44	
		BGB 0.35% 06/22/32	1,220,000.00	999,129.06	
		BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	328,036.59	
		BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	183,079.60	
		BGB 0.8% 06/22/25	2,000,000.00	1,939,724.00	

BGB 0.8% 06/22/27	1,510,000.00	1,423,782.51	
BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,485,177.60	
BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,493,803.72	
BGB 0% 10/22/27	780,000.00	709,444.90	
BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,354,495.25	
BGB 1.25% 04/22/33	1,140,000.00	999,497.28	
BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	671,297.55	
BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	655,992.80	
BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	780,282.72	
BGB 1.7% 06/22/50	1,100,000.00	784,749.83	
BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	556,495.55	
BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,403,542.38	
BGB 1% 06/22/31	1,560,000.00	1,382,177.16	
BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	659,432.40	
BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	522,837.85	
BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	379,290.40	
BGB 3.3% 06/22/54	870,000.00	852,142.38	
BGB 3.45% 06/22/43	440,000.00	449,592.00	
BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	994,154.46	
BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,132,844.16	
BGB 3% 06/22/34	950,000.00	956,517.00	
BGB 4.25% 03/28/41	1,750,000.00	1,985,100.25	
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,181,864.22	
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,177,668.72	
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,276,217.72	
BGB 5% 03/28/35	1,810,000.00	2,153,387.77	
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,618,854.06	
BKO 2.8% 06/12/25	1,490,000.00	1,486,273.99	
BKO 3.1% 09/18/25	1,360,000.00	1,365,756.88	
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,493,093.83	
BTPS 0.35% 02/01/25	1,260,000.00	1,221,683.40	
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,801,672.11	
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,814,165.75	
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,156,448.80	
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,550,872.08	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,270,000.00	1,191,963.07	

BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,439,392.17	
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	703,742.37	
BTPS 0.95% 06/01/32	2,320,000.00	1,877,137.52	
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,906,005.53	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,381,757.05	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,757,813.12	
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,096,295.04	
BTPS 0% 08/01/26	3,230,000.00	2,994,009.67	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,400,215.55	
BTPS 1.2% 08/15/25	850,000.00	824,578.13	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,670,000.00	1,590,051.25	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,639,408.21	
BTPS 1.45% 03/01/36	1,180,000.00	894,868.34	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,248,445.50	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	776,791.25	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,354,509.75	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,045,461.60	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,910,000.00	1,650,431.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,255,540.32	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,350,000.00	812,898.45	
BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	468,431.52	
BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,647,882.60	
BTPS 2.05% 08/01/27	2,320,000.00	2,241,758.00	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,408,766.40	
BTPS 2.15% 03/01/72	490,000.00	294,485.10	
BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	669,274.02	
BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,218,804.80	
BTPS 2.25% 09/01/36	1,650,000.00	1,363,896.60	
BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,972,537.60	
BTPS 2.45% 09/01/50	1,160,000.00	831,972.88	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,660,000.00	1,643,599.20	
BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,781,133.35	
BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,731,365.41	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	862,031.55	
BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	595,342.40	
BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,543,233.59	

	BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,394,537.98	
	BTPS 2.95% 09/01/38	880,000.00	768,052.56	
	BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,165,464.20	
	BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,157,854.00	
	BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,238,802.32	
	BTPS 3.25% 03/01/38	1,860,000.00	1,687,047.90	
	BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,941,054.30	
	BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,062,216.85	
	BTPS 3.4% 04/01/28	1,200,000.00	1,211,178.00	
	BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,600,535.30	
	BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	917,339.24	
	BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,375,797.84	
	BTPS 3.7% 06/15/30	300,000.00	304,198.26	
	BTPS 3.8% 04/15/26	1,350,000.00	1,371,841.65	
	BTPS 3.8% 08/01/28	790,000.00	809,703.70	
	BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,369,995.16	
	BTPS 3.85% 09/15/26	610,000.00	622,352.50	
	BTPS 3.85% 12/15/29	2,860,000.00	2,929,498.00	
	BTPS 3% 08/01/29	1,150,000.00	1,132,077.25	
	BTPS 4.2% 03/01/34	240,000.00	247,373.04	
	BTPS 4.35% 11/01/33	1,400,000.00	1,463,495.60	
	BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	421,036.00	
	BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	865,412.20	
	BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,140,300.65	
	BTPS 4.5% 10/01/53	860,000.00	875,879.04	
	BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,802,073.01	
	BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,590,124.50	
	BTPS 4% 02/01/37	3,070,000.00	3,068,369.83	
	BTPS 4% 04/30/35	880,000.00	886,966.96	
	BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,286,348.87	
	BTPS 4% 11/15/30	1,200,000.00	1,236,333.60	
	BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,922,419.40	
	BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,984,151.73	
	BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,632,032.00	
	BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,183,335.20	
	BTPS 5% 08/01/34	3,770,000.00	4,136,764.45	

	BTPS 5% 09/01/40	2,260,000.00	2,468,670.32	
	BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	3,026,100.60	
	BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,323,416.88	
	BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,556,141.86	
	DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,820,961.60	
	DBR 0.25% 02/15/29	3,030,000.00	2,747,664.60	
	DBR 0.25% 08/15/28	2,090,000.00	1,912,548.55	
	DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,994,736.36	
	DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,874,639.00	
	DBR 0.5% 02/15/28	1,360,000.00	1,268,188.87	
	DBR 0.5% 08/15/27	350,000.00	328,849.15	
	DBR 0% 02/15/30	970,000.00	849,519.21	
	DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	968,367.06	
	DBR 0% 02/15/32	3,100,000.00	2,594,362.10	
	DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,821,602.21	
	DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,657,021.57	
	DBR 0% 08/15/26	1,550,000.00	1,457,058.90	
	DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,611,609.29	
	DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	2,036,515.04	
	DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,283,752.73	
	DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,821,469.04	
	DBR 0% 08/15/50	4,380,000.00	2,295,426.69	
	DBR 0% 08/15/52	3,020,000.00	1,507,617.22	
	DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,220,665.29	
	DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,790,030.87	
	DBR 1.25% 08/15/48	3,390,000.00	2,625,397.36	
	DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	3,025,399.80	
	DBR 1.8% 08/15/53	2,760,000.00	2,364,850.80	
	DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,568,238.31	
	DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,362,470.30	
	DBR 2.1% 11/15/29	3,850,000.00	3,819,277.00	
	DBR 2.3% 02/15/33	4,630,000.00	4,639,829.49	
	DBR 2.4% 11/15/30	500,000.00	504,422.50	
	DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,762,082.90	
	DBR 2.5% 08/15/46	2,820,000.00	2,811,590.76	
	DBR 2.6% 08/15/33	1,440,000.00	1,476,224.64	

	DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	2,017,089.86	
	DBR 4.0% 01/04/37	2,570,000.00	3,003,769.74	
	DBR 4.25% 07/04/39	1,590,000.00	1,937,124.98	
	DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,579,111.82	
	DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,598,452.39	
	DBR 4.75% 07/04/40	1,980,000.00	2,566,575.00	
	DBR 5.5% 01/04/31	3,100,000.00	3,745,927.78	
	DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,652,583.83	
	DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,526,008.87	
	DBR 6.5% 07/04/27	2,690,000.00	3,053,846.16	
	FRTR 0.25% 11/25/26	4,290,000.00	4,016,069.38	
	FRTR 0.5% 05/25/25	3,150,000.00	3,045,659.40	
	FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,281,345.00	
	FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,546,681.30	
	FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,791,472.75	
	FRTR 0.5% 05/25/72	1,290,000.00	501,739.56	
	FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	887,520.48	
	FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,373,154.94	
	FRTR 0.75% 05/25/28	6,010,000.00	5,570,356.48	
	FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,597,557.78	
	FRTR 0.75% 05/25/53	3,040,000.00	1,617,082.40	
	FRTR 0.75% 11/25/28	5,440,000.00	4,997,089.61	
	FRTR 0% 02/25/25	2,840,000.00	2,742,737.10	
	FRTR 0% 02/25/26	4,020,000.00	3,800,463.78	
	FRTR 0% 02/25/27	3,040,000.00	2,808,765.44	
	FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,617,914.46	
	FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,625,662.96	
	FRTR 0% 11/25/29	4,450,000.00	3,835,202.31	
	FRTR 0% 11/25/30	5,810,000.00	4,869,041.45	
	FRTR 0% 11/25/31	4,890,000.00	3,976,768.05	
	FRTR 1.25% 05/25/34	3,860,000.00	3,310,556.02	
	FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,660,027.10	
	FRTR 1.25% 05/25/38	1,800,000.00	1,418,594.40	
	FRTR 1.5% 05/25/31	6,080,000.00	5,624,826.88	
	FRTR 1.5% 05/25/50	2,870,000.00	1,989,211.35	
	FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	1,004,202.20	



FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,450,586.20	
FRTR 1% 05/25/27	4,970,000.00	4,721,618.47	
FRTR 1% 11/25/25	4,670,000.00	4,519,934.22	
FRTR 2.5% 05/25/30	5,570,000.00	5,540,845.55	
FRTR 2.5% 05/25/43	1,020,000.00	914,829.84	
FRTR 2.5% 09/24/26	3,140,000.00	3,126,359.84	
FRTR 2.75% 02/25/29	970,000.00	977,322.82	
FRTR 2.75% 10/25/27	4,130,000.00	4,155,250.82	
FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,264,064.66	
FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,733,328.30	
FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	3,093,903.12	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,812,065.97	
FRTR 3.5% 11/25/33	1,500,000.00	1,585,902.00	
FRTR 3% 05/25/33	3,410,000.00	3,470,227.42	
FRTR 3% 05/25/54	1,850,000.00	1,740,195.10	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,440,000.00	4,057,669.20	
FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,864,542.92	
FRTR 4% 04/25/55	1,940,000.00	2,202,127.95	
FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	2,046,540.76	
FRTR 4% 10/25/38	2,140,000.00	2,377,110.28	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,755,140.32	
FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,416,015.92	
FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,000,229.37	
IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	622,058.15	
IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	669,875.86	
IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	387,950.97	
IRISH 0.4% 05/15/35	690,000.00	533,579.58	
IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	243,723.60	
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	722,030.30	
IRISH 0% 10/18/31	950,000.00	781,554.55	
IRISH 1.1% 05/15/29	940,000.00	875,386.28	
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	382,546.49	
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	433,953.39	
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	578,093.60	
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	504,397.00	
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	964,841.00	

	IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	785,223.92	
	IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	818,191.22	
	IRISH 3% 10/18/43	370,000.00	370,839.90	
	IRISH 5.4% 03/13/25	1,110,000.00	1,137,384.58	
	NETHER 0.25% 07/15/25	1,910,000.00	1,838,089.06	
	NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	843,399.83	
	NETHER 0.5% 01/15/40	1,470,000.00	1,047,893.91	
	NETHER 0.5% 07/15/26	1,800,000.00	1,711,548.71	
	NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	861,660.44	
	NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	849,196.80	
	NETHER 0.75% 07/15/28	1,610,000.00	1,494,129.58	
	NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,128,557.92	
	NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,709,447.21	
	NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,425,629.55	
	NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	654,876.82	
	NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	841,742.54	
	NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,151,197.65	
	NETHER 0% 07/15/31	1,570,000.00	1,305,047.96	
	NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	399,869.60	
	NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,540,783.70	
	NETHER 2.5% 07/15/33	740,000.00	733,109.86	
	NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,851,442.96	
	NETHER 2% 01/15/54	720,000.00	617,132.88	
	NETHER 3.25% 01/15/44	510,000.00	548,446.86	
	NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,935,554.55	
	NETHER 4% 01/15/37	1,560,000.00	1,771,074.24	
	NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,701,799.11	
	OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,904,299.82	
	OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,205,171.25	
	OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,365,915.50	
	OBL 0% 10/09/26	3,650,000.00	3,419,626.60	
	OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,819,052.00	
	OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,425,945.25	
	OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,391,657.60	
	OBL 2.4% 10/19/28	3,770,000.00	3,790,753.85	
	RAGB 0.25% 10/20/36	720,000.00	511,016.24	

	RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,268,454.11	
	RAGB 0.5% 04/20/27	1,220,000.00	1,141,230.08	
	RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	124,382.02	
	RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	817,500.64	
	RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	427,756.26	
	RAGB 0.75% 10/20/26	1,410,000.00	1,339,257.48	
	RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	98,772.12	
	RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,063,406.34	
	RAGB 0% 02/20/30	1,480,000.00	1,261,700.00	
	RAGB 0% 02/20/31	1,670,000.00	1,380,864.55	
	RAGB 0% 04/20/25	990,000.00	953,651.16	
	RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	645,163.78	
	RAGB 0% 10/20/40	580,000.00	348,543.20	
	RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,157,632.00	
	RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	795,199.81	
	RAGB 1.5% 11/02/86	310,000.00	182,687.65	
	RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	359,224.82	
	RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	477,561.50	
	RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	698,174.92	
	RAGB 2.9% 02/20/33	1,000,000.00	1,005,286.00	
	RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	223,058.55	
	RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	702,259.60	
	RAGB 3.15% 10/20/53	440,000.00	440,575.08	
	RAGB 3.45% 10/20/30	120,000.00	125,441.31	
	RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	481,097.40	
	RAGB 4.15% 03/15/37	1,460,000.00	1,631,484.30	
	RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,115,622.66	
	RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,319,568.04	
	RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	312,059.00	
	RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	213,030.71	
	RFGB 0.125% 09/15/31	460,000.00	378,015.75	
	RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	190,556.68	
	RFGB 0.5% 04/15/26	570,000.00	543,544.36	
	RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	307,766.37	
	RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	501,320.88	
	RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	662,910.81	

	RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	471,621.82	
	RFGB 0.75% 04/15/31	570,000.00	497,709.52	
	RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	426,380.68	
	RFGB 0% 09/15/26	460,000.00	429,301.87	
	RFGB 0% 09/15/30	720,000.00	603,892.80	
	RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	313,104.36	
	RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	336,854.00	
	RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	370,466.04	
	RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	514,328.10	
	RFGB 2.625% 07/04/42	470,000.00	440,505.94	
	RFGB 2.75% 04/15/38	400,000.00	385,514.00	
	RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	553,786.75	
	RFGB 2.875% 04/15/29	210,000.00	212,425.92	
	RFGB 3% 09/15/33	460,000.00	466,178.72	
	RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	588,573.56	
	SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,787,467.00	
	SPGB 0.5% 04/30/30	3,210,000.00	2,769,212.43	
	SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,122,234.04	
	SPGB 0.6% 10/31/29	2,970,000.00	2,612,308.05	
	SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,820,876.20	
	SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,277,435.00	
	SPGB 0.8% 07/30/29	2,750,000.00	2,459,941.24	
	SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,046,425.80	
	SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,204,536.56	
	SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,509,324.30	
	SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,675,192.10	
	SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,172,912.96	
	SPGB 0% 05/31/25	3,060,000.00	2,932,991.64	
	SPGB 1.2% 10/31/40	2,110,000.00	1,466,106.07	
	SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,781,776.35	
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,070,000.00	1,987,181.37	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,047,675.79	
	SPGB 1.4% 07/30/28	2,050,000.00	1,928,086.50	
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,507,639.52	
	SPGB 1.45% 10/31/27	1,310,000.00	1,247,055.24	
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	316,212.60	

	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,439,224.87	
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,421,391.38	
	SPGB 1.85% 07/30/35	1,850,000.00	1,585,579.50	
	SPGB 1.9% 10/31/52	1,810,000.00	1,199,914.52	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,252,601.60	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,902,444.08	
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	573,969.90	
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	1,011,097.84	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,548,944.40	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,940,000.00	1,806,805.06	
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,892,345.40	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,417,331.79	
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,270,000.00	1,267,075.19	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,709,953.00	
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,693,986.44	
	SPGB 3.45% 07/30/43	980,000.00	940,375.66	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,239,411.12	
	SPGB 3.55% 10/31/33	2,090,000.00	2,143,878.31	
	SPGB 3.9% 07/30/39	1,030,000.00	1,062,205.72	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,103,844.47	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,904,595.51	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,880,000.00	2,135,429.20	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,996,029.53	
	SPGB 5.15% 10/31/28	2,970,000.00	3,274,057.01	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,420,000.00	1,710,347.11	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,450,000.00	2,934,198.40	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,310,000.00	2,476,338.48	
	SPGB 6.0% 01/31/29	910,000.00	1,042,927.52	
	ユーロ 小計	653,190,000.00	608,856,487.13 (98,342,499,801)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,165,891.60	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,306,633.20	
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,831,591.64	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	2,084,938.50	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,346,530.64	
	UKT 0.375% 10/22/30	1,930,000.00	1,545,316.26	

UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,858,926.98	
UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	516,084.00	
UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,330,768.88	
UKT 0.625% 07/31/35	2,450,000.00	1,675,555.00	
UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	430,140.00	
UKT 0.875% 01/31/46	1,470,000.00	729,561.00	
UKT 0.875% 07/31/33	2,190,000.00	1,659,060.78	
UKT 0.875% 10/22/29	1,890,000.00	1,615,394.34	
UKT 1.125% 01/31/39	2,050,000.00	1,326,965.00	
UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	385,140.00	
UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	871,539.50	
UKT 1.25% 07/31/51	2,420,000.00	1,183,622.00	
UKT 1.25% 10/22/41	2,030,000.00	1,244,999.00	
UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,510,000.00	
UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	960,160.00	
UKT 1.5% 07/31/53	1,140,000.00	582,528.14	
UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	973,533.93	
UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	701,356.00	
UKT 1.625% 10/22/71	1,350,000.00	626,130.00	
UKT 1.75% 01/22/49	1,080,000.00	634,392.00	
UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	830,388.00	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,405,593.00	
UKT 1% 01/31/32	3,940,000.00	3,172,291.00	
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	905,960.00	
UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,295,867.00	
UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,593,704.00	
UKT 3.25% 01/31/33	3,260,000.00	3,095,813.36	
UKT 3.5% 01/22/45	1,820,000.00	1,568,177.52	
UKT 3.5% 07/22/68	1,500,000.00	1,236,450.00	
UKT 3.5% 10/22/25	1,970,000.00	1,944,064.16	
UKT 3.75% 01/29/38	1,410,000.00	1,330,137.60	
UKT 3.75% 07/22/52	1,150,000.00	1,006,940.00	
UKT 3.75% 10/22/53	2,710,000.00	2,357,700.00	
UKT 4.125% 01/29/27	3,340,000.00	3,357,221.04	
UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,911,735.00	
UKT 4.25% 06/07/32	1,320,000.00	1,359,639.60	

	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,253,652.56	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,180,000.00	2,214,509.40	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,423,175.00	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,770,000.00	1,698,191.10	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,610,000.00	1,537,550.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,700,000.00	1,619,049.74	
	UKT 4.5% 06/07/28	910,000.00	934,342.95	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,446,017.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	2,530,000.00	2,541,971.96	
	UKT 4.625% 01/31/34	560,000.00	588,693.28	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,546,738.60	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,467,340.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,144,875.00	
	UKT 4% 10/22/63	1,000,000.00	912,200.00	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,185,354.84	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,483,728.84	
	イギリスポンド 小計	101,600,000.00	84,465,829.94 (15,909,139,069)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,840,924.74	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	6,035,797.46	
	SGB 0.75% 11/12/29	5,340,000.00	4,925,619.79	
	SGB 1.75% 11/11/33	3,610,000.00	3,448,618.48	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,665,606.11	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,508,687.68	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,675,487.73	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,300,000.00	4,889,229.00	
	スウェーデンクローナ 小計	45,370,000.00	43,989,970.99 (622,897,989)	
ノルウェー クローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,109,677.28	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,547,797.28	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,911,017.51	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,630,000.00	4,387,897.30	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,200,000.00	6,043,605.00	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,100,000.00	3,737,982.30	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,620,000.00	3,238,995.00	
	NGB 2% 04/26/28	3,070,000.00	2,890,405.00	

		NGB 3.5% 10/06/42	1,860,000.00	1,870,330.44	
		NGB 3% 08/15/33	4,460,000.00	4,243,021.00	
	ノルウェークローネ 小計		40,910,000.00	37,980,728.11 (537,047,495)	
デンマーク クローネ		DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,790,073.22	
		DGB 0.5% 11/15/27	3,870,000.00	3,608,744.81	
		DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,492,106.33	
		DGB 0% 11/15/31	6,540,000.00	5,450,548.98	
		DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,451,313.92	
		DGB 2.25% 11/15/33	2,930,000.00	2,875,589.90	
		DGB 4.5% 11/15/39	9,700,000.00	12,086,161.20	
	デンマーククローネ 小計		40,870,000.00	38,754,538.36 (839,035,755)	
ポーランド ズロチ		POLGB 0.25% 10/25/26	2,260,000.00	1,990,002.32	
		POLGB 0.75% 04/25/25	4,010,000.00	3,806,741.12	
		POLGB 1.25% 10/25/30	3,900,000.00	3,062,599.80	
		POLGB 1.75% 04/25/32	3,110,000.00	2,414,299.22	
		POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,618,539.10	
		POLGB 2.5% 07/25/27	5,530,000.00	5,102,403.81	
		POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,921,995.60	
		POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,335,020.00	
		POLGB 3.25% 07/25/25	4,480,000.00	4,363,775.36	
		POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,369,961.54	
		POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	618,656.04	
		POLGB 6% 10/25/33	3,470,000.00	3,661,939.58	
		POLGB 7.5% 07/25/28	3,610,000.00	3,961,007.52	
	ポーランドズロチ 小計		46,430,000.00	43,226,941.01 (1,603,883,773)	
オーストラ リアドル		ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,964,123.57	
		ACGB 0.5% 09/21/26	1,570,000.00	1,437,936.52	
		ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,934,830.98	
		ACGB 1.5% 06/21/31	2,400,000.00	1,998,102.02	
		ACGB 1.75% 06/21/51	1,710,000.00	944,416.65	
		ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,486,724.85	
		ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,193,478.01	
		ACGB 1% 12/21/30	1,710,000.00	1,393,404.64	



	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,384,645.50	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,340,000.00	2,139,459.82	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,330,000.00	1,040,391.28	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,028,400.08	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,854,241.05	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,576,060.75	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,366,429.33	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,049,172.26	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,624,643.71	
	ACGB 3.25% 06/21/39	940,000.00	809,432.07	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,346,263.25	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,082,445.28	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,800,000.00	1,717,365.69	
	ACGB 3% 03/21/47	1,350,000.00	1,033,484.67	
	ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,650,957.09	
	ACGB 4.25% 04/21/26	1,660,000.00	1,672,587.78	
	ACGB 4.5% 04/21/33	3,010,000.00	3,061,800.89	
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,010,000.00	2,064,270.00	
	ACGB 4.75% 06/21/54	840,000.00	854,654.64	
	オーストラリアドル 小計	47,740,000.00	42,709,722.38 (4,179,573,432)	
ニュージーランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	650,000.00	543,764.50	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	609,870.54	
	NZGB 1.5% 05/15/31	1,000,000.00	808,505.07	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	286,023.83	
	NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	826,518.95	
	NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	497,111.17	
	NZGB 2.75% 05/15/51	600,000.00	397,190.12	
	NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	433,449.04	
	NZGB 3.5% 04/14/33	1,160,000.00	1,055,438.65	
	NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	606,153.91	
	NZGB 4.25% 05/15/34	560,000.00	536,657.30	
	NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	839,501.99	
	NZGB 4.5% 05/15/30	490,000.00	489,021.37	
	ニュージーランドドル 小計	9,090,000.00	7,929,206.44 (719,892,652)	

シンガポールドル	SIGB 0.5% 11/01/25	790,000.00	751,874.60	
	SIGB 1.25% 11/01/26	760,000.00	724,508.00	
	SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	512,120.00	
	SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	622,545.00	
	SIGB 1.875% 10/01/51	420,000.00	340,529.70	
	SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	615,195.00	
	SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	602,550.00	
	SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	887,292.91	
	SIGB 2.375% 07/01/39	380,000.00	352,043.40	
	SIGB 2.625% 05/01/28	720,000.00	714,024.00	
	SIGB 2.625% 08/01/32	360,000.00	351,360.00	
	SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	616,960.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	610,403.85	
	SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	650,130.00	
	SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	420,126.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	629,055.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	830,000.00	858,253.20	
	SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	752,210.00	
	SIGB 3% 08/01/72	490,000.00	504,210.00	
	シンガポールドル 小計		11,970,000.00	11,515,390.66 (1,274,062,822)
マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,529,332.59	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,508,463.81	
	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	693,251.39	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,937,817.82	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,259,443.49	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,758,121.01	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,864,861.46	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,379,109.26	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,180,077.20	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,143,005.05	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,991,943.43	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,497,732.66	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	606,592.26	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,704,568.64	
	MGS 4.065% 06/15/50	3,070,000.00	2,975,944.41	

	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,559,434.89	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,783,215.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,520,000.00	2,568,829.28	
	MGS 4.457% 03/31/53	490,000.00	506,847.03	
	MGS 4.498% 04/15/30	2,000,000.00	2,080,626.59	
	MGS 4.504% 04/30/29	350,000.00	363,420.68	
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	926,088.63	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,750,000.00	1,881,754.17	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,049,763.35	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,780,000.00	2,979,613.45	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,016,138.23	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,853,177.42	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,131,873.38	
	マレーシアリングット 小計	47,800,000.00	48,731,046.58 (1,531,787,352)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,510,000.00	1,417,296.26	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,321,245.85	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	1,550,000.00	1,233,862.61	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	2,330,000.00	1,616,557.25	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	3,450,000.00	3,340,275.84	
	ILGOV 1% 03/31/30	2,720,000.00	2,267,971.36	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,522,639.70	
	ILGOV 2.8% 11/29/52	980,000.00	666,678.50	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,513,641.60	
	ILGOV 3.75% 02/28/29	1,220,000.00	1,213,455.43	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,570,000.00	2,188,833.79	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,060,965.04	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,424,135.51	
	イスラエルシェケル 小計	26,270,000.00	23,787,558.74 (941,114,322)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	52,570,000.00	52,422,553.76	
	CGB 2.18% 08/15/26	25,000,000.00	24,937,358.25	
	CGB 2.18% 08/25/25	17,100,000.00	17,083,820.49	
	CGB 2.22% 09/25/25	21,100,000.00	21,095,642.63	
	CGB 2.26% 02/24/25	32,000,000.00	32,050,355.20	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,248,343.33	

	CGB 2.3% 05/15/26	47,100,000.00	47,111,238.06	
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,934,749.45	
	CGB 2.39% 11/15/26	42,750,000.00	42,860,812.27	
	CGB 2.4% 07/15/28	42,610,000.00	42,633,120.18	
	CGB 2.44% 10/15/27	11,100,000.00	11,124,024.84	
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,607,579.40	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,078,000.00	
	CGB 2.48% 09/25/28	26,500,000.00	26,593,346.25	
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,163,947.56	
	CGB 2.52% 08/25/33	16,500,000.00	16,478,627.38	
	CGB 2.55% 10/15/28	27,250,000.00	27,453,445.77	
	CGB 2.6% 09/01/32	32,050,000.00	32,148,960.78	
	CGB 2.6% 09/15/30	30,500,000.00	30,700,229.45	
	CGB 2.62% 04/15/28	13,550,000.00	13,690,991.81	
	CGB 2.62% 06/25/30	21,400,000.00	21,539,388.90	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	20,173,820.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,624,515.14	
	CGB 2.67% 05/25/33	26,700,000.00	26,926,600.23	
	CGB 2.68% 05/21/30	33,530,000.00	33,883,003.84	
	CGB 2.69% 08/12/26	32,900,000.00	33,231,776.76	
	CGB 2.69% 08/15/32	16,620,000.00	16,802,547.43	
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,724,800.75	
	CGB 2.75% 06/15/29	25,490,000.00	25,897,791.56	
	CGB 2.76% 05/15/32	10,700,000.00	10,880,136.64	
	CGB 2.79% 12/15/29	21,800,000.00	22,179,601.22	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,507,222.34	
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,352,702.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	4,600,000.00	4,689,154.90	
	CGB 2.85% 06/04/27	31,030,000.00	31,580,925.23	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,630,030.06	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,831,393.22	
	CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,879,034.32	
	CGB 2% 06/15/25	16,600,000.00	16,543,142.67	
	CGB 3.01% 05/13/28	12,590,000.00	12,934,642.43	
	CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,426,930.76	
	CGB 3.02% 10/22/25	4,270,000.00	4,334,936.02	

	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,137,687.48	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,902,734.96	
	CGB 3.19% 04/15/53	13,900,000.00	15,038,095.86	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,203,817.57	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,650,930.83	
	CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,812,988.00	
	CGB 3.39% 03/16/50	16,830,000.00	18,599,144.35	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,350,000.00	9,429,381.12	
	CGB 3.72% 04/12/51	13,540,000.00	15,744,332.31	
	CGB 3.81% 09/14/50	18,020,000.00	21,234,950.00	
	CGB 3.86% 07/22/49	17,280,000.00	20,446,506.43	
	CGB 4.08% 10/22/48	13,110,000.00	16,009,905.78	
	オフショア人民元 小計	1,143,280,000.00	1,169,201,717.97 (24,062,054,435)	
	合計		302,748,390,009 (302,748,390,009)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 208 銘柄	100.0%	47.4%
カナダドル	国債証券 36 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 357 銘柄	100.0%	32.5%
イギリスポンド	国債証券 58 銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 28 銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.3%
オフショア人民元	国債証券 54 銘柄	100.0%	7.9%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,065,275,997
コール・ローン	1,881,217,723
株式	637,297,793,310
投資信託受益証券	123,027,488
投資証券	12,693,314,694
派生商品評価勘定	232,282,560
未収配当金	437,838,025
差入委託証拠金	5,294,313,484
流動資産合計	663,025,063,281
資産合計	663,025,063,281
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,058,920
前受金	200,221,430
未払解約金	1,613,904,052
未払利息	965
流動負債合計	1,846,185,367
負債合計	1,846,185,367
純資産の部	
元本等	
元本	115,832,461,957
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	545,346,415,957
元本等合計	661,178,877,914
純資産合計	661,178,877,914
負債純資産合計	663,025,063,281

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年1月22日現在
--	--------------

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</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)

	2024年 1月 22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,832,461,957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) 5.7081円 (57,081円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年 1月 22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 1月 22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。



(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年1月21日
期首元本額	124,064,922,029円
期中追加設定元本額	13,729,112,383円
期中一部解約元本額	21,961,572,455円
期末元本額	115,832,461,957円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,532,148,621円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,768,416円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,258,054,760円
世界経済インデックスファンド	13,127,406,480円
外国株式インデックス・オープン	884,501,089円
DCマイセレクション25	634,760,665円
DCマイセレクション50	3,469,522,155円
DCマイセレクション75	4,306,398,595円
DC外国株式インデックス・オープン	12,839,368,353円
DCマイセレクションS25	404,444,608円
DCマイセレクションS50	1,914,457,318円
DCマイセレクションS75	1,920,663,664円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	20,596,669円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	140,723,539円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	110,380,022円
DC世界経済インデックスファンド	9,402,961,197円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	961,239,459円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,698,688円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,927,777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)	21,864,173円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	6,731,809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)	7,179,167円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	19,214,922円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	153,084,530円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	128,728,343円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	973,652,591円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	65,665,256円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	16,436,629円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	111,536,786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)	826,136,856円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,179,699,191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)	300,506,762円
分散投資コア戦略ファンドA	1,538,503,488円
分散投資コア戦略ファンドS	7,176,219,465円

DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,489,507,262円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,021,963,245円
コア投資戦略ファンド（切替型）	136,289,740円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	458,139,752円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	24,019,932円
SMT インデックスバランス・オープン	113,787,397円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	76,270,162円
外国株式SMT Bセレクション（SMA専用）	5,073,214,982円
SMT 世界経済インデックス・オープン	252,449,009円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,054,594,215円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	186,415,422円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,489,543円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,509,827,266円
グローバル経済コア	552,431,246円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,062,346円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,949,640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	150,966,898円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	144,007,157円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	63,512,211円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	74,748,923円
10資産分散投資ファンド	50,163,073円
グローバル10資産バランスファンド	5,475,710円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	23,675円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	25,847円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	27,150円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	27,150円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	23,756円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	15,277円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	13,575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）	54,420,170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）	206,767,325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）	638,404,125円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,442,204,695円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	97,137,814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）	82,872,293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）	80,495,973円
SMT AM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	179,358,397円
SMT AM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
SMT AM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
SMT AM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	174,601,806円
SMT AM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	172,871,024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
SMT AM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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	67,569,478,950
投資信託受益証券	△18,862,544

投資証券	894, 509, 748
合計	68, 445, 126, 154

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2024年1月22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	9, 132, 044, 648	—	9, 332, 266, 078	200, 221, 430
合計		9, 132, 044, 648	—	9, 332, 266, 078	200, 221, 430

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 通貨関連

(2024年1月22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	78, 487, 700	—	78, 533, 863	46, 163
	アメリカドル	78, 487, 700	—	78, 533, 863	46, 163
	売建	1, 500, 677, 300	—	1, 500, 721, 253	△43, 953
	アメリカドル	1, 140, 755, 000	—	1, 140, 787, 340	△32, 340
	カナダドル	55, 161, 000	—	55, 159, 500	1, 500
	ユーロ	121, 101, 000	—	121, 111, 425	△10, 425
	イギリスポンド	56, 484, 900	—	56, 488, 170	△3, 270
	スイスフラン	61, 430, 400	—	61, 438, 068	△7, 668
	スウェーデンク ローナ	28, 322, 000	—	28, 313, 600	8, 400
	デンマークク ローネ	30, 305, 800	—	30, 303, 700	2, 100
	イスラエルシェ ケル	7, 117, 200	—	7, 119, 450	△2, 250
	合計	1, 579, 165, 000	—	1, 579, 255, 116	2, 210

(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	APA CORP	23,392	30.37	710,415.04	
	BAKER HUGHES CO	77,332	30.70	2,374,092.40	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	161.05	2,914,843.95	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	75.94	644,123.08	
	CHEVRON CORP	142,373	142.24	20,251,135.52	
	CONOCOPHILLIPS	92,757	107.87	10,005,697.59	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	24.38	1,329,831.48	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	40.97	2,058,988.32	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	151.06	2,004,113.02	
	EOG RESOURCES INC	45,763	110.17	5,041,709.71	
	EQT CORPORATION	27,026	35.33	954,828.58	
	EXXON MOBIL	309,867	96.95	30,041,605.65	
	HALLIBURTON CO	70,302	33.97	2,388,158.94	
	HESS CORP	21,602	137.32	2,966,386.64	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	52.51	705,156.79	
	KINDER MORGAN INC	160,038	17.20	2,752,653.60	
	MARATHON OIL CORP	50,360	22.27	1,121,517.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,811	152.98	4,713,466.78	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	56.42	2,787,486.52	
	ONEOK INC	43,535	70.04	3,049,191.40	
	OVINTIV INC	20,398	40.91	834,482.18	
	PHILLIPS 66	34,260	129.09	4,422,623.40	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	17,374	216.83	3,767,204.42	
	SCHLUMBERGER	110,287	49.64	5,474,646.68	
TARGA RESOURCES CORP	17,298	82.49	1,426,912.02		
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,487.66	792,922.78		

VALERO ENERGY CORP	28,661	128.16	3,673,193.76
WILLIAMS COS	90,577	33.86	3,066,937.22
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	260.64	4,555,726.56
ALBEMARLE CORP	8,403	115.13	967,437.39
AMCOR PLC	110,292	9.47	1,044,465.24
AVERY DENNISON CORP	6,638	200.60	1,331,582.80
BALL CORP	21,539	55.53	1,196,060.67
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	145.13	1,245,505.66
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,499	74.99	1,237,260.01
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	17.73	762,390.00
CORTEVA INC	56,865	45.60	2,593,044.00
CROWN HOLDINGS INC	9,940	90.64	900,961.60
DOW INC	56,839	52.81	3,001,667.59
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	73.68	2,513,887.92
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	86.75	766,176.00
ECOLAB INC	20,345	199.87	4,066,355.15
FMC CORP	8,264	55.65	459,891.60
FREEPORT-MCMORAN INC	118,197	38.77	4,582,497.69
INT'L PAPER CO	25,191	36.74	925,517.34
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	79.52	1,535,292.64
LINDE PLC	38,096	407.38	15,519,548.48
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	93.39	1,843,985.55
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	505.48	2,535,993.16
MOAIC CO/THE	27,732	32.10	890,197.20
NEWMONT CORPORATION	86,194	34.58	2,980,588.52
NUCOR CORP	18,727	166.79	3,123,476.33
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,783	164.38	1,279,369.54
PPG INDUSTRIES INC	17,495	141.39	2,473,618.05
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,126	278.84	1,150,493.84
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	108.10	1,130,293.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,614	304.02	5,963,048.28
STEEL DYNAMICS INC	11,618	112.86	1,311,207.48
VULCAN MATERIALS CO	10,153	226.08	2,295,390.24
WESTLAKE CORP	2,222	138.48	307,702.56
WESTROCK CO	21,356	39.99	854,026.44
3 M COMPANY	43,663	107.76	4,705,124.88

AECOM	10,456	88.50	925,356.00
AERCAP HOLDINGS NV	18,199	75.65	1,376,754.35
ALLEGION PLC	5,598	122.19	684,019.62
AMETEK INC	17,753	162.03	2,876,518.59
AXON ENTERPRISE INC	5,367	256.79	1,378,191.93
BOEING CO	43,809	215.02	9,419,811.18
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	172.51	1,899,335.10
CARLISLE COS INC	3,456	308.74	1,067,005.44
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	55.88	3,468,080.44
CATERPILLAR	39,504	285.28	11,269,701.12
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	11.65	943,952.90
CUMMINS INC	10,414	229.21	2,386,992.94
DEERE&CO	21,646	382.72	8,284,357.12
DOVER CORP	10,657	148.09	1,578,195.13
EATON CORP	30,932	244.60	7,565,967.20
EMERSON ELECTRIC CO	46,685	94.91	4,430,873.35
FASTENAL CO	44,011	69.34	3,051,722.74
FERGUSON PLC	16,260	189.61	3,083,058.60
FORTIVE CORP	25,894	72.27	1,871,359.38
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	77.84	802,530.40
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	249.34	4,527,765.06
GENERAL ELECTRIC CO	83,474	129.81	10,835,759.94
GRACO INC	13,378	85.00	1,137,130.00
GRAINGER (WW) INC	3,363	864.00	2,905,632.00
HEICO CORP	3,640	176.38	642,023.20
HEICO CORP-CLASS A	7,398	138.60	1,025,362.80
HONEYWELL INTL INC	51,027	200.78	10,245,201.06
HOWMET AEROSPACE INC	32,364	55.74	1,803,969.36
HUBBELL INC	3,709	329.62	1,222,560.58
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2,482	256.23	635,962.86
IDEX CORP	5,916	207.04	1,224,848.64
ILLINOIS TOOL WORKS	23,865	255.51	6,097,746.15
INGERSOLL-RAND INC	31,562	78.88	2,489,610.56
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	40.67	516,509.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	50,266	54.19	2,723,914.54
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	204.82	3,007,167.24

LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	444.05	1,121,670.30
LOCKHEED MARTIN CORP	17,553	457.76	8,035,061.28
MASCO CORP	15,277	68.06	1,039,752.62
NORDSON CORP	4,121	253.42	1,044,343.82
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,303	470.48	5,317,835.44
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	87.78	2,696,338.26
OWENS CORNING	6,460	150.63	973,069.80
PACCAR INC	42,924	96.26	4,131,864.24
PARKER HANNIFIN CORP	10,397	470.37	4,890,436.89
PENTAIR PLC	10,813	71.36	771,615.68
QUANTA SERVICES INC	11,573	202.43	2,342,722.39
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	303.45	2,569,007.70
RTX CORP	112,196	85.53	9,596,123.88
SMITH (A. O. ) CORP	9,016	81.21	732,189.36
SNAP-ON INC	4,000	286.86	1,147,440.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	94.90	1,195,550.20
TEXTRON	17,063	78.79	1,344,393.77
TORO CO	8,812	92.81	817,841.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,028	248.92	4,238,609.76
TRANSDIGM GROUP INC	4,468	1,057.13	4,723,256.84
UNITED RENTALS INC	5,364	572.03	3,068,368.92
VERTIV HOLDINGS CO-A	26,201	53.67	1,406,207.67
WABTEC CORP	13,304	128.01	1,703,045.04
WATSCO INC	2,656	400.20	1,062,931.20
XYLEM INC	19,874	111.87	2,223,304.38
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	238.24	7,604,382.56
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	127.49	1,178,007.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,847	204.89	2,017,551.83
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	66.26	706,861.68
CINTAS CORP	7,479	599.05	4,480,294.95
COPART INC	63,766	48.70	3,105,404.20
EQUIFAX INC	9,160	245.34	2,247,314.40
JACOBS SOLUTIONS INC	10,700	132.27	1,415,289.00
LEIDOS HOLDINGS	11,487	109.88	1,262,191.56
PAYCHEX INC	24,118	122.09	2,944,566.62
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	193.59	819,853.65

PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	152.49	521,973.27
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	168.68	2,775,629.40
ROBERT HALF INC	7,185	80.60	579,111.00
ROLLINS INC	25,466	44.13	1,123,814.58
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	60.52	932,129.04
TRANSUNION	15,741	68.95	1,085,341.95
VERALTO CORP	17,691	77.55	1,371,937.05
VERISK ANALYTICS INC	10,738	240.12	2,578,408.56
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	152.20	3,009,755.00
WASTE MANAGEMENT INC	31,977	184.45	5,898,157.65
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	86.25	721,653.75
CSX CORP	161,331	34.55	5,573,986.05
DELTA AIR LINES INC	9,648	37.28	359,677.44
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	127.43	1,564,840.40
FEDEX CORP	18,863	246.53	4,650,295.39
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.00	339,033.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	198.72	1,142,242.56
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	55.01	749,401.23
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,920	234.05	3,960,126.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,356	387.23	2,848,463.88
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	29.99	405,854.67
U-HAUL HOLDING CO	6,606	63.99	422,717.94
UBER TECHNOLOGIES INC	140,815	65.11	9,168,464.65
UNION PACIFIC CORP	46,736	239.27	11,182,522.72
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	156.89	8,717,906.63
APTIV PLC	21,896	79.00	1,729,784.00
BORGWARNER INC	19,781	32.87	650,201.47
FORD MOTOR COMPANY	314,432	11.20	3,521,638.40
GENERAL MOTORS CO	103,664	35.51	3,681,108.64
LEAR CORP	5,714	130.21	744,019.94
LUCID GROUP INC	61,234	2.71	165,944.14
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	15.48	794,681.28
TESLA INC	221,215	212.19	46,939,610.85
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	749.25	1,575,672.75
DR HORTON INC	22,973	155.30	3,567,706.90
GARMIN LTD	13,192	125.48	1,655,332.16



HASBRO INC	10,572	48.26	510,204.72
LENNAR CORP-CL A	18,864	151.81	2,863,743.84
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	484.02	4,171,768.38
NIKE B	94,445	101.78	9,612,612.10
NVR INC	247	7,207.99	1,780,373.53
PULTE GROUP INC	16,747	106.07	1,776,354.29
VF CORP	25,718	15.71	404,029.78
AIRBNB INC-CLASS A	34,609	139.93	4,842,837.37
BOOKING HOLDINGS INC	2,799	3,616.51	10,122,611.49
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	46.76	821,105.60
CARNIVAL CORPORATION	71,810	17.33	1,244,467.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,192	2,334.60	5,117,443.20
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	159.24	1,466,122.68
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	426.77	1,215,440.96
DOORDASH INC - A	19,212	106.33	2,042,811.96
DRAFTKINGS INC	32,654	37.62	1,228,443.48
EXPEDIA GROUP INC	11,638	148.57	1,729,057.66
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,974	187.38	3,930,108.12
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	130.58	494,506.46
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	48.85	1,248,606.00
MARRIOTT INTL A	19,516	233.67	4,560,303.72
MCDONALD'S CORP	55,965	300.53	16,819,161.45
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	43.00	978,422.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,676	127.00	2,625,852.00
STARBUCKS CORP	88,273	93.86	8,285,303.78
VAIL RESORTS INC	3,014	223.16	672,604.24
WYNN RESORTS LTD	6,702	94.23	631,529.46
YUM BRANDS INC	22,162	132.30	2,932,032.60
ALPHABET INC-CL A	459,452	146.38	67,254,583.76
ALPHABET INC-CL C	405,242	147.97	59,963,658.74
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	371.10	2,668,951.20
COMCAST CORP-CL A	319,239	43.35	13,839,010.65
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	137.72	2,717,628.76
FOX CORP - CLASS A	21,544	31.03	668,510.32
FOX CORP- CLASS B	10,345	28.73	297,211.85
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	31.85	908,075.35

LIBERTY BROADBAND-C	9,153	78.12	715,032.36
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	63.04	969,492.16
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	13,584	31.21	423,956.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	91.18	1,058,873.34
MATCH GROUP INC	22,730	36.06	819,643.80
META PLATFORMS INC-CLASS A	172,117	383.45	65,998,263.65
NETFLIX INC	34,076	482.95	16,457,004.20
NEWS CORP-CLASS A	33,479	24.03	804,500.37
OMNICOM GROUP	14,048	87.88	1,234,538.24
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	13.40	435,607.20
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	37.10	1,697,955.70
ROBLOX CORP -CLASS A	28,503	38.69	1,102,781.07
ROKU INC	9,122	87.07	794,252.54
SEA LTD-ADR	28,338	36.40	1,031,503.20
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	5.42	327,736.56
SNAP INC - A	91,303	16.42	1,499,195.26
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	163.10	2,098,607.70
THE WALT DISNEY CO	140,071	93.06	13,035,007.26
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	66.85	2,245,023.55
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	10.35	1,836,224.55
AMAZON.COM	719,107	155.34	111,706,081.38
AUTOZONE INC	1,368	2,746.44	3,757,129.92
BATH & BODY WORKS INC	13,528	42.43	573,993.04
BEST BUY COMPANY INC	15,285	71.00	1,085,235.00
BURLINGTON STORES INC	5,108	194.80	995,038.40
CARMAX INC	10,695	69.15	739,559.25
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	146.49	725,125.50
EBAY	41,952	41.13	1,725,485.76
ETSY INC	10,294	70.66	727,374.04
GENUINE PARTS CO	9,903	142.09	1,407,117.27
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	37.47	262,290.00
HOME DEPOT	77,067	362.41	27,929,851.47
LKQ CORP	19,286	47.38	913,770.68
LOWES COMPANIES	44,328	220.01	9,752,603.28
MERCADOLIBRE INC	3,573	1,726.19	6,167,676.87
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,028.10	4,705,613.70

POOL CORP	2,664	386.84	1,030,541.76
ROSS STORES INC	25,425	137.63	3,499,242.75
TJX COMPANIES INC	88,680	95.50	8,468,940.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	231.06	1,812,896.76
ULTA BEAUTY INC	3,920	472.57	1,852,474.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	22.00	550,000.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,608	694.97	24,051,521.76
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	132.22	2,153,467.14
DOLLAR TREE INC	16,318	130.48	2,129,172.64
KROGER CO	50,664	45.94	2,327,504.16
SYSCO CORP	40,090	75.21	3,015,168.90
TARGET (DAYTON HUDSON)	37,073	138.14	5,121,264.22
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	22.00	1,134,474.00
WALMART INC	115,924	162.38	18,823,739.12
ALTRIA GROUP INC	139,093	40.33	5,609,620.69
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	68.19	2,769,741.42
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	54.60	1,310,727.60
BUNGE GLOBAL SA	11,604	92.68	1,075,458.72
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	43.15	684,747.35
CELSIUS HOLDINGS INC	14,251	51.99	740,909.49
COCA-COLA CO	321,355	59.83	19,226,669.65
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	67.55	1,039,864.70
CONAGRA BRANDS INC	33,324	28.62	953,732.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	253.95	3,333,347.70
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	43.55	576,689.10
GENERAL MILLS INC	43,531	63.15	2,748,982.65
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	190.46	2,084,013.32
HORMEL FOODS CORP	23,338	30.64	715,076.32
JM SMUCKER CO	7,850	129.20	1,014,220.00
KELLANOVA	18,819	53.93	1,014,908.67
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	31.89	2,587,969.17
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	37.08	2,557,185.12
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	109.24	1,297,334.24
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	65.03	1,176,522.76
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	62.49	916,665.81
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	72.85	7,680,648.35

MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	57.18	3,336,338.64
PEPSICO INC	105,521	165.78	17,493,271.38
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	92.32	10,984,510.56
TYSON FOODS INC	23,306	53.10	1,237,548.60
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	96.93	1,875,207.78
CLOROX COMPANY	9,570	142.22	1,361,045.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,761	80.38	4,723,209.18
ESTEE LAUDER CO-CL A	16,973	125.83	2,135,712.59
KENVUE INC	133,461	20.71	2,763,977.31
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	122.77	3,299,689.29
PROCTER & GAMBLE CO	183,167	147.57	27,029,954.19
ABBOTT LABORATORIES	133,298	114.69	15,287,947.62
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	266.34	1,399,084.02
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	38.60	1,604,833.60
BECTON DICKINSON & CO	22,142	235.89	5,223,076.38
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	60.94	6,832,653.74
CARDINAL HEALTH	19,151	105.48	2,020,047.48
CENCORA INC	14,346	218.28	3,131,444.88
CENTENE CORP	40,934	74.15	3,035,256.10
COOPER COS INC/THE	3,504	387.50	1,357,800.00
CVS HEALTH CORP	99,034	73.22	7,251,269.48
DAVITA INC	4,627	104.76	484,724.52
DEXCOM INC	28,772	127.29	3,662,387.88
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	45,052	74.31	3,347,814.12
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	464.61	8,470,769.52
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	74.11	2,217,445.31
HCA HEALTHCARE INC	15,457	287.77	4,448,060.89
HENRY SCHEIN INC	8,755	74.04	648,220.20
HOLOGIC INC	18,875	73.52	1,387,690.00
HUMANA INC	9,818	401.53	3,942,221.54
IDEXX LABORATORIES INC	6,168	523.82	3,230,921.76
INSULET CORP	5,246	204.46	1,072,597.16
INTUITIVE SURGICAL INC	27,005	374.82	10,122,014.10
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	226.15	1,480,830.20
MCKESSON CORP	10,179	484.60	4,932,743.40
MEDTRONIC PLC	102,632	86.49	8,876,641.68

MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	365.51	1,661,242.95
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	132.57	1,150,575.03
RESMED INC	10,920	172.54	1,884,136.80
STERIS PLC	8,172	221.43	1,809,525.96
STRYKER CORP	26,379	315.05	8,310,703.95
TELEFLEX INC	3,934	246.83	971,029.22
THE CIGNA GROUP	22,963	302.06	6,936,203.78
UNITEDHEALTH GROUP INC	72,060	503.56	36,286,533.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	157.81	737,288.32
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	207.15	2,331,473.25
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	123.36	1,881,733.44
ABBVIE INC	137,931	164.77	22,726,890.87
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	131.22	2,859,415.02
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	184.03	1,774,601.29
AMGEN	40,959	307.81	12,607,589.79
AVANTOR INC	49,647	21.58	1,071,382.26
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	306.62	568,166.86
BIO-TECHNE CORP	12,980	70.32	912,753.60
BIOGEN INC	10,740	249.96	2,684,570.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	92.25	1,363,731.75
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	161,137	50.11	8,074,575.07
CATALENT INC	13,739	49.21	676,096.19
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	212.03	891,374.12
DANAHER CORP	54,787	231.05	12,658,536.35
ELI LILLY & CO	62,580	628.58	39,336,536.40
EXACT SCIENCES CORP	12,208	65.85	803,896.80
GILEAD SCIENCES INC	96,270	87.29	8,403,408.30
ILLUMINA INC	11,423	135.88	1,552,157.24
INCYTE CORP	15,212	61.49	935,385.88
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	215.39	2,980,136.04
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	116.54	579,320.34
JOHNSON & JOHNSON	187,036	161.68	30,239,980.48
MERCK & CO	198,157	118.89	23,558,885.73
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,200.00	1,952,400.00
MODERNA INC	24,153	99.70	2,408,054.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	137.37	926,148.54

PFIZER	432,739	28.28	12,237,858.92
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	933.40	7,772,421.80
REPLIGEN CORP	4,353	178.02	774,921.06
REVVITY INC	8,524	106.43	907,209.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	29.07	874,512.81
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	11.18	1,030,136.38
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,059	551.75	16,585,053.25
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	217.84	788,145.12
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	435.02	8,646,457.52
VIATRIS INC	89,720	11.40	1,022,808.00
WATERS CORP	4,749	312.45	1,483,825.05
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	342.74	1,976,581.58
ZOETIS INC	35,994	188.38	6,780,549.72
BANK OF AMERICA CORP	549,785	32.22	17,714,072.70
CITIGROUP	151,597	51.52	7,810,277.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	32.59	1,288,021.98
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	34.21	1,861,708.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,409.68	1,079,814.88
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	12.72	1,451,504.64
JPMORGAN CHASE & CO	224,007	170.31	38,150,632.17
KEY CORP	71,223	13.94	992,848.62
M & T BANK CORP	11,807	139.39	1,645,777.73
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,658	150.79	4,472,129.82
REGIONS FINL CORP	70,810	18.62	1,318,482.20
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	37.47	3,984,634.74
US BANCORP	123,942	42.01	5,206,803.42
WELLS FARGO & CO	281,146	48.12	13,528,745.52
ALLY FINANCIAL INC	21,529	35.57	765,786.53
AMERICAN EXPRESS	48,875	183.17	8,952,433.75
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	381.67	2,983,132.72
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,972	98.94	3,163,309.68
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	116.43	1,487,975.40
BANK NEW YORK CO	61,254	55.04	3,371,420.16
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	366.99	37,174,986.03
BLACKROCK INC	11,583	805.44	9,329,411.52
BLACKSTONE INC	55,334	119.08	6,589,172.72

BLOCK INC	45,824	65.85	3,017,510.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	127.98	3,851,814.06
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	39.73	622,529.37
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	185.38	1,631,900.14
CME GROUP INC	27,997	202.05	5,656,793.85
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	12,595	124.75	1,571,226.25
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	97.33	1,848,004.71
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	33.04	924,558.32
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	463.45	1,458,940.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	49,733	59.86	2,977,017.38
FISERV INC	46,319	139.02	6,439,267.38
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,064	282.86	1,432,403.04
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	27.93	728,135.10
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	46.86	202,247.76
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	129.46	2,686,165.54
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,712	382.20	9,827,126.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	126.45	5,579,226.90
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	166.39	867,391.07
KKR & CO INC	44,805	84.19	3,772,132.95
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,530	239.60	1,564,588.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	265.93	852,837.51
MASTERCARD INC-CLASS A	64,870	436.78	28,333,918.60
MOODY' S CORP	13,287	386.84	5,139,943.08
MORGAN STANLEY	96,993	85.34	8,277,382.62
MSCI INC	5,952	553.93	3,296,991.36
NASDAQ INC	24,183	57.85	1,398,986.55
NORTHERN TRUST CORP	15,902	81.14	1,290,288.28
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	65.82	5,218,604.52
PRICE T ROWE GROUP INC	15,806	109.50	1,730,757.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	111.52	1,726,998.72
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,913	10.71	341,788.23
S&P GLOBAL INC	25,151	441.95	11,115,484.45
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	63.78	7,468,319.10
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	63.49	606,329.50
STATE STREET CORP	26,059	75.86	1,976,835.74
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	36.91	1,077,624.36

TOAST INC-CLASS A	20,341	17.34	352,712.94
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	97.95	887,524.95
VISA INC-CLASS A SHARES	124,044	270.90	33,603,519.60
AFLAC	43,196	84.37	3,644,446.52
ALLSTATE CORP	20,722	154.88	3,209,423.36
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	119.39	754,425.41
AMERICAN INT'L GROUP	54,534	68.83	3,753,575.22
AON PLC	15,249	311.58	4,751,283.42
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	80.88	2,405,128.56
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,412	238.79	4,157,811.48
ASSURANT INC	4,726	167.82	793,117.32
BROWN & BROWN INC	20,155	74.83	1,508,198.65
CHUBB LTD	32,057	237.32	7,607,767.24
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	111.29	1,236,431.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	340.04	736,526.64
EVEREST GROUP LTD	3,288	373.84	1,229,185.92
FNF GROUP	20,461	48.88	1,000,133.68
GLOBE LIFE INC	9,068	121.81	1,104,573.08
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	85.02	2,102,629.62
LOEWS CORP	12,757	72.20	921,055.40
MARKEL GROUP INC	1,007	1,447.81	1,457,944.67
MARSH & MCLENNAN COS	38,224	199.10	7,610,398.40
METLIFE INC	48,925	68.89	3,370,443.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	78.32	1,451,739.52
PROGRESSIVE CORP	45,236	170.14	7,696,453.04
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,521	103.44	2,743,332.24
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	211.67	3,629,505.49
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,724	250.76	2,187,630.24
WR BERKLEY CORP	17,572	75.32	1,323,523.04
WEYERHAEUSER CO	52,615	32.85	1,728,402.75
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	363.90	17,595,656.70
ADOBE INC	35,550	611.55	21,740,602.50
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	120.35	1,382,099.40
ANSYS INC	6,794	337.00	2,289,578.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	202.97	485,910.18
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	242.96	2,778,490.56



AUTODESK INC	15,965	248.64	3,969,537.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.27	744,649.51
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	72.50	539,617.50
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,442	292.14	6,264,065.88
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,767	157.73	1,382,818.91
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	81.35	1,650,022.05
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	40,439	76.88	3,108,950.32
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	21.99	270,477.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,357	290.54	5,333,442.78
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	232.51	720,781.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	130.31	2,707,841.80
DOCUSIGN INC	14,969	63.20	946,040.80
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	32.17	742,097.56
DYNATRACE INC	22,028	57.90	1,275,421.20
EPAM SYSTEMS INC	4,768	300.02	1,430,495.36
FAIR ISAAC CORP	1,816	1,260.21	2,288,541.36
FORTINET INC	53,321	60.90	3,247,248.90
GARTNER INC	6,453	464.88	2,999,870.64
GEN DIGITAL INC	43,555	23.48	1,022,671.40
GODADDY INC - CLASS A	11,388	108.04	1,230,359.52
HUBSPOT INC	3,646	581.40	2,119,784.40
INTL BUSINESS MACHINES CORP	69,606	171.48	11,936,036.88
INTUIT INC	21,468	622.18	13,356,960.24
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	221.41	1,039,298.54
MICROSOFT CORP	546,594	398.67	217,910,629.98
MONDAY.COM LTD	1,631	195.63	319,072.53
MONGODB INC	5,325	401.05	2,135,591.25
OKTA INC	11,505	81.28	935,126.40
ORACLE CORP	129,011	109.67	14,148,636.37
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	16.78	2,465,300.82
PALO ALTO NETWORKS INC	23,561	337.74	7,957,492.14
PTC INC	8,226	174.70	1,437,082.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	548.49	4,638,031.44
SALESFORCE INC	74,662	280.88	20,971,062.56
SERVICENOW INC	15,631	749.11	11,709,338.41
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,702	193.12	4,191,090.24

SPLUNK INC	12,924	153.25	1,980,603.00
SYNOPSYS INC	11,896	517.31	6,153,919.76
TWILIO INC - A	12,842	73.36	942,089.12
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	430.33	1,436,871.87
UIPATH INC - CLASS A	28,419	22.23	631,754.37
UNITY SOFTWARE INC	16,437	33.14	544,722.18
VERISIGN INC	6,723	205.37	1,380,702.51
WIX.COM LTD	5,010	127.15	637,021.50
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	289.99	4,765,115.68
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	16,547	69.04	1,142,404.88
ZSCALER INC	7,204	231.29	1,666,213.16
AMPHENOL CORPORATION	48,409	97.61	4,725,202.49
APPLE INC	1,210,717	191.56	231,924,948.52
ARISTA NETWORKS INC	20,702	263.51	5,455,184.02
CDW CORP/DE	10,931	226.46	2,475,434.26
CISCO SYSTEMS	312,372	51.27	16,015,312.44
CORNING	58,221	30.44	1,772,247.24
DELL TECHNOLOGIES -C	18,124	83.19	1,507,735.56
F5 INC	4,851	180.09	873,616.59
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	15.37	1,497,529.84
HP INC	68,329	29.12	1,989,740.48
JABIL INC	11,304	124.59	1,408,365.36
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	37.41	947,258.61
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	153.63	2,125,931.94
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	326.28	4,293,518.52
NETAPP INC	15,191	87.81	1,333,921.71
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	17,662	85.42	1,508,688.04
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,534	423.36	1,496,154.24
TE CONNECTIVITY LTD	25,075	132.54	3,323,440.50
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	435.63	1,446,291.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	50.01	886,077.18
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	54.77	1,412,518.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	249.09	1,036,712.58
AT&T INC	548,004	16.67	9,135,226.68
LIBERTY GLOBAL LTD-C	18,869	20.49	386,625.81
T-MOBILE US INC	42,307	165.16	6,987,424.12

VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	39.33	12,674,289.15
AES CORP	54,375	16.89	918,393.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	48.87	1,015,420.86
AMEREN CORPORATION	20,898	69.28	1,447,813.44
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	77.70	3,163,944.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	125.30	1,812,840.40
ATMOS ENERGY CORP	11,302	113.08	1,278,030.16
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	27.77	1,318,130.82
CMS ENERGY CORP	23,697	56.44	1,337,458.68
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	89.86	2,486,875.50
CONSTELLATION ENERGY	25,114	114.45	2,874,297.30
DOMINION ENERGY INC	68,588	45.32	3,108,408.16
DTE ENERGY COMPANY	15,851	104.52	1,656,746.52
DUKE ENERGY CORP	60,351	95.56	5,767,141.56
EDISON INTL	30,900	68.29	2,110,161.00
ENTERGY CORP	16,181	99.08	1,603,213.48
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	36.83	751,295.17
EVERGY INC	18,475	50.44	931,879.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	53.41	1,466,104.50
EXELON CORP	73,907	35.04	2,589,701.28
FIRSTENERGY CORP	39,425	37.01	1,459,119.25
NEXTERA ENERGY INC	161,719	57.26	9,260,029.94
NISOURCE INC	32,351	25.60	828,185.60
NRG ENERGY INC	19,068	52.52	1,001,451.36
PG&E CORP	148,742	16.90	2,513,739.80
PPL CORPORATION	58,459	26.01	1,520,518.59
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	58.55	2,357,574.30
SEMPRA	49,744	72.88	3,625,342.72
SOUTHERN CO	86,478	68.95	5,962,658.10
VISTRA CORP	22,676	40.17	910,894.92
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	80.03	1,876,463.41
XCEL ENERGY INC	46,180	59.48	2,746,786.40
ADVANCED MICRO DEVICES	126,574	174.23	22,052,988.02
ANALOG DEVICES	39,233	194.77	7,641,411.41
APPLIED MATERIALS	64,814	167.94	10,884,863.16
BROADCOM INC	34,367	1,211.20	41,625,310.40

	ENPHASE ENERGY INC	9,617	103.59	996,225.03	
	ENTEGRIS INC	10,321	120.34	1,242,029.14	
	FIRST SOLAR INC	7,921	145.92	1,155,832.32	
	INTEL CORP	328,277	48.15	15,806,537.55	
	KLA CORP	10,294	612.99	6,310,119.06	
	LAM RESEARCH CORP	10,237	826.32	8,459,037.84	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	68.46	751,553.88	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	63,694	71.08	4,527,369.52	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	89.44	3,641,817.92	
	MICRON TECHNOLOGY	85,302	87.51	7,464,778.02	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	631.33	2,229,226.23	
	NVIDIA CORP	191,277	594.91	113,792,600.07	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	218.36	4,216,531.60	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	73.87	2,364,652.57	
	QORVO INC	6,249	105.56	659,644.44	
	QUALCOMM	85,393	151.96	12,976,320.28	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	106.04	1,192,101.68	
	TERADYNE INC	12,318	108.72	1,339,212.96	
	TEXAS INSTRUMENTS	69,576	173.65	12,081,872.40	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	85.51	1,966,302.45	
	COSTAR GROUP INC	33,027	82.33	2,719,112.91	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.13	308,931.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	54.39	642,291.51	
	アメリカドル 小計	26,298,707		3,238,680,781.47 (479,972,491,813)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,380	20.51	1,115,333.80	
	CAMECO CORP	31,793	63.05	2,004,548.65	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	86,871	84.55	7,344,943.05	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	20.06	2,232,537.58	
	ENBRIDGE	159,113	48.34	7,691,522.42	
	IMPERIAL OIL	16,488	74.91	1,235,116.08	
	KEYERA CORP	18,607	32.26	600,261.82	
	MEG ENERGY CORP	27,250	23.42	638,195.00	
	PARKLAND CORP	14,896	45.12	672,107.52	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,131	45.35	1,729,240.85	
	SUNCOR ENERGY	98,973	42.30	4,186,557.90	

TC ENERGY CORP	75,669	52.08	3,940,841.52
TOURMALINE OIL CORP	25,009	57.31	1,433,265.79
AGNICO EAGLE MINES	36,100	66.29	2,393,069.00
BARRICK GOLD CORP	133,727	20.98	2,805,592.46
CCL INDUSTRIES INC - CL B	14,689	56.95	836,538.55
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	12.55	544,168.00
FRANCO-NEVADA CORP	15,641	144.59	2,261,532.19
IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	13.29	689,046.63
KINROSS GOLD CORP	108,451	7.26	787,354.26
LUNDIN MINING CORP	31,977	10.20	326,165.40
NUTRIEN LTD	37,152	69.11	2,567,574.72
PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	18.27	409,540.32
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	51.69	1,829,102.34
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	111.34	390,246.70
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,906	62.06	1,980,086.36
CAE INC	25,999	27.92	725,892.08
STANTEC INC	9,001	107.93	971,477.93
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	116.36	606,584.68
WSP GLOBAL INC	9,951	193.39	1,924,423.89
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	22.35	728,140.65
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,971	45.28	632,606.88
RB GLOBAL INC	14,445	85.91	1,240,969.95
THOMSON REUTERS CORP	13,225	203.07	2,685,600.75
AIR CANADA	13,805	18.16	250,698.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	169.44	7,156,637.28
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	105.45	7,711,031.25
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	177.00	1,033,149.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	73.29	1,484,415.66
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	92.93	285,295.10
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	43.10	423,242.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	103.27	2,382,748.71
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	146.24	659,981.12
DOLLARAMA INC	22,000	99.21	2,182,620.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	62,154	81.70	5,077,981.80
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	35.24	244,213.20
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	133.96	1,729,825.48

METRO INC	18,840	69.76	1,314,278.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	171.25	894,952.50
SAPUTO INC	20,898	28.29	591,204.42
BANK MONTREAL	56,278	128.75	7,245,792.50
BANK NOVA SCOTIA	96,990	62.02	6,015,319.80
CANADIAN IMPERIAL BANK	76,913	61.69	4,744,762.97
NATIONAL BANK OF CANADA	24,111	100.18	2,415,439.98
ROYAL BANK OF CANADA	106,365	133.81	14,232,700.65
TORONTO-DOMINION BANK	140,926	81.17	11,438,963.42
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	52.50	1,522,552.50
BROOKFIELD CORP	104,769	53.45	5,599,903.05
IGM FINANCIAL INC	7,685	35.57	273,355.45
ONEX CORP	6,603	102.55	677,137.65
TMX GROUP LTD	23,425	33.00	773,025.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	1,303.89	2,287,023.06
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	42.85	1,019,315.80
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	87.54	610,766.58
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	207.15	2,745,773.25
MANULIFE FINANCIAL CORP	146,284	28.47	4,164,705.48
POWER CORP OF CANADA	43,577	38.26	1,667,256.02
SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	68.48	2,986,686.72
CGI INC - CL A	16,084	145.84	2,345,690.56
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,651	3,660.57	6,043,601.07
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	116.91	816,499.44
OPEN TEXT CORP	20,463	55.26	1,130,785.38
SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	107.50	10,118,975.00
BCE INC	6,203	55.99	347,305.97
QUEBECOR INC -CL B	15,200	33.37	507,224.00
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	63.97	1,783,547.57
TELUS CORP	32,908	24.62	810,194.96
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	8.00	414,544.00
ALTAGAS INCOME LTD	24,395	27.60	673,302.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	38.09	430,226.55
CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	31.67	326,961.08
EMERA INC	17,459	49.38	862,125.42
FORTIS INC	35,547	54.38	1,933,045.86

	HYDRO ONE LTD	20,587	38.96	802,069.52	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	24.59	439,029.86	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	220.01	591,826.90	
	カナダドル 小計	3,159,497		196,379,895.46 (21,670,521,464)	
ユーロ	ENI	174,687	14.45	2,524,227.15	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	13.98	554,474.76	
	NESTE OIL OYJ	32,766	31.16	1,020,988.56	
	OMV AG	12,549	37.81	474,477.69	
	REPSOL SA	89,536	13.00	1,163,968.00	
	TENARIS SA	40,648	14.43	586,550.64	
	TOTALENERGIES SE	180,093	58.28	10,495,820.04	
	AIR LIQUIDE	40,571	173.02	7,019,594.42	
	AKZO NOBEL	12,357	68.94	851,891.58	
	ARCELORMITTAL	42,704	24.18	1,032,796.24	
	ARKEMA	4,369	99.44	434,453.36	
	BASF SE	70,406	43.05	3,030,978.30	
	COVESTRO AG	14,454	47.29	683,529.66	
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	90.87	1,245,555.09	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	16.85	270,303.63	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	83.00	893,495.00	
	OCI NV	7,248	25.02	181,344.96	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	34.06	664,306.24	
	STORA ENSO OYJ R	42,169	11.55	487,262.79	
	SYENSQO SA	5,356	79.03	423,284.68	
	SYMRISE AG	10,018	94.50	946,701.00	
	UMICORE	17,605	20.69	364,247.45	
	UPM KYMMENE OYJ	42,324	33.41	1,414,044.84	
	VOESTALPINE AG	7,152	26.84	191,959.68	
	WACKER CHEMIE AG	1,770	94.66	167,548.20	
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,403	39.44	646,934.32	
	ACS ACTIVIDADES DE CONS-RTS	16,403	0.50	8,201.50	
	AIRBUS SE	46,092	148.84	6,860,333.28	
	ALSTOM	24,388	10.96	267,414.42	
	BOUYGUES ORD	16,606	34.68	575,896.08	
	BRENTAG SE	12,514	80.22	1,003,873.08	

DAIMLER TRUCK HOLDING AG	46,183	30.88	1,426,131.04
DASSAULT AVIATION SA	2,130	171.00	364,230.00
EIFFAGE	5,924	96.52	571,784.48
FERROVIAL SE	37,026	34.63	1,282,210.38
GEA GROUP AG	13,382	35.46	474,525.72
IMCD NV	4,641	142.55	661,574.55
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	72.90	903,814.20
KNORR-BREMSE AG	5,022	54.76	275,004.72
KONE OYJ-B	26,369	42.50	1,120,682.50
LEGRAND SA	19,340	89.80	1,736,732.00
LEONARDO SPA	31,340	16.44	515,229.60
METSO CORPORATION	51,970	9.08	471,991.54
MTU AERO ENGINES AG	3,962	208.70	826,869.40
PRYSMIAN SPA	21,155	40.13	848,950.15
RATIONAL AG	483	724.00	349,692.00
RHEINMETALL AG	3,820	330.30	1,261,746.00
SAFRAN SA	26,619	169.84	4,520,970.96
SAINT-GOBAIN	36,177	61.81	2,236,100.37
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	177.50	7,481,625.00
SIEMENS	58,485	160.94	9,412,575.90
SIEMENS ENERGY AG	36,841	11.83	435,829.03
THALES SA	8,524	133.00	1,133,692.00
VINCI S. A.	39,327	116.74	4,591,033.98
WARTSILA OYJ	41,917	12.95	542,825.15
BUREAU VERITAS SA	25,073	23.85	597,991.05
RANDSTAD NV	10,680	50.98	544,466.40
TELEPERFORMANCE	4,734	143.25	678,145.50
WOLTERS KLUWER	20,863	137.35	2,865,533.05
ADP	2,382	114.70	273,215.40
AENA SME SA	5,508	163.35	899,731.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	7.23	328,011.26
DHL GROUP	74,810	43.72	3,271,067.25
GETLINK	21,115	16.08	339,634.77
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,957	92.30	2,488,131.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	86.20	430,224.20
CONTINENTAL AG	8,168	70.88	578,947.84



DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	73.78	756,540.12
FERRARI NV	9,370	319.50	2,993,715.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	59,903	59.11	3,540,866.33
MICHELIN	56,445	30.57	1,725,523.65
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	43.44	510,202.80
RENAULT SA	11,597	34.24	397,081.28
STELLANTIS NV	176,696	19.67	3,475,610.32
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	106.88	1,638,256.64
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	116.25	288,997.50
ADIDAS AG	12,783	164.68	2,105,104.44
HERMES INTERNATIONAL	2,530	1,832.80	4,636,984.00
KERING	5,534	350.50	1,939,667.00
LVMH	21,429	659.40	14,130,282.60
MONCLER SPA	14,605	51.44	751,281.20
PUMA SE	9,220	42.05	387,701.00
SEB SA	2,282	104.70	238,925.40
ACCOR	14,436	35.98	519,407.28
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	64.62	2,376,206.64
DELIVERY HERO SE	13,414	21.55	289,071.70
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,042	182.75	2,383,425.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	34.36	278,590.88
SODEXO	6,173	103.25	637,362.25
BOLLORE SE	83,646	5.64	471,763.44
PUBLICIS GROUPE	17,217	86.82	1,494,779.94
SCOUT24 SE	3,716	65.22	242,357.52
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	27.22	1,791,783.72
VIVENDI SE	61,243	9.81	600,793.83
D' IETEREN GROUP	2,217	177.90	394,404.30
INDITEX	81,082	38.87	3,151,657.34
PROSUS	112,590	25.76	2,900,318.40
ZALANDO SE	17,664	16.35	288,806.40
CARREFOUR	39,746	15.61	620,435.06
HELLOFRESH SE	13,805	11.57	159,723.85
JERONIMO MARTINS	9,821	21.10	207,223.10
KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.87	338,800.21
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	25.46	1,805,468.50

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	69,428	57.63	4,001,135.64
DANONE (GROUPE)	47,639	61.60	2,934,562.40
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	9.01	305,173.35
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	76.55	728,143.60
HEINEKEN NV	23,160	91.46	2,118,213.60
JDE PEET'S BV	7,000	23.50	164,500.00
KERRY GROUP PLC-A	14,010	78.38	1,098,103.80
LOTUS BAKERIES	4	7,760.00	31,040.00
PERNOD-RICARD	15,339	142.15	2,180,438.85
REMY COINTREAU	1,032	89.58	92,446.56
BEIERSDORF AG	7,430	135.00	1,003,050.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	64.68	567,890.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,415	72.40	826,446.00
LOREAL	18,546	426.20	7,904,305.20
AMPLIFON SPA	11,650	29.32	341,578.00
BIOMERIEUX	3,044	101.75	309,727.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	100.20	343,686.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	84.92	175,784.40
ESSILORLUXOTTICA	22,901	177.68	4,069,049.68
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	35.62	605,005.70
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	26.28	885,346.92
KONINKLIJKE PHILIPS	54,179	21.24	1,151,032.85
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	51.98	1,121,052.66
ARGENX SE	4,935	331.10	1,633,978.50
BAYER	78,462	32.39	2,541,384.18
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	55.22	564,348.40
GRIFOLS SA	27,685	8.36	231,668.08
IPSEN	3,532	105.30	371,919.60
MERCK KGAA	11,170	146.20	1,633,054.00
ORION OYJ-CLASS B	10,139	43.12	437,193.68
QIAGEN N. V.	17,038	41.31	703,839.78
RECORDATI SPA	10,887	49.76	541,737.12
SANOFI	87,091	94.04	8,190,037.64
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	296.10	540,086.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,574	221.30	348,326.20
UCB (GROUPE)	9,389	82.26	772,339.14

ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.20	365,580.42
AIB GROUP PLC	88,299	3.85	340,127.74
BANCO BILBAO VIZCAYA	475,753	7.99	3,804,120.98
BANCO BPM SPA	124,090	4.90	608,041.00
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	3.71	4,537,445.01
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	8.12	718,159.62
BNP PARIBAS	82,197	60.61	4,981,960.17
CAIXABANK	336,789	3.83	1,290,912.23
COMMERZBANK AG	81,889	11.06	906,101.78
CREDIT AGRICOLE SA	66,984	13.23	886,198.32
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	38.95	988,395.20
FINECOBANK SPA	41,585	13.82	574,912.62
ING GROEP NV-CVA	290,125	12.74	3,696,772.75
INTESA SANPAOLO	1,145,097	2.75	3,155,314.78
KBC GROEP NV	18,057	59.70	1,078,002.90
MEDIOBANCA	53,422	12.01	641,865.33
NORDEA BANK ABP	236,636	10.98	2,598,263.28
SOCIETE GENERALE	53,019	23.14	1,226,859.66
UNICREDIT SPA	124,385	26.44	3,288,739.40
ADYEN NV	1,609	1,130.20	1,818,491.80
AMUNDI SA	4,626	62.00	286,812.00
DEUTSCHE BANK NAMEN	161,178	11.81	1,903,834.53
DEUTSCHE BOERSE	14,123	189.55	2,677,014.65
EDENRED	20,131	57.72	1,161,961.32
EURAZEO SA	3,357	74.25	249,257.25
EURONEXT NV	6,480	78.00	505,440.00
EXOR NV	7,825	88.92	695,799.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	67.54	575,103.10
NEXI SPA	48,458	7.13	345,796.28
SOFINA	1,238	208.00	257,504.00
WORLDLINE SA	20,332	13.11	266,654.18
AEGON LTD	148,741	5.41	805,581.25
AGEAS	11,086	38.82	430,358.52
ALLIANZ SE-REG	31,143	247.15	7,696,992.45
ASR NEDERLAND NV	11,959	42.28	505,626.52
ASSICURAZIONI GENERALI	71,236	20.33	1,448,227.88

AXA SA	136,364	30.56	4,167,965.66
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	224.90	1,001,929.50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10,414	393.50	4,097,909.00
NN GROUP NV	16,208	37.11	601,478.88
POSTE ITALIANE SPA	46,035	10.10	465,183.67
SAMPO OYJ-A SHS	33,132	38.23	1,266,802.02
TALANX AG	5,053	65.55	331,224.15
BECHTLE AG	7,659	46.89	359,130.51
CAPGEMINI SA	12,235	197.05	2,410,906.75
DASSAULT SYSTEMES SA	55,391	46.15	2,556,294.65
NEMETSCHEK SE	5,455	80.54	439,345.70
SAP SE	79,638	148.88	11,856,505.44
NOKIA OYJ	396,129	3.10	1,229,188.28
CELLNEX TELECOM SA	41,890	33.74	1,413,368.60
DEUTSCHE TELEKOM	253,485	23.08	5,850,433.80
ELISA A	10,227	43.67	446,613.09
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.03	335,188.12
KPN (KON.)	216,358	3.16	684,556.71
ORANGE	153,281	11.20	1,717,360.32
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.28	241,357.47
TELEFONICA	373,259	3.78	1,410,919.02
ACCIONA SA	2,181	115.50	251,905.50
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	23.40	127,225.80
E. ON SE	166,881	12.47	2,081,840.47
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	15.82	344,116.64
ELIA GROUP SA/NV	987	109.10	107,681.70
ENAGAS	21,663	15.19	329,060.97
ENDESA	25,972	18.65	484,507.66
ENEL	640,374	6.66	4,266,171.58
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	303,675	4.29	1,302,765.75
ENGIE	146,393	15.55	2,276,703.93
FORTUM OYJ	32,550	12.28	399,876.75
IBERDROLA SA	468,794	11.22	5,259,868.68
IBERDROLA SA-RTS	468,794	0.19	90,617.88
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	25.30	253,253.00
REDEIA CORP SA	30,678	14.86	455,875.08

	RWE STAMM	44,929	37.49	1,684,388.21	
	SNAM SPA	147,559	4.73	698,544.30	
	TERNA SPA	95,819	7.75	742,980.52	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	28.59	1,423,238.79	
	VERBUND AG	6,430	75.95	488,358.50	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,400	496.15	1,686,910.00	
	ASML HOLDING NV	31,384	686.30	21,538,839.20	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	143.75	913,818.75	
	INFINEON TECHNOLOGIES	97,070	34.19	3,318,823.30	
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	40.52	2,037,588.72	
	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	72.42	382,015.50	
	VONOVIA SE	52,580	26.96	1,417,556.80	
	ユーロ 小計	14,562,439		369,730,544.64 (59,718,877,570)	
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.45	5,863,433.53	
	SHELL PLC-NEW	513,920	23.70	12,182,473.60	
	ANGLO AMERICAN PLC	93,327	17.73	1,655,247.67	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	15.78	471,127.68	
	CRH PLC	55,581	54.12	3,008,043.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	44.05	481,202.20	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	13.83	243,463.32	
	GLENCORE PLC	793,369	4.12	3,271,060.38	
	MONDI PLC	41,710	14.11	588,736.65	
	RIO TINTO PLC REG	88,047	53.79	4,736,048.13	
	ASHTREAD GROUP PLC	33,317	48.09	1,602,214.53	
	BAE SYSTEMS PLC	240,047	11.74	2,818,151.78	
	BUNZL PLC	22,799	32.19	733,899.81	
	DCC PLC	6,622	56.12	371,626.64	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.77	583,843.78	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	3.05	1,939,522.45	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.46	435,794.96	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	96.24	530,667.36	
	EXPERIAN PLC	67,859	31.83	2,159,951.97	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.94	596,436.60	
	RELX PLC	152,781	32.80	5,011,216.80	
	RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.01	729,336.17	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	5.24	383,578.48
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	47.82	332,444.64
BURBERRY GROUP PLC	29,776	12.32	366,989.20
PERSIMMON PLC	25,686	14.38	369,364.68
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.43	377,932.82
COMPASS GROUP PLC	129,701	21.70	2,814,511.70
ENTAIN PLC	49,630	9.16	455,007.84
INTERCONTINENTAL HOTELS	11,363	74.22	843,361.86
PEARSON	55,305	9.47	524,070.18
WHITBREAD PLC	17,434	35.48	618,558.32
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	7.12	516,509.13
INFORMA PLC	110,598	7.45	824,618.68
WPP PLC	85,821	7.20	618,597.76
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.11	230,092.81
KINGFISHER PLC	153,717	2.18	335,256.77
NEXT PLC	11,023	82.98	914,688.54
OCADO GROUP PLC	54,753	5.52	302,236.56
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.81	417,414.69
TESCO PLC	525,585	2.96	1,555,731.60
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	22.38	576,061.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO	173,690	23.07	4,007,896.75
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.34	419,186.40
DIAGEO	174,682	27.15	4,743,489.71
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	18.81	1,288,071.18
HALEON PLC	452,525	3.28	1,486,544.62
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	55.80	3,159,451.80
UNILEVER PLC	193,307	37.11	7,173,622.77
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	10.99	753,859.05
ASTRAZENECA	118,805	105.08	12,484,029.40
GSK PLC	319,416	15.63	4,994,388.57
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.35	346,558.50
BARCLAYS	1,129,529	1.41	1,593,087.70
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,521,101	5.88	8,950,158.28
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.42	2,060,069.28
NATWEST GROUP PLC	426,244	2.08	886,587.52
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	5.76	1,095,315.84

	3I GROUP PLC	74,757	23.36	1,746,323.52	
	ABRDN PLC	153,430	1.78	273,949.26	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	7.35	243,395.28	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,529	91.40	2,973,150.60	
	M&G PLC	131,539	2.18	287,281.17	
	SCHRODERS PLC	39,932	4.12	164,879.22	
	ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	6.33	259,112.22	
	WISE PLC - A	49,048	8.31	407,981.26	
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	25.28	410,926.40	
	AVIVA PLC	193,334	4.31	833,269.54	
	LEGAL & GENERAL GROUP	408,884	2.46	1,008,716.82	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.08	259,493.08	
	PRUDENTIAL	212,226	7.88	1,672,340.88	
	SAGE GROUP PLC	76,660	11.52	883,123.20	
	HALMA PLC	31,069	21.47	667,051.43	
	BT GROUP PLC	464,863	1.14	530,408.68	
	VODAFONE GROUP PLC	1,971,971	0.67	1,333,841.18	
	CENTRICA PLC	453,631	1.41	641,661.04	
	NATIONAL GRID PLC	285,439	10.26	2,930,031.33	
	SEVERN TRENT PLC	17,468	24.97	436,175.96	
	SSE PLC	81,692	17.57	1,435,328.44	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.17	514,398.60	
	イギリスポンド 小計	21,133,594		138,745,683.67 (26,132,749,519)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	10.90	189,638.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	637.50	365,925.00	
	GIVAUDAN-REG	678	3,347.00	2,269,266.00	
	HOLCIM LTD	38,804	63.72	2,472,590.88	
	SIG GROUP AG	26,203	18.46	483,707.38	
	SIKA AG-BR	12,257	233.00	2,855,881.00	
	ABB LTD	124,889	35.28	4,406,083.92	
	GEBERIT AG-REG	2,530	488.30	1,235,399.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	191.80	392,806.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	201.40	622,728.80	
	VAT GROUP AG	1,956	400.00	782,400.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,856	36.05	535,558.80	

	SGS SA	10,147	73.28	743,572.16	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	287.00	1,085,147.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	116.40	4,769,490.00	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	212.30	527,140.90	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	40.50	159,489.00	
	AVOLTA AG	7,820	30.92	241,794.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,265.00	354,200.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	108,200.00	865,600.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,860.00	890,520.00	
	NESTLE SA - REGISTERED	207,970	97.43	20,262,517.10	
	ALCON INC	38,399	67.30	2,584,252.70	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	275.50	1,070,868.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	130.70	1,116,178.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	55.70	103,045.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,536	361.50	2,001,264.00	
	NOVARTIS	160,992	93.80	15,101,049.60	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	263.40	583,431.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,241	244.10	13,484,328.10	
	SANDOZ GROUP AG	30,458	28.02	853,433.16	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	110.20	274,067.40	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	45.99	703,141.11	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,115.00	2,034,875.00	
	UBS GROUP AG	249,657	24.98	6,236,431.86	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	133.50	569,244.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	120.40	355,782.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	584.00	1,237,496.00	
	SWISS RE LTD	22,063	97.76	2,156,878.88	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,919	434.20	4,741,029.80	
	TEMENOS AG - REG	5,150	83.38	429,407.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	15,069	82.08	1,236,863.52	
	SWISSCOM	1,856	511.00	948,416.00	
	BKW AG	1,744	142.90	249,217.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	88.25	501,171.75	
	スイスフラン 小計	1,170,963		105,083,327.92 (17,935,622,409)	
スウェーデン	BOLIDEN AB	22,252	270.70	6,023,616.40	



ローナ	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	406.60	2,188,727.80
	SCA SV CELLULOSA B	55,976	138.60	7,758,273.60
	ALFA LAVAL AB	18,955	371.10	7,034,200.50
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	284.20	21,592,663.40
	ATLAS COPCO A	207,097	164.45	34,057,101.65
	ATLAS COPCO B	132,940	142.75	18,977,185.00
	BEIJER REF AB	26,868	120.60	3,240,280.80
	EPIROC AB-A	53,479	188.25	10,067,421.75
	EPIROC AB-B	28,804	166.30	4,790,105.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	75.68	2,929,724.16
	INDUTRADE AB	22,644	242.10	5,482,112.40
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	250.80	3,511,701.60
	LIFCO AB-B SHS	17,970	245.40	4,409,838.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	59.10	7,260,316.80
	SAAB AB-B	6,388	670.80	4,285,070.40
	SANDVIK AB	75,334	206.50	15,556,471.00
	SKANSKA B	25,507	167.35	4,268,596.45
	SKF AB-B	21,050	192.70	4,056,335.00
	VOLVO AB-A SHS	13,514	251.20	3,394,716.80
	VOLVO B	114,238	245.40	28,034,005.20
	SECURITAS B	28,375	99.66	2,827,852.50
	VOLVO CAR AB-B	49,839	25.80	1,285,846.20
	EVOLUTION AB	13,186	1,192.60	15,725,623.60
	HENNES & MAURITZ B	60,983	159.00	9,696,297.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	247.90	12,264,604.60
	GETINGE AB-B SHS	17,796	217.60	3,872,409.60
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	292.20	4,188,687.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	133,009	137.70	18,315,339.30
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	107.85	13,021,377.60
	SWEDBANK AB-A	58,652	196.95	11,551,511.40
	EQT AB	31,471	267.30	8,412,198.30
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	314.30	3,714,397.40
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	313.90	3,505,635.20
INVESTOR AB-B SHS	128,538	230.55	29,634,435.90	
LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	521.00	3,792,880.00	
ERICSSON (LM) B	214,689	61.66	13,237,723.74	

	HEXAGON AB-B SHS	148,878	112.75	16,785,994.50	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	88.26	4,127,214.12	
	TELIA CO AB	123,760	27.05	3,347,708.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	63.88	3,621,996.00	
	SAGAX AB-B	17,402	244.60	4,256,529.20	
	スウェーデンクローナ 小計	2,444,789		386,104,725.07 (5,467,242,906)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	18,105	271.90	4,922,749.50	
	EQUINOR ASA	66,436	297.80	19,784,640.80	
	NORSK HYDRO	100,517	59.46	5,976,740.82	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	340.00	4,249,320.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	525.00	4,538,625.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	112.50	2,150,662.50	
	MOWI ASA	31,968	195.50	6,249,744.00	
	ORKLA	77,073	83.34	6,423,263.82	
	SALMAR ASA	5,423	606.80	3,290,676.40	
	DNB BANK ASA	71,795	212.80	15,277,976.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	180.20	3,347,034.80	
	TELENOR ASA	51,193	123.35	6,314,656.55	
	ノルウェークローネ 小計	481,344		82,526,090.19 (1,166,918,915)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	531.60	4,509,562.80	
	NOVOZYMES A/S	17,111	350.30	5,993,983.30	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,801.00	1,359,755.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	72,778	188.60	13,725,930.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,630.00	2,765,970.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	12,895.00	3,945,870.00	
	DSV A/S	14,203	1,230.00	17,469,690.00	
	PANDORA A/S	4,873	958.60	4,671,257.80	
	CARLSBERG AS-B	6,810	881.60	6,003,696.00	
	COLOPLAST-B	11,791	781.60	9,215,845.60	
	DEMANT A/S	8,512	304.90	2,595,308.80	
	GENMAB A/S	5,815	1,984.50	11,539,867.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	732.40	185,318,439.60	
	DANSKE BANK A/S	58,346	183.80	10,723,994.80	
	TRYG A/S	29,772	142.25	4,235,067.00	

	ORSTED A/S	12,910	387.80	5,006,498.00
	デンマーククローネ 小計	505,713		289,080,737.00 (6,258,597,956)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	34.75	716,857.75
	SANTOS	280,929	7.64	2,146,297.56
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	30.91	4,362,482.85
	BHP GROUP LTD	388,318	45.73	17,757,782.14
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	22.48	781,629.60
	FORTESCUE LTD	122,505	27.58	3,378,687.90
	IGO LTD	56,345	7.20	405,684.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	37,852	56.65	2,144,315.80
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	58.15	837,883.35
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	73,682	12.21	899,657.22
	ORICA LTD	38,288	15.99	612,225.12
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.47	726,912.95
	RIO TINTO LTD	28,272	128.00	3,618,816.00
	SOUTH32 LTD	346,773	3.24	1,123,544.52
	REECE LTD	16,814	22.04	370,580.56
	BRAMBLES LTD	108,007	14.28	1,542,339.96
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	25.48	1,130,700.48
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.66	437,703.06
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	5.21	442,850.00
	TRANSURBAN GROUP	224,973	13.10	2,947,146.30
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	42.60	1,968,546.00
	IDP EDUCATION LTD	17,793	21.00	373,653.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	4.93	897,324.09
	CAR GROUP LTD	29,334	31.90	935,754.60
	REA GROUP LTD	3,586	177.25	635,618.50
	SEEK LTD	28,001	25.23	706,465.23
	WESFARMERS LTD	84,329	57.16	4,820,245.64
	COLES GROUP LTD	108,486	15.52	1,683,702.72
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.42	595,663.42
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	35.67	3,284,172.57
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	10.48	670,300.80	
COCHLEAR LIMITED	4,783	298.73	1,428,825.59	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	49.70	601,717.90	

	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	31.13	1,302,136.77	
	CSL LIMITED	37,640	289.00	10,877,960.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	26.13	6,229,992.99	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	113.28	14,784,512.64	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	257,277	31.28	8,047,624.56	
	WESTPAC BANKING	276,117	23.20	6,405,914.40	
	ASX LTD	14,549	64.91	944,375.59	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	30,475	183.28	5,585,458.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.94	454,967.28	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.80	966,639.60	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.85	893,904.55	
	QBE INSURANCE GROUP	104,083	15.31	1,593,510.73	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	14.10	1,337,582.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	73.74	1,017,685.74	
	XERO LTD	11,340	114.73	1,301,038.20	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.97	1,224,613.99	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	109,481	8.13	890,080.53	
	オーストラリアドル 小計	5,256,243		128,844,085.15 (12,608,682,172)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.53	703,804.63	
	EBOS GROUP LTD	14,283	35.52	507,332.16	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	23.37	934,332.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	218,816	5.24	1,146,595.84	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.41	414,169.33	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.46	603,570.24	
	ニュージーランドドル 小計	530,697		4,309,804.80 (391,287,177)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,996	38.85	8,896,494.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	84.65	9,057,550.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	7.04	647,680.00	
	MTR CORP	125,000	25.85	3,231,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	12.58	1,509,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	40.00	6,960,000.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	21.10	4,177,800.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	12.08	1,762,472.00	
	WH GROUP LTD	658,301	4.77	3,140,095.77	

	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	18.56	5,224,640.00	
	HANG SENG BANK	59,400	82.50	4,900,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,300	229.60	20,273,680.00	
	AIA GROUP LTD	897,200	60.45	54,235,740.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	43.45	1,629,375.00	
	CLP HOLDINGS	102,000	60.70	6,191,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.60	5,066,079.20	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	44.00	4,928,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	35.30	4,306,458.80	
	ESR GROUP LTD	157,000	10.34	1,623,380.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	9.66	1,671,180.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.00	2,629,788.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	10.44	1,423,755.00	
	SINO LAND CO	315,400	7.86	2,479,044.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	75.50	7,927,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	62.25	2,770,125.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	14.92	1,435,304.00	
	WHARF HOLDINGS	161,000	22.95	3,694,950.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	22.85	2,810,550.00	
	香港ドル 小計	5,890,453		174,604,391.37 (3,308,753,216)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	29.45	235,600.00	
	KEPPEL LTD	112,800	6.87	774,936.00	
	SEATRIM LTD	2,152,791	0.11	241,112.59	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.83	564,542.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.50	704,158.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.98	288,408.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.36	600,096.00	
	DBS GROUP	141,600	32.05	4,538,280.00	
	OCBC BANK	257,100	12.91	3,319,161.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	27.85	2,617,900.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.61	634,260.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	777,443	2.40	1,865,863.20	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.39	453,299.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.98	775,098.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.30	269,640.00	

	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.26	297,350.00
	シンガポールドル 小計	4,771,366		18,179,703.79 (2,011,402,427)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	16.90	1,004,316.30
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	778.60	1,670,875.60
	BANK HAPOALIM BM	98,310	30.92	3,039,745.20
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	27.29	3,070,452.48
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	17.65	1,756,175.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	134.00	1,675,402.00
	NICE LTD	4,991	790.60	3,945,884.60
	AZRIELI GROUP	1,537	249.80	383,942.60
	イスラエルシェケル 小計	390,926		16,546,793.78 (654,645,766)
	合 計	86,596,731		637,297,793,310 (637,297,793,310)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	—	
		カナダドル 小計	1,490.00	— (—)	
		新株予約権証券合計		— (—)	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	674,649.00	
		オーストラリアドル 小計	83,290	674,649.00 (66,021,151)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,008,250.00	
		香港ドル 小計	315,000	3,008,250.00 (57,006,337)	
		投資信託受益証券合計	398,290	123,027,488 (123,027,488)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,542,245.05	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	889,324.14	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	7,398,442.30	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	721,858.60	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,106,159.39	
	BOSTON PROPERTIES	11,259	769,327.47	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	765,136.26	
	CROWN CASTLE INC	32,235	3,480,412.95	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	25,336	3,479,646.24	
	EQUINIX INC	7,333	5,886,125.77	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	964,742.30	
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,567,595.60	
	ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,253,624.25	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,303,104.68	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	841,598.45	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	893,983.75	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,133,189.08	
	INVITATION HOMES INC	45,008	1,515,869.44	
	IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,559,809.62	
	KIMCO REALTY CORP	47,897	965,603.52	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,243,531.80	
	PROLOGIS INC	71,288	9,156,230.72	
	PUBLIC STORAGE	11,847	3,458,376.24	
	REALTY INCOME CORP	56,068	3,168,963.36	
	REGENCY CENTERS CORP	12,511	784,815.03	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	2,062,451.04	
	SIMON PROPERTY GROUP	25,979	3,679,145.98	
	SUN COMMUNITIES INC	8,423	1,088,167.37	
	UDR INC	23,815	895,682.15	
	VENTAS INC	31,565	1,516,698.25	
	VICI PROPERTIES INC	74,643	2,281,090.08	
	WELLTOWER INC	41,060	3,689,241.00	
	WP CAREY INC	16,024	1,052,135.84	
	アメリカドル 小計	895,342	74,114,327.72 (10,983,743,368)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	230,422.05	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	290,902.20	
	カナダドル 小計	20,377	521,324.25 (57,528,130)	
ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	223,389.24	

		GECINA SA	3,139	323,317.00	
		KLEPIERRE	17,225	407,715.75	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	676,856.70	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	335,247.44	
		ユーロ 小計	48,695	1,966,526.13 (317,633,300)	
	イギリスポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	360,587.33	
		SEGRO PLC	78,133	647,410.03	
		イギリスポンド 小計	134,422	1,007,997.36 (189,856,302)	
	オーストラ リアドル	DEXUS	94,090	682,152.50	
		GOODMAN GROUP	135,303	3,293,275.02	
		GPT GROUP	167,884	731,974.24	
		MIRVAC GROUP	266,683	557,367.47	
		SCENTRE GROUP	381,283	1,090,469.38	
		STOCKLAND	207,412	889,797.48	
		VICINITY CENTERS	305,149	591,989.06	
		オーストラリアドル 小計	1,557,804	7,837,025.15 (766,931,281)	
	香港ドル	LINK REIT	166,900	6,751,105.00	
		香港ドル 小計	166,900	6,751,105.00 (127,933,439)	
	シンガポー ルドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	818,317.44	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	663,516.84	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	455,934.29	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	319,000.00	
		シンガポールドル 小計	1,125,856	2,256,768.57 (249,688,874)	
		投資証券合計	3,949,396	12,693,314,694 (12,693,314,694)	
		合計		12,816,342,182 (12,816,342,182)	

有価証券明細表注記

1. 券面総額欄の数値は、証券数又は口数を表示しております。
2. 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。



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

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

5. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ ドル	株式 589 銘柄	97.8%	—	—	—	73.8%
	投資証券 33 銘柄	—	—	—	2.2%	1.7%
カナダドル	株式 86 銘柄	99.7%	—	—	—	3.3%
	新株予約権 証券 1 銘柄	—	—	—	—	—
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 223 銘柄	99.5%	—	—	—	9.2%
	投資証券 5 銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリス ポンド	株式 80 銘柄	99.3%	—	—	—	4.0%
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.7%	0.0%
スイスフ ラン	株式 45 銘柄	100.0%	—	—	—	2.8%
スウェー デンクロ ーナ	株式 42 銘柄	100.0%	—	—	—	0.8%
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%	—	—	—	1.0%
オースト ラリアド ル	株式 50 銘柄	93.8%	—	—	—	1.9%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	—	0.5%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	—	5.7%	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 28 銘柄	94.7%	—	—	—	0.5%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	—	3.7%	0.0%
シンガポ ールドル	株式 16 銘柄	89.0%	—	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	—	11.0%	0.0%
イスラエ ルシエケ ル	株式 8 銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

#### 新興国債券インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2024年1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	916,578,274
コール・ローン	1,626,470,357
国債証券	124,792,768,808
派生商品評価勘定	11,121,724
未収利息	1,782,087,909
前払費用	115,177,012
流動資産合計	129,244,204,084
資産合計	129,244,204,084
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	137,930
未払解約金	85,342,649
未払利息	834
流動負債合計	85,481,413
負債合計	85,481,413
純資産の部	
元本等	
元本	58,039,006,751
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	71,119,715,920
元本等合計	129,158,722,671
純資産合計	129,158,722,671
負債純資産合計	129,244,204,084

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	58,039,006,751口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2254円 (22,254円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理(流動性リスク管理等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年1月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年1月21日
期首元本額	48,149,126,521円
期中追加設定元本額	14,053,944,163円
期中一部解約元本額	4,164,063,933円
期末元本額	58,039,006,751円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,133,021,556円
世界経済インデックスファンド	20,027,625,211円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,891,408,472円
DC世界経済インデックスファンド	14,505,264,567円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	8,512,505円
分散投資コア戦略ファンドA	395,863,625円
分散投資コア戦略ファンドS	1,042,725,547円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	743,346,725円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,577,227,796円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	231,533,263円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	106,389,287円
SMT インデックスバランス・オープン	170,115,934円
SMT 世界経済インデックス・オープン	484,482,127円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	651,934,145円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	1,038,291,108円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,184,986円
グローバル経済コア	860,862,720円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	98,753,815円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	84,365,997円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	35,278,746円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	39,720,927円
My SMT 新興国債券インデックス (ノーロード)	181,044,967円
10資産分散投資ファンド	42,798,549円
グローバル10資産バランスファンド	13,705,065円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	232,908,342円

私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	157,130,176 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）	22,559,958 円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	227,231,446 円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	220,416,015 円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	219,295,696 円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	221,204,889 円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	219,012,057 円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	141,790,532 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,587,352,980
合計		2,587,352,980

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

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,511,640,233	—	1,522,624,027	10,983,794
	メキシコペソ	232,590,659	—	234,641,715	2,051,056
	チェココルナ	146,167,517	—	147,158,529	991,012
	ハンガリーフォリント	74,646,559	—	74,885,922	239,363
	ポーランドズロチ	176,949,153	—	178,995,070	2,045,917
	マレーシアリングット	232,918,700	—	233,804,606	885,906
	タイバーツ	222,818,310	—	224,503,398	1,685,088
	南アフリカランド	191,074,719	—	191,104,669	29,950
	オフショア人民元	234,474,616	—	237,530,118	3,055,502
合計	1,511,640,233	—	1,522,624,027	10,983,794	

（注）時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考		
国債証券	メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	38,800,000.00	41,017,420.00			
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,738,546.12			
		MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000.00	107,260,800.00			
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	161,921,049.65			
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	54,681,350.00			
		MBONO 7.5% 05/26/33	82,000,000.00	73,148,920.00			
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	131,603,810.00			
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	162,587,847.00			
		MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000.00	106,175,420.00			
		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	25,213,287.00			
		MBONO 7% 09/03/26	33,000,000.00	30,959,610.00			
		MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000.00	135,988,548.00			
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	91,976,361.00			
		MBONO 8% 07/31/53	72,500,000.00	62,769,050.00			
		MBONO 8% 09/05/24	116,900,000.00	114,599,624.26			
		MBONO 8% 11/07/47	96,000,000.00	83,946,240.00			
		メキシコペソ 小計			1,582,850,000.00	1,469,587,883.03 (12,750,585,349)	
		ブラジルリアル	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	63,782,905.45		
			BLTN 0% 07/01/25	45,300,000.00	39,562,952.05		
	BLTN 0% 07/01/26		78,000,000.00	62,011,978.86			
	BLTN 0% 07/01/27		58,000,000.00	41,618,212.04			
	BNTNF 10% 01/01/25		55,300,000.00	55,209,635.04			
	BNTNF 10% 01/01/27		68,300,000.00	68,328,800.33			
	BNTNF 10% 01/01/29		51,400,000.00	50,826,099.67			
	BNTNF 10% 01/01/31		19,850,000.00	19,378,003.40			
	BNTNF 10% 01/01/33		28,900,000.00	27,934,947.90			
	BRAZIL 10.25% 01/10/28		1,400,000.00	1,436,442.00			
ブラジルリアル 小計			482,950,000.00	430,089,976.74			

			(12,926,784,340)
チリペソ	BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	548,205,907.50
	BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,878,004,107.80
	BTPCL 4.5% 03/01/26	1,760,000,000.00	1,732,226,958.88
	BTPCL 4.7% 09/01/30	2,270,000,000.00	2,182,233,403.27
	BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,126,057,302.59
	BTPCL 5% 10/01/28	720,000,000.00	707,770,244.16
	BTPCL 6% 01/01/43	1,800,000,000.00	1,918,076,301.00
	BTPCL 6% 04/01/33	1,650,000,000.00	1,718,084,029.20
	BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	548,818,572.47
チリペソ 小計		14,510,000,000.00	14,359,476,826.87 (2,335,655,062)
コロンビアペソ	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	63,390,431,447.00
	COLTES 6.25% 11/26/25	15,800,000,000.00	15,115,183,602.00
	COLTES 7.25% 10/18/34	48,100,000,000.00	40,160,105,583.00
	COLTES 7.25% 10/26/50	45,110,000,000.00	33,186,957,856.00
コロンビアペソ 小計		174,310,000,000.00	151,852,678,488.00 (5,751,420,197)
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	4,263,047.41
	PERUGB 5.4% 08/12/34	7,250,000.00	6,570,217.30
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,699,927.62
	PERUGB 5.94% 02/12/29	8,800,000.00	8,887,413.04
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	8,127,230.27
	PERUGB 6.35% 08/12/28	6,650,000.00	6,857,149.29
	PERUGB 6.9% 08/12/37	11,050,000.00	11,160,866.30
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,600,000.00	12,032,989.36
	PERUGB 7.3% 08/12/33	9,400,000.00	9,887,093.80
	PERUGB 8.2% 08/12/26	2,550,000.00	2,718,648.99
ペルーソル 小計		74,250,000.00	74,204,583.38 (2,938,034,012)
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	23,813,715.25
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,419,023.47
	URUGUA 9.75% 07/20/33	25,000,000.00	25,906,250.00
ウルグアイペソ 小計		67,000,000.00	66,138,988.72 (250,355,914)
ドミニカペ	DOMREP 11.25% 09/15/35	40,000,000.00	43,256,233.20

	ソ	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	38,997,935.68	
	ドミニカペソ 小計		72,000,000.00	82,254,168.88 (207,272,280)	
チェココ ル ナ	CZGB 0.05% 11/29/29		26,100,000.00	21,038,583.60	
	CZGB 0.25% 02/10/27		55,200,000.00	49,480,728.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30		98,900,000.00	83,382,590.00	
	CZGB 0% 12/12/24		24,000,000.00	22,973,178.72	
	CZGB 1.2% 03/13/31		98,000,000.00	82,154,576.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25		58,500,000.00	56,522,700.00	
	CZGB 1.5% 04/24/40		34,700,000.00	24,558,925.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32		66,500,000.00	56,763,868.00	
	CZGB 1.95% 07/30/37		29,000,000.00	23,055,000.00	
	CZGB 1% 06/26/26		68,800,000.00	64,077,912.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25		75,700,000.00	73,485,018.00	
	CZGB 2.5% 08/25/28		98,700,000.00	93,592,275.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29		100,500,000.00	95,391,585.00	
	CZGB 2% 10/13/33		74,500,000.00	63,446,137.00	
	CZGB 3.5% 05/30/35		22,000,000.00	21,208,000.00	
	CZGB 4.2% 12/04/36		38,000,000.00	39,130,500.00	
	CZGB 4.5% 11/11/32		25,000,000.00	26,162,500.00	
	CZGB 4.9% 04/14/34		47,500,000.00	51,490,000.00	
	CZGB 5.5% 12/12/28		69,000,000.00	74,424,849.00	
	CZGB 5.75% 03/29/29		18,000,000.00	19,631,304.00	
CZGB 5% 09/30/30		80,000,000.00	85,491,520.00		
CZGB 6.2% 06/16/31		27,000,000.00	31,240,080.00		
CZGB 6% 02/26/26		63,000,000.00	65,866,500.00		
	チェココルナ 小計		1,298,600,000.00	1,224,568,329.32 (7,983,450,766)	
ハンガリー フォリント	HGB 1.5% 04/22/26		610,500,000.00	557,722,275.00	
	HGB 1.5% 08/26/26		514,000,000.00	461,559,150.00	
	HGB 1% 11/26/25		835,000,000.00	766,891,388.00	
	HGB 2.25% 04/20/33		712,000,000.00	540,761,294.40	
	HGB 2.25% 06/22/34		221,000,000.00	162,819,982.00	
	HGB 2.5% 10/24/24		578,000,000.00	560,437,470.00	
	HGB 2.75% 12/22/26		485,500,000.00	446,447,253.90	
	HGB 2% 05/23/29		413,000,000.00	345,908,150.00	



	HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	692,264,672.40	
	HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	250,091,100.00	
	HGB 3% 08/21/30	715,000,000.00	613,699,801.00	
	HGB 3% 10/27/27	932,000,000.00	853,286,914.80	
	HGB 3% 10/27/38	530,000,000.00	373,198,016.00	
	HGB 4.5% 03/23/28	263,000,000.00	252,302,606.50	
	HGB 4.75% 11/24/32	840,000,000.00	783,014,139.60	
	HGB 5.5% 06/24/25	900,000,000.00	895,808,790.00	
	HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	802,158,206.20	
	HGB 9.5% 10/21/26	230,000,000.00	250,617,660.00	
	ハンガリーフォロント 小計	10,729,000,000.00	9,608,988,869.80 (4,062,315,352)	
ポーランド ズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	22,200,000.00	19,547,810.40	
	POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	13,575,161.60	
	POLGB 0% 10/25/25	11,500,000.00	10,572,676.80	
	POLGB 1.25% 10/25/30	22,800,000.00	17,904,429.60	
	POLGB 1.75% 04/25/32	22,700,000.00	17,622,055.40	
	POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,554,456.65	
	POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	20,076,506.70	
	POLGB 2.5% 07/25/27	23,700,000.00	21,867,444.90	
	POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	19,219,956.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	23,207,337.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	22,452,013.85	
	POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	20,327,718.90	
	POLGB 6% 10/25/33	14,800,000.00	15,618,647.20	
	POLGB 7.5% 07/25/28	19,900,000.00	21,834,916.80	
	ポーランドズロチ 小計	283,400,000.00	262,381,131.80 (9,735,337,038)	
ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	7,500,000.00	6,617,379.30	
	ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	6,126,947.45	
	ROMGB 3.5% 11/25/25	5,800,000.00	5,569,547.73	
	ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	10,095,703.48	
	ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,401,427.35	
	ROMGB 3.7% 11/25/24	9,200,000.00	9,045,624.00	
	ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,380,202.58	
	ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,566,094.00	

		ROMGB 4.25% 04/28/36	6,600,000.00	5,417,446.11	
		ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,489,452.67	
		ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	6,302,664.00	
		ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,587,323.28	
		ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,310,004.00	
		ROMGB 5.8% 07/26/27	6,500,000.00	6,433,834.03	
		ROMGB 5% 02/12/29	7,600,000.00	7,201,353.70	
		ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,956,545.52	
		ROMGB 7.2% 10/28/26	2,000,000.00	2,058,527.80	
		ROMGB 7.2% 10/30/33	5,300,000.00	5,607,983.00	
		ROMGB 7.35% 04/28/31	4,800,000.00	5,078,352.00	
		ROMGB 7.9% 02/24/38	6,100,000.00	6,903,675.00	
		ROMGB 8.25% 09/29/32	6,800,000.00	7,624,485.04	
		ROMGB 8.75% 10/30/28	7,500,000.00	8,260,803.75	
		ROMGB 8% 04/29/30	3,500,000.00	3,801,490.00	
		ルーマニアレイ 小計	156,400,000.00	151,836,865.79 (4,926,802,621)	
マレーシア リンギット		MGS 2.632% 04/15/31	16,200,000.00	15,015,265.48	
		MGS 3.502% 05/31/27	17,650,000.00	17,632,043.94	
		MGS 3.582% 07/15/32	21,500,000.00	20,992,824.03	
		MGS 3.733% 06/15/28	38,200,000.00	38,301,925.24	
		MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	26,184,652.32	
		MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,144,967.42	
		MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,301,066.32	
		MGS 3.885% 08/15/29	47,600,000.00	48,042,442.00	
		MGS 3.899% 11/16/27	25,500,000.00	25,784,039.40	
		MGS 3.9% 11/30/26	20,450,000.00	20,679,608.51	
		MGS 3.906% 07/15/26	24,600,000.00	24,870,282.66	
		MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	28,947,408.35	
		MGS 4.059% 09/30/24	5,450,000.00	5,473,705.86	
		MGS 4.065% 06/15/50	18,250,000.00	17,690,874.75	
		MGS 4.254% 05/31/35	13,650,000.00	13,909,077.00	
		MGS 4.457% 03/31/53	4,800,000.00	4,965,032.16	
		MGS 4.504% 04/30/29	7,000,000.00	7,268,413.60	
		MGS 4.642% 11/07/33	3,600,000.00	3,832,090.92	
		MGS 4.696% 10/15/42	12,800,000.00	13,763,687.68	

	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,470,395.42	
	MGS 4.893% 06/08/38	18,600,000.00	20,380,527.78	
	MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,604,038.04	
	マレーシアリングット 小計	399,400,000.00	403,254,368.88 (12,675,696,204)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 09/17/24	84,000,000.00	83,143,001.76	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	139,522,243.17	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	164,000,000.00	162,717,656.12	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,395,806.78	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,527,066.73	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	138,100,000.00	131,343,795.84	
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	155,826,128.76	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	201,818,211.52	
	THAIGB 2.25% 03/17/27	28,000,000.00	27,918,356.20	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,121,708.20	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	140,000,000.00	141,373,512.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	93,932,599.32	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	103,032,089.70	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	66,790,940.28	
	THAIGB 2% 12/17/31	113,000,000.00	107,742,856.93	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	154,938,767.98	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	134,000,000.00	140,404,731.00	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	91,000,000.00	95,915,410.50	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	164,826,903.84	
	THAIGB 3.45% 06/17/43	94,000,000.00	98,342,442.80	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	116,500,000.00	124,565,493.05	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	194,336,262.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	108,343,495.26	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	169,500,000.00	190,024,178.70	
	タイバーツ 小計	2,920,300,000.00	2,938,903,658.44 (12,284,617,292)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	27,820,936.50	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	27,820,936.50 (73,692,096)	
インドネシ	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	8,819,121,240.00	

アルピア	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,041,334,250.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	60,897,995,550.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000.00	107,063,473,300.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	15,848,000,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,380,967,886.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	61,184,700,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,805,289,500.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	62,500,000,000.00	62,416,188,750.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	75,500,000,000.00	74,858,250,000.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	53,000,000,000.00	53,089,570,000.00	
	INDOGB 6.625% 02/15/34	15,000,000,000.00	14,988,900,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	19,930,000,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	24,000,000,000.00	24,817,440,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	43,800,000,000.00	44,785,500,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	18,500,000,000.00	19,017,630,000.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	51,000,000,000.00	53,881,500,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	34,700,000,000.00	36,941,620,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	77,700,000,000.00	82,478,550,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,255,600,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000.00	92,816,469,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	39,352,700,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	85,000,000,000.00	86,955,000,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	54,200,000,000.00	58,156,600,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	37,875,430,000.00	
	INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	14,767,594,620.00	
	INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	49,379,000,000.00	
	INDOGB 8.375% 04/15/39	24,200,000,000.00	27,600,100,000.00	
	INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	41,924,550,000.00	
	INDOGB 8.75% 05/15/31	38,700,000,000.00	43,150,500,000.00	
INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,348,193,880.00		
INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	31,901,177,910.00		
	インドネシアルピア 小計	1,294,800,000,000.00	1,338,728,945,886.00 (12,717,924,985)	
南アフリカ ランド	SAGB 10.5% 12/21/26	203,200,000.00	212,293,200.00	
	SAGB 11.625% 03/31/53	16,500,000.00	15,622,365.00	
	SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	47,417,350.00	

	SAGB 6.5% 02/28/41	113,100,000.00	68,029,650.00	
	SAGB 7% 02/28/31	102,700,000.00	86,139,625.00	
	SAGB 8.25% 03/31/32	186,500,000.00	162,590,700.00	
	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000.00	113,573,150.00	
	SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	82,588,800.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	133,031,655.00	
	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	127,202,400.00	
	SAGB 8% 01/31/30	200,100,000.00	184,632,270.00	
	SAGB 9% 01/31/40	118,300,000.00	92,262,170.00	
	南アフリカランド 小計	1,603,000,000.00	1,325,383,335.00 (10,324,736,179)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,561,855.26	
	CGB 2.18% 08/15/26	3,400,000.00	3,391,480.72	
	CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,190,349.06	
	CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,004,720.80	
	CGB 2.3% 05/15/26	14,000,000.00	14,003,340.40	
	CGB 2.4% 07/15/28	10,000,000.00	10,005,426.00	
	CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	21,045,452.40	
	CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,067,500.80	
	CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,421,060.00	
	CGB 2.48% 09/25/28	5,000,000.00	5,017,612.50	
	CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,027,046.20	
	CGB 2.52% 08/25/33	12,700,000.00	12,683,549.55	
	CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,952,182.13	
	CGB 2.62% 04/15/28	17,800,000.00	17,985,214.34	
	CGB 2.62% 06/25/30	5,500,000.00	5,535,824.25	
	CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	5,043,455.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	23,200,000.00	23,430,489.68	
	CGB 2.67% 05/25/33	8,000,000.00	8,067,895.20	
	CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,587,414.40	
	CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,100,844.00	
	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	10,109,836.00	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,819,376.95	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	11,074,379.29	
	CGB 2.76% 05/15/32	13,000,000.00	13,218,857.60	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,208,954.80	

	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,222,126.00	
	CGB 2.8% 03/25/30	9,000,000.00	9,158,715.90	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	10,091,876.85	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,726,684.64	
	CGB 2.88% 02/25/33	17,200,000.00	17,702,346.64	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,205,334.40	
	CGB 2.91% 10/14/28	10,000,000.00	10,232,546.00	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,146,459.40	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,068,268.14	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,788,792.60	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,411,014.75	
	CGB 3.03% 03/11/26	19,500,000.00	19,850,260.95	
	CGB 3.12% 10/25/52	4,600,000.00	4,875,307.24	
	CGB 3.12% 12/05/26	15,000,000.00	15,367,666.50	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,621,839.97	
	CGB 3.19% 04/15/53	3,000,000.00	3,245,632.20	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,037,322.24	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,551,779.80	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,743,949.57	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	23,136,348.40	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,071,865.99	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,866,082.24	
	CGB 3.32% 04/15/52	4,000,000.00	4,361,328.00	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,937,551.36	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,883,812.75	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	19,443,766.65	
	オフショア人民元 小計	608,700,000.00	624,302,796.51 (12,848,089,121)	
	合計		124,792,768,808 (124,792,768,808)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 16 銘柄	100.0%	10.2%
ブラジルレアル	国債証券 10 銘柄	100.0%	10.4%
チリペソ	国債証券 9 銘柄	100.0%	1.9%
コロンビアペソ	国債証券 4 銘柄	100.0%	4.6%
ペルーソル	国債証券 10 銘柄	100.0%	2.4%
ウルグアイペソ	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 2 銘柄	100.0%	0.2%
チェココルナ	国債証券 23 銘柄	100.0%	6.4%
ハンガリーフォリント	国債証券 18 銘柄	100.0%	3.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14 銘柄	100.0%	7.8%
ルーマニアレイ	国債証券 23 銘柄	100.0%	3.9%
マレーシアリンギット	国債証券 22 銘柄	100.0%	10.2%
タイバーツ	国債証券 24 銘柄	100.0%	9.8%
フィリピンペソ	国債証券 1 銘柄	100.0%	0.1%
インドネシアルピア	国債証券 32 銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券 12 銘柄	100.0%	8.3%
オフショア人民元	国債証券 51 銘柄	100.0%	10.3%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,943,317,379
コール・ローン	150,238,855
株式	160,183,801,461
投資信託受益証券	516,338,038
投資証券	179,042,469
派生商品評価勘定	3,584,856
未収入金	1,236,407
未収配当金	156,880,325
前払金	97,713,447

差入委託証拠金	1,176,480,080
流動資産合計	167,408,633,317
資産合計	167,408,633,317
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101,256,168
未払金	1,262
未払解約金	74,076,738
未払利息	77
流動負債合計	175,334,245
負債合計	175,334,245
純資産の部	
元本等	
元本	42,679,478,090
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	124,553,820,982
元本等合計	167,233,299,072
純資産合計	167,233,299,072
負債純資産合計	167,408,633,317

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年1月22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>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1) 受取配当金</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2024年1月22日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	42,679,478,090 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 3.9184 円 (1 万口当たり純資産額) (39,184 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

		2024年1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。</p>	
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

		2024年1月22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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年1月21日
期首元本額	33,154,306,941円
期中追加設定元本額	13,472,256,891円
期中一部解約元本額	3,947,085,742円
期末元本額	42,679,478,090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	7,560,620,428円
世界経済インデックスファンド	10,309,667,197円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,126,815,770円
DC世界経済インデックスファンド	7,409,819,900円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	83,076,033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)	1,200,255,851円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	789,506,839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)	366,598,734円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,210,106円
SMT インデックスバランス・オープン	87,863,856円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	35,711,445円

外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	2,348,903,696円
SMT 世界経済インデックス・オープン	249,400,183円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,075,241,621円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	180,766,597円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,766,545円
グローバル経済コア	440,516,610円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	281,573,347円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	57,500,179円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	14,488,359円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	101,627,090円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	96,941,256円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	42,769,450円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	50,370,765円
10資産分散投資ファンド	13,154,520円
グローバル10資産バランスファンド	7,641,064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）	1,514,620,028円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	94,637,367円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	79,990,415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）	12,645,864円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,166,526円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,020,506,352	
投資信託受益証券	33,588,906	
投資証券	1,639,684	
合計	2,055,734,942	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年1月22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	6,529,590,483	—	6,431,877,036	△97,713,447
合計		6,529,590,483	—	6,431,877,036	△97,713,447

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2024年1月22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	170,345,500	—	170,387,635	42,135
	アメリカドル	170,345,500	—	170,387,635	42,135
合計		170,345,500	—	170,387,635	42,135

## (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	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	139,400	1.48	207,287.80	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	14.87	251,749.10	
	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	81.09	1,277,086.41	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	17.38	1,265,802.78	
	NIO INC - ADR	231,271	6.06	1,401,502.26	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	31.82	959,659.38	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	11.12	881,460.16	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	35.25	2,342,433.00	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	25.27	310,391.41	
	IQIYI INC-ADR	59,454	3.66	217,601.64	
	JOYY INC	6,185	29.85	184,622.25	
	KANZHUN LTD	38,815	13.42	520,897.30	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	8.51	966,284.97	
VK CO LTD	19,368	0.00	—		

	WEIBO CORP-SPON ADR	29,249	8.12	237,501.88	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	—	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	97,780	143.64	14,045,119.20	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	15.03	821,780.28	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	56.68	838,183.84	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	903,900	1.13	1,028,638.20	
	CREDICORP LTD	10,882	148.94	1,620,765.08	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	28,533	2.24	63,913.92	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	14.46	300,088.38	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	1.92	270,399.96	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	20.38	159,677.30	
	KE HOLDINGS INC	114,048	13.54	1,544,209.92	
	アメリカドル 小計	2,418,156		31,717,056.42 (4,700,467,761)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	12.82	34,155,826.02	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	85.23	41,668,265.16	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	211.82	7,413,700.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	35.29	6,301,100.08	
	ALFA S. A. B. -A	313,500	13.27	4,160,145.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	158.44	16,160,880.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	478.17	16,054,557.75	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	157.56	8,366,436.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	265.58	15,929,488.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	172.86	7,378,529.10	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	68.42	56,602,497.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	184.32	15,091,200.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	228.46	71,539,964.40	
	GRUMA S. A. B. -B	25,960	306.85	7,965,826.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	84.42	15,347,556.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.65	7,026,570.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	61.97	8,843,119.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	412,300	167.05	68,874,715.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	271,700	45.00	12,226,500.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	15.78	55,566,745.20	

	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	21.02	4,647,522.00	
	メキシコペソ 小計	10,152,540		481,321,142.71 (4,176,086,630)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	18.09	2,932,389.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	38.95	24,698,195.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	37.53	27,323,341.20	
	PRIO SA	130,000	44.61	5,799,300.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	27.66	4,201,554.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	17.33	1,722,602.00	
	GERDAU SA-PREF	155,590	21.07	3,278,281.30	
	SUZANO SA	121,779	51.80	6,308,152.20	
	VALE SA	550,487	68.10	37,488,164.70	
	WEG SA	255,844	33.48	8,565,657.12	
	CCR SA	248,600	13.51	3,358,586.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	137,340	60.09	8,252,760.60	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHTS	492	18.35	9,028.20	
	RUMO SA	244,300	22.40	5,472,320.00	
	LOJAS RENNER S. A.	216,447	16.72	3,618,993.84	
	MAGAZINE LUIZA SA	305,500	2.03	620,165.00	
	VIBRA ENERGIA SA	173,000	22.68	3,923,640.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.83	1,568,658.00	
	RAIA DROGASIL SA	189,280	26.90	5,091,632.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	14.30	4,285,710.00	
	AMBEV SA	756,200	13.35	10,095,270.00	
	JBS SA	110,000	23.75	2,612,500.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	100,308	17.24	1,729,309.92	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.02	4,201,519.08	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	26.65	2,550,405.00	
	HYPERA SA	54,500	32.81	1,788,145.00	
	BANCO BRADESCO S. A.	326,023	13.85	4,515,418.55	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	15.64	12,952,766.48	
	BANCO DO BRASIL S. A.	156,500	55.92	8,751,480.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	32.94	25,702,456.14	
ITAUSA SA	824,701	10.04	8,279,998.04		
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	887,409	13.79	12,237,370.11		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	34.55	3,762,495.00		

	TOTVS SA	57,900	31.72	1,836,588.00	
	TELEFONICA BRASIL S. A.	89,400	50.65	4,528,110.00	
	TIM SA	96,100	17.62	1,693,282.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	46.70	1,727,900.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	41.71	8,830,007.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	11.53	2,442,365.31	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	76.00	3,838,000.00	
	COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	9.98	2,041,908.00	
	CPFL ENERGIA SA	27,200	36.20	984,640.00	
	ENEVA SA	102,200	12.69	1,296,918.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	40.81	1,887,462.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	34.37	5,674,487.00	
	ブラジルリアル 小計	12,310,134		294,479,931.29 (8,850,888,814)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	5,855.00	529,426,665.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,546.00	210,201,890.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	42,993.00	913,644,243.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	64.00	157,516,032.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	10.50	444,849,636.00	
	FALABELLA SA	70,837	2,000.00	141,674,000.00	
	CENCOSUD SA	306,432	1,525.00	467,308,800.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	99.00	750,737,097.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	23,725.00	165,814,025.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	42.45	490,304,674.05	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	95.99	335,131,326.85	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	53.30	136,516,117.40	
	チリペソ 小計	70,645,682		4,743,124,506.30 (771,497,659)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	33,640.00	1,705,480,720.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	31,260.00	1,924,521,900.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	17,220.00	869,799,420.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,499,802,040.00 (170,430,002)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	24.82	129,088.82	
	MYTILINEOS S. A.	20,295	38.34	778,110.30	
	OPAP SA	20,586	15.91	327,523.26	

	JUMBO SA	19,341	25.80	498,997.80	
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.56	411,322.08	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.74	744,130.14	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	6.90	924,123.90	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.38	383,043.89	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.05	342,001.35	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	12.15	679,087.80	
	ユーロ 小計	1,085,841		5,217,429.34 (842,719,186)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	139.30	19,862,787.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	42.16	10,913,874.88	
	HEKTAS TICARET T. A. S	133,067	17.62	2,344,640.54	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	16,783	20.20	339,016.60	
	SASA POLYESTER SANAYI	368,879	37.60	13,869,850.40	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	47.46	9,450,804.72	
	KOC HOLDING AS	89,884	153.80	13,824,159.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	48.00	14,339,904.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	713.00	5,120,053.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	250.25	21,675,403.75	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	797.00	13,046,890.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	229.30	7,246,567.90	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	335.00	27,211,380.00	
	AKBANK T. A. S.	586,183	40.92	23,986,608.36	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	68.90	14,563,530.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	25.44	9,780,738.72	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	22.16	8,224,174.32	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	64.35	9,207,905.85	
	トルコリラ 小計	3,427,184		225,008,290.04 (1,106,658,272)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	743.00	9,884,129.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	95.40	5,791,734.00	
	CEZ AS	25,283	920.00	23,260,360.00	
	チェココルナ 小計	99,296		38,936,223.00 (253,840,812)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	2,838.00	126,356,274.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,435.00	271,171,335.00	



	OTP BANK NYRT	40,021	17,210.00	688,761,410.00	
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		1,086,289,019.00 (459,241,718)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	102,979	59.94	6,172,561.26	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	107.10	2,161,920.60	
	BUDIMEX	2,656	642.00	1,705,152.00	
	LPP SA	230	15,210.00	3,498,300.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	99.20	665,036.80	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	10.97	395,995.06	
	ALLEGRO.EU SA	83,795	31.51	2,640,380.45	
	PEPCO GROUP NV	22,887	23.22	531,436.14	
	DINO POLSKA SA	9,471	414.20	3,922,888.20	
	BANK PEKAO SA	27,684	143.90	3,983,727.60	
	M BANK SA	1,423	499.30	710,503.90	
	PKO BANK POLSKI SA	130,297	49.78	6,486,184.66	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	465.80	3,420,369.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	46.44	4,018,406.76	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	8.42	840,515.60	
	ポーランドズロチ 小計	638,082		41,153,378.43 (1,526,946,722)	
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 (127)	

香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	7.18	2,362,220.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	7.13	1,725,460.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	3.75	14,510,250.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	27.00	15,538,500.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	22,000	7.92	174,240.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	4.97	18,886,000.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	15.02	6,443,580.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.39	1,152,600.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	15.86	3,766,750.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	5.53	3,071,915.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.76	2,009,280.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.07	3,296,700.00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	24.35	1,315,874.00
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	10.46	2,447,640.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	3.13	1,139,320.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	11.94	2,925,300.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	7.86	1,422,660.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.46	10,371,300.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	2.92	803,000.00
	BOC AVIATION LTD	23,800	56.20	1,337,560.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	3.05	1,665,300.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	3.18	2,245,080.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	8.13	3,593,460.00
	CITIC LTD	1,038,000	6.96	7,224,480.00
	CRRC CORP LTD-H	936,000	3.30	3,088,800.00
	FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.19	1,206,720.00
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	16.54	1,290,120.00
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	5.76	921,600.00
	SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	14.94	2,487,510.00
	WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	12.80	5,232,640.00
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	19.32	1,203,636.00
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	2.49	958,834.26
	AIR CHINA LIMITED-H	630,000	4.57	2,879,100.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	10.02	3,863,180.94	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	3.06	1,829,880.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	7.85	4,066,692.50	

COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.38	1,349,164.12
JD LOGISTICS INC	326,200	7.78	2,537,836.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.41	2,386,020.00
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	112.60	1,970,500.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.49	1,701,900.00
BYD CO LTD-H	169,000	195.60	33,056,400.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.10	824,600.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	37.90	2,213,360.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	7.85	7,441,800.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	9.15	4,517,812.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	3.20	1,146,700.80
LI AUTO INC-CLASS A	190,542	110.20	20,997,728.40
MINTH GROUP LTD	176,000	12.16	2,140,160.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	37.20	6,218,426.40
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	11.72	2,742,480.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	25.80	2,236,860.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	65.75	13,071,100.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.45	1,511,100.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	310,600	21.45	6,662,370.00
LI NING CO LTD	380,000	16.18	6,148,400.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	69.50	11,036,600.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	4.01	661,650.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	24.45	1,075,800.00
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	234,000	13.08	3,060,720.00
MEITUAN-CLASS B	833,450	68.65	57,216,342.50
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	57.00	13,936,500.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	15.58	2,598,744.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	8.15	643,850.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	278.80	24,438,771.60
BAIDU INC-CLASS A	379,500	99.20	37,646,400.00
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	74.30	3,090,880.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	27.65	1,426,740.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.63	2,066,840.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	20.00	3,424,000.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	41.55	15,473,220.00
NETEASE INC	313,630	138.90	43,563,207.00

TENCENT HOLDINGS LTD	1,083,100	271.20	293,736,720.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,643,588	65.55	173,287,193.40
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	71.45	643,050.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	10.88	2,741,760.00
JD.COM INC - CL A	379,111	84.15	31,902,190.65
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	42.40	1,819,129.60
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	18.74	1,210,604.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	5.43	2,226,300.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	14.46	1,330,320.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	3.17	2,485,280.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	28.55	5,522,997.50
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	14.08	756,096.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	105.09	1,597,368.00
CHINA FEIHE LTD	564,000	3.73	2,103,720.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	17.26	9,959,020.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	30.45	7,490,700.00
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	39.75	13,856,850.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	5.27	1,027,650.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	7.19	2,991,040.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	46.15	5,353,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	4.48	358,400.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.31	4,206,560.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	26.25	2,296,875.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	22.85	571,250.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	29.30	2,209,220.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	6.22	410,520.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	5.65	2,255,480.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	10.80	1,386,720.00
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	18.90	3,613,680.00
3SBIO INC	445,500	6.01	2,677,455.00
AKESO INC	61,000	41.45	2,528,450.00
BEIGENE LTD	110,905	95.40	10,580,337.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	11.72	2,894,840.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	5.91	8,204,025.60
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	4.77	1,617,030.00

CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	2.99	1,453,140.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	16.50	3,663,000.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	12.36	1,507,920.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	36.20	7,348,600.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	14.62	1,067,260.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.93	5,775,030.00
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	79.35	5,053,642.80
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	28.35	17,803,800.00
ZAI LAB LTD	128,250	17.62	2,259,765.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,935,000	2.87	11,293,450.00
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	2.88	38,699,136.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	4.46	6,116,778.50
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	3.65	5,712,980.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,201,620	4.39	66,735,111.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.20	825,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	25.15	15,641,363.45
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	2.52	1,699,488.00
IND&COMM BK OF CHINA-H	10,851,515	3.59	38,956,938.85
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,075,000	3.42	3,676,500.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.69	574,080.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	3.76	1,816,080.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	9.34	3,280,208.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	15.30	4,372,357.50
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.68	1,363,200.00
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	7.77	688,422.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.71	1,325,212.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.70	2,580,200.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	8.54	11,272,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	13.32	5,149,512.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	5.94	1,093,102.56
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	105,400	13.24	1,395,496.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.36	4,432,080.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.51	11,386,208.88
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,058,000	30.35	32,110,300.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	14.08	1,634,688.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	5.21	1,437,960.00

GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	5.48	694,316.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	9.43	4,648,990.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	20.50	1,465,750.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	30.45	4,887,225.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	15.54	1,041,180.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	5.27	363,630.00	
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	9.76	11,594,880.00	
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	56.65	6,769,675.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	2,554,200	13.18	33,664,356.00	
ZTE CORP-H	82,908	14.62	1,212,114.96	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.76	5,382,320.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	27.15	1,615,425.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.80	1,098,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	2.14	3,055,920.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.19	3,353,416.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	4.69	2,119,880.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.90	1,931,400.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	22.75	4,477,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	15.28	3,933,072.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	52.55	6,148,350.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	5.79	2,582,340.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.17	2,935,680.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.80	3,726,400.00	
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	15.30	979,200.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.07	3,369,430.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	16.90	1,521,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	3.87	3,467,469.69	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	14.20	1,298,646.80	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	11.40	6,663,756.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	5.05	1,136,250.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	23.05	12,472,608.55	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	22.20	2,641,800.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	5.95	1,877,225.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	5.07	1,728,870.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	6.12	443,700.00	

	LONGFOR PROPERTIES	343,500	8.85	3,039,975.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	4.65	1,490,790.00	
	香港ドル 小計	133,620,496		1,560,577,450.11 (29,572,942,679)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	1.82	752,875.76	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	20.98	1,854,632.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.78	2,823,192.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.78	3,621,328.00	
	GAMUDA BHD	161,910	4.98	806,311.80	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.48	834,138.08	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	7.64	819,626.84	
	MISC BHD	217,540	7.24	1,574,989.60	
	GENTING BHD	271,600	4.64	1,260,224.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.65	979,705.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.46	443,037.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.96	1,070,546.40	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	22.46	2,565,965.16	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	119.40	2,173,080.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	14.68	1,078,686.40	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.88	733,824.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.45	1,099,354.70	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.00	2,828,400.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.22	1,268,954.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	920,002	6.01	5,529,212.02	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	18.80	2,280,289.60	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.03	7,959,990.15	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.35	11,066,835.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.53	1,212,988.91	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.54	1,374,366.06	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.20	2,091,600.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.77	1,009,983.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	5.85	1,588,579.20	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	17.48	2,594,032.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	10.44	4,612,131.00	
INARI AMERTRON BHD	274,700	3.23	887,281.00		
	マレーシアリンギット 小計	12,193,769		70,796,158.68	

				(2,225,371,053)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	6.65	11,392,780.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	149.50	30,019,600.00
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	34.25	57,697,550.00
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	53.00	15,561,065.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	23.60	4,871,040.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	34.50	16,771,623.00
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	31.75	6,435,725.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	272.00	35,468,800.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	60.75	39,785,175.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.45	6,086,650.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	6.80	5,504,600.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.84	3,111,552.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	27.50	23,345,795.00
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	35.25	6,422,550.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	10.80	9,073,458.00
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	18.30	14,500,920.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	25.50	4,528,800.00
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	53.75	51,406,500.00
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	28.50	6,780,435.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	18.10	10,070,840.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	21.60	6,330,960.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	27.25	51,450,725.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	240.00	19,848,000.00
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	125.50	16,716,600.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	18.10	7,939,565.00
	SCB X PCL-NVDR	151,200	105.00	15,876,000.00
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.69	14,748,968.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	43.00	4,364,500.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	42.75	3,838,950.00
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	84.00	41,664,000.00
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	218.00	44,428,400.00
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	71.75	8,742,737.50
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	5.45	10,985,118.10
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	39.50	8,686,050.00
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	49.25	3,358,850.00



	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	45.25	31,408,025.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	64.50	24,406,800.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	7.60	6,627,200.00	
	タイパーツ 小計	29,576,840		680,256,906.60 (2,843,473,869)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	48.80	11,611,472.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	675.00	36,726,750.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	38.00	22,272,674.00	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	870.00	31,567,950.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	239.20	36,628,696.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	267.00	16,289,670.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	114.90	10,979,844.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	106.20	24,935,972.40	
	BDO UNIBANK INC	394,773	136.80	54,004,946.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	56.30	9,080,458.10	
	PLDT INC	10,460	1,270.00	13,284,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	377.00	20,048,860.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	32.35	41,437,115.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	32.75	50,872,212.50	
	フィリピンペソ 小計	4,913,210		379,740,820.40 (1,005,857,485)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,430.00	5,254,389,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	24,075.00	4,836,667,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	7,475.00	8,249,410,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,645.00	1,621,641,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	1,085.00	3,138,046,765.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	8,000.00	6,032,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,700.00	4,382,901,900.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	6,050.00	2,389,169,200.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	5,350.00	17,533,555,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	86.00	11,579,031,744.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,640.00	8,286,168,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	953,300	4,630.00	4,413,779,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAK MUR T	599,400	11,550.00	6,923,070,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	6,450.00	2,767,695,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,240.00	3,749,976,000.00		

	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,555.00	6,513,117,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	9,625.00	90,181,437,500.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	6,525.00	39,814,192,800.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	5,500.00	14,215,300,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,800.00	63,570,331,600.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	940.00	2,670,164,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	7,299,800	3,940.00	28,761,212,000.00	
	インドネシアルピア 小計	197,657,308		336,883,255,509.00 (3,200,390,927)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	66,500.00	344,470,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	66,500.00	424,735,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	113,600.00	1,140,998,400.00	
	ECOPRO CO LTD	3,133	556,000.00	1,741,948,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	32,600.00	595,797,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	31,600.00	353,572,400.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	458,000.00	551,432,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	89,800.00	483,932,200.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	111,100.00	210,867,800.00	
	LG CHEM LTD	8,087	404,500.00	3,271,191,500.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	269,000.00	235,913,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	119,100.00	275,835,600.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	414,500.00	4,884,882,500.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	75,000.00	175,350,000.00	
	SKC CO LTD	1,432	80,100.00	114,703,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	44,950.00	543,805,100.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	15,130.00	1,240,705,390.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	278,500.00	2,292,612,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	40,500.00	267,016,500.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	144,600.00	842,439,600.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	22,400.00	332,617,600.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	120,000.00	253,800,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	113,300.00	710,277,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	33,000.00	322,344,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	73,900.00	213,053,700.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	55,400.00	743,246,400.00	
	L&F CO LTD	4,327	192,800.00	834,245,600.00	

LG CORP	16,658	72,200.00	1,202,707,600.00	
LG ENERGY SOLUTION	7,369	383,500.00	2,826,011,500.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	278,500.00	1,325,103,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	50,200.00	434,079,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,910	117,700.00	1,401,807,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	30,300	24,050.00	728,715,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	7,520.00	715,670,880.00	
SK INC	6,394	153,800.00	983,397,200.00	
SK SQUARE CO LTD	11,660	49,050.00	571,923,000.00	
HMM CO LTD	35,545	19,220.00	683,174,900.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	167,900.00	468,944,700.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	23,000.00	616,906,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	18,150	47,800.00	867,570,000.00	
HANON SYSTEMS	19,000	6,080.00	115,520,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	199,600.00	2,025,540,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	181,700.00	4,260,501,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	110,000.00	664,620,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	108,000.00	372,492,000.00	
KIA CORP	45,204	87,600.00	3,959,870,400.00	
COWAY CO LTD	9,036	55,000.00	496,980,000.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	71,500.00	215,715,500.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	91,800.00	1,583,917,200.00	
KANGWON LAND INC	28,528	14,820.00	422,784,960.00	
HYBE CO LTD	4,975	220,000.00	1,094,500,000.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	4,193	84,100.00	352,631,300.00	
KAKAO CORP	52,020	57,600.00	2,996,352,000.00	
KRAFTON INC	3,793	193,500.00	733,945,500.00	
NAVER CORP	21,578	215,500.00	4,650,059,000.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	192,200.00	520,669,800.00	
NETMARBLE CORP	2,465	55,900.00	137,793,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	32,200.00	148,281,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	57,500.00	250,872,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	286,500.00	526,873,500.00	
KT&G CORP	19,456	85,100.00	1,655,705,600.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	92,000.00	289,064,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	131,500.00	494,703,000.00	

LG H&H CO LTD	1,321	322,500.00	426,022,500.00	
HLB INC	23,903	45,900.00	1,097,147,700.00	
CELLTRION INC	24,444	176,000.00	4,302,144,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,169	99,100.00	214,947,900.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,202	318,000.00	382,236,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	770,000.00	2,059,750,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	88,600.00	283,254,200.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	63,000.00	132,300,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,854	59,700.00	827,083,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	41,200.00	2,111,458,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	11,630.00	329,477,900.00	
KAKAOBANK CORP	35,459	28,400.00	1,007,035,600.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	49,500.00	3,197,650,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	36,800.00	2,494,230,400.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	12,620.00	1,436,332,680.00	
KAKAOPAY CORP	3,065	52,000.00	159,380,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	56,100.00	258,172,200.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	59,800.00	1,015,105,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	6,490.00	201,287,350.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,800.00	118,648,600.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	35,400.00	564,523,800.00	
DB INSURANCE CO LTD	10,074	75,900.00	764,616,600.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	231,500.00	1,422,336,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	60,800.00	737,564,800.00	
POSCO DX CO LTD	9,010	56,000.00	504,560,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	166,600.00	1,213,514,400.00	
COSMOAM&T CO LTD	3,978	138,600.00	551,350,800.00	
LG DISPLAY CO LTD	38,301	13,030.00	499,062,030.00	
LG INNOTEK CO LTD	2,696	217,000.00	585,032,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	147,500.00	1,361,867,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	771,665	74,700.00	57,643,375,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	133,027	60,300.00	8,021,528,100.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	374,000.00	3,299,802,000.00	
LG UPLUS CORP	22,125	9,710.00	214,833,750.00	
SK TELECOM	9,563	49,450.00	472,890,350.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	18,030.00	797,647,200.00	

	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	57,700.00	417,632,600.00	
	SK HYNIX INC	87,370	141,300.00	12,345,381,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,530,822		177,668,380,190.00 (19,738,957,039)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	72.20	17,200,928.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	39.40	17,894,534.40	
	CHINA STEEL	1,779,261	24.65	43,858,783.65	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	55.90	30,301,209.90	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	71.20	42,565,068.80	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	60.00	46,245,120.00	
	TAIWAN CEMENT	1,268,419	32.40	41,096,775.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	970.00	18,000,290.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	30.50	11,041,854.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,360.00	12,240,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	35.85	18,004,336.05	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	20.20	9,393,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	31.10	12,004,600.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	155.00	28,398,325.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	29.70	14,018,400.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	51.20	3,821,312.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	50.90	11,045,300.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	43.15	7,640,182.15	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	526.00	21,006,862.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	159.00	12,545,259.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	341.50	10,586,500.00	
	POU CHEN	273,780	30.30	8,295,534.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	622.00	33,625,320.00	
	MOMO.COM INC	6,600	448.00	2,956,800.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	265.00	23,464,160.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	71.50	55,512,242.50	
	PHARMAESSENTIA CORP	25,000	325.50	8,137,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	17.35	10,555,358.30	
	CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	27.90	86,217,612.30	
	E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,474,537	24.70	61,121,063.90	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,653,358	26.45	43,731,319.10		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	21.20	32,189,253.20		

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,720,087	37.90	65,191,297.30
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	18.95	33,947,863.80
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	17.10	34,211,132.10
TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	13.25	10,583,040.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,514,926	25.30	38,327,627.80
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	44.70	30,842,329.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	287,702	179.50	51,642,509.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,433,822	26.20	37,566,136.40
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	43.80	67,060,296.60
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	11.90	30,657,089.40
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	63.00	85,267,413.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.42	16,266,311.72
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	517.00	44,462,000.00
ACER INC	617,803	45.95	28,388,047.85
ADVANTECH CO LTD	76,261	334.50	25,509,304.50
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	455.00	57,826,860.00
AUO CORP	1,268,072	18.30	23,205,717.60
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	199.50	23,680,650.00
COMPAL ELECTRONICS	805,760	36.30	29,249,088.00
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	285.00	86,327,355.00
E INK HOLDINGS INC	144,000	187.00	26,928,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	270.50	20,287,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,056,248	100.50	206,652,924.00
INNOLUX CORP	1,320,576	16.45	21,723,475.20
INVENTEC CO LTD	455,511	51.90	23,641,020.90
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,495.00	37,524,800.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	110.00	38,879,720.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	184.50	18,450,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	221.50	4,651,500.00
PEGATRON CORP	340,474	82.60	28,123,152.40
QUANTA COMPUTER INC	408,270	240.00	97,984,800.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	70.10	14,167,210.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	169.50	35,764,500.00
WISTRON CORP	427,000	107.00	45,689,000.00
WIWYNN CORP	16,000	1,990.00	31,840,000.00
WPG HOLDINGS LTD	260,692	86.70	22,601,996.40

	YAGEO CORPORATION	64,588	564.00	36,427,632.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	102.00	14,068,044.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	119.00	69,533,485.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	79.60	17,193,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	97.30	23,857,960.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	3,735.00	44,820,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	131.00	67,375,265.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,540.00	30,480,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,675.00	21,775,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	582.00	24,444,000.00	
	MEDIATEK INC	241,804	920.00	222,459,680.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	69.30	17,948,700.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	515.00	49,463,175.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,055.00	8,440,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	27.25	15,696,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	458.00	39,362,352.00	
	SILERGY CORP	53,000	406.00	21,518,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,979,389	626.00	2,491,097,514.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,701,000	49.20	83,689,200.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	74.40	13,987,200.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	363,030	27.65	10,037,779.50	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	35.45	9,893,279.65	
	新台湾ドル 小計	56,347,050		5,623,404,338.47 (26,527,847,626)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	93,550	482.60	45,147,230.00	
	COAL INDIA LTD	295,479	398.95	117,881,347.05	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	469.15	27,879,238.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	148.05	88,391,179.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	241.85	130,540,472.30	
	PETRONET LNG LTD	83,779	246.45	20,647,334.55	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	494,885	2,713.20	1,342,721,982.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	540.70	39,759,293.10	
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,539.60	40,693,167.60	
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	3,140.35	211,040,941.05	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	35,338	575.45	20,335,252.10	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,082.00	97,527,126.00	

HINDALCO INDUSTRIES LTD	179,650	560.75	100,738,737.50
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	729.35	50,889,666.90
JSW STEEL LTD	99,332	808.20	80,280,122.40
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,381.75	43,276,254.75
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,676.95	78,059,862.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	27,611.50	38,297,150.50
SRF LTD	19,164	2,289.05	43,867,354.20
SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	4,064.90	40,697,778.80
TATA STEEL LTD	1,137,948	133.90	152,371,237.20
ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	9,996.80	198,456,473.60
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	552.70	38,496,107.70
VEDANTA LTD	107,173	264.80	28,379,410.40
ABB LTD INDIA	5,256	4,755.80	24,996,484.80
ADANI ENTERPRISES LTD	23,002	2,987.95	68,728,825.90
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	174.40	42,200,091.20
ASTRAL LTD	19,918	1,823.85	36,327,444.30
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	193.35	98,106,756.75
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	453.30	31,915,039.80
CUMMINS INDIA LTD	20,968	2,081.00	43,634,408.00
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,373.10	48,972,984.60
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	3,006.50	109,184,054.00
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	3,633.70	390,949,783.00
POLYCAB INDIA LTD	7,354	4,334.95	31,879,222.30
SIEMENS INDIA LTD	11,025	4,078.25	44,962,706.25
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	41.75	62,625,000.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	1,026.40	23,600,015.20
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,193.30	124,797,700.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	873.15	23,099,183.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	3,043.60	80,506,263.60
BAJAJ AUTO LTD	9,644	7,114.00	68,607,416.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,763.20	24,401,819.20
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,223.95	37,112,611.90
EICHER MOTORS LTD	26,253	3,698.40	97,094,095.20
HERO MOTOCORP LTD	13,719	4,402.75	60,401,327.25
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,623.80	243,751,865.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,974.10	212,737,578.90



MRF LTD	432	145,311.50	62,774,568.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	107.40	55,980,639.00
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	587.10	34,808,571.90
TATA MOTORS LTD	277,381	819.00	227,175,039.00
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	541.65	40,623,750.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	4,059.00	85,855,968.00
TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,012.05	83,005,110.70
PAGE INDUSTRIES LTD	886	37,446.00	33,177,156.00
TITAN CO LTD	56,531	3,784.95	213,967,008.45
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	479.15	78,818,737.55
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	522.70	22,962,211.00
ZOMATO LTD	842,242	133.10	112,102,410.20
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	5,026.20	72,156,127.20
TRENT LTD	37,950	3,192.50	121,155,375.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,674.05	105,048,437.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	15,095	5,163.15	77,937,749.25
ITC LTD	480,447	468.20	224,945,285.40
MARICO LTD	81,711	524.15	42,828,820.65
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,480.30	127,636,238.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,150.50	107,271,469.50
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,108.65	64,944,717.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,259.10	101,178,757.80
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,534.15	65,887,900.00
DABUR INDIA LTD	79,726	538.35	42,920,492.10
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,124.70	71,301,481.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,469.30	319,779,288.60
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,125.25	89,195,890.50
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	749.15	90,041,087.65
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,144.60	40,536,009.00
CIPLA LTD	88,546	1,312.60	116,225,479.60
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,651.65	80,087,987.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	5,632.90	103,200,360.90
LUPIN LTD	26,552	1,410.05	37,439,647.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	1,325.85	192,455,082.60
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	2,531.55	30,935,541.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	747.30	22,519,138.20

AXIS BANK LTD	359,795	1,120.75	403,240,246.25
BANDHAN BANK LTD	74,811	229.45	17,165,383.95
BANK OF BARODA	248,313	232.20	57,658,278.60
HDFC BANK LTD	461,405	1,478.65	682,256,503.25
ICICI BANK LTD	847,011	1,008.30	854,041,191.30
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	87.67	46,555,224.76
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,534.05	74,194,328.25
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,806.45	336,622,925.25
STATE BANK OF INDIA	268,868	631.50	169,790,142.00
YES BANK LTD	2,352,478	25.24	59,376,544.72
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	7,301.35	322,515,232.20
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,579.70	86,883,500.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	8,263.55	24,749,332.25
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,261.35	105,950,877.30
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	3,402.85	48,228,593.05
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	246.45	116,122,803.90
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,410.25	17,519,535.75
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	37,520	784.20	29,423,184.00
POWER FINANCE CORPORATION	205,755	418.85	86,180,481.75
REC LTD	186,584	460.00	85,828,640.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	744.85	45,208,670.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	2,301.10	125,858,664.50
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	140,130	608.00	85,199,040.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,474.50	49,588,909.50
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	491.45	22,270,548.20
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,442.65	104,932,590.40
HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,543.60	252,106,926.40
INFOSYS LTD	532,498	1,648.75	877,956,077.50
LTIMINDTREE LTD	15,699	5,648.70	88,678,941.30
MPHASIS LTD	19,317	2,586.70	49,967,283.90
PERSISTENT SYSTEMS LTD	7,991	7,924.25	63,322,681.75
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	3,860.60	588,197,155.40
TATA ELXSI LTD	4,179	8,286.05	34,627,402.95
TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,385.45	131,336,503.65
WIPRO LTD	182,000	478.10	87,014,200.00
BHARTI AIRTEL LTD	358,975	1,123.00	403,128,925.00

	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,739.70	34,487,812.80	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	1,676.85	71,400,273.00	
	ADANI POWER LTD	167,705	536.85	90,032,429.25	
	GAIL INDIA LTD	504,548	166.45	83,982,014.60	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	443.45	11,850,757.80	
	NTPC LTD	664,141	308.10	204,621,842.10	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	237.25	190,032,505.00	
	TATA POWER CO LTD	199,512	345.90	69,011,200.80	
	DLF LTD	87,983	775.90	68,266,009.70	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	2,307.70	68,681,767.40	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,128.45	47,329,449.90	
	インドルピー 小計	22,070,264		16,079,240,463.88 (28,781,840,430)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	15.88	951,434.32	
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	469,730	3.62	1,701,362.06	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.68	747,569.70	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	11.91	3,369,565.29	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.57	2,959,847.87	
	DUKHAN BANK	319,751	3.96	1,269,091.71	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.54	2,910,335.14	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.82	2,321,247.06	
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	19.59	5,084,878.35	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.09	11,927,549.18	
	OOEDOO QSC	72,800	10.60	771,680.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.40	1,679,308.80	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.86	594,666.34	
	カタールリアル 小計	4,842,933		36,288,535.82 (1,478,032,063)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	192.09	6,572,743.53	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	816.27	8,155,353.57	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	309.54	20,876,306.22	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	240.59	34,693,078.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	107.00	10,685,127.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	72.40	10,921,322.80	
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	539.16	9,531,809.64	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	131.40	6,316,266.60	

	SASOL LTD	88,115	161.33	14,215,592.95
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	21.03	8,305,251.72
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	238.90	12,017,386.70
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	2,925.59	89,496,723.69
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	17.77	8,451,021.06
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	67.35	11,874,882.60
	BID CORP LTD	58,066	449.22	26,084,408.52
	CLICKS GROUP LTD	35,422	305.64	10,826,380.08
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	264.44	22,536,634.56
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	205.59	11,550,457.38
	ABSA GROUP LTD	140,135	157.00	22,001,195.00
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,084.23	30,429,758.00
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	214.09	13,511,433.99
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	197.36	40,186,245.84
	FIRSTRAND LTD	816,636	67.89	55,441,418.04
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	469.88	8,075,827.56
	REMGRO LTD	74,679	156.51	11,688,010.29
	DISCOVERY LIMITED	98,779	133.28	13,165,265.12
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.10	11,793,337.60
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	41.94	9,976,016.16
	SANLAM LTD	307,490	71.08	21,856,389.20
	MTN GROUP LTD	255,377	105.70	26,993,348.90
	VODACOM GROUP	79,334	107.94	8,563,311.96
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	67,336	122.80	8,268,860.80
	南アフリカランド 小計	5,373,831		605,061,165.08 (4,713,426,475)
アラブ首長国連 邦ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.14	1,631,688.44
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.31	1,428,086.26
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.57	1,585,158.54
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	9.05	4,266,441.50
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.92	2,028,728.52
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.80	3,045,835.20
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	17.45	4,716,037.00
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	15.20	11,005,088.80
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	19.96	11,148,378.56
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.06	3,672,704.86

	EMAAR PROPERTIES PJSC	1, 108, 668	7. 60	8, 425, 876. 80
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	5, 964, 783		52, 954, 024. 48 (2, 139, 872, 129)
クウェートディナール	AGILITY	323, 386	0. 54	176, 245. 37
	BOUBYAN BANK K. S. C	162, 047	0. 63	102, 089. 61
	GULF BANK	155, 178	0. 28	43, 915. 37
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1, 292, 981	0. 77	1, 002, 060. 27
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1, 204, 993	0. 97	1, 170, 048. 20
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296, 830	0. 52	154, 945. 26
	MABANEE CO KPSC	141, 825	0. 79	112, 325. 40
	クウェートディナール 小計	3, 577, 240		2, 761, 629. 48 (1, 332, 265, 293)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146, 700	6. 43	943, 281. 00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89, 000	33. 25	2, 959, 250. 00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64, 000	13. 29	850, 560. 00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89, 500	7. 20	644, 400. 00
	PETROCHINA CO LTD-A	100, 000	7. 14	714, 000. 00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96, 200	22. 72	2, 185, 664. 00
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237, 792	9. 48	2, 254, 268. 16
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79, 600	9. 95	792, 020. 00
	SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	9, 900	21. 77	215, 523. 00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31, 050	20. 98	651, 429. 00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28, 000	28. 05	785, 400. 00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164, 300	5. 26	864, 218. 00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29, 440	22. 28	655, 923. 20
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369, 500	5. 77	2, 132, 015. 00
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20, 930	24. 57	514, 250. 10
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20, 600	23. 41	482, 246. 00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92, 200	9. 00	829, 800. 00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20, 800	17. 61	366, 288. 00
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10, 300	48. 43	498, 829. 00
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11, 200	41. 52	465, 024. 00
	GEM CO LTD-A	289, 800	5. 04	1, 460, 592. 00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24, 826	23. 54	584, 404. 04
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37, 100	12. 24	454, 104. 00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147, 500	6. 57	969, 075. 00	

HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.06	1,714,126.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	50.05	1,121,120.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.41	650,010.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.57	214,200.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	9.82	218,986.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	57.01	578,081.40
LB GROUP CO LTD-A	15,300	15.81	241,893.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	11.97	563,787.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	14.10	1,116,720.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.00	58,500.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	15.06	716,856.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	9.45	457,852.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	13.83	767,219.25
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	20.91	151,639.32
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	25.06	449,576.40
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	2.85	816,810.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	19.52	317,004.80
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	5.87	643,809.86
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.58	491,892.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	8.88	437,784.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	43.74	472,392.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	54.34	52,166.40
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	14.72	734,528.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	9,940	41.75	414,995.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	57.45	654,930.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	13.02	127,596.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.08	1,021,328.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	70.20	2,829,060.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	23.80	351,097.60
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	38.93	641,761.05
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	54.70	99,554.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	50.80	208,280.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	26.11	976,514.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	29.17	216,149.70
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	15.43	1,996,642.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	11.92	3,207,672.00

AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	32.10	365,940.00	
AVICOPTER PLC-A	15,500	35.11	544,205.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	26.83	225,372.00	
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	11.57	740,480.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	28.68	1,583,566.20	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.05	1,236,355.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	6.03	1,387,503.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	4.67	2,626,408.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	154.90	6,161,922.00	
CRRC CORP LTD-A	185,800	5.27	979,166.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	14.19	613,008.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	40.27	1,589,577.71	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	4.74	108,072.00	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	71.51	171,624.00	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	7.37	148,218.07	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	126.00	475,020.00	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	20.52	119,016.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	25.17	662,474.40	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	54.72	626,872.32	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	12.01	493,611.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	12.63	607,503.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.00	992,700.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	10.91	394,942.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	21.02	1,765,259.60	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	83.59	496,524.60	
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	37.59	471,153.06	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	34.51	402,904.25	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	12.23	494,092.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	4.61	752,352.00	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	105.84	291,271.68	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	13.04	546,376.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	3.98	1,937,066.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	53.74	1,525,839.82	
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	7.29	182,687.40	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	88.99	889,900.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	13.47	548,229.00	

TBEA CO LTD-A	29,274	14.30	418,618.20	
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	14.30	617,760.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	5.49	1,094,706.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	20.63	651,908.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	53.80	444,388.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	24.11	176,003.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	6.47	583,594.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.09	567,909.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	33.78	371,580.00	
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.28	1,644,552.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	4.85	1,925,935.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.79	151,600.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	9.55	1,752,425.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.31	1,173,255.00	
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	38.35	2,036,385.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	33.44	177,867.36	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.29	234,876.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	12.02	669,514.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	6.72	146,764.80	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	57.82	624,456.00	
BYD CO LTD -A	17,000	189.34	3,218,780.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	136.69	1,230,210.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	14.38	623,401.76	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	39.01	721,685.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	16.61	569,723.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	101.70	854,280.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.41	480,813.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	58.18	40,726.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	13.41	571,266.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	20.41	801,174.14	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	38.24	107,072.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	33.55	1,459,425.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	20.77	576,575.20	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	34.53	273,891.96	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	64.80	498,960.00	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	21.66	2,189,826.00	



ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	51.95	415,600.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	28.72	752,464.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	10.15	339,822.00	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	18.88	462,560.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.07	432,552.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	5.77	804,338.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	208.77	605,433.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	22.25	362,675.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	10.74	244,872.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	5.06	311,190.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	84.01	1,740,687.20	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	6.24	689,520.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	24.89	554,822.99	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	39.37	558,896.52	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	33.66	360,162.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	214.14	342,624.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	41.83	92,026.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	58.92	1,078,236.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	96.24	288,720.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	5.16	307,020.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	61.10	482,690.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	35.00	1,891,995.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	15.64	428,536.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	41.29	701,930.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	27.12	2,131,089.60	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	26.87	921,694.74	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	43.66	755,318.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	96.62	879,242.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	68.63	384,328.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	26.05	299,575.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	23.68	165,760.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,635.00	21,255,000.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	157.80	2,903,520.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	36.73	1,232,585.34	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	8.61	230,748.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	23.44	1,176,688.00	

SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	205.48	1,927,402.40
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	51.40	585,960.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	19.06	727,329.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	128.89	5,348,935.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	30.33	306,333.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	13.23	70,119.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	15.99	474,903.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	14.21	1,303,753.29
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	27.51	440,160.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	54.55	154,812.90
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	34.46	334,951.20
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	21,694	6.98	151,424.12
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	13.76	203,648.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	4.91	121,964.40
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	19.79	142,666.11
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	276.61	4,121,489.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	68.89	137,780.00
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	18,780	100.46	1,886,638.80
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	83,180	27.76	2,309,076.80
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	50.76	1,441,584.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	67.21	704,831.27
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	43.70	703,570.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	41.82	230,010.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	67.39	611,025.13
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	123.82	272,404.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	51.11	521,322.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	49.48	734,778.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	50.72	1,125,628.96
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	48.90	391,200.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	19.04	358,904.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	319.64	664,851.20
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	39,102	41.41	1,619,213.82
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	14.39	398,343.98
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	33.48	638,731.44
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	6.90	442,290.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	24.02	261,337.60

SHEZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	28.95	202,650.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	9,440	22.44	211,833.60
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	25.30	284,169.60
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	19.69	334,730.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	16,464	74.89	1,232,988.96
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	48.22	479,306.80
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	221.30	863,070.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	12.92	116,538.40
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	20.62	1,371,230.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	16.52	575,688.96
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.68	3,798,128.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.82	279,560.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	12.02	1,891,948.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	5.77	2,953,663.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	10.45	1,177,715.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.10	1,631,154.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	7.88	1,162,300.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	19.79	1,153,757.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.23	283,465.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.48	809,352.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.00	2,505,900.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	29.73	5,529,780.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.77	1,031,472.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.61	1,047,079.80
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.80	692,520.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	4.89	2,829,354.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	15.15	3,113,325.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	9.17	1,094,898.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.40	622,600.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	6.59	2,881,807.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.93	358,925.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	9.55	758,270.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.18	411,629.40
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.00	99,500.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	7.37	344,179.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.03	373,439.80

CITIC SECURITIES CO-A	141,080	19.47	2,746,827.60
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	21.30	513,330.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	12.70	1,491,322.90
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	14.46	52,056.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.42	326,284.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	13.70	830,220.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	5.67	973,419.93
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	7.93	1,785,043.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.37	1,038,951.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.40	973,120.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	123.11	664,794.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.65	429,975.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.46	623,914.20
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	8.30	336,780.80
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.17	864,024.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.88	2,116,288.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.79	432,060.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	9.72	424,764.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.51	2,049,348.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	22.16	2,220,432.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	39.20	4,108,160.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.61	204,709.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	4,100	24.16	99,056.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	237.72	1,146,523.56
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	34,398	8.26	284,127.48
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	27.75	895,381.50
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	5.44	303,008.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	24.16	400,137.92
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	39.35	424,980.00
NAVINFO CO LTD-A	33,200	7.79	258,628.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	63.19	189,570.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	43.63	415,837.53
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	60.25	331,375.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	13.16	173,317.20
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	19.32	732,228.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	3.65	2,243,290.00

CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	18.01	362,001.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	25.19	705,320.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	8.93	310,764.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	48.49	441,259.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	14.20	2,344,420.00	
GOERTEK INC -A	26,900	18.06	485,814.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.36	268,000.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	39.41	275,870.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	31.80	626,841.60	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.78	197,904.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	29.34	1,362,843.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	119.28	206,115.84	
NINESTAR CORP-A	18,543	19.94	369,747.42	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	16.68	405,324.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	59.35	282,506.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	133.60	859,716.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	15.12	430,920.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.28	480,216.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.00	423,000.00	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	18,340	17.29	317,098.60	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	36.87	154,854.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	6.36	341,595.60	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	96.47	453,409.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	26.40	415,800.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	17.12	518,736.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	111.00	965,700.00	
ZTE CORP-A	76,400	23.80	1,818,320.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.04	1,708,112.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	7.89	1,371,282.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.25	1,025,525.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	23.50	4,227,180.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	17.62	979,672.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	4.07	1,284,899.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.94	2,289,086.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	14.55	1,342,965.00	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	141.52	1,004,367.44	

AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	51.07	517,747.66
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	131.68	1,504,048.96
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	40.34	848,430.88
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	75.28	472,156.16
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	25.59	541,689.12
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	20.90	156,750.00
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	7,434	31.40	233,427.60
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	69.83	2,871,758.75
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	54.35	407,625.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	20.85	713,111.70
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	26.14	778,972.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	9.15	210,321.90
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	22.10	2,217,514.00
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	55.13	1,160,762.15
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	250.70	777,170.00
SG MICRO CORP-A	4,095	70.12	287,141.40
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	67.48	533,092.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	169.08	473,424.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	120.20	492,339.20
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	16.07	592,581.25
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	7.38	241,695.00
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	22.02	494,701.32
TONGWEI CO LTD-A	66,600	26.08	1,736,928.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	28.28	718,821.04
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	58.18	399,056.62
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	90.76	661,640.40
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	36.47	517,874.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	39.34	669,645.48
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	8.43	461,121.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	9.41	505,317.00
GEMDALE CORP-A	45,500	4.07	185,185.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.54	1,850,712.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	8.87	725,566.00
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	10.27	131,456.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	2.89	229,177.00
オフショア人民元 小計	26,437,269		324,285,859.75

				(6,673,770,565)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	9.32	418,831.48
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	32.00	13,320,768.00
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	37.65	443,328.75
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	11.70	373,557.60
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	126.80	4,743,968.40
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	30.45	1,438,488.45
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	47.30	9,972,921.20
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	149.80	1,400,480.20
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	77.80	11,198,065.20
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	20.02	1,708,166.46
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	9.80	1,013,623.80
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	37.60	1,920,570.40
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	220.00	925,540.00
	JARIR MARKETING CO	125,000	15.06	1,882,500.00
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	143.00	919,633.00
	ALMARAI CO	30,130	61.60	1,856,008.00
	SAVOLA	36,289	45.25	1,642,077.25
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	166.00	1,134,278.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	283.80	3,325,284.60
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	118.00	1,879,032.00
	AL RAJHI BANK	307,532	85.30	26,232,479.60
	ALINMA BANK	161,322	42.85	6,912,647.70
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	24.90	2,142,171.90
	BANK AL-JAZIRA	97,894	18.84	1,844,322.96
	BANK ALBILAD	89,702	44.60	4,000,709.20
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	39.55	3,750,724.25
	RIYAD BANK	234,479	29.00	6,799,891.00
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	36.35	5,375,983.25
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	16.08	1,135,891.20
	THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	42.15	20,686,124.10
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	216.80	2,375,477.60
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	220.20	3,131,904.60
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,260	125.80	787,508.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	332.40	1,468,210.80	
ELM CO	4,094	909.00	3,721,446.00	

	ETIHAD ETISALAT CO	48,844	51.20	2,500,812.80	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	13.26	1,200,136.08	
	SAUDI TELECOM CO	339,167	41.50	14,075,430.50	
	ACWA POWER CO	16,922	248.00	4,196,656.00	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	63.10	1,014,711.10	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	18.44	2,989,289.96	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	13.28	1,341,160.48	
	サウジアラビアリアル 小計	4,025,738		179,200,811.87	(7,090,976,125)
	合 計	1,370,709,883		160,183,801,461	(160,183,801,461)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	メキシコペ ソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	15,198,869.60	
		メキシコペソ 小計	97,360	15,198,869.60	(131,869,952)
	ブラジルレ アル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	7,375,046.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,386,639.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,855,040.00	
KLABIN SA-UNIT	100,000	2,175,000.00			
	ブラジルリアル 小計	383,600	12,791,725.00	(384,468,086)	
投資信託受益証券合計			480,960	516,338,038	(516,338,038)
投資証券	メキシコペ ソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	11,367,134.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	123,500	9,268,675.00	
	メキシコペソ 小計	515,200	20,635,809.00	(179,042,469)	
投資証券合計			515,200	179,042,469	(179,042,469)
合 計				695,380,507	(695,380,507)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。



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 31 銘柄	100.0%	—	—	2.9%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	93.1%	—	—	2.6%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	2.9%	—	0.1%
	投資証券 2 銘柄	—	—	4.0%	0.1%
ブラジルレアル	株式 45 銘柄	95.8%	—	—	5.5%
	投資信託受 益証券 4 銘柄	—	4.2%	—	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%	—	—	0.7%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式 15 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ロシアルーブル	株式 14 銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式 182 銘柄	100.0%	—	—	18.4%
マレーシアリングgit	株式 31 銘柄	100.0%	—	—	1.4%
タイバーツ	株式 38 銘柄	100.0%	—	—	1.8%
フィリピンペソ	株式 14 銘柄	100.0%	—	—	0.6%
インドネシアルピア	株式 22 銘柄	100.0%	—	—	2.0%
韓国ウォン	株式 101 銘柄	100.0%	—	—	12.3%
新台湾ドル	株式 90 銘柄	100.0%	—	—	16.5%
インドルピー	株式 131 銘柄	100.0%	—	—	17.9%
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 32 銘柄	100.0%	—	—	2.9%
アラブ首長国連邦デ イルハム	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 347 銘柄	100.0%	—	—	4.1%
サウジアラビアリアル	株式 42 銘柄	100.0%	—	—	4.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 2 【ファンドの現況】

### 【世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

#### 【純資産額計算書】

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	917,284,251円
II 負債総額	6,052,165円
III 純資産総額（I－II）	911,232,086円
IV 発行済口数	540,834,749口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6849円
（1万口当たり純資産額）	（16,849円）

(参考)

### 国内債券インデックス マザーファンド

#### 純資産額計算書

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	680,942,115,416円
II 負債総額	17,970,586,232円
III 純資産総額（I－II）	662,971,529,184円
IV 発行済口数	496,006,659,360口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3366円
（1万口当たり純資産額）	（13,366円）

### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 純資産額計算書

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	667,702,845,364円
II 負債総額	307,907,027円
III 純資産総額（I－II）	667,394,938,337円
IV 発行済口数	242,704,090,305口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.7498円
（1万口当たり純資産額）	（27,498円）

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	323,952,119,139円
II 負債総額	2,053,500,865円
III 純資産総額 (I - II)	321,898,618,274円
IV 発行済口数	92,095,345,456口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	3.4953円
(1万口当たり純資産額)	(34,953円)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	701,297,289,195円
II 負債総額	603,572,763円
III 純資産総額 (I - II)	700,693,716,432円
IV 発行済口数	115,296,033,402口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	6.0773円
(1万口当たり純資産額)	(60,773円)

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	134,538,127,405円
II 負債総額	36,233,902円
III 純資産総額 (I - II)	134,501,893,503円
IV 発行済口数	59,715,931,757口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.2524円
(1万口当たり純資産額)	(22,524円)

純資産額計算書

(2024年2月29日現在)

I 資産総額	183,981,079,972円
II 負債総額	250,239,447円
III 純資産総額 (I - II)	183,730,840,525円
IV 発行済口数	43,912,239,425口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	4.1840円
(1万口当たり純資産額)	(41,840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2月29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、各取締役に對して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手續を経ずに取締役会を開催することができます。

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

###### ②投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま

す。

#### [DO (実行)]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [CHECK (検証・評価)]

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

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

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

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

委託会社の機構は 2024 年 4 月 22 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 2 月 29 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	536	14,901,081
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	64	218,348
単位型公社債投資信託	51	174,969
合計	651	15,294,398



### 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、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

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

### 7. 収益及び費用の計上基準

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

#### (1) 投資信託委託業務

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

#### (2) 投資一任業務

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

#### (3) 投資助言業務

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

#### (4) 成功報酬

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

### 8. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

##### ①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

##### ②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

### 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債  
前事業年度 (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				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
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おります。

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

#### (1) 投資信託委託業務

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

#### (2) 投資一任業務

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

#### (3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(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ズワップの時価は、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4月22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  
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）  
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 18 条にもとづき、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、主として、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」および「新興国株式インデックス マザーファンド」の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ①主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。
- ②株式（DR（預託証券）を含みます。）と債券の基本資産配分比率は、原則として株式 25%、債券 75%とします。ただし、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で配分比率を調整する場合があります。
- ③各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、地域別のGDP（Gross Domestic Product（国内総生産））を参考に決定するものとします。また、各マザーファンド受益証券の基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
- ④各マザーファンド受益証券の基本組入比率は原則として年 1 回見直しを行う場合があります。
- ⑤実質組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジを行いません。
- ⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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および通貨に係るオプション取引なら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、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- ⑦ただし、資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

#### (3) 運用制限

- ①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 35%以下とします。
- ②投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産

総額の5%以下とします。

③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。

#### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

#### (2) 分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を考慮して分配金額を決定します。ただし、基準価額が下落した場合や分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

#### (3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託  
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）  
投資信託約款

**（信託の種類、委託者および受託者）**

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号にもと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。以下この条、第17条第1項、第17条第2項および第29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第1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、金額および限度額）**

第3条 委託者は、金500,000円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

②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るものとし、追加信託を行ったときは、受託者はその引受を証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

**（信託期間）**

第4条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第48条第1項、第48条第2項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託終了の日または投資信託契約解約の日までとします。

**（受益権の取得申込みの勧誘の種類）**

第5条 この信託にかか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6条 この投資信託契約締結当初およ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7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。

**（受益権の分割および再分割）**

第7条 委託者は、第3条第1項による受益権については500,000口に、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8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、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところにしたがい、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、口数および基準価額の計算方法）**

第8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て得た金額とします。

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（受入担保金代用有価証券および第26条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令およ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。なお、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。

③第 28 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。

#### （信託日時の変化する受益権の内容）

第 9 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 10 条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けるとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。）およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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また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 7 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また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または記録を行います。

#### （受益権の設定に係る受託者の通知）

第 11 条 受託者は、投資信託契約締結日に生じた受益権については投資信託契約締結時に、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。

#### （受益権の申込単位および価額）

第 12 条 指定販売会社（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およ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 7 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、指定販売会社が委託者の承認を得て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、指定販売会社と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益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。なお、ニューヨークまたはロンドンの銀行もしくは取引所（金融商品取引法第 2 条第 16 項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第 2 条第 17 項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）の休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。



- ②第1項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第3項または第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または記録を行うことができます。
- ③第1項の受益権の価額は、この投資信託契約締結日以降は、原則として、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、第4項に規定する手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。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円に、第4項に規定する手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④第3項の手数料の額は、指定販売会社が別に定めるところによるものとします。
- ⑤第3項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約にもと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37条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥第1項から第5項の規定にかかわらず、取引所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、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およ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または記録）

第13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また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第1項の申請のある場合には、第1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およ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または記録するものとします。ただし、第1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また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また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またはやむをえ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14条 受益権の譲渡は、第13条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者およ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15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. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限りません。）
  - ハ. 金銭債権

ニ. 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)

第16条 委託者は、信託金を主として次に掲げる第1号から第6号までの三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券(以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。)ならびに第7号から第28号までの有価証券(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. 国内債券インデックス マザーファンド
2. 国内株式インデックス マザーファンド
3. 外国債券インデックス マザーファンド
4. 外国株式インデックス マザーファンド
5. 新興国債券インデックス マザーファンド
6. 新興国株式インデックス マザーファンド
7. 株券または新株引受権証券
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
12. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
13. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
14. 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
15. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
16. コマーシャル・ペーパー
17. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
18. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号から第17号の証券または証書の性質を有するもの
19. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
20. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
21. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
22. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
23. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

24. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

25. 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。）

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

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

28. 外国の者に対する権利で第27号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券または証書、第18号ならびに第23号の証券または証書のうち第7号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第8号から第12号までの証券および第18号ならびに第23号の証券または証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するもの、および第20号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第19号および第20号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

②委託者は、信託金を、第1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

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で第5号の権利の性質を有するもの

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は、委託者は、信託金を第2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。

④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の総額の100分の35を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑥第4項および第5項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### （利害関係人等との取引等）

第17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なら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。）および受託者の利害関係人、第29条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条ならびに第16条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第26条まで、第28条および第32条から第34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もと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、受託者また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なら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、執行役およ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項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）また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、第15条ならびに第16条第1項および第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条から第26条まで、第28条および第32条から第34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、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

④第1項から第3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### （運用の基本方針）

第18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したがって、その指図を行います。

#### （投資する株式等の範囲）

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

②第1項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### （信用取引の指図範囲）

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、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

②第1項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（第5号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### （先物取引等の運用指図、目的および範囲）

第 21 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）なら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を指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

②委託者は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。

③委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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を指図することができます。

#### （スワップ取引の運用指図、目的および範囲）

第 22 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④第 3 項においてマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

⑥委託者は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的および範囲）

第 23 条 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。

- ②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第4条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- ③金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ④第3項においてマザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ⑥第5項においてマザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑦金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ⑧委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- ⑨本条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」

といたします。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約にもとづく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

⑩本条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### (有価証券の貸付の指図および範囲)

第 24 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

②第 1 項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### (公社債の空売りの指図範囲)

第 25 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることを指図することができます。なお、当該売付の決済については、公社債(第 26 条の規定にもとづき投資信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまたは買戻しにより行うことを指図することができるものとします。

②第 1 項の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、第 2 項の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### (公社債の借入れ)

第 26 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第1項の指図は、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、第2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、委託者はすみやかに、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27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。

#### (外国為替予約の指図および範囲)

第28条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ②前項において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### (信託業務の委託等)

第29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すべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）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、第1項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が第1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第1項および第2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者およ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. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用また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およ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30条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第2条第9項に規定するものをいいます。本条においては、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含みます。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### (投資信託財産の登記等および記載等の留保等)

第31条 信託の登記または登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記または登録をす



- ることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ②第1項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記また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また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また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。

#### （一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第32条 委託者は、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る投資信託契約の一部解約の請求ならびに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33条 委託者は、第32条の規定によるマザーファンド受益証券の一部解約代金、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

#### （資金の借入れ）

第34条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用なら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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、また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。

- ①一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また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、解約代金およ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。
- ②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。
- ③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35条 委託者の指図にもとづく行為により投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### （受託者による資金の立替え）

第36条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、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、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およ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も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第1項および第2項の立替金の決済および利息については、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 37 条 この信託の計算期間は、毎年 1 月 21 日から翌年 1 月 20 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 25 年 11 月 8 日から平成 26 年 1 月 20 日までとします。

②第 1 項の規定にかかわらず、第 1 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 4 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 38 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、第 1 項および第 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 項に定める書類また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およ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 項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

#### (他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)

第 39 条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、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. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

#### (信託事務の諸費用)

第 40 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およ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投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、第 37 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一定率を乗じて得た額とし、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日及び毎計算期末または信託終了のとき投資信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬等の総額および支弁の方法)

第 41 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、次の各号により計算された額の合計額とします。

1. 第 37 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 45 の率を乗じて得た額
2. 第 24 条に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料（貸付有価証券の利子または配当金等相当額を含まないものとします。また、有価証券の貸付にあたって担保として金銭を受け入れた場合には、当該品貸料に、当該金銭の運用により生じたとみなし得る収益を加算し、貸付の相手方に支払う当該金銭に対する利息額を控除して得た額（ただし、この額が負の場合は、零とします。）とすることができます。以下同じ。）に 100 分の 50 未満の率を乗じて得た額
3. マザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図を行った場合は、マザーファンドの投資信託財産に属する品貸料のうち投資信託財産に属するとみなした額（投資信託財産に属するマザーフ

ファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める品貨料の割合を乗じて得た額とします。)に100分の50未満の率を乗じて得た額

②第1項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末また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、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

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42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. 投資信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券に係る品貨料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち投資信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用(消費税等を含みます。)、信託報酬およ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、次期以降の分配金にあてるため、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て得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用(消費税等を含みます。)、信託報酬およ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第1項第1号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③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、償還金および一部解約金の支払い)

第43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また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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に支払います。

②第1項の規定にかかわらず、別に定める契約にもと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、収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は、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10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

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また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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に支払います。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または記録が行われ  
ます。

- ④一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として 6 営業日目から受益者に支払  
います。
- ⑤第 1 項、第 3 項および第 4 項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売  
会社の営業所等において行うものとします。
- ⑥収益分配金、償還金およ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ます。
- ⑦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、第 6 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。

#### (収益分配金、償還金およ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 44 条 受託者は、収益分配金については、第 43 条第 1 項に規定する支払開始日および第 43 条第 2 項に規  
定する交付開始前までに、償還金については第 43 条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金  
については第 43 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、第 1 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、償還金および一部解約金  
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。

#### (収益分配金および償還金の時効)

第 45 条 受益者が、収益分配金については第 43 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、ならびに信託終了による償還金については第 43 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 46 条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に 1 口単位または指定販売会社が委託者の承認を  
得て定める解約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。ただし、ニューヨークまた  
はロンドンの銀行もしくは取引所の休業日においては、当該請求には応じないものとします。

- ②投資信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、指定販売会社に対し、  
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または記録が行われます。
- ④第 3 項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額  
に 0.1%の率を乗じて得た信託財産留保額を控除した価額とします。
- ⑤委託者は、取引所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、およ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。
- ⑥第 5 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項の規定に準じて算出した価額とします。

#### (質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第47条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部解約金およ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したがって取り扱われます。

#### (投資信託契約の解約)

第48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、また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5億口を下回るようになった場合には、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、第1項および第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、書面決議の日なら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第3項の書面決議において、受益者（委託者およ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以上に当たる多数をもって行います。

⑥第3項から第5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すべ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項から第5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49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、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、第53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50条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまた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第1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53条第2項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および承継に伴う取扱い)

第51条 委託者は、事業の全部また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

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また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。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 52 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、委託者または受益者は、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、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 53 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 53 条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまた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また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、変更または併合しようとする旨およ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、第 1 項の事項（第 1 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、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③第 2 項の書面決議において、受益者（委託者およ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。

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、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第 2 項から第 5 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すべ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第 1 項から第 6 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であっても、当該併合にかか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。

#### (反対者の買取請求権)

第 54 条 (削除)

#### (運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 54 条の 2 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 55 条 委託者が受益者に対して行う公告は、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 56 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、委託者と受託者の協議により定めます。

上記条項により投資信託契約を締結します。

平成 25 年 11 月 8 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