

SMT 世界経済インデックス・オープン  
(株式シフト型)  
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3月13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。

SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）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 3 月 12 日に関東財務局長に提出しており、2024 年 3 月 13 日にその届出の効力が生じております。

発行者名	:	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
代表者の役職・氏名	:	代表取締役社長 菱田 賀夫
本店の所在の場所	:	東京都港区芝公園一丁目 1 番 1 号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	:	該当事項はありません。

## 目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	2
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
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】	14
3【投資リスク】	28
4【手数料等及び税金】	31
5【運用状況】	35
第2【管理及び運営】	59
1【申込(販売)手続等】	59
2【換金(解約)手続等】	60
3【資産管理等の概要】	62
4【受益者の権利等】	66
第3【ファンドの経理状況】	67
1【財務諸表】	70
2【ファンドの現況】	333
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	336
第三部【委託会社等の情報】	337
第1【委託会社等の概況】	337
1【委託会社等の概況】	337
2【事業の内容及び営業の概況】	338
3【委託会社等の経理状況】	339
4【利害関係人との取引制限】	373
5【その他】	373
約款	

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（※）とします。

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

### (5)【申込手数料】

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

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

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

### (6)【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2024年3月13日から2024年9月10日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

<申込みコース>

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

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

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

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

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### <ファンドの目的>

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

###### **?** DR(預託証券)とは

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

###### <信託金限度額>

上限 5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

###### <基本的性格>

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

###### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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



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

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

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

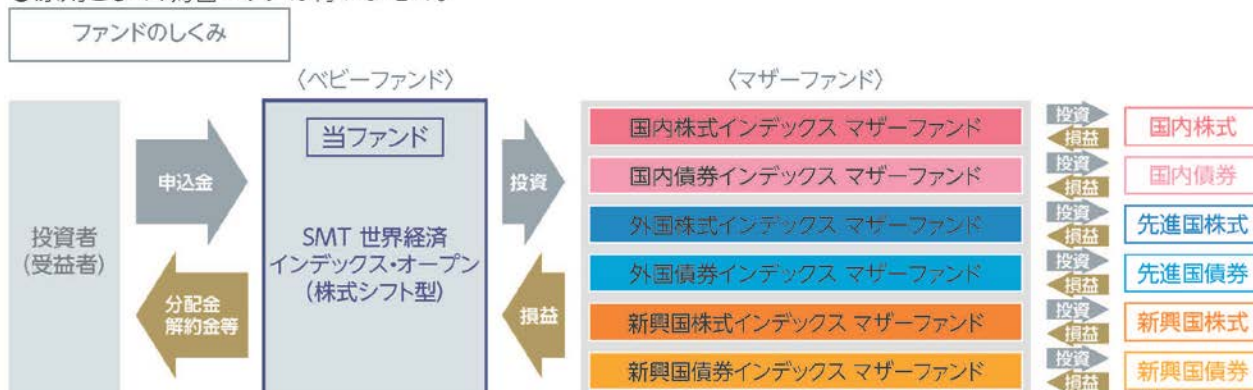
[特殊型]

- (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。

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

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



### ? ファミリーファンド方式とは

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

## 特色2 世界経済全体の発展を享受します。

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

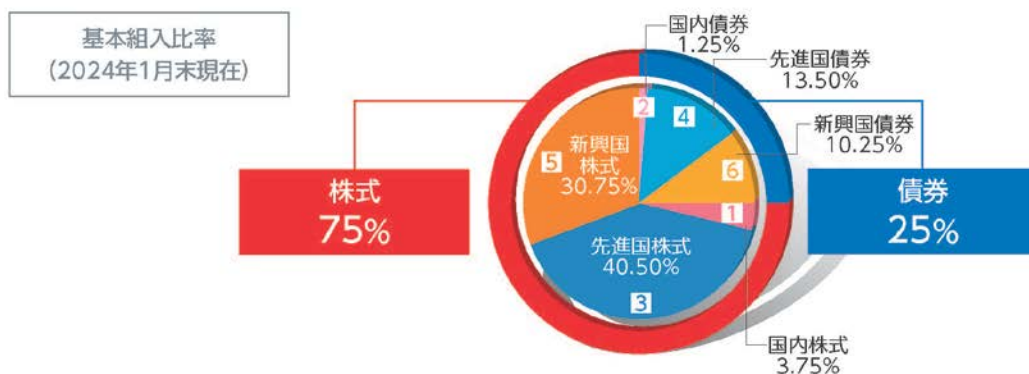


(出所) IMF[世界経済見通し2023年10月]のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※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%と異なる場合があります。

※上記のファンドの地域別構成比は、2024年1月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。



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

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

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

- ※1 「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX(東証株価指数)(配当込み)(以下、「配当込みTOPIX」という。)の指数値及び配当込みTOPIXに係る商標又は商標は、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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る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、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※2 「NOMURA-BPI総合」とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※3 「MSCIコクサイ・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※4 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。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。
- ※5 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
- ※6 「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド」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。

## ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本組入比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※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。

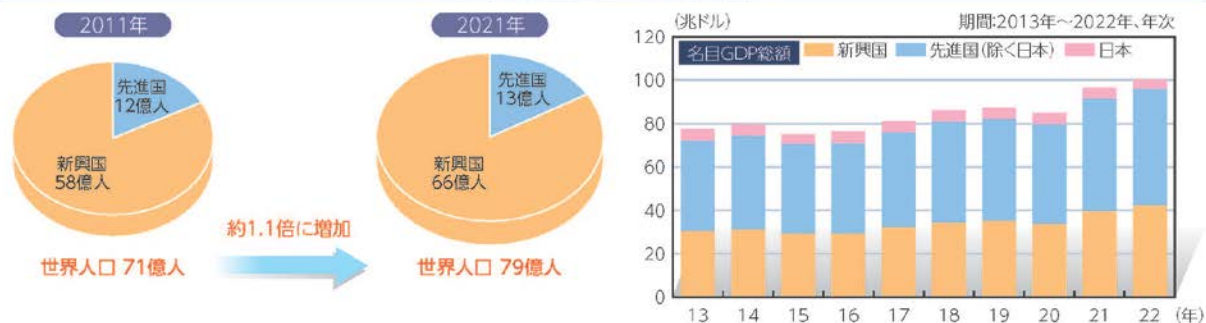
### 主な投資制限

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

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

### 〈ご参考情報〉

#### 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。

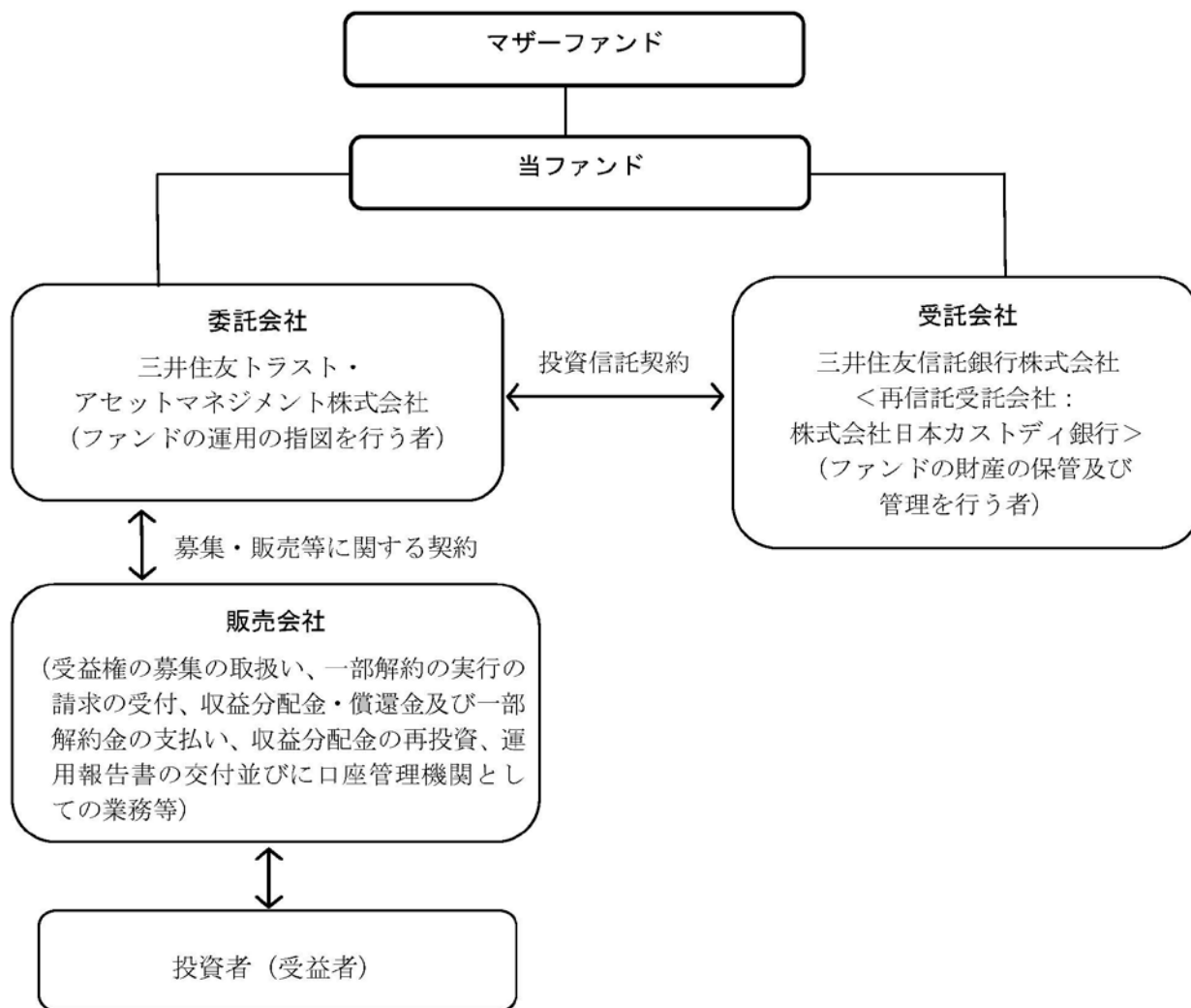
### (2) 【ファンドの沿革】

2017年 8月 25日

当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2023年12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、「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国債券インデックス マザーファンド」（以下総称して「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」ということがあります。）への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。

#### ②投資対象

各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

#### ③投資態度

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

ロ. 株式と債券の基本資産配分比率は、株式 75%、債券 25%とします。

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

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

ホ. 各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド	インデックス
国内株式インデックス マザーファンド	TOPIX（東証株価指数）（配当込み）
国内債券インデックス マザーファンド	NOMURA-BPI 総合
外国株式インデックス マザーファンド	MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）
外国債券インデックス マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国株式インデックス マザーファンド	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
新興国債券インデックス マザーファンド	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・デイバーシファイド（円換算ベース）

ヘ. 実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

## (2)【投資対象】

### ①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限りません。）
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、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国債券インデックス マザーファンド」の受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第 1 号の証券又は証書、第 12 号並びに第 17 号の証券又は証書のうち第 1 号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 2 号から第 6 号までの証券及び第 12 号並びに第 17 号の証券又は証書のうち第 2 号から第 6 号までの証券の性質を有するもの、及び第 14 号に記載する証券のうち投資法人債券及び外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、第 13 号及び第 14 号の証券（「投資法人債券」及び「外国投資証券で投資法人債券に類する証券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

### ③金融商品の指図範囲

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

(参考) マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

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

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、T O P I X (東証株価指数) (配当込み) の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ④ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 10% 以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑤同一銘柄の転換社債並びに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10% 以下とします。
- ⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5% 以下とします。
- ⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5% 以下とします。
- ⑧前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20% 以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

### 3. 運用制限

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

②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

## 「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

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

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

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

⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 運用制限

①株式への投資割合には制限を設けません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ①FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- ⑥投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 運用制限

- ①同一銘柄の転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委

託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## 「新興国株式インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

#### (2) 投資態度

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

### 3. 運用制限

- ①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。



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

## 「新興国債券インデックス マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・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

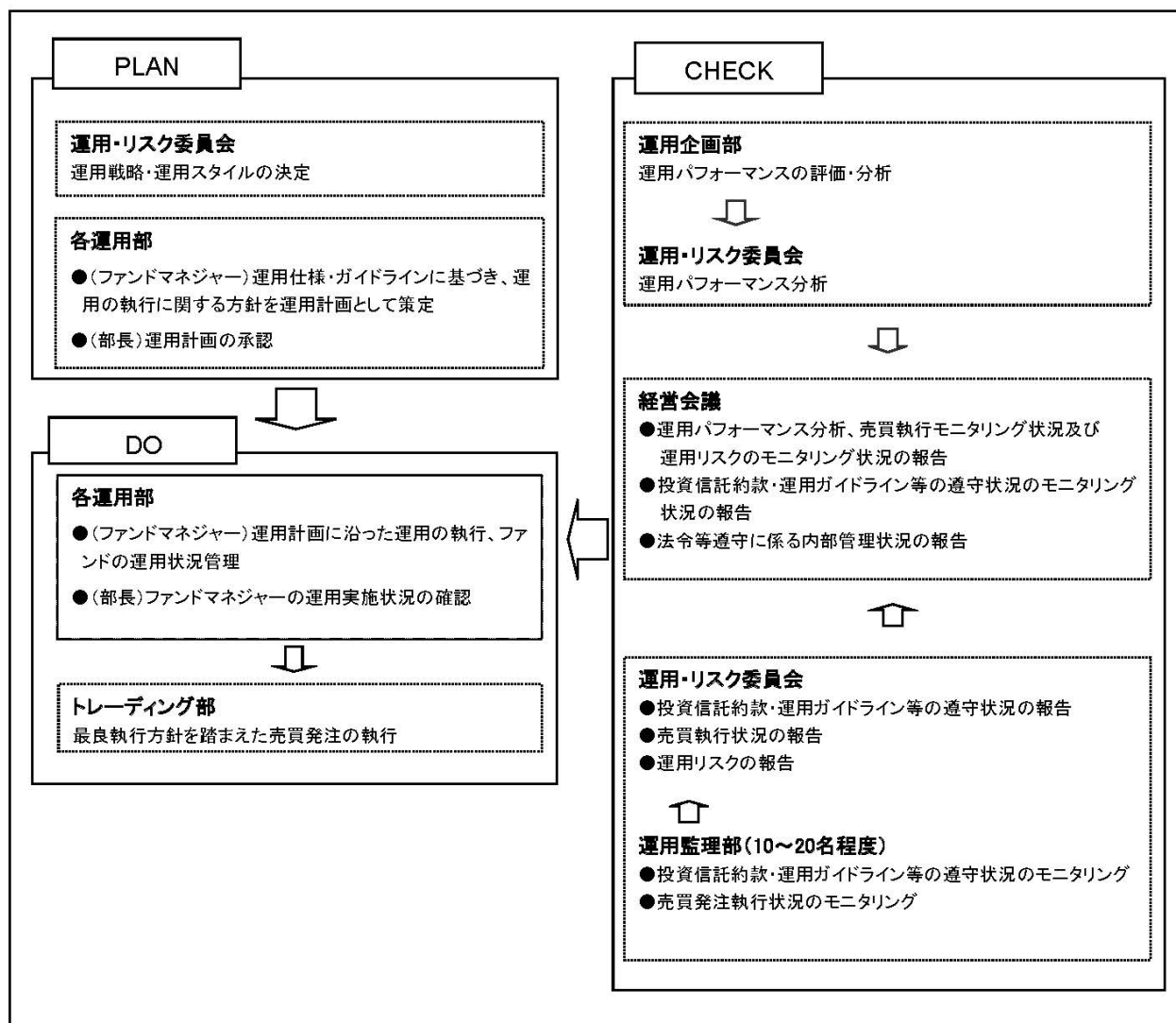
- ①主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、新興国の現地通貨建て国際機関債及び新興国の現地通貨建て債券の騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することもあります。
- ②組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ③投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、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。

### (3) 【運用体制】

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



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

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

### (4) 【分配方針】

- ・年 1 回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とし

ます。

- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## (5) 【投資制限】

### <約款に定める投資制限>

#### イ. 株式等への投資割合

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

#### ロ. 投資信託証券への投資割合

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

#### ハ. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### ニ. 投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記（イ）の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### ホ. 信用取引の指図範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記（イ）の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証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新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
  6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### へ. 先物取引等の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）
- (ロ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。
- (ハ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託会社が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### ト. スワップ取引の運用指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### リ. 有価証券の貸付の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式及び公社債を次の a. 及び b. の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有

する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- (ロ) 上記(イ) a. 及び b. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ヌ. 公社債の空売りの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産において有しない公社債又は下記ル. の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。
- (ロ) 上記(イ) の売付の指図は、当該売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ) の売付に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### ル. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ) 上記(イ) の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ) の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ) の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### ヲ. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ワ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

- (イ) 委託会社は、投資信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの投資信託財産に係る外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ) において投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### カ. 資金の借入れ

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

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

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

タ. デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）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、投資者の皆様様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様様に帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### ① 株価変動リスク

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

##### ② 為替変動リスク

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

##### 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。

※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性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

## (2) リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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



## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## 各資産クラスの指数について

<b>日本株</b> TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、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・サービスに関し一切責任を負いません。
<b>先進国債</b> FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
<b>新興国債</b> 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・デリバティブ・ファンド(円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

##### (2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

- ①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.605%（税抜 0.55%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.242% (税抜 0.22%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.308% (税抜 0.28%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

- 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）」及び「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### ②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

### ③個別元本について

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

ロ. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつ

ど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

- ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

#### ④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

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

#### (参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.69%	0.60%	0.09%

※対象期間は2022年6月11日～2023年6月12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、2023年12月29日現在の状況について記載してあります。

### 【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

#### (1)【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	13,477,040,946	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	168,992,566	1.24
合計(純資産総額)		13,646,033,512	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### (2)【投資資産】

#### ①【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,035,880,845	4.8593	5,033,704,615	5.4634	5,659,431,408	41.47
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	1,035,730,865	3.7639	3,898,466,955	3.9494	4,090,515,478	29.98
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	494,953,764	3.1946	1,581,214,611	3.3905	1,678,140,736	12.30
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	635,475,751	2.0323	1,291,489,137	2.1639	1,375,105,977	10.08
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	218,467,917	2.2819	498,526,317	2.4310	531,095,506	3.89
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	106,364,534	1.3629	144,974,098	1.3421	142,751,841	1.05

(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	98.76
合計	98.76

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

#### ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### ③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 1 期計算期間末 (2018 年 6 月 11 日)	1,504,217,648	1,504,217,648	10,637	10,637
第 2 期計算期間末 (2019 年 6 月 10 日)	1,826,908,363	1,826,908,363	10,374	10,374
第 3 期計算期間末 (2020 年 6 月 10 日)	2,626,130,073	2,626,130,073	10,932	10,932
第 4 期計算期間末 (2021 年 6 月 10 日)	4,732,160,740	4,732,160,740	14,107	14,107
第 5 期計算期間末 (2022 年 6 月 10 日)	7,741,315,348	7,741,315,348	14,763	14,763
第 6 期計算期間末 (2023 年 6 月 12 日)	11,066,909,445	11,066,909,445	15,698	15,698
2022 年 12 月末日	8,688,531,834	—	13,904	—
2023 年 1 月末日	9,279,508,077	—	14,495	—
2 月末日	9,495,401,050	—	14,607	—
3 月末日	9,846,714,543	—	14,637	—
4 月末日	10,134,364,528	—	14,799	—
5 月末日	10,746,715,802	—	15,378	—
6 月末日	11,784,108,436	—	16,372	—
7 月末日	12,182,433,451	—	16,591	—
8 月末日	12,530,583,513	—	16,710	—
9 月末日	12,530,123,854	—	16,363	—
10 月末日	12,496,612,017	—	15,983	—
11 月末日	13,366,504,402	—	16,912	—
12 月末日	13,646,033,512	—	17,035	—

② 【分配の推移】

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

③ 【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第 1 期計算期間	2017 年 8 月 25 日～2018 年 6 月 11 日	6.4
第 2 期計算期間	2018 年 6 月 12 日～2019 年 6 月 10 日	△2.5

第3期計算期間	2019年6月11日～2020年6月10日	5.4
第4期計算期間	2020年6月11日～2021年6月10日	29.0
第5期計算期間	2021年6月11日～2022年6月10日	4.7
第6期計算期間	2022年6月11日～2023年6月12日	6.3
第7期中間計算期間	2023年6月13日～2023年12月12日	7.1

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第1期計算期間	2017年8月25日～2018年6月11日	1,988,223,866	574,034,195	1,414,189,671
第2期計算期間	2018年6月12日～2019年6月10日	972,552,858	625,653,753	1,761,088,776
第3期計算期間	2019年6月11日～2020年6月10日	1,216,187,702	575,000,129	2,402,276,349
第4期計算期間	2020年6月11日～2021年6月10日	1,540,288,799	588,062,814	3,354,502,334
第5期計算期間	2021年6月11日～2022年6月10日	2,416,929,271	527,584,273	5,243,847,332
第6期計算期間	2022年6月11日～2023年6月12日	2,441,482,388	635,240,279	7,050,089,441
第7期中間計算期間	2023年6月13日～2023年12月12日	1,483,215,320	590,642,852	7,942,661,909

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	586,637,466,610	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	7,241,509,381	1.22
合計(純資産総額)		593,878,975,991	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	7,168,980,000	1.21

(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	9,585,900	1,944.31	18,637,971,918	2,590.50	24,832,273,950	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,234,900	13,262.64	16,378,034,785	13,410.00	16,560,009,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,476,900	935.07	9,796,634,883	1,211.50	12,692,764,350	2.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,700	68,435.49	11,955,681,814	62,120.00	10,852,364,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1,585,700	4,415.41	7,001,522,280	5,917.00	9,382,586,900	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,500	19,749.13	7,297,307,208	25,255.00	9,331,722,500	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,081,600	162.92	8,485,138,853	172.30	8,973,659,680	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,400	8,161.66	6,916,194,878	10,170.00	8,618,058,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,222,500	5,682.91	6,947,368,917	6,880.00	8,410,800,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,660,000	2,002.89	7,330,597,902	2,253.50	8,247,810,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,200	5,922.79	6,528,102,549	7,359.00	8,111,089,800	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,328,700	4,450.16	5,912,928,191	5,963.00	7,923,038,100	1.33
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,700	4,702.71	6,544,769,731	5,298.00	7,373,226,600	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,241,600	4,993.91	6,200,440,714	5,767.00	7,160,307,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,549,600	4,531.81	7,022,503,107	4,054.00	6,282,078,400	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,257,300	1,346.23	5,731,320,672	1,466.00	6,241,201,800	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,000	4,358.82	5,897,485,430	4,486.00	6,069,558,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,130.60	5,891,213,340	17,625.00	6,061,237,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,699,500	3,118.90	5,300,580,579	3,529.00	5,997,535,500	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,525,300	4,533.12	6,914,370,121	3,872.00	5,905,961,600	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,320,800	2,084.61	4,837,983,290	2,412.50	5,598,930,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	863,700	5,563.87	4,805,515,260	6,293.00	5,435,264,100	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	949,800	5,369.03	5,099,512,290	5,251.00	4,987,399,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,817,100	1,514.97	4,267,827,507	1,759.50	4,956,687,450	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,500	26,686.15	5,617,435,672	22,985.00	4,838,342,500	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,588,400	2,751.28	4,370,145,617	2,993.00	4,754,081,200	0.80
日本	株式	SMC	機械	52,800	74,470.94	3,932,065,937	75,760.00	4,000,128,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,962,500	1,824.24	3,580,089,531	1,999.00	3,923,037,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,044,500	3,091.13	3,228,692,742	3,645.00	3,807,202,500	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	636,600	6,139.85	3,908,633,900	5,595.00	3,561,777,000	0.60

(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	0.34
		建設業	2.10
		食料品	3.33
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.12
		医薬品	4.56
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.27
		電気機器	17.33
		輸送用機器	8.09
		精密機器	2.34
		その他製品	2.35
		電気・ガス業	1.39
		陸運業	2.81
		海運業	0.83
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.63
		卸売業	6.92
		小売業	4.25
		銀行業	6.79
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	2.35
		その他金融業	1.14
不動産業	1.93		
サービス業	4.94		
	小計	98.78	
合計		98.78	

(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	303	円	7,109,275,050	7,168,980,000	1.21

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

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

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	549,387,054,480	84.55
地方債証券	日本	32,859,840,918	5.06
特殊債券	日本	36,607,573,370	5.63
	国際機関	299,901,000	0.05
	小計	36,907,474,370	5.68
社債券	日本	27,984,534,000	4.31
	フランス	1,395,463,000	0.21
	韓国	99,613,000	0.02
	小計	29,479,610,000	4.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,123,042,875	0.17
合計(純資産総額)		649,757,022,643	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)	6,670,000,000	100.04	6,673,134,900	99.74	6,653,258,300	0.100	2028/3/20	1.02
日本	国債証券	第148回利付国債(5年)	6,010,000,000	100.15	6,019,494,300	99.92	6,005,552,600	0.005	2026/6/20	0.92
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	100.16	5,909,558,000	0.100	2026/9/20	0.91

日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,810,000,000	99.98	5,809,007,400	99.72	5,793,964,400	0.005	2027/6/20	0.89
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	100.12	5,757,302,500	0.100	2027/3/20	0.89
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	99.89	5,673,808,800	0.005	2026/9/20	0.87
日本	国債証券	第150回利付国債(5年)	5,610,000,000	100.08	5,614,488,000	99.85	5,601,697,200	0.005	2026/12/20	0.86
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	5,350,000,000	100.62	5,383,203,600	101.69	5,440,682,500	0.800	2033/9/20	0.84
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	97.13	5,390,770,500	0.200	2032/9/20	0.83
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	97.68	5,196,895,200	0.100	2031/6/20	0.80
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	100.14	5,157,467,500	0.100	2025/6/20	0.79
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	99.92	5,155,923,600	0.100	2027/12/20	0.79
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	99.98	5,089,032,900	0.100	2027/9/20	0.78
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	5,070,000,000	100.37	5,088,759,000	100.15	5,077,757,100	0.100	2025/9/20	0.78
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	100.54	5,047,509,600	0.300	2025/12/20	0.78
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	99.94	5,037,177,600	0.005	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	5,060,000,000	98.53	4,985,618,000	97.67	4,942,253,800	0.200	2032/3/20	0.76
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	5,077,000,000	97.88	4,969,367,600	97.12	4,930,985,480	0.100	2031/12/20	0.76
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	5,000,000,000	98.02	4,901,000,000	97.39	4,869,600,000	0.100	2031/9/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	4,940,000,000	98.68	4,874,823,000	98.49	4,865,406,000	0.100	2030/9/20	0.75
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	4,980,000,000	98.37	4,898,853,100	97.40	4,850,868,600	0.200	2032/6/20	0.75
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	98.16	4,839,583,800	0.400	2033/6/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	4,860,000,000	100.83	4,900,471,300	99.30	4,825,980,000	0.500	2033/3/20	0.74
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	99.64	4,817,884,100	0.100	2028/6/20	0.74
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	100.15	4,807,488,000	0.100	2025/12/20	0.74
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	100.15	4,767,330,400	0.100	2026/3/20	0.73
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	4,850,000,000	98.43	4,774,063,500	97.96	4,751,399,500	0.100	2031/3/20	0.73
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	4,810,000,000	98.55	4,740,410,400	98.23	4,725,055,400	0.100	2030/12/20	0.73
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	4,745,000,000	98.91	4,693,345,850	98.70	4,683,362,450	0.100	2030/6/20	0.72
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	4,650,000,000	100.79	4,686,736,200	99.48	4,626,192,000	0.500	2032/12/20	0.71

(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	84.55
地方債証券	5.06
特殊債券	5.68
社債券	4.54
合計	99.83

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	436,821,245,267	68.92
	イギリス	24,618,803,131	3.88
	カナダ	21,498,781,749	3.39
	スイス	19,790,379,855	3.12
	フランス	19,459,694,281	3.07
	ドイツ	15,130,555,628	2.39
	オーストラリア	12,419,341,448	1.96
	オランダ	11,967,127,087	1.89
	アイルランド	11,327,699,665	1.79
	デンマーク	5,948,861,645	0.94
	スウェーデン	5,745,002,531	0.91
	スペイン	4,599,683,457	0.73
	イタリア	3,492,708,022	0.55
	香港	2,923,160,701	0.46
	シンガポール	1,990,878,487	0.31
	フィンランド	1,897,947,389	0.30
	ジャージー	1,668,614,638	0.26
	ベルギー	1,356,764,905	0.21
	イスラエル	1,251,430,089	0.20
ノルウェー	1,170,291,225	0.18	

	ケイマン	822,555,086	0.13
	キュラソー	817,138,352	0.13
	バミューダ	800,661,258	0.13
	ニュージーランド	515,461,679	0.08
	リベリア	381,134,046	0.06
	ルクセンブルク	370,673,947	0.06
	オーストリア	340,212,200	0.05
	ポルトガル	336,147,214	0.05
	パナマ	190,150,446	0.03
	マン島	89,348,667	0.01
	小計	609,742,454,095	96.20
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	68,791,609	0.01
	香港	52,713,045	0.01
	小計	121,504,654	0.02
投資証券	アメリカ	10,967,896,802	1.73
	オーストラリア	793,123,448	0.13
	フランス	271,340,844	0.04
	シンガポール	254,235,875	0.04
	イギリス	199,518,358	0.03
	香港	132,831,954	0.02
	ベルギー	58,274,249	0.01
	カナダ	56,326,500	0.01
	小計	12,733,548,030	2.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	11,202,036,242	1.77
合計(純資産総額)		633,799,543,021	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	7,950,153,003	1.25
	買建	カナダ	326,532,931	0.05
	買建	ドイツ	1,461,803,793	0.23
	買建	イギリス	629,755,623	0.10
	買建	オーストラリア	460,889,112	0.07

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

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

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	—	283,731,555	0.04
	売建	—	82,169,702	△0.01

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

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

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 （%）
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,210,717	24,864.28	30,103,617,309	27,455.45	33,240,781,753	5.24
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	546,594	47,251.92	25,827,617,340	53,225.96	29,092,991,692	4.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	719,107	17,107.66	12,302,245,001	21,753.88	15,643,371,268	2.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	191,277	55,480.53	10,612,150,623	70,237.05	13,434,732,710	2.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	459,452	17,683.37	8,124,662,630	19,888.82	9,137,958,540	1.44
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	172,117	37,414.47	6,439,667,075	50,820.52	8,747,076,405	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	405,242	17,782.83	7,206,352,964	20,037.74	8,120,134,806	1.28
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	221,215	27,675.29	6,122,190,807	35,908.51	7,943,503,119	1.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	34,367	112,604.02	3,869,862,560	159,191.41	5,470,931,198	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	224,007	19,435.67	4,353,727,963	24,153.64	5,410,586,452	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	72,060	68,537.16	4,938,788,253	74,446.56	5,364,619,618	0.85
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	61,232.73	3,831,944,793	82,381.95	5,155,462,775	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	101,297	45,681.93	4,627,443,415	50,714.15	5,137,191,567	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	124,044	31,931.14	3,960,866,891	36,932.53	4,581,258,999	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	309,867	14,897.75	4,616,321,599	14,209.94	4,403,193,864	0.69

			ー						
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	21,871.54	4,090,766,648	22,207.74	4,153,647,120	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	64,870	53,062.81	3,442,184,632	60,464.96	3,922,362,318	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	77,067	41,483.25	3,196,989,945	49,266.06	3,796,788,124	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	183,167	20,662.70	3,784,726,574	20,668.88	3,785,857,824	0.60
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	12,058.28	3,051,094,979	14,718.05	3,724,094,992	0.59
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	207,970	18,760.39	3,901,598,775	16,283.94	3,386,572,998	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	31,384	106,521.72	3,343,077,703	107,768.60	3,382,209,993	0.53
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	34,608	72,335.68	2,503,393,454	94,047.47	3,254,794,946	0.51
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	15,714.70	3,113,979,758	15,426.84	3,056,938,137	0.48
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	19,562.12	2,698,223,009	21,948.19	3,027,336,140	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	142,373	21,833.04	3,108,436,053	21,241.87	3,024,270,053	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	35,550	59,724.68	2,123,212,633	84,462.60	3,002,645,487	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	74,662	30,481.93	2,275,842,509	37,667.21	2,812,309,338	0.44
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	321,355	8,522.92	2,738,884,773	8,332.51	2,677,694,554	0.42
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	126,574	17,853.61	2,259,803,749	21,098.63	2,670,538,095	0.42

(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	4.62
		素材	4.01
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	2.06
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.08
		メディア・娯楽	5.90
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.54
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.47
		家庭用品・パーソナル用品	1.60
		ヘルスケア機器・サービス	4.27
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.83
		銀行	5.41
		金融サービス	6.68
		保険	2.98
		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	9.97
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.67
		電気通信サービス	1.15
		公益事業	2.64
半導体・半導体製造装置	6.52		
不動産管理・開発	0.36		
	小計	96.20	
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	2.01
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	232	アメリカドル	54,426,043.1	7,719,245,693	56,054,100	7,950,153,003	1.25
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	12	カナダドル	2,960,170	317,448,631	3,044,880	326,532,931	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	23	スイスフラン	2,553,261	429,560,630	2,534,140	426,343,713	0.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	145	ユーロ	6,638,194	1,042,993,041	6,590,250	1,035,460,080	0.16
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	25	オーストラリアドル	4,632,025	449,028,503	4,754,375	460,889,112	0.07
	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	45	イギリスポンド	3,417,853.75	617,537,816	3,485,475	629,755,623	0.10

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	1,670,000.00	236,572,200	236,629,815	0.04
	ユーロ	買建	300,000.00	47,249,100	47,101,740	0.01
	アメリカドル	売建	580,000.00	82,162,800	82,169,702	△0.01

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

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

## 外国債券インデックス 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	138,828,155,278	45.99
	フランス	25,137,414,172	8.33
	イタリア	22,555,698,209	7.47
	中国	22,192,630,962	7.35
	ドイツ	19,616,876,170	6.50
	イギリス	15,617,157,420	5.17
	スペイン	14,722,033,558	4.88
	カナダ	5,945,031,157	1.97
	ベルギー	5,358,708,128	1.78
	オランダ	4,549,218,529	1.51
	オーストラリア	4,245,766,262	1.41

	オーストリア	3,582,221,297	1.19
	メキシコ	2,700,465,553	0.89
	アイルランド	1,759,172,154	0.58
	フィンランド	1,583,609,641	0.52
	ポーランド	1,522,256,383	0.50
	マレーシア	1,491,873,985	0.49
	シンガポール	1,266,874,133	0.42
	イスラエル	888,889,820	0.29
	デンマーク	844,917,398	0.28
	ニュージーランド	730,448,334	0.24
	スウェーデン	637,896,631	0.21
	ノルウェー	539,822,201	0.18
	小計	296,317,137,375	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,551,829,720	1.84
合計(純資産総額)		301,868,967,095	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	1,057,010,248	0.35
	買建	ドイツ	1,031,283,830	0.34

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	2,273,903,860	0.75

(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	14,370.29	2,011,841,580	14,462.78	2,024,789,452	4.125	2032/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 3.375% 05/15/33	13,630,000	13,524.72	1,843,419,967	13,657.78	1,861,556,202	3.375	2033/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/15/32	12,900,000	13,024.24	1,680,128,108	13,029.52	1,680,808,502	2.750	2032/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 05/15/27	11,690,000	13,309.58	1,555,890,143	13,470.80	1,574,736,862	2.375	2027/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.5% 02/15/33	11,200,000	13,457.94	1,507,289,389	13,799.33	1,545,525,943	3.500	2033/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/15/31	12,580,000	11,722.99	1,474,752,411	11,810.39	1,485,747,637	1.375	2031/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	10,770,000	13,091.00	1,409,900,981	13,375.78	1,440,572,355	1.625	2026/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.875% 02/15/32	11,720,000	12,174.94	1,426,903,209	12,229.51	1,433,298,956	1.875	2032/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.5% 07/15/26	10,000,000	14,176.54	1,417,654,589	14,313.47	1,431,347,254	4.500	2026/7/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 3.125% 08/15/25	10,200,000	13,706.58	1,398,071,810	13,894.63	1,417,252,343	3.125	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	11,950,000	11,348.89	1,356,192,724	11,521.74	1,376,848,933	0.625	2030/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/28	10,060,000	13,491.33	1,357,228,616	13,600.72	1,368,232,565	2.875	2028/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/32	10,100,000	13,181.32	1,331,313,889	13,182.71	1,331,453,784	2.875	2032/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 4.125% 08/31/30	9,200,000	13,531.43	1,244,892,265	14,388.81	1,323,771,414	4.125	2030/8/31	0.44
アメリカ	国債証券	T 0.875% 11/15/30	11,150,000	11,528.95	1,285,477,999	11,675.21	1,301,786,232	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.75% 04/30/26	9,500,000	12,832.84	1,219,120,267	13,107.64	1,245,225,851	0.750	2026/4/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/25	9,000,000	13,583.85	1,222,547,120	13,811.25	1,243,012,521	2.875	2025/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/52	10,800,000	11,087.07	1,197,403,879	11,400.69	1,231,274,976	2.875	2052/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.5% 11/30/24	8,800,000	13,493.24	1,187,405,195	13,747.59	1,209,788,742	1.500	2024/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 0.625% 12/31/27	9,600,000	12,187.68	1,170,017,725	12,467.46	1,196,876,778	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/28	9,500,000	12,348.35	1,173,093,379	12,568.02	1,193,962,055	1.250	2028/9/30	0.40
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	8,460,000	13,548.08	1,146,168,347	13,760.83	1,164,166,574	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.125% 02/28/25	8,500,000	13,332.29	1,133,245,244	13,620.11	1,157,709,536	1.125	2025/2/28	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.875% 11/30/29	8,130,000	14,060.15	1,143,090,457	14,175.24	1,152,447,304	3.875	2029/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 3.125% 11/15/28	8,400,000	13,607.64	1,143,042,314	13,702.93	1,151,046,845	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	T 1.25% 06/30/28	9,000,000	12,379.87	1,114,189,028	12,645.86	1,138,127,573	1.250	2028/6/30	0.38
アメリカ	国債証券	T 2.875% 08/15/28	8,220,000	13,270.89	1,090,867,305	13,570.80	1,115,520,099	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/53	8,350,000	13,545.82	1,131,076,740	13,226.20	1,104,387,824	3.625	2053/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	T 1.25% 08/15/31	9,230,000	11,662.47	1,076,446,019	11,768.56	1,086,238,622	1.250	2031/8/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000	17,871.22	1,057,976,319	18,272.36	1,081,723,989	5.500	2029/4/25	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	98.16
合計	98.16

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

## 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	3,019,726.92	428,287,869	3,043,250	431,624,147	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	2,005,495.72	284,439,458	2,032,031.34	288,203,005	0.10
	アメリカ	シカゴ商品取引所	US LONG BOND	買建	19	アメリカドル	2,297,490.69	325,853,104	2,377,375	337,183,096	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	1,169,788.1	183,797,106	1,172,710	184,256,195	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	1,782,261.5	280,028,927	1,794,900	282,014,688	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	26	ユーロ	3,549,464.6	557,691,878	3,596,060	565,012,947	0.19

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

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

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,820,000.00	1,120,056,741	1,105,931,770	0.37
	カナダドル	買建	860,000.00	91,810,503	91,986,718	0.03
	ユーロ	買建	4,800,000.00	751,781,098	752,531,520	0.25
	イギリスポンド	買建	740,000.00	134,213,963	133,329,352	0.04
	オフショア人民元	買建	9,560,000.00	191,600,350	190,124,500	0.06

(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	27,373,751,943	16.30
	台湾	25,312,046,881	15.08
	ケイマン	24,776,930,336	14.76
	韓国	21,142,409,403	12.59
	中国	16,385,534,532	9.76

	ブラジル	9,000,147,496	5.36
	サウジアラビア	6,724,167,134	4.01
	南アフリカ	4,577,727,992	2.73
	メキシコ	4,165,689,427	2.48
	インドネシア	3,067,411,281	1.83
	タイ	2,917,439,982	1.74
	マレーシア	2,160,458,425	1.29
	アラブ首長国連邦	2,013,040,022	1.20
	香港	1,490,809,284	0.89
	ポーランド	1,465,093,995	0.87
	カタール	1,448,993,951	0.86
	クウェート	1,193,728,245	0.71
	トルコ	1,009,437,156	0.60
	フィリピン	981,616,209	0.58
	チリ	818,656,347	0.49
	ギリシャ	769,781,700	0.46
	バミューダ	658,873,422	0.39
	アメリカ	593,551,562	0.35
	ハンガリー	416,412,040	0.25
	チェコ	249,361,169	0.15
	ルクセンブルク	226,829,759	0.14
	イギリス	182,542,842	0.11
	エジプト	166,403,778	0.10
	コロンビア	157,920,139	0.09
	ペルー	36,449,941	0.02
	シンガポール	25,270,245	0.02
	オランダ	21,343,337	0.01
	ロシア	122	0.00
	キプロス	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	161,529,830,097	96.21
投資信託受益証券	ブラジル	386,672,252	0.23
	メキシコ	130,787,763	0.08
	小計	517,460,015	0.31
投資証券	メキシコ	182,927,853	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	5,662,722,373	3.37
合計(純資産総額)		167,892,940,338	100.00

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国／地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,653,658,662	3.37

(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	—	857,491,239	0.51
	売建	—	18,671,160	△0.01

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

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

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	2,580.77	10,269,915,911	2,745.23	10,924,354,778	6.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジ・ハードウェアおよび機器	771,665	7,775.85	6,000,358,738	8,674.24	6,693,615,126	3.99
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,083,100	5,576.70	6,040,130,737	5,317.95	5,759,871,645	3.43
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	1,488.49	3,934,957,611	1,376.67	3,639,368,119	2.17
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	494,885	3,977.88	1,968,593,316	4,481.97	2,218,062,693	1.32
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	15,551.41	1,520,617,380	20,614.99	2,015,733,771	1.20
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	847,011	1,612.38	1,365,704,058	1,729.28	1,464,725,958	0.87
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	532,498	2,365.25	1,259,495,154	2,688.35	1,431,546,323	0.85
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	87,370	14,144.00	1,235,761,281	15,635.75	1,366,095,478	0.81
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	461,405	2,557.98	1,180,266,607	2,932.94	1,353,275,026	0.81
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	15,201,620	80.94	1,230,555,937	84.03	1,277,460,536	0.76

ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	833,450	2,072.81	1,727,583,887	1,494.65	1,245,718,126	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	550,487	2,060.92	1,134,514,260	2,252.72	1,240,096,862	0.74
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	241,804	4,189.60	1,013,063,732	4,745.13	1,147,392,624	0.68
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	307,532	2,681.90	824,771,301	3,295.56	1,013,490,158	0.60
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	152,359	5,775.02	879,877,439	6,537.80	996,093,584	0.59
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	454.19	933,928,977	481.45	989,996,227	0.59
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	6,287.44	836,400,611	6,884.14	915,777,822	0.55
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	9,369,500	82.78	775,697,407	86.48	810,274,360	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	313,630	3,208.92	1,006,413,580	2,560.96	803,195,453	0.48
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	379,500	1,915.79	727,042,578	2,085.43	791,422,583	0.47
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	728,040	1,017.81	741,008,105	1,086.67	791,145,121	0.47
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	379,111	1,853.11	702,536,281	2,043.69	774,785,360	0.46
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	780,281	853.23	665,762,978	991.25	773,459,930	0.46
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,554,200	298.89	763,448,488	295.48	754,720,124	0.45
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	10,851,515	67.38	731,202,578	68.60	744,489,890	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	13,437,200	50.75	682,021,197	53.90	724,338,985	0.43
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	634,100	1,095.78	694,839,926	1,137.45	721,258,308	0.43
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	490,774	1,327.71	651,607,573	1,465.95	719,453,090	0.43
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	24,609.47	752,828,474	23,083.57	706,149,514	0.42

(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	4.99
		素材	7.59



		資本財	4.48
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	2.01
		自動車・自動車部品	3.71
		耐久消費財・アパレル	1.20
		消費者サービス	2.09
		メディア・娯楽	5.83
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.34
		生活必需品流通・小売り	1.53
		食品・飲料・タバコ	3.44
		家庭用品・パーソナル用品	0.73
		ヘルスケア機器・サービス	0.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.66
		銀行	16.30
		金融サービス	2.64
		保険	2.48
		ソフトウェア・サービス	2.62
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9.11
		電気通信サービス	2.66
		公益事業	2.59
		半導体・半導体製造装置	9.74
		不動産管理・開発	1.48
		小計	96.21
投資信託受益証券	—	—	0.31
投資証券	—	—	0.11
合計			96.63

(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	772	アメリカドル	38,489,603	5,458,980,393	39,862,220	5,653,658,662	3.37

(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	6,051,690.39	857,440,727	857,491,239	0.51
	ブラジルレアル	売建	639,852.91	18,813,527	18,671,160	△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	メキシコ	12,314,242,573	9.86
	ブラジル	12,311,429,684	9.86
	マレーシア	12,281,160,017	9.83
	中国	12,168,745,552	9.74
	インドネシア	12,155,671,554	9.73
	タイ	12,108,981,843	9.70
	南アフリカ	10,189,855,066	8.16
	ポーランド	9,412,123,549	7.54
	チェコ	7,724,692,812	6.18
	コロンビア	5,728,441,977	4.59
	ルーマニア	4,701,887,380	3.76
	ハンガリー	3,928,186,892	3.15
	ペルー	2,847,797,489	2.28
	チリ	2,363,960,245	1.89
	ウルグアイ	235,702,281	0.19
	ドミニカ共和国	200,185,445	0.16
フィリピン	72,357,347	0.06	
	小計	120,745,421,706	96.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	4,151,045,923	3.32
合計(純資産総額)		124,896,467,629	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 (%)
コロンビア	国債証券	COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000	3.49	2,281,655,175	3.48	2,274,750,950	9.850	2027/6/28	1.82
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/26	76,500,000	2,346.03	1,794,719,813	2,419.66	1,851,045,690	0.000	2026/1/1	1.48
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/26	78,000,000	2,227.75	1,737,648,349	2,316.66	1,807,001,331	0.000	2026/7/1	1.45
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	207,400,000	792.89	1,644,472,733	799.52	1,658,222,109	10.500	2026/12/21	1.33
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/25	55,300,000	2,886.39	1,596,175,171	2,918.06	1,613,687,194	10.000	2025/1/1	1.29
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/27	54,900,000	2,864.71	1,572,726,050	2,934.21	1,610,883,969	10.000	2027/1/1	1.29
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/29	51,400,000	2,798.00	1,438,175,636	2,907.93	1,494,678,790	10.000	2029/1/1	1.20
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/18/34	48,100,000,000	2.81	1,352,222,368	3.02	1,453,818,351	7.250	2034/10/18	1.16
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 01/31/30	200,100,000	682.39	1,365,479,917	704.04	1,408,803,849	8.000	2030/1/31	1.13
マレーシア	国債証券	MGS 3.885% 08/15/29	44,600,000	3,090.79	1,378,494,452	3,108.59	1,386,433,981	3.885	2029/8/15	1.11
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000	749.30	1,319,520,515	779.13	1,372,065,450	7.750	2031/5/29	1.10
メキシコ	国債証券	MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000	757.82	1,328,468,218	772.32	1,353,878,842	5.750	2026/3/5	1.08
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 03/31/32	186,500,000	642.71	1,198,655,980	667.47	1,244,838,823	8.250	2032/3/31	1.00
コロンビア	国債証券	COLTES 7.25% 10/26/50	45,110,000,000	2.43	1,097,452,868	2.67	1,206,662,617	7.250	2050/10/26	0.97
マレーシア	国債証券	MGS 3.733% 06/15/28	38,200,000	3,071.81	1,173,432,597	3,094.28	1,182,018,510	3.733	2028/6/15	0.95
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/25	45,300,000	2,472.69	1,120,132,254	2,539.01	1,150,173,595	0.000	2025/7/1	0.92
メキシコ	国債証券	MBONO 8.5% 05/31/29	139,600,000	794.53	1,109,176,713	818.17	1,142,168,842	8.500	2029/5/31	0.91
メキシコ	国債証券	MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000	774.83	1,077,026,466	791.47	1,100,149,383	7.500	2027/6/3	0.88
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 07/01/24	37,250,000	2,726.79	1,015,732,545	2,774.85	1,033,634,015	0.000	2024/7/1	0.83
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000	552.37	1,003,663,194	564.48	1,025,677,603	8.750	2048/2/28	0.82
インドネシア	国債証券	INDOGB 5.5% 04/15/26	109,000,000,000	0.89	976,722,226	0.90	983,917,276	5.500	2026/4/15	0.79
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000	621.03	937,755,300	645.60	974,862,795	8.875	2035/2/28	0.78
メキシコ	国債証券	MBONO 8% 09/05/24	116,900,000	814.64	952,314,219	819.26	957,715,622	8.000	2024/9/5	0.77
メキシコ	国債証券	MBONO 7.75% 11/13/42	123,500,000	692.64	855,421,073	737.72	911,093,265	7.750	2042/11/13	0.73
メキシコ	国債証券	MBONO 5.5% 03/04/27	120,000,000	733.04	879,652,010	749.56	899,482,869	5.500	2027/3/4	0.72
マレーシア	国債証券	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000	3,111.58	893,024,961	3,107.79	891,937,555	3.955	2025/9/15	0.71
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.5% 01/31/37	145,700,000	578.20	842,445,559	597.02	869,868,339	8.500	2037/1/31	0.70
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 02/15/33	90,000,000,000	0.93	844,256,492	0.95	858,321,360	7.000	2033/2/15	0.69

ポーランド	国債証券	POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000	3,160.56	824,906,654	3,237.16	844,900,460	2.750	2029/10/25	0.68
タイ	国債証券	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000	409.52	831,740,168	412.33	837,444,004	2.125	2026/12/17	0.67

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.68
合計	96.68

(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

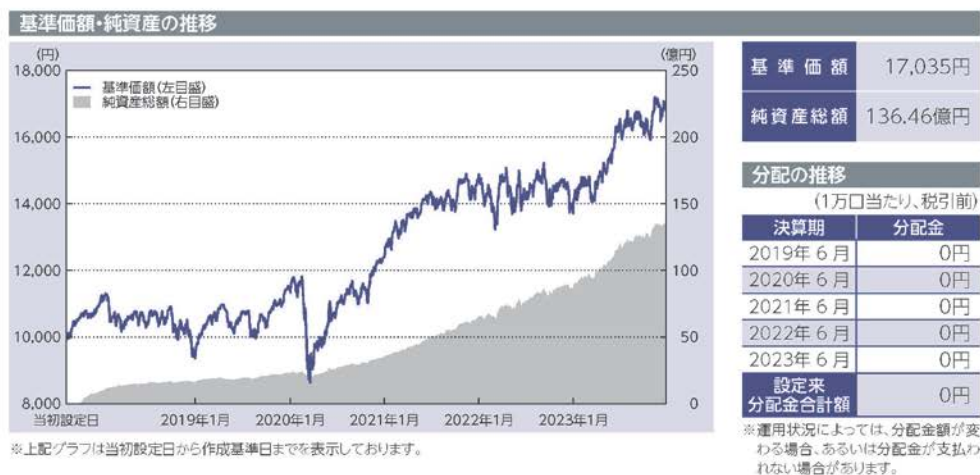
該当事項はありません。

《参考情報》

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

 運用実績

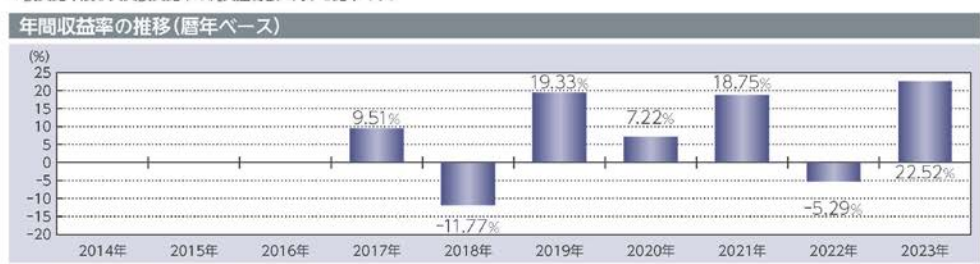
当初設定日：2017年 8月25日  
作成基準日：2023年12月29日



**主要な資産の状況**

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 インデックス マザーファンド	41.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	-	-	2.2%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.9%
新興国株式 インデックス マザーファンド	30.0%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	-	-	2.0%
		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	-	-	1.2%
外国債券 インデックス マザーファンド	12.3%	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	国債	-	4.125%	2032/11/15	0.1%
		T 3.375% 05/15/33	アメリカ	国債	-	3.375%	2033/05/15	0.1%
新興国債券 インデックス マザーファンド	10.1%	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	国債	-	9.850%	2027/06/28	0.2%
		BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	国債	-	0.000%	2026/01/01	0.1%
国内株式 インデックス マザーファンド	3.9%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	0.2%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	-	-	0.1%
国内債券 インデックス マザーファンド	1.0%	第350回利付国債(10年)	日本	国債	-	0.100%	2028/03/20	0.0%
		第148回利付国債(5年)	日本	国債	-	0.005%	2026/06/20	0.0%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <申込受付の中止等>

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

#### <その他>

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、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ないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

#### <一部解約受付の中止等>

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

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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



#### <問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

###### ① マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

###### ② マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

###### (イ) 国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

###### (ハ) 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

###### ③ 外貨建資産等の円換算

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

#### <基準価額の照会方法>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限とします。(2017年8月25日設定)

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

#### (4)【計算期間】

原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとします。

ただし、第1計算期間は2017年8月25日から2018年6月11日までとします。

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

#### (5)【その他】

##### <投資信託契約の終了(償還)と手続き>

###### (1)投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

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

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・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て）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て）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

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6期計算期間(2022年6月11日から2023年6月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2023年8月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘  
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SMT世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2022年6月11日から2023年6月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMT世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかど

うかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

2. 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】

【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2022年6月10日現在)	第6期 (2023年6月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	94,833,312	132,905,207
親投資信託受益証券	7,665,398,960	10,958,894,668
未収入金	34,622,749	26,435,040
流動資産合計	7,794,855,021	11,118,234,915
資産合計	7,794,855,021	11,118,234,915
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	32,753,183	21,599,204
未払受託者報酬	1,872,658	2,678,030
未払委託者報酬	18,726,514	26,780,219
未払利息	108	270
その他未払費用	187,210	267,747
流動負債合計	53,539,673	51,325,470
負債合計	53,539,673	51,325,470
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,243,847,332	7,050,089,441
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	2,497,468,016	4,016,820,004
(分配準備積立金)	1,103,695,291	1,705,354,657
元本等合計	7,741,315,348	11,066,909,445
純資産合計	7,741,315,348	11,066,909,445
負債純資産合計	7,794,855,021	11,118,234,915

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2021年6月11日 至 2022年6月10日	自	2022年6月11日 至 2023年6月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		353		398
有価証券売買等損益		357,039,820		764,889,804
営業収益合計		357,040,173		764,890,202
<b>営業費用</b>				
支払利息		24,968		46,283
受託者報酬		3,384,950		4,945,736
委託者報酬		33,849,349		49,457,191
その他費用		338,378		494,460
営業費用合計		37,597,645		54,943,670
営業利益又は営業損失(△)		319,442,528		709,946,532
経常利益又は経常損失(△)		319,442,528		709,946,532
当期純利益又は当期純損失(△)		319,442,528		709,946,532
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(△)		14,318,107		923,921
期首剰余金又は期首欠損金(△)		1,377,658,406		2,497,468,016
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,032,606,603		1,108,170,260
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,032,606,603		1,108,170,260
剰余金減少額又は欠損金増加額		217,921,414		297,840,883
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		217,921,414		297,840,883
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		2,497,468,016		4,016,820,004

(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6月11日から翌年6月10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6期計算期間は2022年6月11日から2023年6月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第5期 (2022年6月10日現在)	第6期 (2023年6月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,243,847,332 口	7,050,089,441 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,4763 円 (14,763 円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,5698 円 (15,698 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自2021年6月11日 至2022年6月10日			第6期 自2022年6月11日 至2023年6月12日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	122,808,216 円	費用控除後の配当等収益額	A	218,020,608 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	182,316,205 円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	491,002,003 円
収益調整金額	C	1,393,772,725 円	収益調整金額	C	2,311,465,347 円
分配準備積立金額	D	798,570,870 円	分配準備積立金額	D	996,332,046 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,497,468,016 円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,016,820,004 円
当ファンドの期末残存口数	F	5,243,847,332 口	当ファンドの期末残存口数	F	7,050,089,441 口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,762 円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,697 円
1万口当たり分配金額	H	— 円	1万口当たり分配金額	H	— 円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	— 円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	— 円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第6期 自2022年6月11日 至2023年6月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第6期 (2023年6月12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5期 自 2021年6月11日 至 2022年6月10日	第6期 自 2022年6月11日 至 2023年6月12日
	投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	3,354,502,334 円	5,243,847,332 円
期中追加設定元本額	2,416,929,271 円	2,441,482,388 円
期中一部解約元本額	527,584,273 円	635,240,279 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第5期 (2022年6月10日現在)	第6期 (2023年6月12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	350,056,978	761,899,735
合計	350,056,978	761,899,735

(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	892,246,839	3,342,713,557	
	国内株式インデックス マザーファンド	192,980,524	438,413,154	
	外国株式インデックス マザーファンド	942,541,511	4,545,029,420	
	国内債券インデックス マザーファンド	92,073,747	125,892,434	
	外国債券インデックス マザーファンド	433,165,697	1,377,163,700	
	新興国債券インデックス マザーファンド	559,137,994	1,129,682,403	
合計		3,112,146,312	10,958,894,668	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

#### 国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,387,078,750
株式	569,849,009,556
派生商品評価勘定	74,964,600
未収入金	292,900
未収配当金	4,392,922,026
差入委託証拠金	303,921,000
流動資産合計	577,008,188,832
資産合計	577,008,188,832
負債の部	
流動負債	
前受金	74,969,000
未払解約金	452,651,802
未払利息	4,856
流動負債合計	527,625,658
負債合計	527,625,658
純資産の部	
元本等	
元本	253,755,785,513
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	322,724,777,661
元本等合計	576,480,563,174
純資産合計	576,480,563,174
負債純資産合計	577,008,188,832

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年6月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		253,755,785,513 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)	2.2718 円 (22,718 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年6月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月12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。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月11日
期首元本額	262,569,150,387円
期中追加設定元本額	20,725,573,920円
期中一部解約元本額	29,538,938,794円
期末元本額	253,755,785,513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)	360,302,767円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	3,938,837,730円
SBI資産設計オープン (分配型)	13,163,739円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,446,772,318円
世界経済インデックスファンド	4,618,693,112円
日本株式インデックス・オープン	3,103,155,119円
DCマイセレクション25	5,980,107,483円
DCマイセレクション50	17,690,107,068円
DCマイセレクション75	19,131,965,874円
DC日本株式インデックス・オープン	6,043,101,780円
DCマイセレクションS25	3,294,820,468円
DCマイセレクションS50	9,312,335,668円
DCマイセレクションS75	7,900,744,968円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,789,465,231円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	130,559,586円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	666,703,658円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	509,642,776円
DC世界経済インデックスファンド	3,659,477,408円
日本株式インデックス・オープン (SMA専用)	1,067,663,854円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	5,669,968円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	10,113,328円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	15,125,814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)	159,253,372円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	2,122,651円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	21,562,672円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	84,833,818円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	17,859,796円



バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	51,173,986円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	652,379,613円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	368,598,372円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	2,441,869,423円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	33,092,055円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	14,821,567円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	385,167,960円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	223,884,037円
バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	285,798,937円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	27,068,829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)	464,189,731円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,907,960,207円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,800,248,802円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,541,759,417円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,513,257,232円
分散投資コア戦略ファンドA	1,671,155,657円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	551,586,723円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	394,371,065円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,677,177,841円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,284,114円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,593,535円
SMT インデックスバランス・オープン	50,831,603円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	27,824,772,823円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	415,931,772円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,982,354円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	192,980,524円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	33,177,440円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,205,543円
グローバル経済コア	210,418,344円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	32,744,388円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	632,066,720円
DCターゲット・イヤーフンド2055	27,650,797円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,220,569,851円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	260,308,230円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	47,115,908円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	41,608,935円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	16,308,809円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	18,278,585円
10資産分散投資ファンド	94,621,169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)	42,473,084,415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)	671,838,457円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	299,474,027円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,967,849円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	690,518,488円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	44,756,945,467円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,144,717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)	217,836,738円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		19,900,031,061
合計		19,900,031,061

(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

(2023年6月12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	6,522,706,000	—	6,597,675,000	74,969,000
合計		6,522,706,000	—	6,597,675,000	74,969,000

(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	9,500	3,665.00	34,817,500	
ニッセイ	249,500	642.10	160,203,950	
マルハニチロ	37,000	2,476.00	91,612,000	
雪国まいたけ	21,300	966.00	20,575,800	
カネコ種苗	7,600	1,469.00	11,164,400	
サカタのタネ	28,400	4,050.00	115,020,000	
ホクト	22,200	1,876.00	41,647,200	
ホクリヨウ	2,800	915.00	2,562,000	
住石ホールディングス	30,200	379.00	11,445,800	
日鉄鉱業	10,000	3,970.00	39,700,000	
三井松島ホールディングス	11,300	2,645.00	29,888,500	
I N P E X	922,900	1,578.00	1,456,336,200	
石油資源開発	28,900	4,325.00	124,992,500	
K&Oエナジーグループ	11,300	2,305.00	26,046,500	
ショーボンドホールディングス	34,000	5,729.00	194,786,000	
ミライト・ワン	82,500	1,771.00	146,107,500	
タマホーム	15,700	3,490.00	54,793,000	

サンヨーホームズ	2,400	714.00	1,713,600
日本アクア	8,100	890.00	7,209,000
ファーストコーポレーション	5,000	775.00	3,875,000
ベステラ	4,200	1,109.00	4,657,800
R o b o t Home	42,500	189.00	8,032,500
キャンディル	3,500	574.00	2,009,000
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,075.00	4,192,500
第一カッター興業	6,400	1,318.00	8,435,200
安藤・間	144,600	1,061.00	153,420,600
東急建設	71,100	731.00	51,974,100
コムシスホールディングス	84,500	2,800.50	236,642,250
ビーアールホールディングス	39,600	393.00	15,562,800
高松コンストラクショングループ	16,200	2,443.00	39,576,600
東建コーポレーション	7,200	7,630.00	54,936,000
ソネック	2,100	982.00	2,062,200
ヤマウラ	12,600	1,199.00	15,107,400
オリエンタル白石	89,700	300.00	26,910,000
大成建設	163,300	4,560.00	744,648,000
大林組	624,300	1,166.50	728,245,950
清水建設	524,800	874.30	458,832,640
飛島建設	19,300	1,282.00	24,742,600
長谷工コーポレーション	180,200	1,692.00	304,898,400
松井建設	16,300	685.00	11,165,500
銭高組	1,700	3,050.00	5,185,000
鹿島建設	387,100	2,078.00	804,393,800
不動テトラ	12,100	1,813.00	21,937,300
大末建設	4,900	1,282.00	6,281,800
鉄建建設	12,500	2,004.00	25,050,000
西松建設	29,600	3,504.00	103,718,400
三井住友建設	140,800	369.00	51,955,200
大豊建設	7,200	3,850.00	27,720,000
佐田建設	8,700	450.00	3,915,000
ナカノフドー建設	9,600	370.00	3,552,000
奥村組	28,300	4,035.00	114,190,500
東鉄工業	24,000	2,565.00	61,560,000
イチケン	3,100	1,906.00	5,908,600

富士ピー・エス	6,100	442.00	2,696,200
浅沼組	14,000	3,190.00	44,660,000
戸田建設	214,800	814.80	175,019,040
熊谷組	29,200	3,140.00	91,688,000
北野建設	2,500	2,984.00	7,460,000
植木組	3,800	1,325.00	5,035,000
矢作建設工業	23,800	1,150.00	27,370,000
ピーエス三菱	22,100	739.00	16,331,900
日本ハウスホールディングス	34,600	381.00	13,182,600
新日本建設	24,500	1,153.00	28,248,500
東亜道路工業	6,900	4,350.00	30,015,000
日本道路	3,500	8,900.00	31,150,000
東亜建設工業	15,000	3,160.00	47,400,000
日本国土開発	52,300	586.00	30,647,800
若築建設	7,800	3,095.00	24,141,000
東洋建設	56,500	1,015.00	57,347,500
五洋建設	247,500	756.50	187,233,750
世紀東急工業	22,400	1,299.00	29,097,600
福田組	6,600	4,735.00	31,251,000
住友林業	133,900	3,338.00	446,958,200
日本基礎技術	8,200	506.00	4,149,200
巴コーポレーション	15,200	453.00	6,885,600
大和ハウス工業	487,800	3,687.00	1,798,518,600
ライト工業	32,300	1,922.00	62,080,600
積水ハウス	529,300	2,707.50	1,433,079,750
日特建設	16,700	1,011.00	16,883,700
北陸電気工事	12,000	891.00	10,692,000
ユアテック	38,500	850.00	32,725,000
日本リーテック	15,300	1,445.00	22,108,500
四電工	7,300	2,177.00	15,892,100
中電工	27,100	2,263.00	61,327,300
関電工	95,600	1,108.00	105,924,800
きんでん	122,900	1,928.00	236,951,200
東京エネシス	17,400	1,004.00	17,469,600
トーエネック	5,800	3,665.00	21,257,000
住友電設	16,600	3,015.00	50,049,000

日本電設工業	28,700	1,886.00	54,128,200
エクシオグループ	80,400	2,770.00	222,708,000
新日本空調	9,700	2,267.00	21,989,900
九電工	42,400	4,022.00	170,532,800
三機工業	38,700	1,508.00	58,359,600
日揮ホールディングス	172,700	1,830.50	316,127,350
中外炉工業	5,700	2,061.00	11,747,700
ヤマト	11,300	898.00	10,147,400
太平電業	10,800	4,285.00	46,278,000
高砂熱学工業	42,100	2,442.00	102,808,200
三晃金属工業	1,700	4,355.00	7,403,500
朝日工業社	7,200	2,223.00	16,005,600
明星工業	30,000	951.00	28,530,000
大氣社	20,100	3,995.00	80,299,500
ダイダン	11,500	2,608.00	29,992,000
日比谷総合設備	15,000	2,161.00	32,415,000
フィル・カンパニー	3,100	937.00	2,904,700
テスホールディングス	18,800	1,068.00	20,078,400
インフロニア・ホールディングス	182,900	1,327.50	242,799,750
東洋エンジニアリング	23,100	578.00	13,351,800
レイズネクスト	25,200	1,373.00	34,599,600
ニッポン	47,200	1,840.00	86,848,000
日清製粉グループ本社	162,100	1,815.50	294,292,550
日東富士製粉	3,100	4,695.00	14,554,500
昭和産業	15,300	2,711.00	41,478,300
鳥越製粉	10,900	616.00	6,714,400
中部飼料	24,300	1,100.00	26,730,000
フィード・ワン	25,600	729.00	18,662,400
東洋精糖	2,500	1,432.00	3,580,000
日本甜菜製糖	10,200	1,859.00	18,961,800
DM三井製糖ホールディングス	17,400	2,679.00	46,614,600
塩水港精糖	16,300	204.00	3,325,200
ウェルネオシュガー	9,100	1,970.00	17,927,000
森永製菓	32,000	4,618.00	147,776,000
中村屋	4,400	3,065.00	13,486,000
江崎グリコ	50,100	3,862.00	193,486,200

名糖産業	6,900	1,625.00	11,212,500
井村屋グループ	9,600	2,251.00	21,609,600
不二家	12,000	2,488.00	29,856,000
山崎製パン	117,300	2,039.00	239,174,700
第一屋製パン	2,600	390.00	1,014,000
モロゾフ	5,700	3,615.00	20,605,500
亀田製菓	11,100	4,245.00	47,119,500
寿スピリッツ	18,600	10,710.00	199,206,000
カルビー	80,200	2,794.50	224,118,900
森永乳業	31,800	5,072.00	161,289,600
六甲バター	12,900	1,314.00	16,950,600
ヤクルト本社	125,200	9,179.00	1,149,210,800
明治ホールディングス	214,900	3,222.00	692,407,800
雪印メグミルク	42,400	1,940.00	82,256,000
プリマハム	23,500	2,194.00	51,559,000
日本ハム	68,500	3,921.00	268,588,500
林兼産業	4,200	480.00	2,016,000
丸大食品	17,600	1,489.00	26,206,400
S Foods	19,300	3,275.00	63,207,500
柿安本店	6,800	2,328.00	15,830,400
伊藤ハム米久ホールディングス	133,900	719.00	96,274,100
サッポロホールディングス	57,700	3,781.00	218,163,700
アサヒグループホールディングス	404,900	5,662.00	2,292,543,800
キリンホールディングス	790,800	2,104.00	1,663,843,200
宝ホールディングス	119,600	1,051.00	125,699,600
オエノンホールディングス	52,400	381.00	19,964,400
養命酒製造	5,800	1,840.00	10,672,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	137,300	1,609.00	220,915,700
サントリー食品インターナショナル	123,400	5,322.00	656,734,800
ダイドーグループホールディングス	9,900	5,060.00	50,094,000
伊藤園	59,400	4,207.00	249,895,800
キーコーヒー	19,600	2,062.00	40,415,200
ユニカフェ	4,500	907.00	4,081,500
ジャパンフーズ	2,100	1,100.00	2,310,000
日清オイリオグループ	24,700	3,430.00	84,721,000

不二製油グループ本社	40,800	2,024.50	82,599,600
かどや製油	1,600	3,470.00	5,552,000
J-オイルミルズ	17,800	1,626.00	28,942,800
キッコーマン	116,100	8,410.00	976,401,000
味の素	423,200	5,611.00	2,374,575,200
ブルドックソース	9,300	2,002.00	18,618,600
キューピー	94,200	2,278.00	214,587,600
ハウス食品グループ本社	53,600	3,291.00	176,397,600
カゴメ	81,700	3,390.00	276,963,000
焼津水産化学工業	5,300	805.00	4,266,500
アリアケジャパン	15,300	5,168.00	79,070,400
ピエトロ	2,000	1,822.00	3,644,000
エバラ食品工業	4,700	2,945.00	13,841,500
やまみ	1,300	1,372.00	1,783,600
ニチレイ	80,300	3,076.00	247,002,800
東洋水産	88,600	6,390.00	566,154,000
イトアンドホールディングス	7,400	2,185.00	16,169,000
大冷	1,700	1,948.00	3,311,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	881.00	9,779,100
日清食品ホールディングス	61,600	12,085.00	744,436,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,125.00	18,275,000
一正蒲鉾	5,800	798.00	4,628,400
フジッコ	18,000	1,927.00	34,686,000
ロック・フィールド	19,600	1,497.00	29,341,200
日本たばこ産業	1,153,700	3,148.00	3,631,847,600
ケンコーマヨネーズ	12,100	1,282.00	15,512,200
わらべや日洋ホールディングス	12,900	2,274.00	29,334,600
なとり	11,000	1,945.00	21,395,000
イフジ産業	2,300	1,062.00	2,442,600
ファーマフーズ	25,200	1,871.00	47,149,200
ユウグレナ	113,300	921.00	104,349,300
紀文食品	13,700	987.00	13,521,900
ピックルスホールディングス	10,300	1,304.00	13,431,200
ミヨシ油脂	4,800	1,001.00	4,804,800
理研ビタミン	15,100	2,111.00	31,876,100
片倉工業	16,700	1,667.00	27,838,900

グンゼ	12,800	4,475.00	57,280,000
東洋紡	77,600	1,005.00	77,988,000
ユニチカ	56,200	227.00	12,757,400
富士紡ホールディングス	7,200	3,095.00	22,284,000
倉敷紡績	13,500	2,254.00	30,429,000
シキボウ	7,700	991.00	7,630,700
日本毛織	47,500	1,021.00	48,497,500
トーア紡コーポレーション	5,400	392.00	2,116,800
帝国繊維	20,400	1,622.00	33,088,800
帝人	171,700	1,370.50	235,314,850
東レ	1,195,200	769.80	920,064,960
住江織物	3,000	2,185.00	6,555,000
日本フェルト	8,900	414.00	3,684,600
イチカワ	2,100	1,348.00	2,830,800
日東製網	1,500	1,365.00	2,047,500
アツギ	8,600	423.00	3,637,800
ダイニック	3,600	733.00	2,638,800
セーレン	34,600	2,306.00	79,787,600
ソトー	4,700	800.00	3,760,000
東海染工	1,500	1,138.00	1,707,000
小松マテーレ	26,200	676.00	17,711,200
ワコールホールディングス	34,400	3,030.00	104,232,000
ホギメディカル	24,000	3,220.00	77,280,000
T S I ホールディングス	60,300	698.00	42,089,400
マツオカコーポレーション	4,000	1,114.00	4,456,000
ワールド	23,000	1,517.00	34,891,000
三陽商会	5,300	1,588.00	8,416,400
ナイガイ	5,400	280.00	1,512,000
オンワードホールディングス	116,200	381.00	44,272,200
ルックホールディングス	4,100	2,356.00	9,659,600
ゴールドウイン	31,600	12,580.00	397,528,000
デサント	30,800	3,975.00	122,430,000
キング	6,500	567.00	3,685,500
ヤマトインターナショナル	11,700	275.00	3,217,500
特種東海製紙	8,000	3,345.00	26,760,000
王子ホールディングス	742,700	553.30	410,935,910



日本製紙	92,900	1,278.00	118,726,200
三菱製紙	16,700	588.00	9,819,600
北越コーポレーション	112,600	907.00	102,128,200
中越パルプ工業	5,600	1,366.00	7,649,600
巴川製紙所	4,400	671.00	2,952,400
大王製紙	78,700	1,133.50	89,206,450
阿波製紙	3,300	574.00	1,894,200
レンゴー	162,400	867.50	140,882,000
トーモク	10,300	1,990.00	20,497,000
ザ・パック	13,200	3,095.00	40,854,000
北の達人コーポレーション	75,100	303.00	22,755,300
クラレ	283,400	1,350.00	382,590,000
旭化成	1,113,300	957.00	1,065,428,100
共和レザー	8,000	530.00	4,240,000
レゾナック・ホールディングス	172,300	2,228.50	383,970,550
住友化学	1,322,500	426.00	563,385,000
住友精化	7,400	4,235.00	31,339,000
日産化学	84,600	6,274.00	530,780,400
ラサ工業	6,900	2,043.00	14,096,700
クレハ	15,200	8,370.00	127,224,000
多木化学	6,900	4,420.00	30,498,000
テイカ	12,000	1,289.00	15,468,000
石原産業	32,300	1,297.00	41,893,100
片倉コープアグリ	2,800	1,305.00	3,654,000
日本曹達	19,100	5,060.00	96,646,000
東ソー	238,000	1,682.00	400,316,000
トクヤマ	57,600	2,345.50	135,100,800
セントラル硝子	28,600	3,160.00	90,376,000
東亜合成	89,400	1,277.00	114,163,800
大阪ソーダ	10,700	4,850.00	51,895,000
関東電化工業	34,500	874.00	30,153,000
デンカ	64,800	2,662.00	172,497,600
信越化学工業	1,481,900	4,582.00	6,790,065,800
日本カーバイド工業	5,300	1,309.00	6,937,700
堺化学工業	13,600	1,857.00	25,255,200
第一稀元素化学工業	16,200	953.00	15,438,600

エア・ウォーター	168,200	1,857.50	312,431,500
日本酸素ホールディングス	173,000	3,147.00	544,431,000
日本化学工業	5,900	1,848.00	10,903,200
東邦アセチレン	2,900	1,368.00	3,967,200
日本パーカラライジング	88,300	1,061.00	93,686,300
高压ガス工業	25,900	736.00	19,062,400
チタン工業	1,700	1,390.00	2,363,000
四国化成ホールディングス	21,200	1,473.00	31,227,600
戸田工業	4,100	2,397.00	9,827,700
ステラ ケミファ	10,600	2,944.00	31,206,400
保土谷化学工業	5,000	3,255.00	16,275,000
日本触媒	27,200	5,460.00	148,512,000
大日精化工業	12,400	1,945.00	24,118,000
カネカ	40,700	3,959.00	161,131,300
三菱瓦斯化学	133,100	2,072.00	275,783,200
三井化学	147,000	3,864.00	568,008,000
J S R	166,400	3,300.00	549,120,000
東京応化工業	31,200	8,455.00	263,796,000
大阪有機化学工業	13,400	2,530.00	33,902,000
三菱ケミカルグループ	1,203,100	810.70	975,353,170
KHネオケム	29,700	2,362.00	70,151,400
ダイセル	262,100	1,223.00	320,548,300
住友ベークライト	26,400	5,705.00	150,612,000
積水化学工業	364,600	2,021.00	736,856,600
日本ゼオン	106,900	1,446.00	154,577,400
アイカ工業	45,000	3,070.00	138,150,000
U B E	91,900	2,353.50	216,286,650
積水樹脂	25,900	2,220.00	57,498,000
タキロンシーアイ	39,000	532.00	20,748,000
旭有機材	11,900	4,260.00	50,694,000
ニチバン	11,000	1,884.00	20,724,000
リケンテクノス	38,400	610.00	23,424,000
大倉工業	8,300	2,056.00	17,064,800
積水化成品工業	25,000	422.00	10,550,000
群栄化学工業	4,200	2,529.00	10,621,800
タイガースポリマー	6,300	575.00	3,622,500

ミライアル	4,200	1,600.00	6,720,000
ダイキアクシス	5,100	719.00	3,666,900
ダイキョーニシカワ	39,300	786.00	30,889,800
竹本容器	4,700	815.00	3,830,500
森六ホールディングス	9,000	1,944.00	17,496,000
恵和	11,500	1,132.00	13,018,000
日本化薬	136,200	1,251.00	170,386,200
カーリットホールディングス	16,000	785.00	12,560,000
日本精化	10,100	2,798.00	28,259,800
扶桑化学工業	16,500	3,970.00	65,505,000
トリケミカル研究所	23,800	2,571.00	61,189,800
ADEKA	62,200	2,537.00	157,801,400
日油	55,100	6,127.00	337,597,700
新日本理化	19,100	240.00	4,584,000
ハリマ化成グループ	9,700	851.00	8,254,700
花王	434,100	5,058.00	2,195,677,800
第一工業製薬	6,400	1,798.00	11,507,200
石原ケミカル	8,100	1,660.00	13,446,000
日華化学	5,600	851.00	4,765,600
ニイタカ	2,500	2,100.00	5,250,000
三洋化成工業	11,000	4,255.00	46,805,000
有機合成薬品工業	10,200	297.00	3,029,400
大日本塗料	21,800	896.00	19,532,800
日本ペイントホールディングス	788,900	1,207.00	952,202,300
関西ペイント	163,300	2,152.50	351,503,250
神東塗料	11,600	129.00	1,496,400
中国塗料	29,300	1,134.00	33,226,200
日本特殊塗料	8,800	1,006.00	8,852,800
藤倉化成	24,000	429.00	10,296,000
太陽ホールディングス	27,100	2,515.00	68,156,500
D I C	69,700	2,590.00	180,523,000
サカタインクス	39,700	1,234.00	48,989,800
東洋インキS Cホールディングス	34,900	2,192.00	76,500,800
T&K TOKA	15,800	1,212.00	19,149,600
富士フイルムホールディングス	342,500	8,776.00	3,005,780,000
資生堂	372,700	6,697.00	2,495,971,900

ライオン	214,200	1,380.00	295,596,000
高砂香料工業	12,100	2,636.00	31,895,600
マンダム	38,600	1,482.00	57,205,200
ミルボン	26,500	5,140.00	136,210,000
ファンケル	78,100	2,416.50	188,728,650
コーセー	36,300	14,475.00	525,442,500
コタ	16,400	1,653.00	27,109,200
シーボン	1,800	1,554.00	2,797,200
ポーラ・オルビスホールディングス	91,500	2,084.50	190,731,750
ノエビアホールディングス	15,900	5,380.00	85,542,000
アジュバンホールディングス	3,400	920.00	3,128,000
新日本製薬	10,200	1,405.00	14,331,000
アクシージア	9,000	1,220.00	10,980,000
エステー	13,800	1,530.00	21,114,000
アグロ カネショウ	7,100	1,579.00	11,210,900
コニシ	29,800	2,191.00	65,291,800
長谷川香料	34,100	3,225.00	109,972,500
星光PMC	7,100	569.00	4,039,900
小林製薬	51,900	8,119.00	421,376,100
荒川化学工業	15,100	1,001.00	15,115,100
メック	14,700	3,310.00	48,657,000
日本高純度化学	4,400	2,688.00	11,827,200
タカラバイオ	48,100	1,674.00	80,519,400
JCU	19,900	3,585.00	71,341,500
新田ゼラチン	8,600	748.00	6,432,800
OATアグリオ	5,700	1,842.00	10,499,400
デクセリアルズ	51,600	3,009.00	155,264,400
アース製薬	16,200	5,150.00	83,430,000
北興化学工業	18,000	947.00	17,046,000
大成ラミック	5,600	2,871.00	16,077,600
クミアイ化学工業	70,900	1,111.00	78,769,900
日本農薬	32,700	649.00	21,222,300
アキレス	11,200	1,447.00	16,206,400
有沢製作所	29,000	1,095.00	31,755,000
日東電工	129,600	10,535.00	1,365,336,000
レック	25,400	823.00	20,904,200

三光合成	22,500	549.00	12,352,500
きもと	20,400	188.00	3,835,200
藤森工業	14,100	3,370.00	47,517,000
前澤化成工業	11,500	1,628.00	18,722,000
未来工業	6,400	2,589.00	16,569,600
ウェーブロックホールディングス	4,100	575.00	2,357,500
J S P	12,500	1,792.00	22,400,000
エフピコ	33,800	2,982.00	100,791,600
天馬	15,200	2,682.00	40,766,400
信越ポリマー	33,000	1,419.00	46,827,000
東リ	31,100	314.00	9,765,400
ニフコ	64,400	3,836.00	247,038,400
バルカー	14,900	3,760.00	56,024,000
ユニ・チャーム	371,900	5,499.00	2,045,078,100
ショーエイコーポレーション	4,000	559.00	2,236,000
協和キリン	215,600	2,719.50	586,324,200
武田薬品工業	1,579,700	4,504.00	7,114,968,800
アステラス製薬	1,686,300	2,277.00	3,839,705,100
住友ファーマ	132,400	658.70	87,211,880
塩野義製薬	225,100	6,174.00	1,389,767,400
わかもと製薬	13,000	235.00	3,055,000
日本新薬	42,100	6,561.00	276,218,100
中外製薬	558,800	4,049.00	2,262,581,200
科研製薬	30,600	3,672.00	112,363,200
エーザイ	217,100	10,795.00	2,343,594,500
ロート製薬	172,900	3,118.00	539,102,200
小野薬品工業	344,400	2,718.00	936,079,200
久光製薬	39,700	3,649.00	144,865,300
持田製薬	20,500	3,355.00	68,777,500
参天製薬	325,200	1,250.00	406,500,000
扶桑薬品工業	5,700	1,981.00	11,291,700
日本ケミファ	1,400	1,815.00	2,541,000
ツムラ	56,200	2,834.00	159,270,800
キッセイ薬品工業	27,600	2,925.00	80,730,000
生化学工業	34,000	761.00	25,874,000
栄研化学	29,000	1,548.00	44,892,000

鳥居薬品	9,600	3,640.00	34,944,000
JCRファーマ	60,400	1,396.00	84,318,400
東和薬品	27,400	1,800.00	49,320,000
富士製薬工業	13,200	1,128.00	14,889,600
ゼリア新薬工業	24,700	2,546.00	62,886,200
そーせいグループ	61,300	3,005.00	184,206,500
第一三共	1,555,100	5,111.00	7,948,116,100
杏林製薬	38,700	1,746.00	67,570,200
大幸薬品	34,300	389.00	13,342,700
ダイト	12,500	2,400.00	30,000,000
大塚ホールディングス	408,400	5,447.00	2,224,554,800
大正製薬ホールディングス	39,700	5,348.00	212,315,600
ペプチドリーム	86,500	2,388.00	206,562,000
あすか製薬ホールディングス	18,300	1,272.00	23,277,600
サワイグループホールディングス	40,800	3,366.00	137,332,800
日本コークス工業	161,000	105.00	16,905,000
ニチレキ	21,100	1,759.00	37,114,900
ユシロ化学工業	9,300	1,029.00	9,569,700
ビーピー・カストロール	5,400	891.00	4,811,400
富士石油	36,400	264.00	9,609,600
MORESCO	4,500	1,149.00	5,170,500
出光興産	198,300	2,849.50	565,055,850
ENEOSホールディングス	3,027,900	482.40	1,460,658,960
コスモエネルギーホールディングス	70,600	4,182.00	295,249,200
横浜ゴム	101,600	3,107.00	315,671,200
TOYO TIRE	102,600	1,916.00	196,581,600
ブリヂストン	570,000	5,855.00	3,337,350,000
住友ゴム工業	175,100	1,317.00	230,606,700
藤倉コンポジット	9,800	913.00	8,947,400
オカモト	9,900	3,975.00	39,352,500
フコク	9,400	1,276.00	11,994,400
ニッタ	18,100	3,050.00	55,205,000
住友理工	34,600	843.00	29,167,800
三ツ星ベルト	26,000	4,155.00	108,030,000
バンドー化学	28,300	1,365.00	38,629,500
日東紡績	20,200	2,541.00	51,328,200

AGC	181,700	5,261.00	955,923,700
日本板硝子	91,000	604.00	54,964,000
石塚硝子	2,300	1,539.00	3,539,700
日本山村硝子	5,400	885.00	4,779,000
日本電気硝子	73,000	2,572.00	187,756,000
オハラ	8,600	1,251.00	10,758,600
住友大阪セメント	25,200	3,714.00	93,592,800
太平洋セメント	113,800	2,688.50	305,951,300
日本ヒューム	15,900	771.00	12,258,900
日本コンクリート工業	35,400	293.00	10,372,200
三谷セキサン	7,500	5,110.00	38,325,000
アジアパイルホールディングス	28,300	603.00	17,064,900
東海カーボン	149,900	1,219.00	182,728,100
日本カーボン	10,300	4,425.00	45,577,500
東洋炭素	11,200	5,010.00	56,112,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,900	5,160.00	45,924,000
TOTO	117,800	4,383.00	516,317,400
日本碍子	207,700	1,733.00	359,944,100
日本特殊陶業	136,000	2,659.50	361,692,000
MARUWA	6,600	19,590.00	129,294,000
品川リフラクトリーズ	5,100	5,070.00	25,857,000
黒崎播磨	3,700	7,520.00	27,824,000
ヨータイ	9,800	1,466.00	14,366,800
東京窯業	13,400	326.00	4,368,400
ニッカトー	6,600	607.00	4,006,200
フジインコーポレーテッド	14,200	9,070.00	128,794,000
クニミネ工業	4,300	935.00	4,020,500
エーアンドエーマテリアル	2,700	1,033.00	2,789,100
ニチアス	45,200	2,807.00	126,876,400
ニチハ	22,400	3,165.00	70,896,000
日本製鉄	822,300	2,889.00	2,375,624,700
神戸製鋼所	369,400	1,223.00	451,776,200
中山製鋼所	37,800	813.00	30,731,400
合同製鐵	9,100	3,335.00	30,348,500
JFEホールディングス	490,800	1,894.50	929,820,600
東京製鐵	51,600	1,451.00	74,871,600

共英製鋼	20,900	1,996.00	41,716,400
大和工業	30,300	5,870.00	177,861,000
東京鐵鋼	8,700	2,796.00	24,325,200
大阪製鐵	8,500	1,395.00	11,857,500
淀川製鋼所	20,900	3,195.00	66,775,500
中部鋼板	15,100	1,876.00	28,327,600
丸一鋼管	55,900	3,246.00	181,451,400
モリ工業	3,300	3,335.00	11,005,500
大同特殊鋼	23,100	5,415.00	125,086,500
日本高周波鋼業	4,900	332.00	1,626,800
日本冶金工業	13,400	4,035.00	54,069,000
山陽特殊製鋼	18,200	2,745.00	49,959,000
愛知製鋼	10,600	2,711.00	28,736,600
日本金属	3,100	882.00	2,734,200
大平洋金属	13,100	1,569.00	20,553,900
新日本電工	109,700	284.00	31,154,800
栗本鐵工所	8,700	2,025.00	17,617,500
虹技	1,800	1,214.00	2,185,200
三菱製鋼	11,500	1,284.00	14,766,000
日亜鋼業	14,600	317.00	4,628,200
日本精線	2,500	4,665.00	11,662,500
エンビプロ・ホールディングス	9,900	570.00	5,643,000
シンニッタン	15,600	243.00	3,790,800
新家工業	3,100	2,290.00	7,099,000
大紀アルミニウム工業所	26,200	1,317.00	34,505,400
日本軽金属ホールディングス	49,600	1,382.00	68,547,200
三井金属鉱業	53,400	3,262.00	174,190,800
東邦亜鉛	10,900	1,655.00	18,039,500
三菱マテリアル	122,600	2,473.50	303,251,100
住友金属鉱山	212,900	4,655.00	991,049,500
DOWAホールディングス	41,300	4,393.00	181,430,900
古河機械金属	27,000	1,547.00	41,769,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,000	3,050.00	82,350,000
東邦チタニウム	33,300	1,835.00	61,105,500
UACJ	25,800	2,657.00	68,550,600
CKサンエツ	4,400	4,200.00	18,480,000



古河電気工業	61,200	2,424.00	148,348,800
住友電気工業	634,200	1,701.50	1,079,091,300
フジクラ	197,000	1,171.50	230,785,500
SWCC	20,600	1,895.00	39,037,000
タツタ電線	37,500	714.00	26,775,000
カナレ電気	2,300	1,359.00	3,125,700
平河ヒューテック	10,600	1,446.00	15,327,600
リョービ	19,600	1,768.00	34,652,800
アーレスティ	15,900	628.00	9,985,200
アサヒホールディングス	74,300	1,952.00	145,033,600
稲葉製作所	9,500	1,660.00	15,770,000
宮地エンジニアリンググループ	5,100	3,975.00	20,272,500
トーカロ	50,500	1,372.00	69,286,000
アルファCo	5,200	1,151.00	5,985,200
SUMCO	349,600	2,007.00	701,647,200
川田テクノロジーズ	4,300	5,260.00	22,618,000
RS Technologies	12,200	3,140.00	38,308,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,534.00	4,814,600
信和	7,900	734.00	5,798,600
東洋製罐グループホールディングス	109,500	2,124.50	232,632,750
ホッカンホールディングス	9,900	1,374.00	13,602,600
コロナ	10,300	890.00	9,167,000
横河ブリッジホールディングス	23,000	2,390.00	54,970,000
駒井ハルテック	2,300	1,799.00	4,137,700
高田機工	1,100	2,751.00	3,026,100
三和ホールディングス	169,100	1,751.00	296,094,100
文化シャッター	52,900	1,104.00	58,401,600
三協立山	21,000	666.00	13,986,000
アルインコ	14,000	995.00	13,930,000
東洋シャッター	3,300	606.00	1,999,800
LIXIL	267,600	1,840.00	492,384,000
日本ファイルコン	9,300	462.00	4,296,600
ノーリツ	27,000	1,791.00	48,357,000
長府製作所	18,500	2,453.00	45,380,500
リンナイ	99,900	3,002.00	299,899,800
ダイニチ工業	7,100	748.00	5,310,800

日東精工	26,600	590.00	15,694,000	
三洋工業	1,600	1,919.00	3,070,400	
岡部	29,500	785.00	23,157,500	
ジーテクト	20,500	1,414.00	28,987,000	
東プレ	32,400	1,460.00	47,304,000	
高周波熱錬	28,300	941.00	26,630,300	
東京製綱	10,800	1,094.00	11,815,200	
サンコール	12,700	509.00	6,464,300	
モリテック スチール	10,500	273.00	2,866,500	
パイオラックス	25,300	1,980.00	50,094,000	
エイチワン	18,900	677.00	12,795,300	
日本発條	162,400	997.50	161,994,000	
中央発條	13,600	695.00	9,452,000	
アドバネクス	1,700	986.00	1,676,200	
立川ブラインド工業	8,300	1,279.00	10,615,700	
三益半導体工業	14,200	3,000.00	42,600,000	
日本ドライケミカル	3,400	1,651.00	5,613,400	
日本製鋼所	49,600	2,996.50	148,626,400	
三浦工業	75,100	3,807.00	285,905,700	
タクマ	55,300	1,504.00	83,171,200	
ツガミ	40,000	1,383.00	55,320,000	
オークマ	18,000	7,087.00	127,566,000	
芝浦機械	18,000	4,790.00	86,220,000	
アマダ	286,900	1,360.50	390,327,450	
アイダエンジニアリング	37,100	915.00	33,946,500	
TAKI SAWA	3,700	1,225.00	4,532,500	
FUJ I	78,200	2,488.50	194,600,700	
牧野フライス製作所	19,900	5,330.00	106,067,000	
オーエスジー	85,900	1,987.00	170,683,300	
ダイジェット工業	1,600	863.00	1,380,800	
旭ダイヤモンド工業	50,400	820.00	41,328,000	
DMG 森精機	109,000	2,497.50	272,227,500	
ソディック	49,700	712.00	35,386,400	
ディスコ	86,500	21,150.00	1,829,475,000	
日東工器	8,700	1,949.00	16,956,300	
日進工具	15,100	1,156.00	17,455,600	

パンチ工業	12,800	489.00	6,259,200
富士ダイス	6,600	695.00	4,587,000
豊和工業	7,800	794.00	6,193,200
東洋機械金属	9,800	646.00	6,330,800
エンシュウ	3,200	708.00	2,265,600
島精機製作所	28,700	1,916.00	54,989,200
オプトラン	26,600	2,367.00	62,962,200
NCホールディングス	2,900	2,289.00	6,638,100
イワキポンプ	12,000	1,374.00	16,488,000
フリー	18,900	1,064.00	20,109,600
ヤマシンフィルタ	43,100	313.00	13,490,300
日阪製作所	17,500	876.00	15,330,000
やまびこ	29,400	1,524.00	44,805,600
野村マイクロ・サイエンス	6,100	6,470.00	39,467,000
平田機工	8,600	8,340.00	71,724,000
PEGASUS	20,000	560.00	11,200,000
マルマエ	7,900	1,679.00	13,264,100
タツモ	9,900	2,396.00	23,720,400
ナブテスコ	112,900	3,222.00	363,763,800
三井海洋開発	22,600	1,421.00	32,114,600
レオン自動機	19,000	1,456.00	27,664,000
SMC	58,300	80,860.00	4,714,138,000
ホソカワミクロン	12,600	2,970.00	37,422,000
ユニオンツール	7,900	3,320.00	26,228,000
オイレス工業	25,200	1,914.00	48,232,800
日精エー・エス・ビー機械	7,200	4,110.00	29,592,000
サトーホールディングス	25,600	1,943.00	49,740,800
技研製作所	16,900	2,022.00	34,171,800
日本エアータック	9,100	1,177.00	10,710,700
カワタ	4,100	965.00	3,956,500
日精樹脂工業	13,500	980.00	13,230,000
オカダアイヨン	4,300	2,211.00	9,507,300
ワイエイシイホールディングス	5,900	3,360.00	19,824,000
小松製作所	842,300	3,567.00	3,004,484,100
住友重機械工業	106,400	3,352.00	356,652,800
日立建機	71,600	3,805.00	272,438,000

日工	26,900	642.00	17,269,800
巴工業	7,700	2,890.00	22,253,000
井関農機	16,900	1,223.00	20,668,700
TOWA	18,400	2,495.00	45,908,000
丸山製作所	2,400	1,857.00	4,456,800
北川鉄工所	7,200	1,188.00	8,553,600
ローツェ	9,400	11,720.00	110,168,000
タカキタ	4,100	442.00	1,812,200
クボタ	951,300	2,029.50	1,930,663,350
荏原実業	8,700	3,250.00	28,275,000
三菱化工機	5,900	2,763.00	16,301,700
月島ホールディングス	24,400	1,210.00	29,524,000
帝国電機製作所	12,700	2,413.00	30,645,100
新東工業	36,500	1,072.00	39,128,000
澁谷工業	16,900	2,660.00	44,954,000
アイチ コーポレーション	25,200	833.00	20,991,600
小森コーポレーション	41,800	926.00	38,706,800
鶴見製作所	13,800	2,532.00	34,941,600
日本ギア工業	4,900	387.00	1,896,300
酒井重工業	2,300	4,835.00	11,120,500
荏原製作所	73,600	6,607.00	486,275,200
石井鐵工所	1,600	2,478.00	3,964,800
西島製作所	15,600	1,700.00	26,520,000
北越工業	18,100	1,345.00	24,344,500
ダイキン工業	214,600	28,790.00	6,178,334,000
オルガノ	24,700	3,995.00	98,676,500
トーヨーカネツ	6,900	3,440.00	23,736,000
栗田工業	100,600	5,847.00	588,208,200
椿本チエイン	25,500	3,625.00	92,437,500
大同工業	5,800	721.00	4,181,800
木村化工機	13,900	740.00	10,286,000
アネスト岩田	30,600	1,097.00	33,568,200
ダイフク	278,100	2,965.50	824,705,550
サムコ	4,800	6,190.00	29,712,000
加藤製作所	6,700	1,218.00	8,160,600
油研工業	2,200	2,023.00	4,450,600

タダノ	94,900	1,106.50	105,006,850	
フジテック	63,000	3,737.00	235,431,000	
CKD	49,800	2,271.00	113,095,800	
平和	59,800	2,372.00	141,845,600	
理想科学工業	16,000	2,305.00	36,880,000	
SANKYO	35,300	5,823.00	205,551,900	
日本金銭機械	19,800	1,078.00	21,344,400	
マースグループホールディングス	10,600	2,647.00	28,058,200	
フクシマガリレイ	13,200	5,640.00	74,448,000	
オーイズミ	5,400	484.00	2,613,600	
ダイコク電機	9,900	2,910.00	28,809,000	
竹内製作所	32,600	4,195.00	136,757,000	
アマノ	51,000	3,001.00	153,051,000	
JUKI	28,000	580.00	16,240,000	
ジャノメ	18,300	604.00	11,053,200	
マックス	22,200	2,430.00	53,946,000	
グローリー	43,200	2,806.50	121,240,800	
新晃工業	18,200	2,066.00	37,601,200	
大和冷機工業	27,600	1,411.00	38,943,600	
セガサミーホールディングス	144,500	2,894.50	418,255,250	
日本ピストンリング	4,700	1,434.00	6,739,800	
リケン	7,100	2,820.00	20,022,000	
TPR	20,600	1,504.00	30,982,400	
ツバキ・ナカシマ	44,400	852.00	37,828,800	
ホシザキ	115,700	5,312.00	614,598,400	
大豊工業	15,600	832.00	12,979,200	
日本精工	330,300	853.10	281,778,930	
NTN	354,400	289.30	102,527,920	
ジェイテクト	160,000	1,208.00	193,280,000	
不二越	13,300	3,975.00	52,867,500	
日本トムソン	44,200	573.00	25,326,600	
THK	103,700	3,037.00	314,936,900	
ユースン精機	14,300	707.00	10,110,100	
前澤給装工業	12,700	1,139.00	14,465,300	
イーグル工業	19,900	1,637.00	32,576,300	
前澤工業	8,100	774.00	6,269,400	

日本ピラー工業	16,700	4,560.00	76,152,000
キット	66,300	1,097.00	72,731,100
マキタ	223,700	3,867.00	865,047,900
三井E&S	84,300	488.00	41,138,400
日立造船	147,500	869.00	128,177,500
三菱重工業	314,400	6,663.00	2,094,847,200
I H I	113,300	3,780.00	428,274,000
スター精密	34,000	1,831.00	62,254,000
日清紡ホールディングス	146,300	1,103.50	161,442,050
イビデン	103,200	7,664.00	790,924,800
コニカミノルタ	402,300	469.20	188,759,160
ブラザー工業	240,400	2,156.00	518,302,400
ミネベアミツミ	312,800	2,716.00	849,564,800
日立製作所	874,100	8,684.00	7,590,684,400
東芝	345,900	4,533.00	1,567,964,700
三菱電機	1,857,900	2,003.50	3,722,302,650
富士電機	109,300	6,269.00	685,201,700
東洋電機製造	4,500	973.00	4,378,500
安川電機	213,000	6,529.00	1,390,677,000
シンフォニアテクノロジー	19,800	1,672.00	33,105,600
明電舎	27,300	1,915.00	52,279,500
オリジン	3,100	1,252.00	3,881,200
山洋電気	7,800	7,550.00	58,890,000
デンヨー	13,700	1,916.00	26,249,200
PHCホールディングス	25,300	1,446.00	36,583,800
ソシオネクスト	24,700	20,880.00	515,736,000
東芝テック	26,800	4,205.00	112,694,000
芝浦メカトロニクス	3,500	19,440.00	68,040,000
マブチモーター	44,700	3,953.00	176,699,100
ニデック	437,400	7,428.00	3,249,007,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	13,900	573.00	7,964,700
トレックス・セミコンダクター	8,600	2,205.00	18,963,000
東光高岳	11,000	2,123.00	23,353,000
ダブル・スコープ	58,800	1,263.00	74,264,400
ダイヘン	16,200	5,530.00	89,586,000
ヤーマン	31,400	1,166.00	36,612,400

JVCケンウッド	164,500	527.00	86,691,500
ミマキエンジニアリング	17,600	812.00	14,291,200
I-PEX	10,200	1,390.00	14,178,000
大崎電気工業	42,600	541.00	23,046,600
オムロン	164,700	8,985.00	1,479,829,500
日東工業	24,200	3,400.00	82,280,000
IDEC	26,500	3,180.00	84,270,000
正興電機製作所	5,700	1,024.00	5,836,800
不二電機工業	3,100	1,162.00	3,602,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,200	2,571.50	152,232,800
サクサホールディングス	2,900	1,792.00	5,196,800
メルコホールディングス	4,600	3,220.00	14,812,000
テクノメディカ	4,600	1,911.00	8,790,600
日本電気	254,200	6,908.00	1,756,013,600
富士通	179,100	19,085.00	3,418,123,500
沖電気工業	81,300	874.00	71,056,200
岩崎通信機	6,100	819.00	4,995,900
電気興業	7,200	2,274.00	16,372,800
サンケン電気	16,700	12,140.00	202,738,000
ナカヨ	2,200	1,144.00	2,516,800
アイホン	10,900	2,359.00	25,713,100
ルネサスエレクトロニクス	1,173,100	2,475.50	2,904,009,050
セイコーエプソン	230,600	2,202.50	507,896,500
ワコム	137,200	652.00	89,454,400
アルバック	42,700	5,912.00	252,442,400
アクセル	5,500	1,689.00	9,289,500
EIZO	13,200	4,755.00	62,766,000
日本信号	40,900	1,081.00	44,212,900
京三製作所	37,600	443.00	16,656,800
能美防災	24,500	1,853.00	45,398,500
ホーチキ	13,600	1,726.00	23,473,600
星和電機	6,300	487.00	3,068,100
エレコム	43,200	1,538.00	66,441,600
パナソニック ホールディングス	2,123,400	1,647.50	3,498,301,500
シャープ	216,500	809.60	175,278,400
アンリツ	126,600	1,218.00	154,198,800

富士通ゼネラル	50,900	3,242.00	165,017,800
ソニーグループ	1,259,000	13,805.00	17,380,495,000
TDK	284,700	5,532.00	1,574,960,400
帝国通信工業	8,300	1,563.00	12,972,900
タムラ製作所	77,100	689.00	53,121,900
アルプスアルパイン	160,800	1,246.00	200,356,800
池上通信機	4,400	618.00	2,719,200
日本電波工業	21,800	1,308.00	28,514,400
鈴木	10,000	956.00	9,560,000
メイコー	19,800	2,562.00	50,727,600
日本トリム	4,200	2,883.00	12,108,600
ローランド ディー. ジー.	10,000	3,380.00	33,800,000
フォスター電機	16,600	947.00	15,720,200
SMK	4,300	2,349.00	10,100,700
ヨコオ	14,500	1,711.00	24,809,500
ホシデン	42,200	1,803.00	76,086,600
ヒロセ電機	29,700	19,500.00	579,150,000
日本航空電子工業	36,900	2,734.00	100,884,600
TOA	20,400	874.00	17,829,600
マクセル	36,600	1,487.00	54,424,200
古野電気	23,700	1,058.00	25,074,600
スミダコーポレーション	16,800	1,324.00	22,243,200
アイコム	6,900	2,945.00	20,320,500
リオン	7,600	1,860.00	14,136,000
横河電機	196,700	2,714.50	533,942,150
新電元工業	6,900	3,270.00	22,563,000
アズビル	124,300	4,626.00	575,011,800
東亜ディーケーケー	6,900	836.00	5,768,400
日本光電工業	82,300	3,817.00	314,139,100
チノー	7,400	2,279.00	16,864,600
共和電業	12,900	354.00	4,566,600
日本電子材料	11,800	1,658.00	19,564,400
堀場製作所	39,600	7,770.00	307,692,000
アドバンテスト	140,200	18,365.00	2,574,773,000
小野測器	6,000	437.00	2,622,000
エスベック	14,400	2,259.00	32,529,600



キーエンス	178,100	70,010.00	12,468,781,000
日置電機	9,400	9,010.00	84,694,000
シスメックス	153,600	10,100.00	1,551,360,000
日本マイクロニクス	29,500	1,796.00	52,982,000
メガチップス	14,700	3,730.00	54,831,000
OBARA GROUP	9,800	4,085.00	40,033,000
澤藤電機	1,900	1,335.00	2,536,500
原田工業	6,600	808.00	5,332,800
コーセル	21,700	1,197.00	25,974,900
イリソ電子工業	16,400	4,270.00	70,028,000
オプテックスグループ	32,800	1,992.00	65,337,600
千代田インテグレ	6,300	2,408.00	15,170,400
レーザーテック	81,600	21,160.00	1,726,656,000
スタンレー電気	126,800	2,907.00	368,607,600
ウシオ電機	90,600	1,920.50	173,997,300
岡谷電機産業	12,000	272.00	3,264,000
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	613.00	8,152,900
エノモト	3,700	1,660.00	6,142,000
日本セラミック	18,300	2,523.00	46,170,900
遠藤照明	6,500	1,203.00	7,819,500
古河電池	13,400	1,027.00	13,761,800
双信電機	6,600	356.00	2,349,600
山一電機	15,700	2,237.00	35,120,900
図研	15,600	3,610.00	56,316,000
日本電子	44,700	5,099.00	227,925,300
カシオ計算機	132,600	1,211.50	160,644,900
ファナック	873,500	5,130.00	4,481,055,000
日本シイエムケイ	38,500	512.00	19,712,000
エンプラス	5,200	5,650.00	29,380,000
大真空	22,300	643.00	14,338,900
ローム	82,300	12,680.00	1,043,564,000
浜松ホトニクス	142,900	7,130.00	1,018,877,000
三井ハイテック	18,400	9,400.00	172,960,000
新光電気工業	63,000	5,612.00	353,556,000
京セラ	276,500	7,804.00	2,157,806,000
太陽誘電	86,800	4,260.00	369,768,000

村田製作所	539,800	8,509.00	4,593,158,200
双葉電子工業	34,600	512.00	17,715,200
北陸電気工業	5,500	1,211.00	6,660,500
ニチコン	36,600	1,371.00	50,178,600
日本ケミコン	17,800	1,298.00	23,104,400
KOA	27,200	1,703.00	46,321,600
市光工業	26,400	537.00	14,176,800
小糸製作所	214,200	2,681.00	574,270,200
ミツバ	33,400	739.00	24,682,600
SCREENホールディングス	30,400	15,545.00	472,568,000
キヤノン電子	19,900	1,920.00	38,208,000
キヤノン	976,500	3,586.00	3,501,729,000
リコー	446,300	1,232.50	550,064,750
象印マホービン	53,400	1,729.00	92,328,600
MUTOHホールディングス	2,100	1,714.00	3,599,400
東京エレクトロン	376,700	18,955.00	7,140,348,500
イノテック	12,100	1,588.00	19,214,800
トヨタ紡織	75,000	2,427.50	182,062,500
芦森工業	2,600	1,919.00	4,989,400
ユニプレス	32,000	1,058.00	33,856,000
豊田自動織機	130,100	9,302.00	1,210,190,200
モリタホールディングス	31,300	1,528.00	47,826,400
三櫻工業	27,300	738.00	20,147,400
デンソー	367,100	9,188.00	3,372,914,800
東海理化電機製作所	50,200	2,040.00	102,408,000
川崎重工業	134,100	3,427.00	459,560,700
名村造船所	35,500	574.00	20,377,000
日本車輛製造	6,800	2,031.00	13,810,800
三菱ロジスネクスト	28,400	1,190.00	33,796,000
近畿車輛	1,900	1,453.00	2,760,700
日産自動車	2,528,300	524.30	1,325,587,690
いすゞ自動車	517,500	1,737.50	899,156,250
トヨタ自動車	9,773,100	2,069.00	20,220,543,900
日野自動車	229,500	611.50	140,339,250
三菱自動車工業	694,300	479.90	333,194,570
エフテック	9,700	973.00	9,438,100

レシップホールディングス	5,400	491.00	2,651,400	
GMB	2,700	2,893.00	7,811,100	
ファルテック	2,300	617.00	1,419,100	
武蔵精密工業	43,500	1,717.00	74,689,500	
日産車体	31,400	861.00	27,035,400	
新明和工業	55,900	1,303.00	72,837,700	
極東開発工業	29,400	1,691.00	49,715,400	
トピー工業	14,500	2,117.00	30,696,500	
ティラド	4,500	1,790.00	8,055,000	
曙ブレーキ工業	108,600	140.00	15,204,000	
タチエス	28,200	1,494.00	42,130,800	
NOK	69,200	1,999.50	138,365,400	
フタバ産業	47,900	482.00	23,087,800	
KYB	17,200	4,585.00	78,862,000	
大同メタル工業	35,000	492.00	17,220,000	
プレス工業	79,600	586.00	46,645,600	
ミクニ	16,100	413.00	6,649,300	
太平洋工業	40,900	1,285.00	52,556,500	
アイシン	137,300	4,238.00	581,877,400	
マツダ	588,700	1,286.50	757,362,550	
今仙電機製作所	8,900	629.00	5,598,100	
本田技研工業	1,446,800	4,297.00	6,216,899,600	
スズキ	326,900	5,004.00	1,635,807,600	
SUBARU	563,100	2,562.50	1,442,943,750	
安永	6,100	935.00	5,703,500	
ヤマハ発動機	279,700	3,769.00	1,054,189,300	
TBK	13,900	372.00	5,170,800	
エクセディ	29,100	2,232.00	64,951,200	
豊田合成	52,000	2,415.50	125,606,000	
愛三工業	29,500	1,023.00	30,178,500	
盟和産業	2,000	970.00	1,940,000	
日本プラスト	11,000	443.00	4,873,000	
ヨロズ	16,800	858.00	14,414,400	
エフ・シー・シー	31,600	1,777.00	56,153,200	
シマノ	72,800	23,500.00	1,710,800,000	
テイ・エス テック	81,500	1,856.50	151,304,750	

ジャムコ	7,600	1,357.00	10,313,200
テルモ	547,400	4,466.00	2,444,688,400
クリエートメディック	4,500	898.00	4,041,000
日機装	41,500	896.00	37,184,000
日本エム・ディ・エム	10,600	980.00	10,388,000
島津製作所	216,800	4,555.00	987,524,000
JMS	16,500	564.00	9,306,000
長野計器	12,900	1,901.00	24,522,900
ブイ・テクノロジー	8,700	2,552.00	22,202,400
東京計器	13,700	1,271.00	17,412,700
愛知時計電機	6,900	1,667.00	11,502,300
インターアクション	8,400	1,473.00	12,373,200
オーバル	12,300	405.00	4,981,500
東京精密	39,100	6,780.00	265,098,000
マニー	71,200	1,641.50	116,874,800
ニコン	257,300	1,585.00	407,820,500
トプコン	93,700	2,050.50	192,131,850
オリンパス	1,095,600	2,220.00	2,432,232,000
理研計器	11,000	4,955.00	54,505,000
タムロン	13,300	3,630.00	48,279,000
HOYA	380,100	17,435.00	6,627,043,500
シード	7,000	555.00	3,885,000
ノーリツ鋼機	16,900	2,278.00	38,498,200
A&Dホロンホールディングス	26,000	1,704.00	44,304,000
朝日インテック	198,900	2,758.00	548,566,200
シチズン時計	195,700	843.00	164,975,100
リズム	4,300	1,652.00	7,103,600
大研医器	10,400	515.00	5,356,000
メニコン	61,100	2,542.00	155,316,200
シンシア	1,300	552.00	717,600
松風	8,000	2,253.00	18,024,000
セイコーグループ	27,600	2,584.00	71,318,400
ニプロ	148,400	1,008.50	149,661,400
KYORITSU	20,600	142.00	2,925,200
中本パックス	4,200	1,611.00	6,766,200
スノーピーク	30,500	1,912.00	58,316,000

パラマウントベッドホールディングス	41,100	2,438.00	100,201,800
トランザクション	11,700	1,684.00	19,702,800
粧美堂	3,700	378.00	1,398,600
ニホンフラッシュ	16,700	990.00	16,533,000
前田工織	15,000	3,180.00	47,700,000
永大産業	14,700	207.00	3,042,900
アートネイチャー	18,300	753.00	13,779,900
バンダイナムコホールディングス	487,600	3,420.00	1,667,592,000
アイフィスジャパン	3,800	609.00	2,314,200
SHOEI	40,200	2,617.00	105,203,400
フランスベッドホールディングス	22,000	1,110.00	24,420,000
パイロットコーポレーション	27,800	4,485.00	124,683,000
萩原工業	11,900	1,263.00	15,029,700
フジシールインターナショナル	36,000	1,528.00	55,008,000
タカラトミー	81,900	1,726.00	141,359,400
広済堂ホールディングス	9,300	2,271.00	21,120,300
エステールホールディングス	3,200	611.00	1,955,200
タカノ	5,100	737.00	3,758,700
プロネクサス	14,800	979.00	14,489,200
ホクシン	10,600	133.00	1,409,800
ウッドワン	4,600	1,166.00	5,363,600
大建工業	10,800	2,320.00	25,056,000
凸版印刷	232,800	3,053.00	710,738,400
大日本印刷	194,500	3,958.00	769,831,000
共同印刷	5,000	2,959.00	14,795,000
NISSHA	33,800	1,583.00	53,505,400
光村印刷	1,200	1,184.00	1,420,800
TAKARA & COMPANY	11,400	2,250.00	25,650,000
アシックス	164,300	4,062.00	667,386,600
ツツミ	3,100	2,089.00	6,475,900
ローランド	13,100	4,150.00	54,365,000
小松ウオール工業	6,500	2,586.00	16,809,000
ヤマハ	112,200	5,583.00	626,412,600
河合楽器製作所	4,800	3,150.00	15,120,000
クリナップ	19,900	684.00	13,611,600
ピジョン	113,400	2,160.00	244,944,000

キングジム	15,700	921.00	14,459,700
リンテック	35,700	2,242.50	80,057,250
イトーキ	36,500	948.00	34,602,000
任天堂	1,123,700	6,126.00	6,883,786,200
三菱鉛筆	25,300	1,702.00	43,060,600
タカラスタANDARD	32,800	1,790.00	58,712,000
コクヨ	85,700	1,906.50	163,387,050
ナカバヤシ	19,200	484.00	9,292,800
グローブライト	14,400	2,216.00	31,910,400
オカムラ	53,600	1,883.00	100,928,800
美津濃	17,700	3,760.00	66,552,000
東京電力ホールディングス	1,604,400	504.40	809,259,360
中部電力	655,900	1,737.00	1,139,298,300
関西電力	687,300	1,745.00	1,199,338,500
中国電力	283,500	958.70	271,791,450
北陸電力	168,000	812.70	136,533,600
東北電力	435,100	905.10	393,809,010
四国電力	151,900	1,046.50	158,963,350
九州電力	410,300	935.50	383,835,650
北海道電力	172,000	629.60	108,291,200
沖縄電力	41,700	1,231.00	51,332,700
電源開発	134,000	2,123.50	284,549,000
エフオン	11,500	548.00	6,302,000
イーレックス	31,600	1,200.00	37,920,000
レノバ	47,400	1,615.00	76,551,000
東京瓦斯	376,300	3,188.00	1,199,644,400
大阪瓦斯	360,500	2,294.00	826,987,000
東邦瓦斯	70,100	2,538.50	177,948,850
北海道瓦斯	10,600	2,240.00	23,744,000
広島ガス	37,500	369.00	13,837,500
西部ガスホールディングス	16,700	2,147.00	35,854,900
静岡ガス	40,600	1,224.00	49,694,400
メタウォーター	22,300	1,808.00	40,318,400
SBSホールディングス	15,900	3,155.00	50,164,500
東武鉄道	195,500	3,732.00	729,606,000
相鉄ホールディングス	58,800	2,587.50	152,145,000

東急	499,100	1,815.50	906,116,050	
京浜急行電鉄	201,900	1,318.00	266,104,200	
小田急電鉄	269,800	1,982.00	534,743,600	
京王電鉄	94,100	4,711.00	443,305,100	
京成電鉄	114,800	5,591.00	641,846,800	
富士急行	21,900	5,080.00	111,252,000	
東日本旅客鉄道	301,900	7,895.00	2,383,500,500	
西日本旅客鉄道	227,400	5,995.00	1,363,263,000	
東海旅客鉄道	137,100	17,580.00	2,410,218,000	
西武ホールディングス	215,300	1,477.50	318,105,750	
鴻池運輸	30,300	1,545.00	46,813,500	
西日本鉄道	47,500	2,405.00	114,237,500	
ハマキョウレックス	13,900	3,675.00	51,082,500	
サカイ引越センター	8,500	4,810.00	40,885,000	
近鉄グループホールディングス	177,700	4,873.00	865,932,100	
阪急阪神ホールディングス	236,900	4,637.00	1,098,505,300	
南海電気鉄道	84,900	3,203.00	271,934,700	
京阪ホールディングス	97,900	3,627.00	355,083,300	
神戸電鉄	4,800	3,035.00	14,568,000	
名古屋鉄道	196,400	2,359.00	463,307,600	
山陽電気鉄道	13,400	2,199.00	29,466,600	
アルプス物流	14,200	1,370.00	19,454,000	
ヤマトホールディングス	227,500	2,488.50	566,133,750	
山九	45,200	4,908.00	221,841,600	
丸運	6,700	240.00	1,608,000	
丸全昭和運輸	11,000	3,810.00	41,910,000	
センコーグループホールディングス	94,100	957.00	90,053,700	
トナミホールディングス	3,900	4,370.00	17,043,000	
ニッコンホールディングス	56,900	2,765.00	157,328,500	
日本石油輸送	1,400	2,657.00	3,719,800	
福山通運	13,500	3,415.00	46,102,500	
セイノーホールディングス	110,600	1,645.50	181,992,300	
エスライン	3,900	786.00	3,065,400	
神奈川中央交通	5,000	3,175.00	15,875,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	42,900	2,044.00	87,687,600	
C&Fロジホールディングス	17,100	1,186.00	20,280,600	

九州旅客鉄道	125,600	3,033.00	380,944,800
S Gホールディングス	341,000	2,045.00	697,345,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	66,300	8,095.00	536,698,500
日本郵船	475,700	3,003.00	1,428,527,100
商船三井	313,600	3,212.00	1,007,283,200
川崎汽船	133,800	3,182.00	425,751,600
N Sユナイテッド海運	9,900	3,435.00	34,006,500
飯野海運	66,500	818.00	54,397,000
共栄タンカー	3,700	841.00	3,111,700
乾汽船	23,400	1,304.00	30,513,600
日本航空	436,400	2,768.00	1,207,955,200
A N Aホールディングス	483,500	3,143.00	1,519,640,500
パスコ	2,700	1,670.00	4,509,000
トランコム	5,200	6,660.00	34,632,000
日新	13,500	2,436.00	32,886,000
三菱倉庫	38,200	3,491.00	133,356,200
三井倉庫ホールディングス	16,600	3,470.00	57,602,000
住友倉庫	47,900	2,337.00	111,942,300
澁澤倉庫	7,100	2,463.00	17,487,300
東陽倉庫	18,300	271.00	4,959,300
日本トランスシティ	35,800	609.00	21,802,200
ケイヒン	2,400	1,710.00	4,104,000
中央倉庫	8,600	1,036.00	8,909,600
川西倉庫	2,300	1,005.00	2,311,500
安田倉庫	12,100	975.00	11,797,500
ファイズホールディングス	2,500	1,240.00	3,100,000
東洋埠頭	4,000	1,334.00	5,336,000
上組	85,200	3,186.00	271,447,200
サンリツ	3,100	717.00	2,222,700
キムラユニティー	6,600	1,129.00	7,451,400
キューソー流通システム	8,300	959.00	7,959,700
東海運	8,100	282.00	2,284,200
エーアイテイー	11,100	1,728.00	19,180,800
内外トランスライン	6,400	2,494.00	15,961,600
日本コンセプト	5,500	1,669.00	9,179,500



NEC ネットエスアイ	59,700	1,984.00	118,444,800
クロスキャット	10,300	1,168.00	12,030,400
システナ	300,400	304.00	91,321,600
デジタルアーツ	11,300	5,950.00	67,235,000
日鉄ソリューションズ	30,500	4,055.00	123,677,500
キューブシステム	10,700	1,255.00	13,428,500
コア	7,900	1,715.00	13,548,500
手間いらず	3,000	3,955.00	11,865,000
ラクーンホールディングス	14,900	763.00	11,368,700
ソリトンシステムズ	9,300	1,190.00	11,067,000
ソフトクリエイトホールディングス	14,700	1,693.00	24,887,100
T I S	195,300	3,662.00	715,188,600
J N Sホールディングス	6,500	539.00	3,503,500
グリー	48,000	673.00	32,304,000
GMOペパボ	2,600	1,780.00	4,628,000
コーエーテクモホールディングス	111,900	2,353.00	263,300,700
三菱総合研究所	8,800	5,300.00	46,640,000
電算	1,700	1,626.00	2,764,200
A G S	5,900	717.00	4,230,300
ファインデックス	14,300	620.00	8,866,000
ブレインパッド	13,400	994.00	13,319,600
K L a b	35,600	344.00	12,246,400
ポールトゥウィンホールディングス	30,600	883.00	27,019,800
ネクソン	462,400	2,863.50	1,324,082,400
アイスタイル	52,000	650.00	33,800,000
エムアップホールディングス	21,900	1,183.00	25,907,700
エイチーム	10,600	695.00	7,367,000
エニグモ	22,900	401.00	9,182,900
テクノスジャパン	11,500	619.00	7,118,500
コロプラ	69,400	675.00	46,845,000
ブロードリーフ	104,400	440.00	45,936,000
クロス・マーケティンググループ	8,500	774.00	6,579,000
デジタルハーツホールディングス	11,200	1,291.00	14,459,200
システム情報	14,300	749.00	10,710,700
メディアドゥ	7,200	1,468.00	10,569,600
じげん	52,100	734.00	38,241,400

ブイキューブ	21,600	509.00	10,994,400
エンカレッジ・テクノロジー	3,400	519.00	1,764,600
サイバーリンクス	4,600	676.00	3,109,600
フィックスターズ	20,200	1,367.00	27,613,400
CARTA HOLDINGS	8,400	1,349.00	11,331,600
オブティム	14,800	1,057.00	15,643,600
セレス	7,200	999.00	7,192,800
SHIFT	11,900	25,505.00	303,509,500
ティーガイア	18,700	1,748.00	32,687,600
セック	1,900	3,325.00	6,317,500
テクマトリックス	32,600	1,843.00	60,081,800
プロシップ	7,800	1,450.00	11,310,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52,300	2,843.50	148,715,050
GMOペイメントゲートウェイ	35,700	11,565.00	412,870,500
ザッパラス	4,000	365.00	1,460,000
システムリサーチ	5,600	2,526.00	14,145,600
インターネットイニシアティブ	99,600	2,785.00	277,386,000
さくらインターネット	20,100	695.00	13,969,500
ヴィンクス	4,200	1,465.00	6,153,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,500	3,275.00	18,012,500
SRAホールディングス	9,200	3,245.00	29,854,000
システムインテグレータ	4,300	460.00	1,978,000
朝日ネット	19,300	606.00	11,695,800
eBASE	25,200	781.00	19,681,200
アバントグループ	22,600	1,473.00	33,289,800
アドソル日進	7,500	1,816.00	13,620,000
ODKソリューションズ	3,200	575.00	1,840,000
フリービット	9,400	1,800.00	16,920,000
コムチュア	23,600	2,182.00	51,495,200
サイバーコム	2,300	1,533.00	3,525,900
アステリア	14,100	781.00	11,012,100
アイル	8,400	2,761.00	23,192,400
マークライنز	9,700	2,557.00	24,802,900
メディカル・データ・ビジョン	26,800	744.00	19,939,200
gumi	26,400	671.00	17,714,400
ショーケース	3,400	415.00	1,411,000

モバイルファクトリー	3,000	909.00	2,727,000
テラスカイ	7,700	2,689.00	20,705,300
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,400	1,571.00	16,338,400
P C I ホールディングス	5,400	1,029.00	5,556,600
アイビーシー	2,300	637.00	1,465,100
ネオジャパン	6,000	965.00	5,790,000
P R T I M E S	4,500	1,435.00	6,457,500
ラクス	84,500	2,379.50	201,067,750
ランドコンピュータ	3,400	1,321.00	4,491,400
ダブルスタンダード	7,300	2,509.00	18,315,700
オープンドア	12,500	1,202.00	15,025,000
アカツキ	8,500	2,129.00	18,096,500
ベネフィットジャパン	900	1,215.00	1,093,500
U b i c o mホールディングス	5,600	1,745.00	9,772,000
カナミックネットワーク	19,400	440.00	8,536,000
ノムラシステムコーポレーション	13,600	119.00	1,618,400
チェンジホールディングス	43,800	2,098.00	91,892,400
シンクロ・フード	8,900	684.00	6,087,600
オークネット	8,900	1,667.00	14,836,300
キャピタル・アセット・プランニング	2,800	729.00	2,041,200
セグエグループ	3,900	1,091.00	4,254,900
エイトレッド	2,100	1,368.00	2,872,800
マクロミル	35,100	874.00	30,677,400
ビーグリー	2,400	1,178.00	2,827,200
オロ	5,400	2,212.00	11,944,800
ユーザーローカル	6,500	3,050.00	19,825,000
テモナ	3,500	285.00	997,500
ニーズウェル	7,700	726.00	5,590,200
マネーフォワード	43,100	6,248.00	269,288,800
サインポスト	5,400	509.00	2,748,600
S u n A s t e r i s k	12,700	1,232.00	15,646,400
電算システムホールディングス	8,600	3,490.00	30,014,000
A p p i e r G r o u p	67,700	1,593.00	107,846,100
ソルクシーズ	11,400	441.00	5,027,400
フェイス	4,000	503.00	2,012,000
プロトコーポレーション	22,400	1,151.00	25,782,400

ハイマックス	5,600	1,455.00	8,148,000
野村総合研究所	355,600	3,744.00	1,331,366,400
サイバネットシステム	15,000	878.00	13,170,000
C Eホールディングス	7,300	598.00	4,365,400
日本システム技術	5,800	2,498.00	14,488,400
インテージホールディングス	20,200	1,605.00	32,421,000
東邦システムサイエンス	3,900	1,229.00	4,793,100
ソースネクスト	91,100	207.00	18,857,700
インフォコム	23,000	2,325.00	53,475,000
シンプレクス・ホールディングス	30,500	2,418.00	73,749,000
HEROZ	6,000	2,189.00	13,134,000
ラクスル	42,900	1,358.00	58,258,200
メルカリ	107,500	3,115.00	334,862,500
I P S	5,800	2,256.00	13,084,800
F I G	16,300	281.00	4,580,300
システムサポート	6,900	2,030.00	14,007,000
イーソル	11,500	982.00	11,293,000
アルテリア・ネットワークス	16,700	1,967.00	32,848,900
東海ソフト	2,100	1,028.00	2,158,800
ウイングアーク1 s t	18,400	2,479.00	45,613,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,800	1,510.00	7,248,000
サーバーワークス	3,700	3,305.00	12,228,500
東名	1,100	2,395.00	2,634,500
ヴィッツ	1,400	1,421.00	1,989,400
トビラシステムズ	3,500	1,084.00	3,794,000
S a n s a n	58,500	1,791.50	104,802,750
L i n k - U	3,400	1,159.00	3,940,600
ギフトィ	19,400	1,912.00	37,092,800
メドレー	24,000	5,180.00	124,320,000
ベース	6,100	5,310.00	32,391,000
J M D C	29,300	5,850.00	171,405,000
フォーカスシステムズ	13,100	1,088.00	14,252,800
クレスコ	13,800	2,008.00	27,710,400
フジ・メディア・ホールディングス	171,500	1,361.00	233,411,500
オービック	59,700	24,025.00	1,434,292,500

ジャストシステム	25,700	4,326.00	111,178,200
TDCソフト	15,100	1,655.00	24,990,500
Zホールディングス	2,540,600	355.10	902,167,060
トレンドマイクロ	103,100	6,900.00	711,390,000
IDホールディングス	12,100	1,179.00	14,265,900
日本オラクル	34,200	11,080.00	378,936,000
アルファシステムズ	5,600	3,555.00	19,908,000
フューチャー	44,500	1,788.00	79,566,000
CAC Holdings	11,000	1,748.00	19,228,000
SBテクノロジー	7,600	2,519.00	19,144,400
トーセ	4,100	760.00	3,116,000
オービックビジネスコンサルタント	35,100	5,470.00	191,997,000
伊藤忠テクノソリューションズ	95,900	3,668.00	351,761,200
アイティフォー	23,600	1,058.00	24,968,800
東計電算	2,500	6,500.00	16,250,000
エクスネット	2,000	1,048.00	2,096,000
大塚商会	101,200	5,584.00	565,100,800
サイボウズ	24,600	2,433.00	59,851,800
電通国際情報サービス	21,700	5,300.00	115,010,000
ACCESS	21,200	1,012.00	21,454,400
デジタルガレージ	31,700	3,865.00	122,520,500
EMシステムズ	29,800	831.00	24,763,800
ウェザーニューズ	5,500	6,720.00	36,960,000
C I J	29,800	647.00	19,280,600
ビジネスエンジニアリング	3,000	3,510.00	10,530,000
日本エンタープライズ	14,900	134.00	1,996,600
WOWOW	13,500	1,131.00	15,268,500
スカラ	16,600	789.00	13,097,400
インテリジェント ウェイブ	7,500	811.00	6,082,500
IMAGICA GROUP	15,000	594.00	8,910,000
ネットワンシステムズ	66,500	3,367.00	223,905,500
システムソフト	63,100	78.00	4,921,800
アルゴグラフィックス	16,400	4,080.00	66,912,000
マーベラス	29,100	665.00	19,351,500
エイベックス	30,400	1,511.00	45,934,400
B I P R O G Y	65,700	3,429.00	225,285,300

都築電気	9,400	1,842.00	17,314,800
TBSホールディングス	91,400	2,389.00	218,354,600
日本テレビホールディングス	158,100	1,314.50	207,822,450
朝日放送グループホールディングス	16,800	647.00	10,869,600
テレビ朝日ホールディングス	43,400	1,603.00	69,570,200
スカパーJ SATホールディングス	158,500	561.00	88,918,500
テレビ東京ホールディングス	12,900	2,956.00	38,132,400
日本BS放送	5,100	915.00	4,666,500
ビジョン	23,600	1,822.00	42,999,200
スマートバリュー	3,500	397.00	1,389,500
USEN-NEXT HOLDINGS	20,000	3,400.00	68,000,000
ワイヤレスゲート	6,400	229.00	1,465,600
日本通信	165,000	275.00	45,375,000
クロップス	2,300	1,041.00	2,394,300
日本電信電話	2,287,300	4,118.00	9,419,101,400
KDDI	1,379,400	4,474.00	6,171,435,600
ソフトバンク	2,868,300	1,517.00	4,351,211,100
光通信	21,000	21,425.00	449,925,000
エムティーアイ	12,400	637.00	7,898,800
GMOインターネットグループ	66,000	2,698.50	178,101,000
ファイバーゲート	9,700	1,567.00	15,199,900
アイドママーケティングコミュニケーション	4,100	274.00	1,123,400
KADOKAWA	94,400	3,345.00	315,768,000
学研ホールディングス	29,800	881.00	26,253,800
ゼンリン	30,600	903.00	27,631,800
昭文社ホールディングス	6,200	298.00	1,847,600
インプレスホールディングス	12,600	206.00	2,595,600
アイネット	10,900	1,554.00	16,938,600
松竹	10,200	11,625.00	118,575,000
東宝	111,700	5,576.00	622,839,200
東映	4,900	18,100.00	88,690,000
エヌ・ティ・ティ・データ	560,100	2,059.00	1,153,245,900
ピー・シー・エー	10,300	1,338.00	13,781,400
ビジネスブレイン太田昭和	7,700	2,355.00	18,133,500
DTS	38,000	3,505.00	133,190,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	89,700	6,619.00	593,724,300

シーイーシー	25,100	1,683.00	42,243,300	
カプコン	177,400	5,695.00	1,010,293,000	
アイ・エス・ビー	9,100	1,648.00	14,996,800	
ジャステック	11,000	1,317.00	14,487,000	
S C S K	145,700	2,285.00	332,924,500	
N S W	7,000	2,466.00	17,262,000	
アイネス	12,600	1,464.00	18,446,400	
T K C	28,500	3,800.00	108,300,000	
富士ソフト	20,200	9,060.00	183,012,000	
N S D	63,700	2,843.00	181,099,100	
コナミグループ	76,400	7,808.00	596,531,200	
福井コンピュータホールディングス	12,400	2,969.00	36,815,600	
J B C Cホールディングス	13,000	2,392.00	31,096,000	
ミロク情報サービス	16,300	1,576.00	25,688,800	
ソフトバンクグループ	880,600	5,995.00	5,279,197,000	
高千穂交易	5,200	2,899.00	15,074,800	
オルバヘルスケアホールディングス	2,200	1,928.00	4,241,600	
伊藤忠食品	4,200	5,200.00	21,840,000	
エレマテック	16,900	1,755.00	29,659,500	
あらた	14,400	4,615.00	66,456,000	
トーメンデバイス	2,700	5,720.00	15,444,000	
東京エレクトロン デバイス	7,000	10,540.00	73,780,000	
円谷フィールズホールディングス	32,300	2,614.00	84,432,200	
双日	187,700	3,071.00	576,426,700	
アルフレッサ ホールディングス	189,000	2,175.00	411,075,000	
横浜冷凍	51,300	1,170.00	60,021,000	
ラサ商事	6,700	1,397.00	9,359,900	
アルコニックス	24,800	1,350.00	33,480,000	
神戸物産	145,700	3,965.00	577,700,500	
ハイパー	2,800	437.00	1,223,600	
あい ホールディングス	30,100	2,344.00	70,554,400	
ディーブイエックス	4,100	924.00	3,788,400	
ダイワボウホールディングス	77,000	2,806.00	216,062,000	
マクニカホールディングス	44,600	5,330.00	237,718,000	
ラクト・ジャパン	7,300	1,992.00	14,541,600	
グリムス	7,900	2,906.00	22,957,400	

バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,500	910.00	25,025,000
八洲電機	15,200	1,356.00	20,611,200
メディアスホールディングス	12,100	887.00	10,732,700
レスターホールディングス	18,000	2,432.00	43,776,000
ジューテックホールディングス	3,400	1,144.00	3,889,600
大光	6,200	578.00	3,583,600
OCHIホールディングス	3,400	1,239.00	4,212,600
TOKAIホールディングス	93,000	885.00	82,305,000
黒谷	4,100	593.00	2,431,300
Cominix	2,900	780.00	2,262,000
三洋貿易	21,300	1,361.00	28,989,300
ビューティガレージ	3,000	4,270.00	12,810,000
ウイン・パートナーズ	13,700	1,010.00	13,837,000
ミタチ産業	3,700	1,414.00	5,231,800
シップヘルスケアホールディングス	67,700	2,412.50	163,326,250
明治電機工業	7,000	1,340.00	9,380,000
デリカフーズホールディングス	5,800	594.00	3,445,200
スターティアホールディングス	2,900	1,208.00	3,503,200
コメダホールディングス	46,100	2,664.00	122,810,400
ピーバンドットコム	2,100	471.00	989,100
アセンテック	6,400	749.00	4,793,600
富士興産	3,300	1,408.00	4,646,400
協栄産業	1,400	2,090.00	2,926,000
フルサト・マルカホールディングス	18,700	2,403.00	44,936,100
ヤマエグループホールディングス	10,700	2,938.00	31,436,600
小野建	18,500	1,536.00	28,416,000
南陽	2,800	2,161.00	6,050,800
佐鳥電機	9,200	1,704.00	15,676,800
エコートレーディング	2,900	785.00	2,276,500
伯東	10,800	5,020.00	54,216,000
コンドーテック	14,500	1,111.00	16,109,500
中山福	7,900	350.00	2,765,000
ナガイレーベン	23,800	2,184.00	51,979,200
三菱食品	17,400	3,550.00	61,770,000
松田産業	14,300	2,153.00	30,787,900
第一興商	72,900	2,529.00	184,364,100



メディopalホールディングス	180,100	2,324.00	418,552,400
S P K	8,400	1,742.00	14,632,800
萩原電気ホールディングス	7,200	3,015.00	21,708,000
アズワン	26,800	5,772.00	154,689,600
スズデン	6,600	2,217.00	14,632,200
尾家産業	3,500	1,199.00	4,196,500
シモジマ	12,900	1,127.00	14,538,300
ドウシシャ	19,900	2,197.00	43,720,300
小津産業	3,300	1,613.00	5,322,900
高速	9,800	2,059.00	20,178,200
たけびし	7,200	1,699.00	12,232,800
リックス	3,000	2,941.00	8,823,000
丸文	16,800	1,248.00	20,966,400
ハピネット	16,000	2,070.00	33,120,000
橋本総業ホールディングス	7,500	1,178.00	8,835,000
日本ライフライン	55,200	1,064.00	58,732,800
タカショー	16,400	676.00	11,086,400
I D O M	57,000	864.00	49,248,000
進和	11,500	2,175.00	25,012,500
エスケイジャパン	3,600	566.00	2,037,600
ダイトロン	7,400	2,996.00	22,170,400
シークス	26,900	1,563.00	42,044,700
田中商事	4,200	623.00	2,616,600
オーハシテクニカ	9,100	1,565.00	14,241,500
白銅	6,800	2,327.00	15,823,600
ダイコー通産	1,500	1,111.00	1,666,500
伊藤忠商事	1,160,400	5,429.00	6,299,811,600
丸紅	1,469,600	2,243.50	3,297,047,600
高島	2,300	3,530.00	8,119,000
長瀬産業	86,300	2,386.50	205,954,950
蝶理	10,100	2,692.00	27,189,200
豊田通商	165,000	6,842.00	1,128,930,000
三共生興	27,100	555.00	15,040,500
兼松	73,100	1,947.00	142,325,700
ツカモトコーポレーション	2,100	1,326.00	2,784,600
三井物産	1,336,400	5,042.00	6,738,128,800

日本紙パルプ商事	10,000	5,020.00	50,200,000
カメイ	20,000	1,377.00	27,540,000
東都水産	800	6,500.00	5,200,000
OUGホールディングス	2,200	2,443.00	5,374,600
スターゼン	14,300	2,377.00	33,991,100
山善	50,800	1,098.00	55,778,400
椿本興業	3,000	3,935.00	11,805,000
住友商事	1,166,200	2,892.50	3,373,233,500
内田洋行	7,600	5,690.00	43,244,000
三菱商事	1,164,700	6,287.00	7,322,468,900
第一実業	6,600	5,800.00	38,280,000
キヤノンマーケティングジャパン	43,600	3,550.00	154,780,000
西華産業	7,400	2,025.00	14,985,000
佐藤商事	13,100	1,406.00	18,418,600
菱洋エレクトロ	16,100	3,310.00	53,291,000
東京産業	17,200	856.00	14,723,200
ユアサ商事	17,000	4,450.00	75,650,000
神鋼商事	4,700	5,560.00	26,132,000
トルク	8,000	227.00	1,816,000
阪和興業	33,800	4,380.00	148,044,000
正栄食品工業	12,500	4,025.00	50,312,500
カナデン	12,600	1,259.00	15,863,400
RYODEN	15,200	2,080.00	31,616,000
岩谷産業	42,900	7,527.00	322,908,300
ナイス	4,000	1,451.00	5,804,000
ニチモウ	1,800	3,580.00	6,444,000
極東貿易	11,300	1,624.00	18,351,200
アステナホールディングス	32,600	456.00	14,865,600
三愛オブリ	49,800	1,481.00	73,753,800
稲畑産業	38,000	3,095.00	117,610,000
G S I クレオス	10,900	1,907.00	20,786,300
明和産業	25,100	683.00	17,143,300
クワザワホールディングス	4,700	450.00	2,115,000
ワキタ	34,700	1,297.00	45,005,900
東邦ホールディングス	46,900	2,628.50	123,276,650
サンゲツ	47,300	2,442.00	115,506,600

ミツウロコグループホールディングス	24,000	1,345.00	32,280,000
シナネンホールディングス	6,100	3,815.00	23,271,500
伊藤忠エネクス	46,700	1,219.00	56,927,300
サンリオ	53,400	5,727.00	305,821,800
サンワテクノス	9,600	2,337.00	22,435,200
リョーサン	20,000	4,020.00	80,400,000
新光商事	25,300	1,182.00	29,904,600
トーホー	8,100	2,460.00	19,926,000
三信電気	7,600	2,095.00	15,922,000
東陽テクニカ	19,100	1,386.00	26,472,600
モスフードサービス	27,700	3,175.00	87,947,500
加賀電子	15,300	5,620.00	85,986,000
ソーダニッカ	10,700	792.00	8,474,400
立花エレテック	13,800	2,751.00	37,963,800
フォーバル	7,400	1,035.00	7,659,000
PAL TAC	29,600	5,120.00	151,552,000
三谷産業	33,000	314.00	10,362,000
西本Wismettacホールディングス	4,800	4,510.00	21,648,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,071.00	2,485,200
コア商事ホールディングス	10,600	701.00	7,430,600
KPPグループホールディングス	43,900	614.00	26,954,600
ヤマタネ	8,300	1,627.00	13,504,100
丸紅建材リース	1,300	2,193.00	2,850,900
泉州電業	9,400	3,585.00	33,699,000
トラスコ中山	39,600	2,235.00	88,506,000
オートバックスセブン	65,600	1,533.00	100,564,800
モリト	13,500	1,030.00	13,905,000
加藤産業	23,300	3,965.00	92,384,500
北恵	3,300	735.00	2,425,500
イエローハット	33,200	1,848.00	61,353,600
JKホールディングス	14,500	961.00	13,934,500
日伝	11,200	2,239.00	25,076,800
北沢産業	7,900	379.00	2,994,100
杉本商事	8,400	2,046.00	17,186,400
因幡電機産業	48,800	3,290.00	160,552,000
東テク	6,300	4,305.00	27,121,500

ミスミグループ本社	284,200	3,013.00	856,294,600
アルテック	8,300	273.00	2,265,900
タキヒヨー	3,600	937.00	3,373,200
蔵王産業	2,400	2,222.00	5,332,800
スズケン	55,100	3,612.00	199,021,200
ジェコス	11,300	863.00	9,751,900
グローセル	17,700	410.00	7,257,000
ローソン	46,800	6,211.00	290,674,800
サンエー	14,500	4,555.00	66,047,500
カワチ薬品	15,000	2,192.00	32,880,000
エービーシー・マート	27,500	8,176.00	224,840,000
ハードオフコーポレーション	6,200	1,379.00	8,549,800
アスクル	39,200	1,875.00	73,500,000
ゲオホールディングス	18,700	1,672.00	31,266,400
アダストリア	22,900	2,970.00	68,013,000
くら寿司	22,200	3,090.00	68,598,000
キャンドウ	6,900	2,443.00	16,856,700
I Kホールディングス	6,000	374.00	2,244,000
パルグループホールディングス	18,600	3,755.00	69,843,000
エディオン	74,900	1,407.00	105,384,300
サーラコーポレーション	40,300	770.00	31,031,000
ワッツ	7,900	704.00	5,561,600
ハローズ	8,700	3,420.00	29,754,000
あみやき亭	4,700	3,515.00	16,520,500
大黒天物産	5,900	5,070.00	29,913,000
ハニーズホールディングス	15,200	1,507.00	22,906,400
ファーマライズホールディングス	4,000	617.00	2,468,000
アルペン	15,800	1,994.00	31,505,200
ハブ	5,500	771.00	4,240,500
クオールホールディングス	26,200	1,805.00	47,291,000
ジズホールディングス	11,300	3,145.00	35,538,500
ビックカメラ	100,700	1,070.00	107,749,000
DCMホールディングス	109,900	1,245.00	136,825,500
Monotaro	267,200	2,039.50	544,954,400
東京一番フーズ	4,400	496.00	2,182,400
きちりホールディングス	3,400	911.00	3,097,400

アークランドサービスホールディングス	15,600	2,952.00	46,051,200
J. フロント リテイリング	234,500	1,410.00	330,645,000
ドトール・日レスホールディングス	33,700	2,047.00	68,983,900
マツキヨココカラ&カンパニー	114,300	7,886.00	901,369,800
ブロンコビリー	10,200	2,881.00	29,386,200
ZOZO	124,600	2,955.00	368,193,000
トレジャー・ファクトリー	9,400	1,595.00	14,993,000
物語コーポレーション	31,600	3,340.00	105,544,000
三越伊勢丹ホールディングス	317,400	1,402.00	444,994,800
H a m e e	7,000	948.00	6,636,000
マーケットエンタープライズ	1,900	1,383.00	2,627,700
ウエルシアホールディングス	97,900	2,920.00	285,868,000
クリエイトSDホールディングス	31,300	3,490.00	109,237,000
丸善CHIホールディングス	18,800	350.00	6,580,000
ミサワ	3,500	616.00	2,156,000
ティーライフ	2,400	1,399.00	3,357,600
チムニー	4,500	1,248.00	5,616,000
シュッピン	14,500	1,097.00	15,906,500
オイシックス・ラ・大地	25,500	2,262.00	57,681,000
ネクステージ	43,200	2,770.00	119,664,000
ジョイフル本田	56,200	1,759.00	98,855,800
鳥貴族ホールディングス	7,200	2,470.00	17,784,000
ホットランド	14,700	1,727.00	25,386,900
すかいらーくホールディングス	257,700	1,847.00	475,971,900
SFPホールディングス	10,300	2,017.00	20,775,100
綿半ホールディングス	15,000	1,364.00	20,460,000
ヨシックスホールディングス	3,100	2,250.00	6,975,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	61,800	1,112.00	68,721,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,100	868.00	7,898,800
B E E N O S	8,300	1,849.00	15,346,700
あさひ	16,100	1,276.00	20,543,600
日本調剤	13,300	1,170.00	15,561,000
コスモス薬品	18,700	13,740.00	256,938,000
トーエル	7,200	786.00	5,659,200
セブン&アイ・ホールディングス	649,000	6,156.00	3,995,244,000

クリエイト・レストランズ・ホールディングス	141,600	1,002.00	141,883,200
ツルハホールディングス	39,600	9,902.00	392,119,200
サンマルクホールディングス	15,400	1,910.00	29,414,000
フェリシモ	3,800	1,011.00	3,841,800
トリドールホールディングス	47,000	2,960.00	139,120,000
TOKYO BASE	20,500	465.00	9,532,500
ウイルプラスホールディングス	2,800	1,168.00	3,270,400
JMホールディングス	14,500	2,030.00	29,435,000
サツドラホールディングス	7,300	791.00	5,774,300
アレンザホールディングス	14,600	996.00	14,541,600
串カツ田中ホールディングス	5,300	1,690.00	8,957,000
バロックジャパンリミテッド	12,800	839.00	10,739,200
クスリのアオキホールディングス	16,900	7,597.00	128,389,300
力の源ホールディングス	8,400	1,401.00	11,768,400
FOOD & LIFE COMPANIES	100,600	3,130.00	314,878,000
メディカルシステムネットワーク	17,700	368.00	6,513,600
はるやまホールディングス	7,300	480.00	3,504,000
ノジマ	61,800	1,401.00	86,581,800
カッパ・クリエイト	29,600	1,507.00	44,607,200
ライトオン	11,000	563.00	6,193,000
良品計画	206,000	1,388.50	286,031,000
パリティホールディングス	19,900	325.00	6,467,500
アドヴァングループ	18,500	956.00	17,686,000
アルビス	6,400	2,393.00	15,315,200
コナカ	16,000	362.00	5,792,000
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,607.00	3,374,700
G-7ホールディングス	23,900	1,293.00	30,902,700
イオン北海道	28,000	861.00	24,108,000
コジマ	32,100	566.00	18,168,600
ヒマラヤ	5,200	938.00	4,877,600
コーナン商事	25,500	3,525.00	89,887,500
エコス	7,300	1,881.00	13,731,300
ワタミ	22,700	906.00	20,566,200
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	380,200	2,521.00	958,484,200
西松屋チェーン	42,000	1,643.00	69,006,000

ゼンショーホールディングス	103,200	6,048.00	624,153,600
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,003.00	12,336,900
ハークスレイ	6,000	622.00	3,732,000
サイゼリヤ	28,000	3,585.00	100,380,000
VTホールディングス	72,600	524.00	38,042,400
魚力	6,100	2,165.00	13,206,500
フジ・コーポレーション	11,000	1,343.00	14,773,000
ユナイテッドアローズ	20,300	2,428.00	49,288,400
ハイデイ日高	28,200	2,359.00	66,523,800
YU-WA Creation Holdings	11,400	195.00	2,223,000
コロワイド	86,800	2,000.00	173,600,000
ピーシーデポコーポレーション	22,100	479.00	10,585,900
壺番屋	15,000	5,370.00	80,550,000
PLANT	4,200	693.00	2,910,600
スギホールディングス	38,000	5,905.00	224,390,000
薬王堂ホールディングス	10,700	2,607.00	27,894,900
スクロール	28,500	922.00	26,277,000
ヨンドシーホールディングス	16,500	1,778.00	29,337,000
木曽路	28,700	2,384.00	68,420,800
SRSホールディングス	31,600	953.00	30,114,800
千趣会	35,900	415.00	14,898,500
リテールパートナーズ	28,300	1,686.00	47,713,800
ケーヨー	30,500	815.00	24,857,500
上新電機	17,000	1,968.00	33,456,000
日本瓦斯	101,200	1,948.00	197,137,600
ロイヤルホールディングス	36,500	2,690.00	98,185,000
いなげや	18,400	1,600.00	29,440,000
チヨダ	18,600	863.00	16,051,800
ライフコーポレーション	16,500	3,060.00	50,490,000
リンガーハット	24,300	2,437.00	59,219,100
MrMaxHD	27,200	617.00	16,782,400
AOKIホールディングス	35,600	831.00	29,583,600
オークワ	30,300	863.00	26,148,900
コメリ	29,200	2,963.00	86,519,600
青山商事	40,700	1,285.00	52,299,500

しまむら	22,200	13,100.00	290,820,000	
はせがわ	8,500	343.00	2,915,500	
高島屋	142,100	1,867.50	265,371,750	
松屋	32,100	1,175.00	37,717,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	91,800	1,457.00	133,752,600	
近鉄百貨店	8,300	2,531.00	21,007,300	
丸井グループ	138,900	2,422.00	336,415,800	
アクシアル リテイリング	13,000	3,385.00	44,005,000	
イオン	638,400	2,796.50	1,785,285,600	
イズミ	28,700	3,364.00	96,546,800	
平和堂	31,600	2,119.00	66,960,400	
フジ	29,000	1,824.00	52,896,000	
ヤオコー	21,300	7,122.00	151,698,600	
ゼビオホールディングス	26,000	1,123.00	29,198,000	
ケーズホールディングス	133,500	1,257.50	167,876,250	
O l y m p i c グループ	6,400	552.00	3,532,800	
日産東京販売ホールディングス	20,300	343.00	6,962,900	
シルバーライフ	4,000	1,252.00	5,008,000	
Genky Drug Stores	8,400	4,130.00	34,692,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	956.00	2,772,400	
ブックオフグループホールディングス	10,000	1,260.00	12,600,000	
ギフトホールディングス	4,100	5,200.00	21,320,000	
アインホールディングス	26,000	5,200.00	135,200,000	
元気寿司	5,500	3,270.00	17,985,000	
ヤマダホールディングス	773,400	430.80	333,180,720	
アークランズ	27,900	1,581.00	44,109,900	
ニトリホールディングス	76,200	17,395.00	1,325,499,000	
グルメ杵屋	15,800	1,055.00	16,669,000	
愛眼	10,800	192.00	2,073,600	
ケーユーホールディングス	11,400	1,264.00	14,409,600	
吉野家ホールディングス	73,900	2,575.00	190,292,500	
松屋フーズホールディングス	9,000	4,110.00	36,990,000	
サガミホールディングス	30,700	1,254.00	38,497,800	
関西フードマーケット	17,400	1,523.00	26,500,200	
王将フードサービス	12,500	6,440.00	80,500,000	
ミニストップ	13,800	1,461.00	20,161,800	



アークス	34,800	2,428.00	84,494,400
バローホールディングス	36,200	1,924.00	69,648,800
ベルク	9,500	6,090.00	57,855,000
大庄	8,400	1,109.00	9,315,600
ファーストリテイリング	84,700	34,790.00	2,946,713,000
サンドラッグ	71,600	4,184.00	299,574,400
サックスパー ホールディングス	18,400	969.00	17,829,600
ヤマザワ	3,100	1,246.00	3,862,600
やまや	3,200	2,660.00	8,512,000
ベルーナ	46,100	696.00	32,085,600
いよぎんホールディングス	208,600	746.50	155,719,900
しずおかフィナンシャルグループ	396,100	1,011.00	400,457,100
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	147,600	857.50	126,567,000
楽天銀行	59,700	1,885.00	112,534,500
島根銀行	4,700	480.00	2,256,000
じもとホールディングス	12,000	390.00	4,680,000
めぶきフィナンシャルグループ	869,800	338.40	294,340,320
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,400	3,115.00	69,776,000
九州フィナンシャルグループ	308,400	543.20	167,522,880
ゆうちょ銀行	491,200	1,087.00	533,934,400
富山第一銀行	58,200	683.00	39,750,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	940,600	548.90	516,295,340
西日本フィナンシャルホールディングス	108,800	1,186.00	129,036,800
三十三フィナンシャルグループ	15,700	1,541.00	24,193,700
第四北越フィナンシャルグループ	27,500	3,055.00	84,012,500
ひろぎんホールディングス	228,700	783.90	179,277,930
おきなわフィナンシャルグループ	16,700	2,121.00	35,420,700
十六フィナンシャルグループ	22,700	3,075.00	69,802,500
北國フィナンシャルホールディングス	19,700	4,405.00	86,778,500
プロクレアホールディングス	21,500	2,078.00	44,677,000
あいちフィナンシャルグループ	24,500	2,180.00	53,410,000
SBI 新生銀行	40,900	2,810.00	114,929,000
あおぞら銀行	110,200	2,600.00	286,520,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,978,200	961.00	10,550,050,200
りそなホールディングス	2,215,600	645.70	1,430,612,920
三井住友トラスト・ホールディングス	318,500	5,031.00	1,602,373,500

三井住友フィナンシャルグループ	1,281,000	5,749.00	7,364,469,000	
千葉銀行	488,500	860.80	420,500,800	
群馬銀行	340,200	513.70	174,760,740	
武蔵野銀行	22,500	2,136.00	48,060,000	
千葉興業銀行	31,900	546.00	17,417,400	
筑波銀行	76,900	200.00	15,380,000	
七十七銀行	56,100	2,425.00	136,042,500	
秋田銀行	11,700	1,687.00	19,737,900	
山形銀行	19,500	1,078.00	21,021,000	
岩手銀行	12,000	2,052.00	24,624,000	
東邦銀行	138,600	228.00	31,600,800	
東北銀行	6,600	1,001.00	6,606,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	139,900	2,705.50	378,499,450	
スルガ銀行	154,500	500.00	77,250,000	
八十二銀行	370,268	602.00	222,901,336	
山梨中央銀行	18,000	1,151.00	20,718,000	
大垣共立銀行	33,400	1,833.00	61,222,200	
福井銀行	15,700	1,430.00	22,451,000	
清水銀行	7,000	1,428.00	9,996,000	
富山銀行	2,100	1,655.00	3,475,500	
滋賀銀行	29,200	2,731.00	79,745,200	
南都銀行	26,400	2,405.00	63,492,000	
百五銀行	164,900	409.00	67,444,100	
京都銀行	55,500	6,908.00	383,394,000	
紀陽銀行	62,700	1,484.00	93,046,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	111,400	1,122.50	125,046,500	
山陰合同銀行	109,700	781.00	85,675,700	
鳥取銀行	4,400	1,145.00	5,038,000	
百十四銀行	16,000	1,757.00	28,112,000	
四国銀行	27,800	844.00	23,463,200	
阿波銀行	24,600	1,985.00	48,831,000	
大分銀行	10,500	2,112.00	22,176,000	
宮崎銀行	11,400	2,264.00	25,809,600	
佐賀銀行	10,300	1,617.00	16,655,100	
琉球銀行	40,200	905.00	36,381,000	
セブン銀行	627,900	282.30	177,256,170	

みずほフィナンシャルグループ	2,535,100	2,098.00	5,318,639,800	
高知銀行	4,700	678.00	3,186,600	
山口フィナンシャルグループ	193,500	901.10	174,362,850	
名古屋銀行	11,600	3,295.00	38,222,000	
北洋銀行	265,600	271.00	71,977,600	
大光銀行	4,100	1,056.00	4,329,600	
愛媛銀行	23,600	798.00	18,832,800	
トマト銀行	4,500	1,014.00	4,563,000	
京葉銀行	80,200	526.00	42,185,200	
栃木銀行	80,200	250.00	20,050,000	
北日本銀行	6,100	1,986.00	12,114,600	
東和銀行	32,200	528.00	17,001,600	
福島銀行	14,400	214.00	3,081,600	
大東銀行	5,300	623.00	3,301,900	
トモニホールディングス	141,700	361.00	51,153,700	
フィデアホールディングス	18,100	1,315.00	23,801,500	
池田泉州ホールディングス	224,400	237.00	53,182,800	
F P G	59,500	1,169.00	69,555,500	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,500	1,111.00	16,109,500	
マーキュリアホールディングス	8,300	716.00	5,942,800	
S B I ホールディングス	253,900	2,690.00	682,991,000	
ジャフコ グループ	58,600	1,781.50	104,395,900	
大和証券グループ本社	1,253,700	692.80	868,563,360	
野村ホールディングス	3,228,700	515.20	1,663,426,240	
岡三証券グループ	154,300	464.00	71,595,200	
丸三証券	58,800	424.00	24,931,200	
東洋証券	58,800	288.00	16,934,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	191,300	369.00	70,589,700	
光世証券	3,500	430.00	1,505,000	
水戸証券	47,700	303.00	14,453,100	
いちよし証券	32,600	591.00	19,266,600	
松井証券	103,800	786.00	81,586,800	
マネックスグループ	189,200	498.00	94,221,600	
極東証券	22,100	627.00	13,856,700	
岩井コスモホールディングス	20,100	1,387.00	27,878,700	
アイザワ証券グループ	25,600	800.00	20,480,000	

マネーパートナーズグループ	14,900	259.00	3,859,100	
スパークス・グループ	19,700	1,575.00	31,027,500	
かんぽ生命保険	212,800	2,115.00	450,072,000	
SOMPOホールディングス	300,800	6,270.00	1,886,016,000	
アニコム ホールディングス	59,500	626.00	37,247,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	356,700	5,172.00	1,844,852,400	
第一生命ホールディングス	856,400	2,579.00	2,208,655,600	
東京海上ホールディングス	1,732,700	3,232.00	5,600,086,400	
T&Dホールディングス	470,400	2,007.00	944,092,800	
アドバンスクリエイト	10,100	1,173.00	11,847,300	
全国保証	45,900	5,125.00	235,237,500	
あんしん保証	7,800	304.00	2,371,200	
イントラスト	5,600	967.00	5,415,200	
日本モーゲージサービス	8,200	582.00	4,772,400	
C a s a	5,700	875.00	4,987,500	
アルヒ	22,000	984.00	21,648,000	
プレミアグループ	29,700	1,596.00	47,401,200	
ネットプロテクションズホールディングス	59,000	345.00	20,355,000	
クレディセゾン	111,300	2,016.00	224,380,800	
芙蓉総合リース	16,200	10,450.00	169,290,000	
みずほリース	26,200	4,420.00	115,804,000	
東京センチュリー	32,800	5,195.00	170,396,000	
日本証券金融	64,700	1,138.00	73,628,600	
アイフル	291,400	341.00	99,367,400	
リコーリース	16,700	3,930.00	65,631,000	
イオンフィナンシャルサービス	100,900	1,262.00	127,335,800	
アコム	313,900	332.90	104,497,310	
ジャックス	18,800	4,590.00	86,292,000	
オリентコーポレーション	46,100	1,084.00	49,972,400	
オリックス	1,150,800	2,456.00	2,826,364,800	
三菱HCキャピタル	683,900	769.30	526,124,270	
九州リースサービス	6,800	830.00	5,644,000	
日本取引所グループ	492,700	2,409.50	1,187,160,650	
イー・ギャランティ	28,600	1,940.00	55,484,000	
アサックス	6,700	621.00	4,160,700	

NECキャピタルソリューション	8,700	2,971.00	25,847,700
大東建託	64,300	13,910.00	894,413,000
いちご	204,300	268.00	54,752,400
日本駐車場開発	188,300	257.00	48,393,100
スター・マイカ・ホールディングス	16,900	641.00	10,832,900
SREホールディングス	8,800	3,460.00	30,448,000
ADワークスグループ	34,300	208.00	7,134,400
ヒューリック	409,400	1,214.00	497,011,600
三栄建築設計	8,900	1,530.00	13,617,000
野村不動産ホールディングス	109,800	3,436.00	377,272,800
三重交通グループホールディングス	38,700	574.00	22,213,800
サムティ	28,200	2,180.00	61,476,000
ディア・ライフ	30,800	777.00	23,931,600
地主	13,700	1,959.00	26,838,300
プレサンスコーポレーション	28,000	1,942.00	54,376,000
ハウスコム	4,100	910.00	3,731,000
JPMC	9,500	1,108.00	10,526,000
サンセイランディック	4,800	867.00	4,161,600
フージャースホールディングス	27,000	1,001.00	27,027,000
オープンハウスグループ	64,300	5,425.00	348,827,500
東急不動産ホールディングス	527,900	798.90	421,739,310
飯田グループホールディングス	153,800	2,401.50	369,350,700
イーグランド	2,500	1,476.00	3,690,000
ムゲンエステート	10,100	772.00	7,797,200
And Doホールディングス	10,400	1,172.00	12,188,800
シーアールイー	10,200	1,310.00	13,362,000
ケイアイスター不動産	8,600	4,930.00	42,398,000
グッドコムアセット	17,000	871.00	14,807,000
ジェイ・エス・ビー	4,500	4,670.00	21,015,000
ロードスターキャピタル	10,400	1,596.00	16,598,400
テンポイノベーション	4,700	1,053.00	4,949,100
フェイスネットワーク	4,200	1,354.00	5,686,800
パーク24	136,900	2,168.00	296,799,200
パラカ	6,500	1,922.00	12,493,000
三井不動産	757,800	2,808.00	2,127,902,400
三菱地所	1,058,100	1,689.00	1,787,130,900

平和不動産	28,600	3,745.00	107,107,000
東京建物	167,400	1,866.00	312,368,400
京阪神ビルディング	30,000	1,196.00	35,880,000
住友不動産	317,100	3,645.00	1,155,829,500
テーオーシー	32,800	631.00	20,696,800
東京楽天地	3,000	4,285.00	12,855,000
レオパレス21	197,300	310.00	61,163,000
スターツコーポレーション	25,400	2,822.00	71,678,800
フジ住宅	25,500	686.00	17,493,000
空港施設	22,400	544.00	12,185,600
明和地所	7,300	925.00	6,752,500
ゴールドクレスト	17,100	1,798.00	30,745,800
エスリード	8,500	2,633.00	22,380,500
日神グループホールディングス	29,600	517.00	15,303,200
日本エスコン	39,400	802.00	31,598,800
MIRARTHホールディングス	88,600	440.00	38,984,000
AVANTIA	8,400	837.00	7,030,800
イオンモール	91,200	1,813.00	165,345,600
毎日コムネット	5,900	750.00	4,425,000
ファースト住建	6,100	1,085.00	6,618,500
カチタス	47,400	2,214.00	104,943,600
トーセイ	29,600	1,733.00	51,296,800
穴吹興産	3,000	2,252.00	6,756,000
サンフロンティア不動産	29,700	1,350.00	40,095,000
FJネクストホールディングス	19,100	1,009.00	19,271,900
インテリックス	3,300	557.00	1,838,100
ランドビジネス	5,000	242.00	1,210,000
サンネクスタグループ	5,800	1,003.00	5,817,400
グランディハウス	12,700	558.00	7,086,600
日本空港ビルデング	62,100	6,420.00	398,682,000
明豊ファシリティワークス	7,600	754.00	5,730,400
日本工営	11,100	3,720.00	41,292,000
LIFULL	63,800	279.00	17,800,200
MIXI	41,800	2,781.00	116,245,800
ジェイエイシーリクルートメント	16,700	2,411.00	40,263,700
日本M&Aセンターホールディングス	314,300	1,020.00	320,586,000

メンバーズ	5,500	1,539.00	8,464,500
中広	2,800	405.00	1,134,000
UTグループ	27,000	2,938.00	79,326,000
アイティメディア	7,200	1,288.00	9,273,600
E・Jホールディングス	10,900	1,556.00	16,960,400
オープンアップグループ	55,000	2,024.00	111,320,000
コシダカホールディングス	55,100	1,182.00	65,128,200
アルトナー	3,700	1,700.00	6,290,000
パソナグループ	22,400	1,745.00	39,088,000
CDS	3,700	1,788.00	6,615,600
リンクアンドモチベーション	52,700	440.00	23,188,000
エス・エム・エス	69,700	2,909.00	202,757,300
サニーサイドアップグループ	4,700	685.00	3,219,500
パーソルホールディングス	201,900	2,665.50	538,164,450
リニカル	8,500	866.00	7,361,000
クックパッド	51,900	181.00	9,393,900
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	660.00	4,950,000
学情	8,500	1,895.00	16,107,500
スタジオアリス	9,300	2,176.00	20,236,800
シミックホールディングス	9,000	1,990.00	17,910,000
エプコ	3,500	761.00	2,663,500
NJS	4,100	2,680.00	10,988,000
総合警備保障	68,000	3,997.00	271,796,000
カカコム	134,400	2,067.00	277,804,800
アイロムグループ	6,700	1,936.00	12,971,200
セントケア・ホールディング	12,100	749.00	9,062,900
サイネックス	3,000	618.00	1,854,000
ルネサンス	13,200	902.00	11,906,400
ディップ	32,100	3,495.00	112,189,500
デジタルホールディングス	14,600	1,044.00	15,242,400
新日本科学	19,500	2,231.00	43,504,500
キャリアデザインセンター	3,200	1,513.00	4,841,600
ベネフィット・ワン	85,000	1,655.50	140,717,500
エムスリー	361,600	3,245.00	1,173,392,000
ツカダ・グローバルホールディング	9,100	483.00	4,395,300
アウトソーシング	109,200	1,343.00	146,655,600

ウェルネット	11,400	621.00	7,079,400
ワールドホールディングス	8,300	2,800.00	23,240,000
ディー・エヌ・エー	73,300	1,879.50	137,767,350
博報堂DYホールディングス	233,600	1,513.50	353,553,600
ぐるなび	34,500	369.00	12,730,500
タカミヤ	25,500	511.00	13,030,500
ジャパンベストレスキューシステム	9,100	715.00	6,506,500
ファンコミュニケーションズ	36,700	401.00	14,716,700
ライク	7,000	1,660.00	11,620,000
ビジネス・ブレークスルー	6,100	437.00	2,665,700
エスプール	53,100	555.00	29,470,500
WDBホールディングス	9,500	2,206.00	20,957,000
ティア	9,100	438.00	3,985,800
CDG	1,800	1,391.00	2,503,800
アドウェイズ	25,600	680.00	17,408,000
バリューコマース	14,000	1,456.00	20,384,000
インフォマート	191,200	284.00	54,300,800
J Pホールディングス	53,500	396.00	21,186,000
エコナックホールディングス	28,000	96.00	2,688,000
CLホールディングス	5,400	888.00	4,795,200
プレステージ・インターナショナル	77,500	659.00	51,072,500
アミューズ	10,100	1,805.00	18,230,500
ドリームインキュベータ	5,700	2,890.00	16,473,000
クイック	14,100	2,067.00	29,144,700
TAC	8,500	200.00	1,700,000
電通グループ	179,900	4,613.00	829,878,700
イオンファンタジー	8,000	3,480.00	27,840,000
シーティーエス	20,700	728.00	15,069,600
ネクシィーズグループ	4,900	670.00	3,283,000
H. U. グループホールディングス	53,700	2,815.00	151,165,500
アルプス技研	16,000	2,895.00	46,320,000
日本空調サービス	20,100	749.00	15,054,900
オリエンタルランド	968,300	5,366.00	5,195,897,800
ダスキン	40,800	3,167.00	129,213,600
明光ネットワークジャパン	22,700	641.00	14,550,700
ファルコホールディングス	8,400	1,849.00	15,531,600



ラウンドワン	153,500	580.00	89,030,000
リゾートトラスト	72,400	2,146.50	155,406,600
ビー・エム・エル	22,800	3,200.00	72,960,000
りらいあコミュニケーションズ	30,400	1,462.00	44,444,800
リソー教育	84,200	292.00	24,586,400
早稲田アカデミー	10,400	1,365.00	14,196,000
ユー・エス・エス	188,300	2,364.00	445,141,200
東京個別指導学院	22,300	528.00	11,774,400
サイバーエージェント	404,500	1,046.00	423,107,000
楽天グループ	1,098,000	554.00	608,292,000
クリーク・アンド・リバー社	10,900	1,983.00	21,614,700
SBIグローバルアセットマネジメント	30,500	500.00	15,250,000
テー・オー・ダブリュー	36,900	322.00	11,881,800
山田コンサルティンググループ	9,500	1,694.00	16,093,000
セントラルスポーツ	7,000	2,426.00	16,982,000
フルキャストホールディングス	17,600	2,308.00	40,620,800
エン・ジャパン	33,200	2,480.00	82,336,000
リソルホールディングス	1,400	4,670.00	6,538,000
テクノプロ・ホールディングス	108,300	3,305.00	357,931,500
アトラグループ	3,200	179.00	572,800
インターワークス	4,600	339.00	1,559,400
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	1,643.00	15,937,100
Keepers 技研	11,400	5,230.00	59,622,000
ファーストロジック	2,000	933.00	1,866,000
三機サービス	2,500	1,082.00	2,705,000
Gunosy	15,000	642.00	9,630,000
デザインワン・ジャパン	5,400	172.00	928,800
イー・ガーディアン	7,100	2,015.00	14,306,500
リブセンス	7,800	262.00	2,043,600
ジャパンマテリアル	56,100	2,346.00	131,610,600
ベクトル	29,000	1,346.00	39,034,000
ウチヤマホールディングス	7,100	307.00	2,179,700
チャーム・ケア・コーポレーション	15,500	1,259.00	19,514,500
キャリアリンク	6,800	2,925.00	19,890,000
I B J	11,700	682.00	7,979,400
アサンテ	9,200	1,652.00	15,198,400

バリューHR	16,200	1,415.00	22,923,000
M&Aキャピタルパートナーズ	14,900	3,050.00	45,445,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,049.00	7,133,200
E R I ホールディングス	3,900	1,342.00	5,233,800
アビスト	2,300	3,110.00	7,153,000
シグマクス・ホールディングス	28,000	1,226.00	34,328,000
ウィルグループ	15,600	1,091.00	17,019,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,300	141.00	2,439,300
メドピア	16,400	1,023.00	16,777,200
レアジョブ	3,100	1,004.00	3,112,400
リクルートホールディングス	1,354,600	4,629.00	6,270,443,400
エラン	24,600	823.00	20,245,800
土木管理総合試験所	6,900	335.00	2,311,500
日本郵政	2,201,800	1,002.50	2,207,304,500
ベルシステム24ホールディングス	24,800	1,381.00	34,248,800
鎌倉新書	21,200	823.00	17,447,600
SMN	4,100	453.00	1,857,300
グローバルキッズCOMPANY	3,100	743.00	2,303,300
エアトリ	13,400	2,579.00	34,558,600
アトラエ	11,200	705.00	7,896,000
ストライク	7,800	3,365.00	26,247,000
ソラスト	50,900	684.00	34,815,600
セラク	5,800	1,486.00	8,618,800
インソース	40,000	1,310.00	52,400,000
ベイカレント・コンサルティング	144,900	5,402.00	782,749,800
Orchestra Holdings	4,200	1,341.00	5,632,200
アイモバイル	8,400	1,209.00	10,155,600
キャリアインデックス	6,000	291.00	1,746,000
MS-Japan	5,000	1,035.00	5,175,000
船場	2,900	725.00	2,102,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,400	1,879.00	122,886,600
フルテック	2,300	1,079.00	2,481,700
GameWith	5,100	390.00	1,989,000
MS&Consulting	2,200	603.00	1,326,600
ウェルビー	14,000	500.00	7,000,000

エル・ティー・エス	2,500	3,295.00	8,237,500
ミダックホールディングス	11,300	1,689.00	19,085,700
日総工産	14,100	916.00	12,915,600
キュービーネットホールディングス	8,900	1,493.00	13,287,700
R P Aホールディングス	25,600	438.00	11,212,800
スプリックス	4,500	792.00	3,564,000
マネジメントソリューションズ	10,200	2,956.00	30,151,200
プロレド・パートナーズ	5,100	519.00	2,646,900
テノ.ホールディングス	2,200	787.00	1,731,400
フロンティア・マネジメント	6,400	1,206.00	7,718,400
ピアラ	3,000	512.00	1,536,000
コプロ・ホールディングス	2,500	2,128.00	5,320,000
ギークス	2,400	786.00	1,886,400
アンビスホールディングス	19,700	3,060.00	60,282,000
カーブスホールディングス	50,400	714.00	35,985,600
フォーラムエンジニアリング	10,900	1,148.00	12,513,200
F a s t F i t n e s s J a p a n	6,500	1,249.00	8,118,500
ダイレクトマーケティングミックス	22,300	941.00	20,984,300
ポピンズ	2,900	1,661.00	4,816,900
L I T A L I C O	14,400	2,466.00	35,510,400
アドバンテッジリスクマネジメント	7,000	593.00	4,151,000
リログループ	102,000	1,990.50	203,031,000
東祥	13,000	1,142.00	14,846,000
ビーウィズ	4,800	2,000.00	9,600,000
T R Eホールディングス	38,800	1,162.00	45,085,600
人・夢・技術グループ	7,100	1,495.00	10,614,500
大栄環境	46,700	2,316.00	108,157,200
日本管財ホールディングス	19,300	2,616.00	50,488,800
エイチ・アイ・エス	48,000	1,907.00	91,536,000
ラックランド	7,700	3,355.00	25,833,500
共立メンテナンス	31,400	5,295.00	166,263,000
イチネンホールディングス	19,600	1,321.00	25,891,600
建設技術研究所	9,500	3,510.00	33,345,000
スペース	13,600	1,058.00	14,388,800
燦ホールディングス	7,900	2,241.00	17,703,900
スバル興業	900	9,460.00	8,514,000

東京テアトル	5,200	1,130.00	5,876,000	
タナベコンサルティンググループ	5,900	901.00	5,315,900	
ナガワ	4,900	6,660.00	32,634,000	
東京都競馬	15,400	4,080.00	62,832,000	
カナモト	33,700	2,148.00	72,387,600	
ニシオホールディングス	17,100	3,265.00	55,831,500	
トランス・コスモス	22,800	3,475.00	79,230,000	
乃村工藝社	80,100	955.00	76,495,500	
藤田観光	8,100	3,595.00	29,119,500	
KNT-CTホールディングス	10,900	1,366.00	14,889,400	
トーカイ	16,400	1,860.00	30,504,000	
セコム	186,400	9,490.00	1,768,936,000	
セントラル警備保障	10,000	2,879.00	28,790,000	
丹青社	35,900	815.00	29,258,500	
メイテック	71,500	2,421.00	173,101,500	
応用地質	17,300	1,894.00	32,766,200	
船井総研ホールディングス	38,200	2,602.00	99,396,400	
進学会ホールディングス	5,800	292.00	1,693,600	
オオバ	9,300	753.00	7,002,900	
いであ	3,300	1,666.00	5,497,800	
学究社	7,400	2,183.00	16,154,200	
ベネッセホールディングス	68,500	1,823.50	124,909,750	
イオンディライト	20,300	2,985.00	60,595,500	
ナック	8,400	960.00	8,064,000	
ダイセキ	37,400	3,770.00	140,998,000	
ステップ	6,800	1,806.00	12,280,800	
合 計	208,421,368		569,849,009,556	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 貸借対照表

	2023年6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	962,020,824
国債証券	543,460,746,790
地方債証券	32,327,139,206
特殊債券	36,233,201,549
社債券	28,581,567,000
未収入金	649,016,600
未収利息	1,389,464,852
前払費用	70,190,495
流動資産合計	643,673,347,316
資産合計	643,673,347,316
負債の部	
流動負債	
未払金	1,200,000,000
未払解約金	291,396,511
未払利息	1,957
流動負債合計	1,491,398,468
負債合計	1,491,398,468
純資産の部	
元本等	
元本	469,662,622,453
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	172,519,326,395
元本等合計	642,181,948,848
純資産合計	642,181,948,848
負債純資産合計	643,673,347,316

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。

3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
----------------	------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	2023年6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	469,662,622,453 口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 100,142,000 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3673 円 (1万口当たり純資産額) (13,673 円)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年6月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月12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	2023年6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月11日
期首元本額	452,471,725,809円
期中追加設定元本額	44,490,977,597円
期中一部解約元本額	27,300,080,953円
期末元本額	469,662,622,453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)	4,287,936,919円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,539,081円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,138,168,422円
世界経済インデックスファンド	5,509,259,565円
DCマイセレクション25	27,039,836,618円
DCマイセレクション50	33,328,258,784円
DCマイセレクション75	9,595,799,301円
DC日本債券インデックス・オープン	422,481,400円
DC日本債券インデックス・オープンS	91,197,621,654円
DC日本債券インデックス・オープンP	64,902,438,465円
DCマイセレクションS25	14,990,055,551円
DCマイセレクションS50	17,544,352,553円
DCマイセレクションS75	4,086,138,122円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	588,839,823円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,499,981,002円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	969,948,362円
DC世界経済インデックスファンド	4,363,258,570円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,930,501円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,217,001円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	7,961,710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)	65,519,349円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	102,948,955円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	27,501,015円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	22,979,293円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,353,740,428円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	698,746,915円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,963,008,471円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	63,703,148円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	52,307,572円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	895,561,004円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,017,697,602円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,325,289,926円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	116,400,221円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,557,283,556円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,025,812,132円
分散投資コア戦略ファンドA	19,225,644,223円
分散投資コア戦略ファンドS	25,390,862,131円

DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	263,681,202円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,739,960,073円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	98,267,387円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,277,183円
SMT インデックスバランス・オープン	73,787,471円
SMT 世界経済インデックス・オープン	42,917,502円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	92,073,747円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	146,382,426円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,755,623円
グローバル経済コア	229,841,710円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	38,660,909円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,637,113円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	92,651,633円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	52,155,797円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	14,387,706円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	10,733,377円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	303,147,013円
10資産分散投資ファンド	289,332,613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）	87,186,567,508円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	40,470,737円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,328,686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）	432,244,668円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		487,515,870
地方債証券		40,955,444
特殊債券		45,286,233
社債券		59,846,000
合計		633,603,547

（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438回利付国債（2年）	860,000,000	861,350,200	
	第439回利付国債（2年）	470,000,000	470,770,800	



第440回利付国債（2年）	1,930,000,000	1,933,281,000	
第441回利付国債（2年）	440,000,000	440,743,600	
第442回利付国債（2年）	2,400,000,000	2,403,984,000	
第443回利付国債（2年）	3,300,000,000	3,305,577,000	
第444回利付国債（2年）	2,925,000,000	2,930,001,750	
第445回利付国債（2年）	1,160,000,000	1,161,995,200	
第446回利付国債（2年）	3,060,000,000	3,064,987,800	
第448回利付国債（2年）	50,000,000	50,084,500	
第449回利付国債（2年）	690,000,000	691,083,300	
第141回利付国債（5年）	8,820,000,000	8,845,225,200	
第142回利付国債（5年）	3,910,000,000	3,922,199,200	
第143回利付国債（5年）	4,480,000,000	4,495,052,800	
第144回利付国債（5年）	5,650,000,000	5,670,566,000	
第145回利付国債（5年）	5,120,000,000	5,140,377,600	
第146回利付国債（5年）	4,910,000,000	4,931,063,900	
第147回利付国債（5年）	4,090,000,000	4,097,934,600	
第148回利付国債（5年）	5,600,000,000	5,610,136,000	
第149回利付国債（5年）	5,320,000,000	5,328,671,600	
第150回利付国債（5年）	6,660,000,000	6,669,324,000	
第151回利付国債（5年）	4,510,000,000	4,514,239,400	
第152回利付国債（5年）	210,000,000	210,949,200	
第153回利付国債（5年）	5,810,000,000	5,811,162,000	
第154回利付国債（5年）	4,650,000,000	4,665,856,500	
第155回利付国債（5年）	1,480,000,000	1,497,360,400	
第156回利付国債（5年）	3,720,000,000	3,746,002,800	
第157回利付国債（5年）	1,460,000,000	1,468,657,800	
第158回利付国債（5年）	2,650,000,000	2,653,127,000	
第1回利付国債（40年）	500,000,000	631,430,000	
第2回利付国債（40年）	1,130,000,000	1,374,034,800	
第3回利付国債（40年）	650,000,000	790,491,000	
第4回利付国債（40年）	950,000,000	1,157,499,000	
第5回利付国債（40年）	1,150,000,000	1,351,066,000	
第6回利付国債（40年）	1,260,000,000	1,453,435,200	
第7回利付国債（40年）	1,340,000,000	1,480,566,000	
第8回利付国債（40年）	1,490,000,000	1,530,379,000	
第9回利付国債（40年）	2,210,000,000	1,679,600,000	

第10回利付国債（40年）	2,040,000,000	1,812,356,400	
第11回利付国債（40年）	1,525,000,000	1,306,437,000	
第12回利付国債（40年）	1,290,000,000	988,552,800	
第13回利付国債（40年）	2,330,000,000	1,769,448,600	
第14回利付国債（40年）	2,130,000,000	1,723,319,100	
第15回利付国債（40年）	2,970,000,000	2,635,043,400	
第16回利付国債（40年）	560,000,000	539,492,800	
第335回利付国債（10年）	3,630,000,000	3,658,858,500	
第336回利付国債（10年）	1,210,000,000	1,221,144,100	
第337回利付国債（10年）	2,800,000,000	2,817,248,000	
第338回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,599,535,200	
第339回利付国債（10年）	3,970,000,000	4,008,509,000	
第340回利付国債（10年）	4,430,000,000	4,477,844,000	
第341回利付国債（10年）	5,020,000,000	5,066,886,800	
第342回利付国債（10年）	4,760,000,000	4,781,753,200	
第343回利付国債（10年）	2,670,000,000	2,682,495,600	
第344回利付国債（10年）	5,900,000,000	5,928,025,000	
第345回利付国債（10年）	3,780,000,000	3,797,955,000	
第346回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,775,990,000	
第347回利付国債（10年）	3,550,000,000	3,564,235,500	
第348回利付国債（10年）	4,260,000,000	4,274,526,600	
第349回利付国債（10年）	5,120,000,000	5,133,824,000	
第350回利付国債（10年）	6,670,000,000	6,679,471,400	代用有価証券 100,000,000円
第351回利付国債（10年）	4,835,000,000	4,838,577,900	
第352回利付国債（10年）	4,330,000,000	4,330,000,000	
第353回利付国債（10年）	4,385,000,000	4,381,360,450	
第354回利付国債（10年）	4,720,000,000	4,711,881,600	
第355回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,647,464,600	
第356回利付国債（10年）	4,630,000,000	4,612,730,100	
第357回利付国債（10年）	3,330,000,000	3,313,882,800	
第358回利付国債（10年）	4,000,000,000	3,975,920,000	
第359回利付国債（10年）	3,920,000,000	3,890,168,800	
第360回利付国債（10年）	4,840,000,000	4,791,551,600	
第361回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,603,287,800	
第362回利付国債（10年）	4,050,000,000	3,991,518,000	

第363回利付国債（10年）	5,650,000,000	5,557,114,000	
第364回利付国債（10年）	5,110,000,000	5,017,355,700	
第365回利付国債（10年）	6,417,000,000	6,289,430,040	
第366回利付国債（10年）	5,370,000,000	5,299,223,400	
第367回利付国債（10年）	4,900,000,000	4,827,284,000	
第368回利付国債（10年）	4,880,000,000	4,799,138,400	
第369回利付国債（10年）	4,660,000,000	4,704,875,800	
第370回利付国債（10年）	3,040,000,000	3,061,371,200	
第1回利付国債（30年）	110,000,000	128,109,300	
第2回利付国債（30年）	160,000,000	183,601,600	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	137,328,000	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	131,430,200	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	57,429,000	
第6回利付国債（30年）	350,000,000	410,151,000	
第7回利付国債（30年）	380,000,000	444,771,000	
第8回利付国債（30年）	850,000,000	960,474,500	
第9回利付国債（30年）	240,000,000	262,370,400	
第10回利付国債（30年）	160,000,000	170,286,400	
第11回利付国債（30年）	260,000,000	291,714,800	
第12回利付国債（30年）	190,000,000	220,884,500	
第13回利付国債（30年）	400,000,000	461,580,000	
第14回利付国債（30年）	750,000,000	898,342,500	
第15回利付国債（30年）	340,000,000	411,876,000	
第16回利付国債（30年）	200,000,000	242,808,000	
第17回利付国債（30年）	1,130,000,000	1,361,638,700	
第18回利付国債（30年）	315,000,000	376,755,750	
第19回利付国債（30年）	530,000,000	635,279,200	
第20回利付国債（30年）	480,000,000	587,596,800	
第21回利付国債（30年）	500,000,000	601,085,000	
第22回利付国債（30年）	540,000,000	663,238,800	
第23回利付国債（30年）	430,000,000	528,977,400	
第24回利付国債（30年）	780,000,000	960,991,200	
第25回利付国債（30年）	600,000,000	724,836,000	
第26回利付国債（30年）	1,550,000,000	1,895,154,000	
第27回利付国債（30年）	1,870,000,000	2,317,247,900	
第28回利付国債（30年）	2,020,000,000	2,508,294,600	

第 2 9 回利付国債 (30年)	1,670,000,000	2,053,181,500	
第 3 0 回利付国債 (30年)	2,070,000,000	2,517,057,900	
第 3 1 回利付国債 (30年)	1,100,000,000	1,321,716,000	
第 3 2 回利付国債 (30年)	1,460,000,000	1,778,499,000	
第 3 3 回利付国債 (30年)	2,120,000,000	2,483,410,400	
第 3 4 回利付国債 (30年)	1,865,000,000	2,246,690,900	
第 3 5 回利付国債 (30年)	2,480,000,000	2,910,329,600	
第 3 6 回利付国債 (30年)	2,420,000,000	2,842,822,400	
第 3 7 回利付国債 (30年)	2,295,000,000	2,654,465,850	
第 3 8 回利付国債 (30年)	1,510,000,000	1,717,881,700	
第 3 9 回利付国債 (30年)	1,470,000,000	1,699,173,000	
第 4 0 回利付国債 (30年)	1,280,000,000	1,456,268,800	
第 4 1 回利付国債 (30年)	1,270,000,000	1,421,358,600	
第 4 2 回利付国債 (30年)	1,360,000,000	1,522,384,000	
第 4 3 回利付国債 (30年)	1,350,000,000	1,511,500,500	
第 4 4 回利付国債 (30年)	1,350,000,000	1,511,770,500	
第 4 5 回利付国債 (30年)	1,440,000,000	1,556,481,600	
第 4 6 回利付国債 (30年)	1,750,000,000	1,891,190,000	
第 4 7 回利付国債 (30年)	1,660,000,000	1,824,904,400	
第 4 8 回利付国債 (30年)	1,930,000,000	2,044,545,500	
第 4 9 回利付国債 (30年)	1,740,000,000	1,842,520,800	
第 5 0 回利付国債 (30年)	1,610,000,000	1,509,680,900	
第 5 1 回利付国債 (30年)	1,670,000,000	1,393,865,500	
第 5 2 回利付国債 (30年)	1,590,000,000	1,387,529,400	
第 5 3 回利付国債 (30年)	1,460,000,000	1,300,495,000	
第 5 4 回利付国債 (30年)	1,720,000,000	1,598,671,200	
第 5 5 回利付国債 (30年)	1,590,000,000	1,474,152,600	
第 5 6 回利付国債 (30年)	1,500,000,000	1,387,215,000	
第 5 7 回利付国債 (30年)	1,410,000,000	1,300,668,600	
第 5 8 回利付国債 (30年)	2,260,000,000	2,079,448,600	
第 5 9 回利付国債 (30年)	1,370,000,000	1,227,561,100	
第 6 0 回利付国債 (30年)	1,440,000,000	1,348,387,200	
第 6 1 回利付国債 (30年)	1,280,000,000	1,137,177,600	
第 6 2 回利付国債 (30年)	1,145,000,000	963,540,400	
第 6 3 回利付国債 (30年)	1,500,000,000	1,224,420,000	
第 6 4 回利付国債 (30年)	1,710,000,000	1,390,896,900	

第 6 5 回利付国債 (30年)	1,405,000,000	1,140,986,450	
第 6 6 回利付国債 (30年)	1,290,000,000	1,041,868,500	
第 6 7 回利付国債 (30年)	1,695,000,000	1,441,885,650	
第 6 8 回利付国債 (30年)	1,490,000,000	1,263,460,400	
第 6 9 回利付国債 (30年)	1,420,000,000	1,234,789,400	
第 7 0 回利付国債 (30年)	1,960,000,000	1,700,966,400	
第 7 1 回利付国債 (30年)	1,400,000,000	1,212,526,000	
第 7 2 回利付国債 (30年)	1,600,000,000	1,382,944,000	
第 7 3 回利付国債 (30年)	1,870,000,000	1,614,707,600	
第 7 4 回利付国債 (30年)	2,040,000,000	1,905,870,000	
第 7 5 回利付国債 (30年)	1,410,000,000	1,417,458,900	
第 7 6 回利付国債 (30年)	1,960,000,000	2,018,662,800	
第 7 7 回利付国債 (30年)	1,870,000,000	2,015,467,300	
第 7 8 回利付国債 (30年)	650,000,000	668,973,500	
第 7 2 回利付国債 (20年)	630,000,000	647,841,600	
第 7 3 回利付国債 (20年)	360,000,000	371,538,000	
第 7 4 回利付国債 (20年)	200,000,000	206,716,000	
第 7 5 回利付国債 (20年)	130,000,000	135,038,800	
第 7 6 回利付国債 (20年)	270,000,000	279,509,400	
第 7 7 回利付国債 (20年)	290,000,000	300,727,100	
第 7 8 回利付国債 (20年)	170,000,000	176,806,800	
第 7 9 回利付国債 (20年)	270,000,000	281,356,200	
第 8 0 回利付国債 (20年)	220,000,000	229,697,600	
第 8 1 回利付国債 (20年)	390,000,000	408,408,000	
第 8 2 回利付国債 (20年)	600,000,000	629,688,000	
第 8 3 回利付国債 (20年)	290,000,000	305,889,100	
第 8 4 回利付国債 (20年)	470,000,000	494,562,200	
第 8 5 回利付国債 (20年)	290,000,000	307,402,900	
第 8 6 回利付国債 (20年)	510,000,000	543,435,600	
第 8 7 回利付国債 (20年)	1,830,000,000	1,944,887,400	
第 8 8 回利付国債 (20年)	420,000,000	449,908,200	
第 8 9 回利付国債 (20年)	350,000,000	373,866,500	
第 9 0 回利付国債 (20年)	630,000,000	676,330,200	
第 9 1 回利付国債 (20年)	450,000,000	484,569,000	
第 9 2 回利付国債 (20年)	880,000,000	946,220,000	
第 9 3 回利付国債 (20年)	410,000,000	441,221,500	

第 9 4 回利付国債 ( 2 0 年 )	610,000,000	658,751,200	
第 9 5 回利付国債 ( 2 0 年 )	830,000,000	906,725,200	
第 9 6 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,590,000,000	1,724,196,000	
第 9 7 回利付国債 ( 2 0 年 )	900,000,000	983,727,000	
第 9 8 回利付国債 ( 2 0 年 )	440,000,000	479,054,400	
第 9 9 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,510,000,000	1,650,354,500	
第 1 0 0 回利付国債 ( 2 0 年 )	480,000,000	528,700,800	
第 1 0 1 回利付国債 ( 2 0 年 )	715,000,000	794,336,400	
第 1 0 2 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,180,000,000	1,316,844,600	
第 1 0 3 回利付国債 ( 2 0 年 )	400,000,000	444,392,000	
第 1 0 4 回利付国債 ( 2 0 年 )	160,000,000	176,156,800	
第 1 0 5 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,180,000,000	1,304,088,800	
第 1 0 6 回利付国債 ( 2 0 年 )	680,000,000	755,072,000	
第 1 0 7 回利付国債 ( 2 0 年 )	700,000,000	776,433,000	
第 1 0 8 回利付国債 ( 2 0 年 )	840,000,000	922,504,800	
第 1 0 9 回利付国債 ( 2 0 年 )	520,000,000	572,847,600	
第 1 1 0 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,100,000,000	1,224,388,000	
第 1 1 1 回利付国債 ( 2 0 年 )	970,000,000	1,089,591,300	
第 1 1 2 回利付国債 ( 2 0 年 )	790,000,000	882,682,800	
第 1 1 3 回利付国債 ( 2 0 年 )	2,020,000,000	2,264,702,800	
第 1 1 4 回利付国債 ( 2 0 年 )	2,330,000,000	2,620,830,600	
第 1 1 5 回利付国債 ( 2 0 年 )	700,000,000	791,896,000	
第 1 1 6 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,660,000,000	1,884,183,000	
第 1 1 7 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,480,000,000	1,669,972,800	
第 1 1 8 回利付国債 ( 2 0 年 )	660,000,000	742,229,400	
第 1 1 9 回利付国債 ( 2 0 年 )	530,000,000	588,697,500	
第 1 2 0 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,270,000,000	1,393,063,000	
第 1 2 1 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,470,000,000	1,646,150,100	
第 1 2 2 回利付国債 ( 2 0 年 )	900,000,000	1,001,403,000	
第 1 2 3 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,820,000,000	2,068,539,200	
第 1 2 4 回利付国債 ( 2 0 年 )	610,000,000	688,799,800	
第 1 2 5 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,230,000,000	1,410,588,600	
第 1 2 6 回利付国債 ( 2 0 年 )	730,000,000	825,761,400	
第 1 2 7 回利付国債 ( 2 0 年 )	1,020,000,000	1,146,041,400	
第 1 2 8 回利付国債 ( 2 0 年 )	970,000,000	1,092,384,900	
第 1 2 9 回利付国債 ( 2 0 年 )	740,000,000	827,564,200	

第 1 3 0 回利付国債 (20年)	1,685,000,000	1,888,227,850	
第 1 3 1 回利付国債 (20年)	1,320,000,000	1,468,552,800	
第 1 3 2 回利付国債 (20年)	660,000,000	735,543,600	
第 1 3 3 回利付国債 (20年)	950,000,000	1,066,612,500	
第 1 3 4 回利付国債 (20年)	1,480,000,000	1,664,659,600	
第 1 3 5 回利付国債 (20年)	630,000,000	703,237,500	
第 1 3 6 回利付国債 (20年)	1,050,000,000	1,163,116,500	
第 1 3 7 回利付国債 (20年)	1,000,000,000	1,118,030,000	
第 1 3 8 回利付国債 (20年)	680,000,000	748,367,200	
第 1 3 9 回利付国債 (20年)	830,000,000	920,702,400	
第 1 4 0 回利付国債 (20年)	2,670,000,000	2,989,625,700	
第 1 4 1 回利付国債 (20年)	1,600,000,000	1,794,048,000	
第 1 4 2 回利付国債 (20年)	1,265,000,000	1,430,044,550	
第 1 4 3 回利付国債 (20年)	1,880,000,000	2,090,090,000	
第 1 4 4 回利付国債 (20年)	800,000,000	881,888,000	
第 1 4 5 回利付国債 (20年)	2,515,000,000	2,821,779,700	
第 1 4 6 回利付国債 (20年)	2,760,000,000	3,098,679,600	
第 1 4 7 回利付国債 (20年)	2,360,000,000	2,627,340,800	
第 1 4 8 回利付国債 (20年)	2,130,000,000	2,351,221,800	
第 1 4 9 回利付国債 (20年)	2,860,000,000	3,158,669,800	
第 1 5 0 回利付国債 (20年)	2,680,000,000	2,931,089,200	
第 1 5 1 回利付国債 (20年)	2,375,000,000	2,545,002,500	
第 1 5 2 回利付国債 (20年)	2,780,000,000	2,978,047,200	
第 1 5 3 回利付国債 (20年)	2,420,000,000	2,620,182,400	
第 1 5 4 回利付国債 (20年)	2,775,000,000	2,970,387,750	
第 1 5 5 回利付国債 (20年)	3,000,000,000	3,137,910,000	
第 1 5 6 回利付国債 (20年)	2,610,000,000	2,534,571,000	
第 1 5 7 回利付国債 (20年)	2,930,000,000	2,765,070,300	
第 1 5 8 回利付国債 (20年)	2,640,000,000	2,583,715,200	
第 1 5 9 回利付国債 (20年)	2,590,000,000	2,561,147,400	
第 1 6 0 回利付国債 (20年)	2,010,000,000	2,010,000,000	
第 1 6 1 回利付国債 (20年)	2,380,000,000	2,343,609,800	
第 1 6 2 回利付国債 (20年)	1,230,000,000	1,207,761,600	
第 1 6 3 回利付国債 (20年)	2,190,000,000	2,144,163,300	
第 1 6 4 回利付国債 (20年)	2,000,000,000	1,925,840,000	
第 1 6 5 回利付国債 (20年)	2,320,000,000	2,226,666,400	

	第166回利付国債(20年)	1,850,000,000	1,823,582,000	
	第167回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,108,273,700	
	第168回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,413,556,300	
	第169回利付国債(20年)	1,990,000,000	1,826,660,800	
	第170回利付国債(20年)	2,710,000,000	2,477,454,900	
	第171回利付国債(20年)	1,830,000,000	1,667,276,400	
	第172回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,104,713,600	
	第173回利付国債(20年)	2,350,000,000	2,162,211,500	
	第174回利付国債(20年)	2,640,000,000	2,420,959,200	
	第175回利付国債(20年)	2,030,000,000	1,888,529,300	
	第176回利付国債(20年)	2,710,000,000	2,513,145,600	
	第177回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,116,548,700	
	第178回利付国債(20年)	2,120,000,000	1,956,230,000	
	第179回利付国債(20年)	2,495,000,000	2,296,447,900	
	第180回利付国債(20年)	2,390,000,000	2,316,292,400	
	第181回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,155,003,800	
	第182回利付国債(20年)	2,400,000,000	2,440,728,000	
	第183回利付国債(20年)	2,450,000,000	2,616,453,000	
	第184回利付国債(20年)	1,350,000,000	1,367,766,000	
	国債証券合計	534,332,000,000	543,460,746,790	
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	100,000,000	
	第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	100,000,000	84,657,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,462,000	
	第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	120,213,000	
	第11回東京都公募公債(30年)	100,000,000	117,719,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	100,000,000	113,973,000	
	第15回東京都公募公債(30年)	100,000,000	111,931,000	
	第16回東京都公募公債(20年)	200,000,000	218,984,000	
	第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,957,000	
	第19回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,888,000	
	第19回東京都公募公債(30年)	100,000,000	84,916,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	200,000,000	220,158,000	
	第27回東京都公募公債(20年)	200,000,000	219,358,000	
	第33回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,722,000	
	第751回東京都公募公債	100,000,000	100,767,000	



第765回東京都公募公債	100,000,000	100,356,000	
第770回東京都公募公債	100,000,000	100,179,000	
第781回東京都公募公債	300,000,000	298,956,000	
第800回東京都公募公債	200,000,000	196,682,000	
第830回東京都公募公債	300,000,000	292,038,000	
平成27年度第15回北海道公募公債	100,000,000	100,378,000	
平成28年度第1回北海道公募公債	100,000,000	99,999,000	
平成28年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,424,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	200,000,000	199,116,000	
令和4年度第10回北海道公募公債	200,000,000	198,188,000	
第31回1号宮城県公募公債(10年)	200,000,000	202,064,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	200,000,000	246,606,000	
第11回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	110,635,000	
第15回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	221,790,000	
第17回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,539,000	
第20回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,788,000	
第27回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	107,025,000	
第210回神奈川県公募公債	200,000,000	201,310,000	
第215回神奈川県公募公債	100,000,000	100,896,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,327,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,300,000	
第227回神奈川県公募公債	100,000,000	100,179,000	
第243回神奈川県公募公債	200,000,000	196,618,000	
第6回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	221,962,000	
第7回大阪府公募公債(20年)	200,000,000	220,978,000	
第10回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	109,743,000	
第389回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,701,000	
第395回大阪府公募公債(10年)	151,000,000	152,076,630	
第399回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,013,000	
第402回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,026,000	
第407回大阪府公募公債(10年)	156,000,000	156,021,840	
第410回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,416,000	
第439回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	199,094,000	
第440回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	99,553,000	
第458回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	97,785,000	
第465回大阪府公募公債(10年)	160,000,000	155,604,800	

第468回大阪府公募公債（10年）	182,000,000	176,698,340	
第469回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	193,950,000	
平成21年度第3回京都府公募公債（20年）	100,000,000	111,568,000	
平成23年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	110,292,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,014,000	
平成28年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	93,745,000	
平成29年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	96,666,000	
令和2年度第12回京都府公募公債	140,500,000	137,130,810	
第2回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	109,316,000	
第3回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	100,931,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	105,499,000	
第7回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,574,000	
第8回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,566,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	400,000,000	448,268,000	
平成26年度第17回兵庫県公募公債	100,000,000	100,710,000	
第35回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	95,138,000	
令和元年度第17回兵庫県公募公債	300,000,000	295,824,000	
第1回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	104,796,000	
第9回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	106,168,000	
第12回静岡県公募公債（30年）	100,000,000	89,690,000	
第15回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,780,000	
第18回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	107,782,000	
平成27年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,957,000	
平成29年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	100,219,000	
平成29年度第8回静岡県公募公債	100,000,000	100,299,000	
平成29年度第11回静岡県公募公債	100,000,000	100,233,000	
令和2年度第11回静岡県公募公債	310,000,000	304,451,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	111,776,000	
平成27年度第17回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	100,812,000	
平成28年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	99,954,000	
平成29年度第6回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	200,574,000	
平成29年度第12回愛知県公募公債（20年）	300,000,000	288,174,000	

平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,855,000	
平成30年度第6回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	88,526,000	
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	196,478,000	
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	98,163,000	
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	200,000,000	168,640,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	110,883,000	
平成21年度第1回広島県公募公債(20年)	200,000,000	222,556,000	
平成27年度第4回広島県公募公債	125,230,000	126,491,066	
平成29年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,176,000	
令和2年度第7回広島県公募公債	390,000,000	382,090,800	
令和4年度第2回広島県公募公債	100,000,000	98,003,000	
第2回埼玉県公募公債(10年)	100,000,000	100,290,000	
第3回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	109,127,000	
第6回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	110,466,000	
第6回埼玉県公募公債(30年)	100,000,000	93,813,000	
第7回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	223,692,000	
第8回埼玉県公募公債(15年)	200,000,000	189,240,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	221,790,000	
第18回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	187,934,000	
平成27年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,023,000	
平成28年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	99,986,000	
平成28年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,494,000	
平成29年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	100,200,000	
令和2年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	97,794,000	
令和2年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	97,602,000	
令和3年度第8回埼玉県公募公債	150,000,000	145,129,500	
平成19年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	109,259,000	
平成20年度第2回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	109,739,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,916,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(20年)	100,000,000	111,692,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,779,000	

平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	117,074,000	
平成26年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,638,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	105,368,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	101,010,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	88,526,000	
平成30年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	95,739,000	
令和2年度第1回福岡県公募公債	300,000,000	295,275,000	
令和3年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	97,358,000	
令和3年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	93,512,000	
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	100,104,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,057,000	
第5回千葉県公募公債（20年）	200,000,000	220,932,000	
第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	111,404,000	
第13回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	109,780,000	
平成26年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	100,673,000	
平成27年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,970,000	
平成28年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	99,986,000	
平成28年度第6回千葉県公募公債	120,000,000	120,302,400	
令和元年度第7回千葉県公募公債	300,000,000	294,498,000	
令和2年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	98,056,000	
令和4年度第6回千葉県公募公債	130,000,000	129,170,600	
平成27年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	101,009,000	
令和3年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	293,202,000	
令和4年度第1回長野県公募公債（10年）	300,000,000	293,019,000	
令和5年度第1回茨城県公募公債	100,000,000	100,696,000	
第1回群馬県公募公債（20年）	200,000,000	220,262,000	
第28回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	99,823,000	
平成29年度第1回岐阜県公募公債（10年）	100,000,000	100,130,000	
第136回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,672,000	
第137回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,666,000	
第139回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,727,000	
第140回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,420,000	
第145回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,350,000	

第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,956,000	
第148回共同発行市場公募地方債	125,400,000	126,706,668	
第149回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,967,000	
第152回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,056,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,069,000	
第157回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,014,000	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,908,000	
第160回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,784,000	
第161回共同発行市場公募地方債	400,000,000	399,688,000	
第164回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,828,000	
第166回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,252,000	
第167回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,479,000	
第171回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,360,000	
第174回共同発行市場公募地方債	194,300,000	194,132,902	
第175回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,195,000	
第181回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,493,000	
第219回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,183,000	
第228回共同発行市場公募地方債	200,000,000	193,876,000	
第233回共同発行市場公募地方債	200,000,000	194,848,000	
第243回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,057,000	
令和4年度第3回長崎県公募公債(10年)	100,000,000	98,108,000	
令和4年度第1回熊本市公募公債	101,000,000	99,454,700	
平成29年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	100,176,000	
平成30年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	99,304,000	
第13回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	223,350,000	
第15回大阪市公募公債(30年)	100,000,000	83,962,000	
第22回大阪市公募公債(20年)	300,000,000	282,711,000	
第24回大阪市公募公債(20年)	100,000,000	97,341,000	
令和3年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	194,808,000	
第1回名古屋市公募公債(12年)	100,000,000	101,985,000	
第1回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	119,766,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	122,038,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	109,848,000	
第11回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	110,850,000	
第499回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	100,395,000	
第512回名古屋市公募公債(10年)	300,000,000	295,179,000	

平成28年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,504,000	
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	120,000,000	128,870,400	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	200,000,000	221,166,000	
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	112,241,000	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	100,000,000	109,999,000	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	84,035,000	
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	100,000,000	84,222,000	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	104,282,000	
第20回横浜市公募公債(20年)	300,000,000	333,246,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	101,011,000	
平成28年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,233,000	
平成29年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	100,366,000	
平成30年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	99,904,000	
平成30年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	100,177,000	
第30回横浜市公募公債(20年)	200,000,000	213,788,000	
令和2年度第1回横浜市公募公債	300,000,000	295,194,000	
令和3年度第2回横浜市公募公債	100,000,000	97,402,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	100,000,000	105,037,000	
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,623,000	
第11回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	110,124,000	
第89回川崎市公募公債	100,000,000	100,210,000	
第93回川崎市公募公債	100,000,000	97,742,000	
平成26年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	100,637,000	
平成27年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,027,000	
平成28年度第1回北九州市公募公債	100,000,000	99,985,000	
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	111,251,000	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	100,000,000	108,062,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	200,000,000	201,448,000	
平成26年度第2回広島市公募公債	100,000,000	100,661,000	
平成28年度第4回広島市公募公債	105,000,000	105,221,550	
平成29年度第6回広島市公募公債	170,000,000	170,197,200	
令和元年度第6回広島市公募公債	550,000,000	541,178,000	

	令和2年度第3回広島市公募公債（5年）	300,000,000	299,679,000	
	令和元年度第5回千葉市公募公債	200,000,000	196,332,000	
	令和3年度第8回千葉市公募公債	300,000,000	291,066,000	
	令和4年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	97,422,000	
	平成27年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	101,023,000	
	平成26年度第1回岡山県公募公債（10年）	200,000,000	200,980,000	
	平成30年度第3回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	99,259,000	
	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	109,342,000	
	地方債証券合計	31,780,430,000	32,327,139,206	
特殊債券	第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,035,000	
	第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,001,000	
	第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,171,000	
	第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	71,041,000	
	第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	500,000,000	499,695,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,038,000	
	第21回道路債券	100,000,000	119,475,000	
	第28回道路債券	200,000,000	241,628,000	
	第33回道路債券	200,000,000	244,594,000	
	第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,965,000	
	第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,661,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,542,000	
	第38回道路債券	100,000,000	102,833,000	
	第42回道路債券	200,000,000	207,616,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,913,000	
	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	124,041,000	
	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	222,586,000	
	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	224,108,000	
	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,237,000	

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	118,369,000	
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	112,486,000	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,130,000	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,655,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,827,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,410,000	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,718,000	
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	108,949,000	
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	109,693,000	
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	109,965,000	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	575,028,000	
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	111,097,000	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	90,481,000	
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	216,978,000	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,678,000	
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	108,016,000	
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	215,270,000	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,749,000	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	259,000,000	260,875,160	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,530,000	
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	105,094,000	
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	211,362,000	
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,708,000	
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	113,052,800	
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	201,446,000	



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	100,270,000	
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	83,900,000	
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	106,741,060	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,479,000	
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	205,221,400	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,124,000	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,609,000	
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	100,189,000	
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	200,308,000	
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	100,104,000	
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	120,111,600	
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	199,508,000	
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	288,306,000	
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	214,038,520	
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	98,511,000	
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	98,188,000	
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	117,493,200	
第2回公営企業債券（30年）	300,000,000	349,173,000	
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	100,000,000	104,725,000	
第5回公営企業債券（30年）	300,000,000	361,488,000	
第7回公営企業債券（30年）	200,000,000	241,408,000	
第8回公営企業債券（30年）	100,000,000	118,935,000	
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	222,128,000	
第10回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	218,260,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	600,000,000	600,006,000	
第11回地方公共団体金融機構債券（30年）	200,000,000	162,870,000	
第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	107,432,000	

第19回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	220,950,000	
第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	109,741,000	
第34回地方公共団体金融機構債券（20年）	500,000,000	545,155,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,094,000	
第67回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,710,000	
第69回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,734,000	
第72回政府保証地方公共団体金融機構債券	419,000,000	422,984,690	
第76回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,966,000	
F77回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,356,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,847,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,267,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,931,000	
第83回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,028,000	
第88回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,855,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,035,000	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	251,000,000	251,384,030	
F95回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,135,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,162,000	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,124,000	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	110,000,000	110,127,600	
F107回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,355,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	156,000,000	156,031,200	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,019,000	
第116回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,030,000	
第119回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,733,000	
第120回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,448,000	
F129回地方公共団体金融機構債券	700,000,000	714,875,000	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,170,000	
F146回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,026,000	
第169回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,114,000	
F202回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,022,000	
F206回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,753,000	

F 2 0 8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,054,000	
F 2 1 4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,945,000	
F 2 2 6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,295,000	
F 4 4 1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,008,000	
第 2 9回首都高速道路株式会社債	100,000,000	99,790,000	
第 7 回阪神高速道路債券	100,000,000	103,709,000	
第 2 7 回阪神高速道路株式会社債	100,000,000	100,261,000	
第 2 8 回阪神高速道路株式会社債	100,000,000	100,420,000	
第 1 9 回水資源債券（サステナビリティボンド）	200,000,000	199,878,000	
第 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	111,151,000	
第 1 8 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	112,345,000	
第 4 0 回政府保証日本政策金融公庫債券	126,000,000	125,913,060	
第 4 6 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,163,000	
第 4 7 回政府保証日本政策金融公庫債券	210,000,000	209,596,800	
第 5 3 回政府保証日本政策金融公庫債券	187,000,000	186,988,780	
第 5 4 回政府保証日本政策金融公庫債券	220,000,000	220,006,600	
第 8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	99,949,000	
第 1 1 7 回都市再生債券	200,000,000	204,362,000	
第 1 5 9 回都市再生債券	200,000,000	139,290,000	
第 1 6 1 回都市再生債券	100,000,000	76,690,000	
第 1 7 1 回都市再生債券	200,000,000	161,982,000	
第 5 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,285,000	
第 6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	98,196,000	
第 2 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	107,484,000	107,000,322	
第 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,802,000	
第 3 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	73,812,000	73,820,857	
第 4 回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	107,832,000	
第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,167,000	10,220,783	
第 4 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	127,911,000	126,978,528	
第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	9,979,000	10,029,593	
第 6 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	147,165,000	145,819,911	
第 7 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	52,581,000	52,195,581	

第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,524,000	10,636,501	
第 8 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	183,978,000	183,225,529	
第 9 回貸付債権担保 T 種住宅金融支援機構債券	126,518,000	125,637,434	
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	10,643,000	10,780,720	
第 1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,147,000	
第 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	14,225,000	14,858,723	
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	13,961,000	14,561,602	
第 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,916,000	16,745,541	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,067,000	19,011,181	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,146,000	20,206,496	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,725,000	20,781,076	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,700,000	42,807,446	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,482,000	19,337,162	
第 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,834,000	19,654,409	
第 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,446,000	19,261,497	
第 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,446,000	18,196,526	
第 4 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,373,000	10,514,072	
第 5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,822,000	38,267,631	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,394,000	20,165,881	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,993,000	10,044,463	
第 5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,991,000	27,000,750	
第 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,735,000	25,690,760	
第 5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,882,000	25,861,853	
第 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,692,000	55,661,959	
第 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,288,000	68,205,048	
第 6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,444,000	35,388,110	
第 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,290,000	36,545,265	
第 6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,993,000	37,310,703	
第 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,243,000	32,326,507	
第 7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,255,000	31,078,843	
第 7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,707,000	37,053,153	
第 7 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	150,000,000	167,685,000	
第 7 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,414,000	95,957,663	
第 7 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	125,896,000	129,264,976	

第 8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,693,000	37,551,983	
第 8 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,145,000	39,046,366	
第 8 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,853,000	39,644,435	
第 8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,539,000	
第 8 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,745,000	125,132,390	
第 9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,974,000	42,618,720	
第 9 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,952,000	89,620,029	
第 9 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,833,000	50,326,845	
第 9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,521,000	53,840,520	
第 9 6 回一般担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	315,924,000	
第 9 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,671,000	53,248,274	
第 9 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,082,000	166,423,450	
第 9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	110,804,000	112,200,130	
第 1 0 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,892,000	54,544,093	
第 1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,157,000	58,827,550	
第 1 0 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,462,000	63,130,215	
第 1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,110,000	68,864,145	
第 1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,662,000	68,240,895	
第 1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,978,000	68,812,866	
第 1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,520,000	69,634,974	
第 1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,771,000	69,746,943	
第 1 2 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,816,000	71,573,759	
第 1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,113,000	71,929,300	
第 1 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,897,000	71,511,228	
第 1 2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,918,000	71,528,912	
第 1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,583,000	72,193,752	
第 1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,980,000	146,783,926	
第 1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,657,000	72,221,425	
第 1 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,672,000	148,009,625	

第 1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,194,000	73,678,840	
第 1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,196,000	146,960,778	
第 1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,845,000	74,306,863	
第 1 3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,010,000	149,506,071	
第 1 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,518,000	150,933,182	
第 1 3 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,567,000	
第 1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,811,000	76,407,289	
第 1 3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,294,000	76,068,890	
第 1 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,600,000	75,694,144	
第 1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	160,256,000	155,515,627	
第 1 4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,306,000	77,823,741	
第 1 4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,387,000	77,053,816	
第 1 4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,294,000	156,210,013	
第 1 4 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,168,000	78,962,626	
第 1 4 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	247,833,000	236,873,824	
第 1 4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,856,000	159,405,879	
第 1 5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,914,000	82,206,941	
第 1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,737,000	82,739,634	
第 1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,298,000	170,756,953	
第 1 6 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,108,000	86,191,495	
第 1 6 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,390,000	172,469,235	
第 1 6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,536,000	174,182,938	
第 1 6 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,600,000	86,676,352	
第 1 6 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,260,000	175,064,906	
第 1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,778,000	175,307,657	

第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,491,000	88,612,693	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,795,000	89,358,801	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,467,000	267,136,903	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,978,000	89,612,196	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,256,000	91,976,889	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,785,000	93,610,680	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,718,000	94,668,545	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,008,000	189,406,130	
第187回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,099,000	98,027,387	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,516,000	200,709,651	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,493,000	101,126,675	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	91,726,000	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,713,000	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	83,152,000	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,946,000	
い第832号商工債	200,000,000	199,870,000	
い第833号商工債	100,000,000	99,913,000	
い第843号商工債	200,000,000	199,844,000	
い第847号商工債	100,000,000	99,810,000	
い第850号商工債	200,000,000	199,444,000	
い第876号商工債	200,000,000	200,486,000	
第360回信金中金債（5年）	200,000,000	199,862,000	
第376回信金中金債（5年）	100,000,000	99,805,000	
第379回信金中金債（5年）	100,000,000	99,697,000	
第385回信金中金債（5年）	400,000,000	398,308,000	
第16号商工債（10年）	100,000,000	100,702,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,936,000	
第21回国際協力機構債券	100,000,000	110,015,000	
第64回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	98,207,000	
第67回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	197,226,000	

	第73回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	490,905,000	
	第86回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,475,000	
	第102回東日本高速道路株式会社社債	500,000,000	500,245,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,764,000	
	第98回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	202,074,000	
	第100回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,364,000	
	第27回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	202,062,000	
	第54回西日本高速道路株式会社社債	600,000,000	599,514,000	
	第70回西日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,105,000	
	第71回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,274,000	
	第74回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	202,000,000	
	第77回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,584,000	
	第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,779,000	
	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	190,628,000	
	特殊債券合計	35,696,378,000	36,233,201,549	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	100,000,000	99,877,000	
	第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	300,000,000	299,097,000	
	第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	99,788,000	
	第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,156,000	
	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	400,000,000	400,012,000	
	第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー円貨社債	400,000,000	397,452,000	
	第52回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	100,312,000	
	第39回大成建設株式会社無担保社債	100,000,000	98,380,000	
	第24回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,784,000	
	第32回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,512,000	
	第11回西松建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,001,000	
	第8回戸田建設株式会社無担保社債	100,000,000	99,485,000	
	第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	298,716,000	
	第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	96,820,000	
	第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,046,000	
	第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,073,000	
	第7回明治ホールディングス株式会社無担保	100,000,000	100,159,000	



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	100,163,000	
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	100,798,000	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	198,968,000	
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	300,051,000	
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	99,767,000	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	100,075,000	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	99,462,000	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	100,085,000	
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	99,310,000	
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	99,014,000	
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	100,242,000	
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	100,899,000	
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	199,848,000	
第13回旭化成株式会社無担保社債	100,000,000	99,839,000	
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	99,854,000	
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	100,000,000	99,818,000	
第13回イビデン株式会社無担保社債	200,000,000	199,974,000	
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	100,000,000	99,074,000	
第56回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第13回J S R株式会社無担保社債	100,000,000	97,553,000	
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	99,293,000	
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	198,758,000	
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	199,796,000	
第40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	99,367,000	
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	86,596,000	
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	100,000,000	99,351,000	
第4回株式会社電通グループ無担保社債	100,000,000	100,029,000	
第6回株式会社電通無担保社債	200,000,000	197,888,000	

第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	300,000,000	288,558,000	
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	100,000,000	100,122,000	
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	100,013,000	
第13回ヤフー株式会社無担保社債	100,000,000	96,484,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,843,000	
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	100,000,000	101,024,000	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,005,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,867,000	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,972,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,281,000	
第11回住友理工株式会社無担保社債	100,000,000	98,171,000	
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,926,000	
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	300,213,000	
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	100,000,000	100,002,000	
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	99,810,000	
第14回株式会社LIXIL無担保社債	100,000,000	99,981,000	
第17回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,630,000	
第8回株式会社タダノ無担保社債	100,000,000	99,676,000	
第17回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,941,000	
第20回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	98,022,000	
第1回株式会社安川電機無担保社債	100,000,000	99,607,000	
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	99,904,000	
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	100,000,000	97,939,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	200,842,000	
第21回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,760,000	
第23回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	96,124,000	
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	200,000,000	200,296,000	
第18回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	99,812,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,633,000	
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,751,000	
第22回J A 三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,713,000	
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	99,723,000	
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	200,000,000	195,144,000	

第4回豊田合成株式会社無担保社債	100,000,000	99,962,000	
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,537,000	
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	89,721,000	
第108回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	99,881,000	
第70回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	110,370,000	
第73回三井物産株式会社無担保社債	200,000,000	196,942,000	
第53回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,677,000	
第56回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,448,000	
第60回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	97,366,000	
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	100,000,000	99,898,000	
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	97,554,000	
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	99,795,000	
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	111,896,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,691,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	100,219,000	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,568,000	
第1回みずほFG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	300,000,000	300,819,000	
第9回みずほリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,461,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	199,848,000	
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	196,918,000	
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	100,000,000	98,639,000	
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,821,000	
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,086,000	
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,174,000	
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,929,000	
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,070,000	
第41回リコーリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,549,000	
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	99,665,000	
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	99,476,000	

第32回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,425,000	
第35回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	99,262,000	
第38回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	101,125,000	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	102,048,000	
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	97,766,000	
第212回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,021,000	
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	200,032,000	
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	200,000,000	199,722,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,004,000	
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,591,000	
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	99,222,000	
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	100,547,000	
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	98,815,000	
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	299,961,000	
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	199,678,000	
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	199,190,000	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	200,136,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	200,000,000	199,368,000	
第131回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	89,559,000	
第135回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,285,000	
第100回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,802,000	
第109回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	96,564,000	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,105,000	
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	97,693,000	
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	88,292,000	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,356,000	
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,754,000	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	90,098,000	
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	82,647,000	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	91,122,000	
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,322,000	

第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,133,000	
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	220,726,000	
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,350,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	91,226,000	
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	85,725,000	
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	97,825,000	
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	81,359,000	
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	88,642,000	
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	77,324,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	300,000,000	299,928,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,573,000	
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	80,899,000	
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	89,234,000	
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	500,000,000	499,325,000	
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	88,433,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,676,000	
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,670,000	
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,317,000	
第31回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	85,444,000	
第37回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	73,043,000	
第40回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	66,038,000	
第54回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	78,713,000	
第56回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	86,512,000	
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	166,188,000	
第25回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,351,000	
第30回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,022,000	
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	400,000,000	397,600,000	
第31回株式会社光通信無担保社債	200,000,000	178,992,000	
第33回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	91,993,000	

第36回株式会社光通信無担保社債	100,000,000	90,909,000	
第511回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,692,000	
第519回中部電力株式会社社債	100,000,000	94,733,000	
第540回中部電力株式会社社債	100,000,000	86,637,000	
第508回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,171,000	
第510回関西電力株式会社社債	200,000,000	200,484,000	
第511回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,853,000	
第524回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,732,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	97,412,000	
第538回関西電力株式会社社債	100,000,000	96,779,000	
第550回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,902,000	
第554回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,211,000	
第398回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,182,000	
第400回中国電力株式会社社債	100,000,000	99,768,000	
第416回中国電力株式会社社債	200,000,000	197,184,000	
第425回中国電力株式会社社債	100,000,000	97,591,000	
第448回中国電力株式会社社債	300,000,000	299,595,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,286,000	
第322回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,020,000	
第330回北陸電力株式会社社債	200,000,000	197,240,000	
第496回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,705,000	
第508回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,263,000	
第521回東北電力株式会社社債	200,000,000	196,298,000	
第527回東北電力株式会社社債	100,000,000	96,237,000	
第535回東北電力株式会社社債	100,000,000	98,331,000	
第309回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,915,000	
第314回四国電力株式会社社債	100,000,000	95,976,000	
第449回九州電力株式会社社債	200,000,000	200,304,000	
第465回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,277,000	
第468回九州電力株式会社社債	100,000,000	99,468,000	
第484回九州電力株式会社社債	200,000,000	196,416,000	
第489回九州電力株式会社社債	100,000,000	98,213,000	
第494回九州電力株式会社社債	100,000,000	95,982,000	
第516回九州電力株式会社社債	200,000,000	199,458,000	
第340回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,304,000	
第350回北海道電力株式会社社債	100,000,000	91,802,000	

第385回北海道電力株式会社社債	100,000,000	99,911,000	
第44回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	92,919,000	
第50回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,022,000	
第57回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,114,000	
第77回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,020,000	
第84回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,307,000	
第86回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,816,000	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,286,000	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,290,000	
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	299,856,000	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,277,000	
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,340,000	
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	97,576,000	
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	300,000,000	278,235,000	
第9回株式会社JERA無担保社債	100,000,000	96,788,000	
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	81,287,000	
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	194,186,000	
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,026,000	
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	87,914,000	
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	199,916,000	
社債券合計	29,100,000,000	28,581,567,000	
合計		640,602,654,545	

(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。

貸借対照表

	2023年6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,879,423,742
コール・ローン	372,941,383
株式	563,169,012,011
投資信託受益証券	176,258,784
投資証券	11,725,754,528
派生商品評価勘定	453,301,738
未収入金	9,163,746
未収配当金	821,609,617
差入委託証拠金	4,658,229,504
流動資産合計	587,265,695,053
資産合計	587,265,695,053
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,478,068
前受金	433,167,127
未払解約金	326,575,989
未払利息	758
流動負債合計	781,221,942
負債合計	781,221,942
純資産の部	
元本等	
元本	121,623,869,603
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	464,860,603,508
元本等合計	586,484,473,111
純資産合計	586,484,473,111
負債純資産合計	587,265,695,053

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月12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</p>



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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	121,623,869,603口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 4,8221円 (1万口当たり純資産額) (48,221円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年6月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月12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	2023年6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月11日
期首元本額	125,392,890,332円
期中追加設定元本額	16,654,658,001円
期中一部解約元本額	20,423,678,730円

期末元本額	121,623,869,603円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,812,527,494円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,126,239円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,819,723,371円
世界経済インデックスファンド	11,766,651,956円
外国株式インデックス・オープン	897,902,307円
DCマイセクション25	771,733,385円
DCマイセクション50	3,533,182,810円
DCマイセクション75	4,453,935,546円
DC外国株式インデックス・オープン	12,401,345,995円
DCマイセクションS25	421,245,270円
DCマイセクションS50	1,859,824,500円
DCマイセクションS75	1,821,732,095円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	29,326,309円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	149,806,448円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	114,531,937円
DC世界経済インデックスファンド	9,327,170,664円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,078,489,795円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,046,222円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,528,471円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	23,455,467円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	9,533,949円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	37,948,390円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,218,514円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	23,547,978円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	205,623,462円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	150,534,828円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,128,619,174円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	76,764,148円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	20,628,861円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	137,185,087円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	45,581,213円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	904,970,174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)	958,397,875円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,125,843,387円
コア投資戦略ファンド(安定型)	290,950,305円
コア投資戦略ファンド(成長型)	710,788,744円
分散投資コア戦略ファンドA	1,677,632,553円
分散投資コア戦略ファンドS	8,247,590,532円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,405,356,732円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,005,106,419円
コア投資戦略ファンド(切替型)	339,465,119円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	525,863,903円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,490,175円
SMT インデックスバランス・オープン	128,883,834円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	188,271,082円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	10,821,370,570円
SMT 世界経済インデックス・オープン	234,596,599円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	942,541,511円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	160,570,655円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,065,392円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	778,958,522円
グローバル経済コア	535,241,187円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,569,951円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,222,162円

コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	288,399,668円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	61,645,058円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	126,190,981円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	113,164,049円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	44,173,163円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	49,057,498円
10資産分散投資ファンド	54,720,812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）	132,346,874円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	24,632,403円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	466,866,224円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,453,630,341円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	107,392,067円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用）	82,116,060円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	83,685,761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）	76,015,453円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	214,968,295円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	209,372,552円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	208,311,048円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	209,262,076円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	207,193,300円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	103,512,005円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	134,994,647円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		8,290,614,217
投資信託受益証券		△5,988,759
投資証券		357,520,356
合計		8,642,145,814

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年6月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	10,829,829,908	—	11,262,997,035	433,167,127
合計		10,829,829,908	—	11,262,997,035	433,167,127

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

(2023年6月12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	80,840,400	—	80,843,880	3,480
	アメリカドル	80,840,400	—	80,843,880	3,480
	売建	145,088,400	—	146,435,337	△1,346,937
	ユーロ	76,473,480	—	76,400,397	73,083
	イスラエルシェ ケル	68,614,920	—	70,034,940	△1,420,020
合計		225,928,800	—	227,279,217	△1,343,457

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	23,392	33.41	781,526.72	
	BAKER HUGHES CO	77,332	30.01	2,320,733.32	
	CHENIERE ENERGY INC	19,971	147.14	2,938,532.94	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	79.90	677,711.80	
	CHEVRON CORP	143,594	158.86	22,811,342.84	
	CONOCOPHILLIPS	96,113	103.89	9,985,179.57	
	COTERRA ENERGY INC	64,000	24.57	1,572,480.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	49.87	2,506,266.72	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	132.28	1,754,958.76	
	EOG RESOURCES INC	46,173	116.25	5,367,611.25	
	EQT CORPORATION	27,026	38.55	1,041,852.30	
	EXXON MOBIL	323,843	107.39	34,777,499.77	
	HALLIBURTON CO	70,302	32.34	2,273,566.68	

HESS CORP	21,535	136.39	2,937,158.65
HF SINCLAIR CORP	13,429	45.82	615,316.78
KINDER MORGAN INC	157,856	17.03	2,688,287.68
MARATHON OIL CORP	50,360	23.55	1,185,978.00
MARATHON PETROLEUM CORP	35,232	113.01	3,981,568.32
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,802	59.32	3,428,814.64
ONEOK INC	35,533	59.84	2,126,294.72
OVINTIV INC	20,998	37.72	792,044.56
PHILLIPS 66	37,618	98.76	3,715,153.68
PIONEER NATURAL RESOURCES	19,500	204.80	3,993,600.00
SCHLUMBERGER	111,773	47.53	5,312,570.69
TARGA RESOURCES CORP	17,298	70.81	1,224,871.38
TEXAS PACIFIC LAND CORP	533	1,392.94	742,437.02
VALERO ENERGY CORP	28,597	113.39	3,242,613.83
WILLIAMS COS	98,553	30.39	2,995,025.67
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,457	278.59	4,863,345.63
ALBEMARLE CORP	9,440	220.50	2,081,520.00
ALCOA CORP	15,500	35.23	546,065.00
AMCOR PLC	110,292	10.01	1,104,022.92
AVERY DENNISON CORP	6,638	162.52	1,078,807.76
BALL CORP	25,605	52.58	1,346,310.90
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	113.63	975,172.66
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	16,527	67.97	1,123,340.19
CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	16.00	688,000.00
CORTEVA INC	55,406	56.44	3,127,114.64
CROWN HOLDINGS INC	9,940	83.77	832,673.80
DOW INC	55,796	51.74	2,886,885.04
DUPONT DE NEMOURS INC	38,372	69.67	2,673,377.24
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	80.48	710,799.36
ECOLAB INC	19,940	177.48	3,538,951.20
FMC CORP	10,507	105.63	1,109,854.41
FREEMPORT-MCMORAN INC	111,600	37.89	4,228,524.00
INT'L PAPER CO	25,191	31.68	798,050.88
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	78.24	1,510,579.68
LINDE PLC	39,250	360.76	14,159,830.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	89.02	1,757,699.90

MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,892	427.26	2,090,155.92
MOSAIC CO/THE	27,732	35.08	972,838.56
NEWMONT CORPORATION	61,808	41.46	2,562,559.68
NUCOR CORP	20,956	145.55	3,050,145.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,687	130.80	1,005,459.60
PPG INDUSTRIES INC	19,305	139.67	2,696,329.35
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	5,000	246.62	1,233,100.00
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	82.93	867,116.08
SEALED AIR CORP	11,690	38.62	451,467.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,339	240.76	4,656,057.64
STEEL DYNAMICS INC	13,766	99.22	1,365,862.52
VULCAN MATERIALS CO	10,153	206.64	2,098,015.92
WESTLAKE CORP	2,222	111.40	247,530.80
WESTROCK CO	21,356	29.61	632,351.16
3 M COMPANY	43,028	99.90	4,298,497.20
AECOM	10,456	83.57	873,807.92
AERCAP HOLDINGS NV	15,704	59.59	935,801.36
ALLEGION PLC	7,601	112.65	856,252.65
AMETEK INC	17,753	150.29	2,668,098.37
AXON ENTERPRISE INC	5,367	194.82	1,045,598.94
BOEING CO	45,873	217.31	9,968,661.63
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	11,010	122.08	1,344,100.80
CARLISLE COS INC	4,378	232.66	1,018,585.48
CARRIER GLOBAL CORP	68,158	45.30	3,087,557.40
CATERPILLAR	41,312	235.03	9,709,559.36
CUMMINS INC	11,372	226.63	2,577,236.36
DEERE&CO	22,675	378.87	8,590,877.25
DOVER CORP	10,657	141.14	1,504,128.98
EATON CORP	31,311	187.30	5,864,550.30
EMERSON ELECTRIC CO	46,386	84.20	3,905,701.20
FASTENAL CO	44,011	54.77	2,410,482.47
FERGUSON PLC	16,011	144.57	2,314,710.27
FORTIVE CORP	29,113	68.15	1,984,050.95
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	65.76	677,985.60
GENERAC HOLDINGS INC	5,211	116.77	608,488.47
GENERAL DYNAMICS CORP	18,106	212.27	3,843,360.62

GENERAL ELECTRIC CO	87,133	106.30	9,262,237.90
GRACO INC	13,378	82.55	1,104,353.90
GRAINGER (WW) INC	3,667	706.48	2,590,662.16
HEICO CORP	3,640	163.61	595,540.40
HEICO CORP-CLASS A	6,394	130.71	835,759.74
HONEYWELL INTL INC	52,641	197.89	10,417,127.49
HOWMET AEROSPACE INC	31,594	45.94	1,451,428.36
HUBBELL INC	4,432	306.86	1,360,003.52
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,522	215.31	758,321.82
IDEX CORP	5,916	206.86	1,223,783.76
ILLINOIS TOOL WORKS	24,371	237.51	5,788,356.21
INGERSOLL-RAND INC	31,562	62.46	1,971,362.52
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	50.17	637,159.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	53,782	63.51	3,415,694.82
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	188.59	2,768,878.38
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	303.38	766,337.88
LOCKHEED MARTIN CORP	18,184	462.69	8,413,554.96
MASCO CORP	19,462	53.96	1,050,169.52
NORDSON CORP	4,121	232.15	956,690.15
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,590	454.26	5,264,873.40
OTIS WORLDWIDE CORP	33,858	85.66	2,900,276.28
OWENS CORNING	6,460	118.15	763,249.00
PACCAR INC	42,159	76.83	3,239,075.97
PARKER HANNIFIN CORP	10,335	356.13	3,680,603.55
PENTAIR PLC	14,533	59.17	859,917.61
QUANTA SERVICES INC	11,465	182.83	2,096,145.95
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	117,466	99.34	11,669,072.44
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,188	305.50	2,806,934.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	13,828	43.82	605,942.96
SMITH (A. O.) CORP	9,016	68.79	620,210.64
SNAP-ON INC	4,000	267.58	1,070,320.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	84.60	1,065,790.80
TEXTRON	16,934	65.29	1,105,620.86
TORO CO	8,812	96.74	852,472.88
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,638	176.23	3,284,574.74
TRANSDIGM GROUP INC	4,356	800.01	3,484,843.56



UNITED RENTALS INC	5,364	389.02	2,086,703.28
WABTEC CORP	15,480	99.05	1,533,294.00
WATSCO INC	2,656	351.83	934,460.48
XYLEM INC	18,991	109.71	2,083,502.61
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,866	215.22	7,073,420.52
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	11,364	103.51	1,176,287.64
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,742	153.84	1,498,709.28
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,668	63.44	676,777.92
CINTAS CORP	7,433	480.43	3,571,036.19
CLARIVATE PLC	27,357	8.21	224,600.97
COPART INC	35,164	85.74	3,014,961.36
COSTAR GROUP INC	32,116	80.14	2,573,776.24
EQUIFAX INC	10,391	223.84	2,325,921.44
JACOBS SOLUTIONS INC	10,661	116.23	1,239,128.03
LEIDOS HOLDINGS	11,220	82.91	930,250.20
PAYCHEX INC	26,437	111.69	2,952,748.53
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	304.70	1,290,404.50
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	182.44	624,492.12
REPUBLIC SERVICES INC	18,327	143.30	2,626,259.10
ROBERT HALF INTL INC	7,185	72.72	522,493.20
ROLLINS INC	17,468	40.80	712,694.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,335	56.50	1,092,427.50
TRANSUNION	15,741	73.30	1,153,815.30
VERISK ANALYTICS INC	12,079	219.36	2,649,649.44
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	135.83	2,686,038.25
WASTE MANAGEMENT INC	32,506	162.68	5,288,076.08
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	89.73	750,770.91
CSX CORP	164,261	32.31	5,307,272.91
DELTA AIR LINES INC	14,609	39.28	573,841.52
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	115.31	1,416,006.80
FEDEX CORP	19,274	223.76	4,312,750.24
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	113,011	3.44	388,757.84
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,052	170.04	1,199,122.08
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	55.74	759,346.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,967	216.18	3,884,106.06
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,111	306.19	2,483,507.09

SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	30.62	414,380.46
U-HAUL HOLDING CO	6,606	50.51	333,669.06
UBER TECHNOLOGIES INC	144,596	40.99	5,926,990.04
UNION PACIFIC CORP	48,838	199.67	9,751,483.46
UNITED PARCEL SERVICE B	58,304	170.49	9,940,248.96
APTIV PLC	21,362	97.99	2,093,262.38
BORGWARNER INC	19,781	45.85	906,958.85
FORD MOTOR COMPANY	306,411	13.74	4,210,087.14
GENERAL MOTORS CO	112,798	36.23	4,086,671.54
LEAR CORP	5,287	138.11	730,187.57
LUCID GROUP INC	61,234	6.21	380,263.14
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	13.87	712,030.32
TESLA INC	227,557	244.40	55,614,930.80
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	488.33	1,026,957.99
DR HORTON INC	25,466	114.01	2,903,378.66
GARMIN LTD	12,854	105.34	1,354,040.36
HASBRO INC	10,572	60.29	637,385.88
LENNAR CORP-CL A	20,844	114.20	2,380,384.80
LULULEMON ATHLETICA INC	9,374	360.40	3,378,389.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,163	95.35	396,942.05
NIKE B	96,874	105.86	10,255,081.64
NVR INC	247	5,817.96	1,437,036.12
PULTE GROUP INC	16,747	71.99	1,205,616.53
VF CORP	25,718	19.11	491,470.98
WHIRLPOOL CORP	3,785	142.06	537,697.10
AIRBNB INC-CLASS A	32,980	117.86	3,887,022.80
ARAMARK	16,686	40.30	672,445.80
BOOKING HOLDINGS INC	2,968	2,606.13	7,734,993.84
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	48.50	851,660.00
CARNIVAL CORPORATION	84,361	13.09	1,104,285.49
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,159	2,040.55	4,405,547.45
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	161.91	1,490,705.37
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	298.07	848,903.36
DOORDASH INC - A	19,212	71.78	1,379,037.36
EXPEDIA GROUP INC	11,638	110.48	1,285,766.24
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,810	141.53	2,945,239.30

HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	115.61	437,815.07
LAS VEGAS SANDS CORP	25,560	58.48	1,494,748.80
MARRIOTT INTL A	21,339	179.01	3,819,894.39
MCDONALD'S CORP	58,058	286.79	16,650,453.82
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,754	41.33	940,422.82
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,116	91.22	1,561,321.52
STARBUCKS CORP	90,925	97.96	8,907,013.00
VAIL RESORTS INC	3,014	239.66	722,335.24
WYNN RESORTS LTD	6,702	102.21	685,011.42
YUM BRANDS INC	21,705	133.44	2,896,315.20
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,339	80.38	4,689,288.82
ALPHABET INC-CL A	474,294	122.23	57,972,955.62
ALPHABET INC-CL C	428,504	122.87	52,650,286.48
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,838	328.48	2,574,626.24
COMCAST CORP-CL A	335,595	40.23	13,500,986.85
ELECTRONIC ARTS INC	21,551	125.94	2,714,132.94
FOX CORP - CLASS A	21,544	33.54	722,585.76
FOX CORP- CLASS B	10,345	31.40	324,833.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	39.63	1,129,890.93
LIBERTY BROADBAND-C	9,153	73.85	675,949.05
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	15,379	75.64	1,163,267.56
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	13,584	29.65	402,765.60
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	84.15	977,233.95
MATCH GROUP INC	22,730	41.59	945,340.70
META PLATFORMS INC-CLASS A	176,691	264.95	46,814,280.45
NETFLIX INC	35,692	420.02	14,991,353.84
NEWS CORP-CLASS A	33,479	19.21	643,131.59
OMNICOM GROUP	16,538	94.49	1,562,675.62
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	16.10	523,378.80
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	23.87	1,092,458.29
ROBLOX CORP -CLASS A	34,155	38.69	1,321,456.95
ROKU INC	9,122	69.48	633,796.56
SEA LTD-ADR	28,338	63.38	1,796,062.44
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,468	3.81	230,383.08
SNAP INC - A	83,375	10.09	841,253.75
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	134.03	1,724,564.01

THE WALT DISNEY CO	144,810	91.93	13,312,383.30
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,671	74.58	2,734,923.18
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	13.84	2,455,395.92
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	21,935	26.15	573,600.25
ADVANCE AUTO PARTS	4,616	63.58	293,485.28
AMAZON.COM	737,070	123.43	90,976,550.10
AUTOZONE INC	1,495	2,363.19	3,532,969.05
BATH & BODY WORKS INC	19,806	42.23	836,407.38
BEST BUY COMPANY INC	15,285	75.24	1,150,043.40
BURLINGTON STORES INC	5,108	145.51	743,265.08
CARMAX INC	13,591	78.81	1,071,106.71
CHEWY INC - CLASS A	6,878	36.80	253,110.40
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	135.72	671,814.00
EBAY	41,952	45.81	1,921,821.12
ETSY INC	10,294	91.24	939,224.56
GENUINE PARTS CO	11,319	155.82	1,763,726.58
HOME DEPOT	80,884	297.35	24,050,857.40
LKQ CORP	19,286	54.30	1,047,229.80
LOWES COMPANIES	47,875	209.12	10,011,620.00
MERCADOLIBRE INC	3,552	1,208.55	4,292,769.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,912	906.99	4,455,134.88
POOL CORP	3,304	326.42	1,078,491.68
ROSS STORES INC	28,076	103.29	2,899,970.04
TJX COMPANIES INC	91,766	79.36	7,282,549.76
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,922	217.22	1,938,036.84
ULTA BEAUTY INC	3,920	423.62	1,660,590.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	20.81	520,250.00
COSTCO WHOLESALE CORP	35,279	517.28	18,249,121.12
DOLLAR GENERAL CORP	17,687	153.05	2,706,995.35
DOLLAR TREE INC	17,931	131.77	2,362,767.87
KROGER CO	56,285	46.17	2,598,678.45
SYSCO CORP	39,357	72.54	2,854,956.78
TARGET (DAYTON HUDSON)	36,243	126.99	4,602,498.57
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	59,767	31.42	1,877,879.14
WALMART INC	117,948	153.09	18,056,659.32
ALTRIA GROUP INC	142,110	45.22	6,426,214.20

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	43,835	72.54	3,179,790.90
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	24,006	64.34	1,544,546.04
BUNGE LIMITED	11,604	93.62	1,086,366.48
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	46.05	730,767.45
COCA-COLA CO	326,933	60.47	19,769,638.51
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	63.73	981,059.62
CONAGRA BRANDS INC	40,304	34.38	1,385,651.52
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,940	241.61	3,126,433.40
DARLING INGREDIENTS INC	13,242	63.09	835,437.78
GENERAL MILLS INC	46,616	82.30	3,836,496.80
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,019	255.82	3,074,700.58
HORMEL FOODS CORP	23,338	40.87	953,824.06
JM SMUCKER CO	7,850	153.57	1,205,524.50
KELLOGG CO	22,290	67.16	1,496,996.40
KEURIG DR PEPPER INC	72,932	31.31	2,283,500.92
KRAFT HEINZ CO/THE	63,627	36.88	2,346,563.76
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	113.62	1,349,351.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	20,790	90.67	1,885,029.30
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	66.46	974,901.74
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	108,308	72.97	7,903,234.76
MONSTER BEVERAGE CORP	64,176	57.25	3,674,076.00
PEPSICO INC	109,961	182.35	20,051,388.35
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	124,090	92.59	11,489,493.10
TYSON FOODS INC	23,306	50.37	1,173,923.22
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	94.10	1,820,458.60
CLOROX COMPANY	9,570	156.66	1,499,236.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,289	75.84	4,723,997.76
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,174	176.53	3,208,256.22
KIMBERLY-CLARK CORP	26,373	134.50	3,547,168.50
PROCTER & GAMBLE CO	187,873	146.56	27,534,666.88
ABBOTT LABORATORIES	139,490	101.69	14,184,738.10
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,943	304.44	1,809,286.92
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,715	178.22	2,444,287.30
BAXTER INTERNATIONAL	40,013	41.97	1,679,345.61
BECTON DICKINSON & CO	22,473	251.50	5,651,959.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,067	51.28	5,900,635.76

CARDINAL HEALTH	21,902	86.77	1,900,436.54
CENTENE CORP	45,335	69.00	3,128,115.00
CVS HEALTH CORP	101,145	71.76	7,258,165.20
DAVITA INC	4,627	97.48	451,039.96
DENTSPLY SIRONA INC	17,774	38.42	682,877.08
DEXCOM INC	30,645	124.34	3,810,399.30
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	48,456	84.10	4,075,149.60
ELEVANCE HEALTH INC	19,014	470.17	8,939,812.38
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	29,921	77.10	2,306,909.10
HCA HEALTHCARE INC	16,567	271.79	4,502,744.93
HENRY SCHEIN INC	11,747	74.86	879,380.42
HOLOGIC INC	18,875	77.76	1,467,720.00
HUMANA INC	9,946	513.34	5,105,679.64
IDEXX LABORATORIES INC	6,751	450.87	3,043,823.37
INSULET CORP	5,246	283.09	1,485,090.14
INTUITIVE SURGICAL INC	28,238	312.76	8,831,716.88
LABORATORY CRP OF AMER	6,548	217.57	1,424,648.36
MASIMO CORP	4,147	156.34	648,341.98
MCKESSON CORP	10,876	393.91	4,284,165.16
MEDTRONIC PLC	105,263	83.73	8,813,670.99
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	284.34	1,292,325.30
NOVOCURE LTD	7,933	42.76	339,215.08
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	134.55	1,167,759.45
RESMED INC	12,255	213.53	2,616,810.15
STERIS PLC	8,018	206.98	1,659,565.64
STRYKER CORP	26,887	280.64	7,545,567.68
TELEFLEX INC	3,934	237.06	932,594.04
THE CIGNA GROUP	23,653	265.88	6,288,859.64
THE COOPER COS INC	4,134	346.15	1,430,984.10
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,171	493.62	36,612,289.02
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	136.38	637,167.36
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	11,255	187.61	2,111,550.55
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,923	136.01	2,301,697.23
ABBVIE INC	140,386	138.18	19,398,537.48
AGILENT TECHNOLOGIES	23,785	115.79	2,754,065.15
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	190.83	1,840,173.69

AMGEN	42,448	218.76	9,285,924.48
AVANTOR INC	49,647	19.63	974,570.61
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	361.03	668,988.59
BIO-TECHNE CORP	12,980	78.43	1,018,021.40
BIOGEN INC	11,851	308.88	3,660,536.88
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	91.37	1,350,722.71
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	169,623	64.80	10,991,570.40
CATALENT INC	13,739	38.81	533,210.59
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	197.68	831,046.72
DANAHER CORP	54,898	235.37	12,921,342.26
ELI LILLY & CO	64,441	446.04	28,743,263.64
EXACT SCIENCES CORP	14,756	87.81	1,295,724.36
GILEAD SCIENCES INC	99,953	78.12	7,808,328.36
HORIZON THERAPEUTICS PLC	17,926	99.25	1,779,155.50
ILLUMINA INC	12,687	200.53	2,544,124.11
INCYTE CORP	15,212	61.04	928,540.48
IQVIA HOLDINGS INC	15,126	206.59	3,124,880.34
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,971	127.10	631,814.10
JOHNSON & JOHNSON	207,999	160.01	33,281,919.99
MERCK & CO	203,377	110.71	22,515,867.67
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,808	1,292.06	2,336,044.48
MODERNA INC	26,107	123.26	3,217,948.82
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	93.39	629,635.38
PFIZER	452,231	38.97	17,623,442.07
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,615	746.52	6,431,269.80
REPLIGEN CORP	4,353	162.19	706,013.07
REVVITY INC	10,545	111.09	1,171,444.05
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	32.91	990,031.53
SEAGEN INC	10,981	196.60	2,158,864.60
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	7.33	675,393.53
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,671	518.18	15,893,098.78
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	228.49	826,676.82
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,685	334.11	6,911,065.35
VIATRIS INC	89,720	9.38	841,573.60
WATERS CORP	4,749	249.28	1,183,830.72
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	348.28	2,008,530.76

ZOETIS INC	36,859	163.09	6,011,334.31
BANK OF AMERICA CORP	574,499	29.27	16,815,585.73
CITIGROUP	153,036	48.30	7,391,638.80
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	28.34	1,120,053.48
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	26.41	1,437,232.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	950	1,284.97	1,220,721.50
FIRST HORIZON CORP	44,308	11.71	518,846.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	10.95	1,249,526.40
JPMORGAN CHASE & CO	234,597	141.01	33,080,522.97
KEY CORP	71,223	10.68	760,661.64
M & T BANK CORP	13,674	126.92	1,735,504.08
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,049	128.93	4,132,077.57
REGIONS FINL CORP	70,810	18.47	1,307,860.70
TRUIST FINANCIAL CORP	104,155	32.63	3,398,577.65
US BANCORP	122,203	32.86	4,015,590.58
WEBSTER FINANCIAL CORP	14,273	38.75	553,078.75
WELLS FARGO & CO	298,905	42.13	12,592,867.65
ALLY FINANCIAL INC	21,529	28.00	602,812.00
AMERICAN EXPRESS	50,389	171.72	8,652,799.08
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,702	314.35	2,735,473.70
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,854	72.98	2,324,704.92
ARES MANAGEMENT CORP - A	12,780	92.22	1,178,571.60
BANK NEW YORK CO	61,254	44.43	2,721,515.22
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	103,354	335.29	34,653,562.66
BLACKROCK INC	11,937	684.40	8,169,682.80
BLACKSTONE INC	56,921	88.19	5,019,862.99
BLOCK INC	43,057	64.94	2,796,121.58
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,514	111.49	3,290,515.86
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	30.05	470,853.45
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,875	138.43	1,228,566.25
CME GROUP INC	28,271	184.84	5,225,611.64
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,872	53.28	739,100.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,002	114.14	2,397,168.28
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	26.56	743,228.48
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	397.58	1,251,581.84
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	46,912	54.66	2,564,209.92



FISERV INC	49,788	116.82	5,816,234.16
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,002	239.37	1,436,698.74
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	26.37	687,465.90
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	41.70	179,977.20
GLOBAL PAYMENTS INC	20,864	100.09	2,088,277.76
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,705	336.02	8,973,414.10
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,833	109.96	4,819,876.68
INVESCO LTD	26,420	16.14	426,418.80
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	157.89	823,080.57
KKR & CO INC	49,157	55.18	2,712,483.26
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,386	204.52	1,306,064.72
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	276.65	887,216.55
MASTERCARD INC-CLASS A	67,952	369.22	25,089,237.44
MOODY' S CORP	13,065	335.48	4,383,046.20
MORGAN STANLEY	100,851	86.21	8,694,364.71
MSCI INC	6,518	473.85	3,088,554.30
NASDAQ INC	28,971	57.83	1,675,392.93
NORTHERN TRUST CORP	15,902	74.83	1,189,946.66
PAYPAL HOLDINGS INC	86,747	63.49	5,507,567.03
PRICE T ROWE GROUP INC	17,907	114.47	2,049,814.29
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	95.68	1,481,700.48
S&P GLOBAL INC	26,047	384.00	10,002,048.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,051	55.00	6,657,805.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	58.84	561,922.00
STATE STREET CORP	26,059	73.91	1,926,020.69
SYNCHRONY FINANCIAL	36,117	33.69	1,216,781.73
TOAST INC-CLASS A	20,341	21.86	444,654.26
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	70.81	641,609.41
VISA INC-CLASS A SHARES	130,009	223.56	29,064,812.04
AFLAC	46,816	68.97	3,228,899.52
ALLSTATE CORP	20,709	111.96	2,318,579.64
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	116.10	733,635.90
AMERICAN INT'L GROUP	59,547	56.88	3,387,033.36
AON PLC	16,687	314.32	5,245,057.84
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,726	71.44	2,123,625.44
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,019	206.87	3,727,590.53

ASSURANT INC	4,726	125.52	593,207.52
BROWN & BROWN INC	19,873	64.03	1,272,468.19
CHUBB LTD	33,210	191.15	6,348,091.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,530	101.93	1,379,112.90
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	218.20	472,621.20
EVEREST RE GROUP LTD	3,288	344.59	1,133,011.92
FNF GROUP	20,461	35.40	724,319.40
GLOBE LIFE INC	8,106	107.93	874,880.58
HARTFORD FINANCIAL SVCS	24,731	71.32	1,763,814.92
LOEWS CORP	16,741	59.34	993,410.94
MARKEL GROUP INC	1,007	1,342.27	1,351,665.89
MARSH & MCLENNAN COS	39,396	178.25	7,022,337.00
METLIFE INC	54,127	53.87	2,915,821.49
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	71.39	1,323,285.04
PROGRESSIVE CORP	47,071	130.90	6,161,593.90
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	29,190	84.55	2,468,014.50
TRAVELERS COS INC/THE	18,521	175.60	3,252,287.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,448	225.70	1,906,713.60
WR BERKLEY CORP	17,572	57.19	1,004,942.68
WEYERHAEUSER CO	59,710	29.66	1,770,998.60
ACCENTURE PLC-CL A	50,658	308.72	15,639,137.76
ADOBE INC	36,682	454.00	16,653,628.00
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	92.48	1,062,040.32
ANSYS INC	6,794	325.53	2,211,650.82
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	163.69	391,873.86
ATLASSIAN CORP-CL A	11,855	171.99	2,038,941.45
AUTODESK INC	17,467	201.39	3,517,679.13
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	19,292	50.64	976,946.88
BILL HOLDINGS, INC.	7,443	115.26	857,880.18
BLACK KNIGHT INC	11,543	56.12	647,793.16
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,364	229.30	4,898,765.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,124	126.14	1,024,761.36
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20,283	63.82	1,294,461.06
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	39,936	62.05	2,478,028.80
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	18,367	149.53	2,746,417.51
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	150.22	465,682.00

DATADOG INC - CLASS A	20,137	95.63	1,925,701.31
DOCUSIGN INC	14,969	57.02	853,532.38
DROPBOX INC-CLASS A	23,068	24.00	553,632.00
DYNATRACE INC	14,790	50.96	753,698.40
EPAM SYSTEMS INC	4,768	211.33	1,007,621.44
FAIR ISAAC CORP	2,115	774.71	1,638,511.65
FORTINET INC	51,829	68.01	3,524,890.29
GARTNER INC	6,340	344.55	2,184,447.00
GEN DIGITAL INC	43,555	17.82	776,150.10
GODADDY INC - CLASS A	11,388	72.01	820,049.88
HUBSPOT INC	3,646	516.91	1,884,653.86
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,616	135.30	9,689,644.80
INTUIT INC	22,381	431.55	9,658,520.55
MICROSOFT CORP	564,159	326.79	184,361,519.61
MONDAY.COM LTD	2,028	174.72	354,332.16
MONGODB INC	5,325	374.51	1,994,265.75
OKTA INC	11,505	71.40	821,457.00
ORACLE CORP	128,416	109.85	14,106,497.60
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,074	15.02	2,194,031.48
PALO ALTO NETWORKS INC	24,051	220.10	5,293,625.10
PTC INC	8,226	138.57	1,139,876.82
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,729	451.80	3,943,762.20
SALESFORCE INC	79,382	215.31	17,091,738.42
SERVICENOW INC	16,202	534.03	8,652,354.06
SNOWFLAKE INC-CLASS A	20,742	170.65	3,539,622.30
SPLUNK INC	13,355	98.89	1,320,675.95
SYNOPSYS INC	12,010	438.78	5,269,747.80
TWILIO INC - A	12,842	63.89	820,475.38
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	388.67	1,297,769.13
UIPATH INC - CLASS A	28,419	17.17	487,954.23
UNITY SOFTWARE INC	21,912	36.30	795,405.60
VERISIGN INC	7,790	220.97	1,721,356.30
VMWARE INC-CLASS A	18,801	135.38	2,545,279.38
WIX.COM LTD	5,010	73.82	369,838.20
WORKDAY INC-CLASS A	16,701	204.38	3,413,350.38
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,031	67.14	1,344,881.34

ZSCALER INC	7,204	150.84	1,086,651.36
AMPHENOL CORPORATION	47,254	78.23	3,696,680.42
APPLE INC	1,262,821	180.96	228,520,088.16
ARISTA NETWORKS INC	20,777	162.52	3,376,678.04
ARROW ELECTRONICS INC	4,338	134.16	581,986.08
CDW CORP/DE	10,882	170.44	1,854,728.08
CISCO SYSTEMS	326,126	49.66	16,195,417.16
COGNEX CORP	14,352	55.30	793,665.60
CORNING	64,989	32.78	2,130,339.42
DELL TECHNOLOGIES -C	22,481	47.61	1,070,320.41
F5 INC	4,851	146.78	712,029.78
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	15.79	1,538,451.28
HP INC	68,329	29.80	2,036,204.20
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	30.19	764,440.99
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	161.57	2,235,805.66
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,014	277.99	3,617,761.86
NETAPP INC	18,303	69.71	1,275,902.13
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	16,583	60.89	1,009,738.87
TE CONNECTIVITY LTD	24,490	128.00	3,134,720.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,899	391.99	1,528,369.01
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	50.11	887,848.98
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	39.78	1,025,926.20
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	274.66	1,143,134.92
AT&T INC	569,565	15.95	9,084,561.75
LIBERTY GLOBAL PLC-A	15,516	16.76	260,048.16
LIBERTY GLOBAL PLC-C	18,869	17.74	334,736.06
T-MOBILE US INC	48,037	131.36	6,310,140.32
VERIZON COMMUNICATIONS	338,242	35.47	11,997,443.74
AES CORP	54,375	20.09	1,092,393.75
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	53.23	1,106,012.94
AMEREN CORPORATION	20,898	83.36	1,742,057.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,907	83.68	3,339,417.76
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,127	146.66	2,365,185.82
ATMOS ENERGY CORP	11,302	117.33	1,326,063.66
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	28.95	1,374,140.70
CMS ENERGY CORP	23,697	60.69	1,438,170.93

CONSOLIDATED EDISON INC	27,140	93.49	2,537,318.60
CONSTELLATION ENERGY	25,114	93.29	2,342,885.06
DOMINION ENERGY INC	66,179	53.09	3,513,443.11
DTE ENERGY COMPANY	15,851	111.43	1,766,276.93
DUKE ENERGY CORP	60,751	91.52	5,559,931.52
EDISON INTL	30,339	67.72	2,054,557.08
ENTERGY CORP	16,181	101.44	1,641,400.64
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	41.61	848,802.39
EVERGY INC	18,475	59.40	1,097,415.00
EVERSOURCE ENERGY	27,450	70.37	1,931,656.50
EXELON CORP	81,368	40.08	3,261,229.44
FIRSTENERGY CORP	45,523	38.61	1,757,643.03
NEXTERA ENERGY INC	161,421	74.07	11,956,453.47
NISOURCE INC	32,351	27.09	876,388.59
NRG ENERGY INC	19,068	34.08	649,837.44
PG&E CORP	143,296	16.88	2,418,836.48
PPL CORPORATION	58,459	26.82	1,567,870.38
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	39,468	62.07	2,449,778.76
SEMPRA ENERGY	24,582	147.70	3,630,761.40
SOUTHERN CO	85,837	71.26	6,116,744.62
UGI CORP	18,019	29.38	529,398.22
VISTRA CORP	31,797	24.82	789,201.54
WEC ENERGY GROUP INC	26,142	89.93	2,350,950.06
XCEL ENERGY INC	43,741	63.45	2,775,366.45
ADVANCED MICRO DEVICES	127,756	124.92	15,959,279.52
ANALOG DEVICES	40,091	182.46	7,315,003.86
APPLIED MATERIALS	68,040	136.12	9,261,604.80
BROADCOM INC	33,103	804.62	26,635,335.86
ENPHASE ENERGY INC	11,020	174.58	1,923,871.60
ENTEGRIS INC	12,483	109.08	1,361,645.64
FIRST SOLAR INC	7,921	192.00	1,520,832.00
INTEL CORP	333,366	31.34	10,447,690.44
KLA CORP	10,913	465.65	5,081,638.45
LAM RESEARCH CORP	10,752	606.59	6,522,055.68
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	80.55	884,277.90
MARVELL TECHNOLOGY INC	70,922	60.01	4,256,029.22

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,289	80.07	3,546,220.23
	MICRON TECHNOLOGY	86,632	65.43	5,668,331.76
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,531	501.87	1,772,102.97
	NVIDIA CORP	197,051	387.70	76,396,672.70
	NXP SEMICONDUCTORS NV	20,458	185.00	3,784,730.00
	ON SEMICONDUCTOR CORP	34,468	89.02	3,068,341.36
	QORVO INC	8,556	98.36	841,568.16
	QUALCOMM	89,339	119.11	10,641,168.29
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,372	104.49	1,397,240.28
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,156	282.33	1,173,363.48
	TERADYNE INC	12,318	105.02	1,293,636.36
	TEXAS INSTRUMENTS	72,562	170.59	12,378,351.58
	WOLFSPEED INC	10,256	53.13	544,901.28
	CBRE GROUP INC-A	25,904	78.94	2,044,861.76
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	4.18	412,566.00
	ZILLOW GROUP INC-C	13,427	44.83	601,932.41
	アメリカドル 小計	27,087,416		2,970,398,832.45 (414,162,709,208)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	54,860	17.38	953,466.80
	CAMECO CORP	31,793	41.05	1,305,102.65
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,954	75.27	6,620,297.58
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	23.21	2,583,110.53
	ENBRIDGE	159,030	50.62	8,050,098.60
	IMPERIAL OIL	16,488	67.03	1,105,190.64
	KEYERA CORP	18,607	31.10	578,677.70
	PARKLAND CORP	14,075	34.09	479,816.75
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,666	42.30	1,931,671.80
	SUNCOR ENERGY	109,226	40.43	4,416,007.18
	TC ENERGY CORP	83,423	55.25	4,609,120.75
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	60.05	1,501,790.45
	AGNICO EAGLE MINES	40,863	68.03	2,779,909.89
	BARRICK GOLD CORP	133,727	22.67	3,031,591.09
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,139	63.01	827,888.39
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,360	29.67	1,286,491.20
	FRANCO-NEVADA CORP	15,363	194.64	2,990,254.32
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	11.13	577,057.11

KINROSS GOLD CORP	108,451	6.47	701,677.97
LUNDIN MINING CORP	62,243	10.06	626,164.58
NUTRIEN LTD	41,509	78.45	3,256,381.05
PAN AMERICAN SILVER CORP	38,411	20.57	790,114.27
TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	56.72	2,007,093.92
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	101.14	354,495.70
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	37,268	59.87	2,231,235.16
CAE INC	25,999	27.83	723,552.17
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	105.31	548,981.03
WSP GLOBAL INC	9,951	172.52	1,716,746.52
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	20,047	49.69	996,135.43
RB GLOBAL INC	14,445	73.76	1,065,463.20
THOMSON REUTERS CORP	13,293	164.11	2,181,514.23
AIR CANADA	13,805	22.37	308,817.85
CANADIAN NATL RAILWAY CO	46,034	152.41	7,016,041.94
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	72,867	102.04	7,435,348.68
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	140.15	818,055.55
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	71.04	1,438,844.16
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	100.82	309,517.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,079	39.51	674,791.29
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	100.30	2,314,221.90
QUEBECOR INC -CL B	15,200	32.68	496,736.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	167.46	755,746.98
DOLLARAMA INC	22,000	83.03	1,826,660.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	61,467	64.58	3,969,538.86
EMPIRE CO LTD 'A'	15,253	33.91	517,229.23
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	116.46	1,503,847.98
METRO INC	18,840	70.16	1,321,814.40
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	153.09	800,048.34
SAPUTO INC	20,898	30.93	646,375.14
BANK MONTREAL	57,263	116.34	6,661,977.42
BANK NOVA SCOTIA	93,348	66.13	6,173,103.24
CANADIAN IMPERIAL BANK	73,910	57.05	4,216,565.50
NATIONAL BANK OF CANADA	27,289	96.22	2,625,747.58
ROYAL BANK OF CANADA	109,566	123.89	13,574,131.74
TORONTO-DOMINION BANK	146,523	79.12	11,592,899.76

	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	42.50	1,232,542.50	
	BROOKFIELD CORP	114,442	42.21	4,830,596.82	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	19.96	650,276.84	
	IGM FINANCIAL INC	7,685	39.86	306,324.10	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	4,301	39.75	170,964.75	
	ONEX CORP	6,603	67.62	446,494.86	
	TMX GROUP LTD	4,685	147.06	688,976.10	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,754	978.53	1,716,341.62	
	GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	38.07	905,609.16	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,977	88.75	619,208.75	
	INTACT FINANCIAL CORP	13,255	198.29	2,628,333.95	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	143,336	25.72	3,686,601.92	
	POWER CORP OF CANADA	43,577	34.76	1,514,736.52	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	48,433	67.40	3,264,384.20	
	CGI INC - CL A	16,084	138.65	2,230,046.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,604	2,702.64	4,335,034.56	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	98.29	686,457.36	
	OPEN TEXT CORP	20,463	56.20	1,150,020.60	
	SHOPIFY INC - CLASS A	95,607	81.88	7,828,301.16	
	BCE INC	6,203	61.37	380,678.11	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	57.51	1,603,436.31	
	TELUS CORP	32,908	25.30	832,572.40	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	51,818	11.54	597,979.72	
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	24.74	603,532.30	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	46.63	526,685.85	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	36.12	372,902.88	
	EMERA INC	23,223	55.33	1,284,928.59	
	FORTIS INC	35,547	57.42	2,041,108.74	
	HYDRO ONE LTD	28,888	37.54	1,084,455.52	
	NORTHLAND POWER INC	17,854	28.56	509,910.24	
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	194.78	523,958.20	
	カナダドル 小計	3,251,856		189,078,560.83 (19,756,818,821)	
ユーロ	ENI	174,687	12.98	2,268,136.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	10.69	423,986.78	
	NESTE OIL OYJ	32,766	38.91	1,274,925.06	



OMV AG	12,549	39.52	495,936.48
REPSOL SA	111,112	13.49	1,498,900.88
TENARIS SA	40,648	12.82	521,310.60
TOTALENERGIES SE	188,735	54.95	10,370,988.25
AIR LIQUIDE	41,239	156.60	6,458,027.40
AKZO NOBEL	12,357	70.94	876,605.58
ARCELORMITTAL	41,072	25.46	1,045,693.12
ARKEMA	4,369	83.32	364,025.08
BASF SE	69,088	46.02	3,179,775.20
COVESTRO AG	14,454	39.05	564,428.70
CRH PLC	55,581	45.26	2,515,596.06
DSM-FIRMENICH AG	13,707	95.89	1,314,364.23
EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	17.99	288,505.63
HEIDELBERG MATERIALS AG	14,240	71.90	1,023,856.00
OCI NV	7,248	21.63	156,774.24
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	33.93	661,770.72
SOLVAY SA	5,356	104.65	560,505.40
STORA ENSO OYJ R	42,169	12.40	522,895.60
SYMRISE AG	10,018	92.12	922,858.16
UMICORE	17,605	27.46	483,433.30
UPM KYMMENE OYJ	42,324	29.85	1,263,371.40
VOESTALPINE AG	7,152	32.44	232,010.88
WACKER CHEMIE AG	1,770	116.85	206,824.50
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	15,622	31.48	491,780.56
AIRBUS SE	46,560	128.42	5,979,235.20
ALSTOM	24,388	27.58	672,621.04
BOUYGUES ORD	16,606	30.33	503,659.98
BRENTAG SE	12,514	72.54	907,765.56
CNH INDUSTRIAL NV	81,026	12.71	1,029,840.46
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	41,219	30.58	1,260,477.02
DASSAULT AVIATION SA	2,130	166.20	354,006.00
EIFFAGE	5,924	98.76	585,054.24
FERROVIAL SA	37,026	28.75	1,064,497.50
GEA GROUP AG	13,382	39.24	525,109.68
IMCD NV	4,641	135.10	626,999.10
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	62.32	772,643.36

KNORR-BREMSE AG	5,022	64.76	325,224.72
KONE OYJ-B	26,369	50.24	1,324,778.56
LEGRAND SA	21,768	89.48	1,947,800.64
METSO CORPORATION	51,970	10.84	563,614.65
MTU AERO ENGINES AG	3,962	225.10	891,846.20
PRYSMIAN SPA	21,155	35.70	755,233.50
RATIONAL AG	483	630.00	304,290.00
RHEINMETALL AG	3,660	240.50	880,230.00
SAFRAN SA	26,468	136.64	3,616,587.52
SAINT-GOBAIN	40,093	55.82	2,237,991.26
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,646	163.94	6,991,385.24
SIEMENS	60,788	158.14	9,613,014.32
SIEMENS ENERGY AG	36,841	23.72	873,868.52
THALES SA	8,524	130.45	1,111,955.80
VINCI S. A.	41,377	106.70	4,414,925.90
WARTSILA OYJ	41,917	11.12	466,117.04
BUREAU VERITAS SA	25,073	24.11	604,510.03
RANDSTAD NV	10,558	48.99	517,236.42
TELEPERFORMANCE	4,734	145.30	687,850.20
WOLTERS KLUWER	20,644	113.35	2,339,997.40
ADP	2,382	137.40	327,286.80
AENA SME SA	5,508	142.40	784,339.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	9.18	416,430.11
DEUTSCHE POST AG-REG	81,221	41.80	3,395,037.80
GETLINK	21,115	15.89	335,517.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,705	108.08	2,886,276.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	101.60	507,085.60
CONTINENTAL AG	8,168	68.88	562,611.84
DR ING HC F PORSCHE AG	9,400	116.70	1,096,980.00
FERRARI NV	10,170	276.40	2,810,988.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	67,331	72.60	4,888,230.60
MICHELIN	55,356	27.52	1,523,397.12
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	56.46	663,122.70
RENAULT SA	17,362	33.08	574,421.77
STELLANTIS NV	175,794	15.05	2,646,051.28
VALEO SA	16,596	20.68	343,205.28

VOLKSWAGEN AG-PFD	17,164	126.28	2,167,469.92
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	155.90	387,567.40
ADIDAS AG	12,635	160.00	2,021,600.00
HERMES INTERNATIONAL	2,516	1,916.40	4,821,662.40
KERING	5,997	504.70	3,026,685.90
LVMH	22,026	820.00	18,061,320.00
MONCLER SPA	18,054	63.32	1,143,179.28
PUMA SE	9,220	49.25	454,085.00
SEB SA	2,282	86.00	196,252.00
ACCOR	14,436	32.70	472,057.20
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35,321	66.82	2,360,149.22
DELIVERY HERO SE	13,414	35.75	479,550.50
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	14,938	178.00	2,658,964.00
JUST EAT TAKEAWAY	15,572	12.91	201,127.95
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	36.36	294,806.88
SODEXO	6,173	101.90	629,028.70
BOLLORE SE	83,646	5.70	476,782.20
PUBLICIS GROUPE	17,217	71.76	1,235,491.92
SCOUT24 SE	7,492	58.70	439,780.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	19.42	1,278,340.92
VIVENDI SE	61,243	8.14	498,518.02
D' IETEREN GROUP	2,217	170.20	377,333.40
INDITEX	87,326	33.25	2,903,589.50
PROSUS	64,875	66.18	4,293,427.50
ZALANDO SE	17,664	24.34	429,941.76
CARREFOUR	52,544	16.45	864,348.80
HELLOFRESH SE	13,805	18.15	250,629.77
JERONIMO MARTINS	14,298	24.16	345,439.68
KESKO OYJ-B SHS	20,083	18.13	364,205.20
KONINKLIJKE AHOLD NV	77,838	29.16	2,269,756.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	67,606	51.17	3,459,399.02
DANONE (GROUPE)	51,543	53.62	2,763,735.66
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	51,242	12.64	647,955.09
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	79.00	751,448.00
HEINEKEN NV	20,157	93.10	1,876,616.70
JDE PEET' S BV	7,000	27.32	191,240.00

KERRY GROUP PLC-A	13,050	89.60	1,169,280.00
PERNOD-RICARD	16,694	198.90	3,320,436.60
REMY COINTREAU	2,519	142.40	358,705.60
BEIERSDORF AG	7,430	117.20	870,796.00
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	66.38	582,816.40
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	14,439	74.76	1,079,459.64
LOREAL	19,143	402.20	7,699,314.60
AMPLIFON SPA	11,650	34.97	407,400.50
BIOMERIEUX	3,044	91.16	277,491.04
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	109.70	376,271.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	96.72	200,210.40
ESSILORLUXOTTICA	22,662	167.82	3,803,136.84
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	16,985	42.34	719,144.90
FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	25.83	870,186.87
KONINKLIJKE PHILIPS	71,825	18.24	1,310,231.65
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	52.34	1,128,816.78
ARGENX SE	4,177	364.50	1,522,516.50
BAYER	76,626	51.15	3,919,419.90
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	59.82	611,360.40
GRIFOLS SA	27,685	11.39	315,332.15
IPSEN	3,532	110.90	391,698.80
MERCK KGAA	10,555	168.55	1,779,045.25
ORION OYJ-CLASS B	9,854	39.96	393,765.84
QIAGEN N. V.	17,038	42.17	718,492.46
RECORDATI SPA	10,171	44.39	451,490.69
SANOFI	90,096	95.40	8,595,158.40
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	328.40	599,001.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,524	265.60	670,374.40
UCB (GROUPE)	9,389	85.66	804,261.74
ABN AMRO BANK NV-CVA	27,685	13.64	377,761.82
AIB GROUP PLC	88,299	3.80	336,065.99
BANCO BILBAO VIZCAYA	472,469	6.51	3,075,773.19
BANCO SANTANDER SA	1,306,699	3.20	4,183,396.84
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.19	812,900.84
BNP PARIBAS	89,945	56.07	5,043,216.15
CAIXABANK	336,789	3.59	1,211,766.82

COMMERZBANK AG	81,889	9.82	804,477.53
CREDIT AGRICOLE SA	99,453	10.83	1,077,274.89
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	31.47	798,582.72
FINECOBANK SPA	41,585	12.50	519,812.50
ING GROEP NV-CVA	293,860	12.08	3,551,004.24
INTESA SANPAOLO	1,247,505	2.30	2,881,112.79
KBC GROEP NV	21,452	62.44	1,339,462.88
MEDIOBANCA	25,262	10.94	276,492.59
SOCIETE GENERALE	53,019	23.32	1,236,668.17
UNICREDIT SPA	149,896	18.35	2,750,591.60
ADYEN NV	1,746	1,577.80	2,754,838.80
AMUNDI SA	4,626	53.85	249,110.10
DEUTSCHE BANK NAMEN	157,109	9.84	1,546,423.88
DEUTSCHE BOERSE	15,678	164.80	2,583,734.40
EDEMRED	20,131	61.34	1,234,835.54
EURAZEO SA	3,357	65.55	220,051.35
EURONEXT NV	6,480	63.30	410,184.00
EXOR NV	7,825	80.12	626,939.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,515	72.44	616,826.60
NEXI SPA	48,458	7.26	351,901.99
SOFINA	1,238	204.00	252,552.00
WENDEL	2,023	100.80	203,918.40
WORLDLINE SA	20,332	35.85	728,902.20
AEGON	148,741	4.53	673,796.73
AGEAS	11,086	37.63	417,166.18
ALLIANZ SE-REG	31,825	207.95	6,618,008.75
ASSICURAZIONI GENERALI	82,625	18.30	1,512,037.50
AXA SA	145,657	26.52	3,862,823.64
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,455	189.35	843,554.25
MUENCHENER RUECKVERSICH.	11,181	323.40	3,615,935.40
NN GROUP NV	16,208	33.35	540,536.80
POSTE ITALIANE SPA	46,035	9.90	455,930.64
SAMPO OYJ-A SHS	38,655	43.11	1,666,417.05
TALANX AG	5,053	52.60	265,787.80
BECHTLE AG	7,659	37.54	287,518.86
CAPGEMINI SA	13,474	168.40	2,269,021.60

DASSAULT SYSTEMES SA	52,767	40.17	2,119,914.22
NEMETSCHEK SE	5,455	72.08	393,196.40
SAP SE	82,544	123.20	10,169,420.80
NOKIA OYJ	451,941	3.78	1,708,562.95
CELLNEX TELECOM SA	47,754	37.01	1,767,375.54
DEUTSCHE TELEKOM	256,698	19.04	4,889,070.10
ELISA A	10,227	50.88	520,349.76
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30,375	11.66	354,172.50
KPN (KON.)	282,927	3.13	886,127.36
ORANGE	149,082	10.52	1,569,535.29
TELECOM ITALIA ORD	852,552	0.25	213,734.78
TELEFONICA	431,420	3.88	1,676,498.12
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	98,715	2.62	258,929.44
ACCIONA SA	2,181	159.40	347,651.40
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	5,437	32.24	175,288.88
E. ON SE	186,604	11.40	2,127,285.60
EDP RENOVAVEIS SA	21,752	19.49	424,055.24
ELIA GROUP SA/NV	3,125	117.30	366,562.50
ENAGAS	21,663	18.24	395,133.12
ENDESA	25,972	21.06	546,970.32
ENEL	630,812	6.07	3,830,921.27
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	273,128	4.64	1,268,679.56
ENGIE	145,658	14.22	2,072,422.02
FORTUM OYJ	32,550	12.40	403,782.75
IBERDROLA SA	460,276	11.49	5,290,872.62
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,010	26.62	266,466.20
RED ELECTRICA CORPORACION SA	30,678	16.15	495,449.70
RWE STAMM	50,344	39.83	2,005,201.52
SNAM SPA	147,559	4.97	733,958.46
TERNA SPA	123,882	7.95	985,852.95
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,274	28.80	1,649,491.20
VERBUND AG	6,430	71.50	459,745.00
ASM INTERNATIONAL NV	3,965	389.30	1,543,574.50
ASML HOLDING NV	32,209	666.60	21,470,519.40
INFINEON TECHNOLOGIES	105,329	36.83	3,879,267.07
STMICROELECTRONICS NV	55,076	44.10	2,428,851.60

	LEG IMMOBILIEN SE	5,275	54.40	286,960.00	
	VONOVIA SE	52,580	18.68	982,194.40	
	ユーロ 小計	14,490,227		374,586,897.20 (56,120,608,938)	
イギリスポンド	BP PLC	1,399,834	4.68	6,563,821.62	
	SHELL PLC-NEW	546,298	22.94	12,534,807.61	
	ANGLO AMERICAN PLC	101,345	24.57	2,490,046.65	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	14.67	438,136.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	52.74	576,131.76	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	20.24	356,304.96	
	GLENORE PLC	833,513	4.35	3,625,781.55	
	JOHNSON MATTHEY PLC	16,848	17.36	292,481.28	
	MONDI PLC	41,710	12.43	518,455.30	
	RIO TINTO PLC REG	88,610	51.25	4,541,262.50	
	ASHTAD GROUP PLC	33,317	53.68	1,788,456.56	
	BAE SYSTEMS PLC	240,104	9.40	2,256,977.60	
	BUNZL PLC	29,127	30.70	894,198.90	
	DCC PLC	6,622	47.33	313,419.26	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	1.49	949,094.18	
	SMITHS GROUP PLC	26,476	16.59	439,369.22	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,514	111.90	617,016.60	
	EXPERIAN PLC	74,115	28.68	2,125,618.20	
	INTERTEK GROUP PLC	13,890	42.87	595,464.30	
	RELX PLC	149,499	25.31	3,783,819.69	
	RENTOKIL INITIAL PLC	212,480	6.43	1,367,096.32	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.62	338,852.05	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	39.77	276,481.04	
	BURBERRY GROUP PLC	29,776	22.25	662,516.00	
	PERSIMMON PLC	25,686	12.13	311,571.18	
	TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.13	300,814.45	
	COMPASS GROUP PLC	142,427	21.72	3,093,514.44	
	ENTAIN PLC	49,630	12.96	643,204.80	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	14,811	54.42	806,014.62	
	PEARSON	55,305	8.19	453,169.17	
	WHITBREAD PLC	17,434	33.72	587,874.48	
	AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	6.17	447,670.23	

INFORMA PLC	110,598	7.07	782,149.05
WPP PLC	85,821	8.62	739,948.66
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.48	307,445.36
KINGFISHER PLC	153,717	2.37	365,385.30
NEXT PLC	11,044	64.34	710,570.96
OCADO GROUP PLC	54,753	3.86	211,675.09
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.67	396,054.45
TESCO PLC	601,050	2.61	1,574,149.95
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	18.59	478,635.30
BRITISH AMERICAN TOBACCO	169,799	25.90	4,398,643.09
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	23.38	419,904.80
DIAGEO	179,481	33.20	5,959,666.60
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	17.25	1,181,245.50
HALEON PLC	405,046	3.20	1,299,590.09
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,052	60.34	3,382,177.68
UNILEVER PLC	200,460	39.70	7,958,262.00
SMITH & NEPHEW PLC	68,595	11.94	819,024.30
ASTRAZENECA	123,190	117.12	14,428,012.80
GSK PLC	332,472	13.78	4,581,464.16
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16,454	18.90	311,062.87
BARCLAYS	1,252,105	1.56	1,957,540.95
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,607,565	6.07	9,765,957.37
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,254,644	0.45	2,378,514.60
NATWEST GROUP PLC	518,371	2.61	1,352,948.31
STANDARD CHARTERED PLC	190,159	6.60	1,256,570.67
3I GROUP PLC	74,757	19.91	1,488,785.65
ABRDN PLC	153,430	2.14	328,800.49
HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	8.61	285,008.66
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,689	86.50	2,827,598.50
M&G PLC	131,539	2.01	265,314.16
SCHRODERS PLC	82,861	4.58	380,249.12
ST JAMES' S PLACE PLC	40,934	11.60	474,834.40
WISE PLC - A	49,048	6.05	296,740.40
ADMIRAL GROUP PLC	16,255	22.94	372,889.70
AVIVA PLC	240,378	4.00	963,675.40
LEGAL & GENERAL GROUP	490,759	2.39	1,174,877.04



	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.58	284,993.58
	PRUDENTIAL	212,226	11.14	2,364,197.64
	SAGE GROUP PLC	76,660	8.59	658,969.36
	HALMA PLC	31,069	24.15	750,316.35
	BT GROUP PLC	614,465	1.47	903,263.55
	VODAFONE GROUP PLC	1,818,722	0.74	1,361,859.03
	CENTRICA PLC	453,631	1.16	530,294.63
	NATIONAL GRID PLC	286,962	10.54	3,026,014.29
	SEVERN TRENT PLC	17,468	27.49	480,195.32
	SSE PLC	81,692	18.43	1,505,583.56
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.55	533,871.90
	イギリスポンド 小計	22,164,303		143,264,375.96 (25,117,110,393)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	12.78	222,346.44
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	696.00	399,504.00
	GIVAUDAN-REG	748	2,860.00	2,139,280.00
	HOLCIM LTD	44,847	58.06	2,603,816.82
	SIG GROUP AG	26,203	25.24	661,363.72
	SIKA AG-BR	11,714	247.60	2,900,386.40
	ABB LTD	128,677	34.50	4,439,356.50
	GEBERIT AG-REG	2,530	486.60	1,231,098.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	189.30	387,686.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	196.45	607,423.40
	VAT GROUP AG	1,956	368.80	721,372.80
	ADECCO GROUP AG-REG	15,639	28.64	447,900.96
	SGS SA	12,650	84.20	1,065,130.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	4,577	244.50	1,119,076.50
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,941	141.90	5,809,527.90
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,483	264.10	655,760.30
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	49.75	195,915.50
	DUFREY AG-REG	7,820	40.34	315,458.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,756.00	491,680.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	112,800.00	902,400.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	11,190.00	917,580.00
	NESTLE SA - REGISTERED	220,234	107.16	23,600,275.44
	ALCON INC	38,399	71.24	2,735,544.76

	SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	240.00	932,880.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	133.30	1,138,382.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	88.10	162,985.00	
	LONZA GROUP AG-REG	6,166	562.80	3,470,224.80	
	NOVARTIS	163,524	90.17	14,744,959.08	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	306.40	678,676.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	55,824	282.10	15,747,950.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	94.95	236,140.65	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	56.62	865,663.18	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,833	838.00	1,536,054.00	
	UBS GROUP AG	249,657	18.20	4,543,757.40	
	BALOISE HOLDING AG - REG	4,366	141.70	618,662.20	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	124.10	366,715.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,419	534.20	1,292,229.80	
	SWISS RE LTD	24,445	88.14	2,154,582.30	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,854	426.80	5,059,287.20	
	TEMENOS AG - REG	5,150	77.70	400,155.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	14,686	57.00	837,102.00	
	SWISSCOM	2,237	557.20	1,246,456.40	
	BKW AG	1,744	145.40	253,577.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	78.00	442,962.00	
	スイスフラン 小計	1,173,645		111,299,287.15 (17,170,141,028)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	361.80	8,050,773.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	417.60	2,247,940.80	
	SCA SV CELLULOSA B	53,887	149.15	8,037,246.05	
	ALFA LAVAL AB	25,745	395.30	10,176,998.50	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	255.90	19,442,514.30	
	ATLAS COPCO A	207,097	159.05	32,938,777.85	
	ATLAS COPCO B	127,608	137.90	17,597,143.20	
	BEIJER REF AB	26,868	158.80	4,266,638.40	
	EPIROC AB-A	53,479	198.75	10,628,951.25	
	EPIROC AB-B	28,804	170.00	4,896,680.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	84.28	3,262,647.36	
	INDUTRADE AB	22,644	261.30	5,916,877.20	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	221.90	3,107,043.80	

	LIFCO AB-B SHS	17,970	229.50	4,124,115.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	105.95	13,015,745.60	
	SAAB AB-B	6,388	584.40	3,733,147.20	
	SANDVIK AB	87,644	207.00	18,142,308.00	
	SKANSKA B	25,507	148.30	3,782,688.10	
	SKF AB-B	21,050	190.80	4,016,340.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	220.20	2,975,782.80	
	VOLVO B	114,238	213.00	24,332,694.00	
	SECURITAS B	28,375	86.66	2,458,977.50	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	42.25	2,105,697.75	
	EVOLUTION AB	15,096	1,415.20	21,363,859.20	
	EMBRACER GROUP AB	53,147	25.55	1,358,171.58	
	HENNES & MAURITZ B	55,229	143.22	7,909,897.38	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	283.50	14,025,879.00	
	GETINGE AB-B SHS	17,796	247.20	4,399,171.20	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	221.40	3,173,769.00	
	NORDEA BANK ABP	258,570	113.22	29,275,295.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	131,245	119.25	15,650,966.25	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	92.48	11,165,665.28	
	SWEDBANK AB-A	72,526	179.30	13,003,911.80	
	EQT AB	31,471	222.20	6,992,856.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	294.00	3,474,492.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	292.80	3,269,990.40	
	INVESTOR AB-A SHS	26,088	217.50	5,674,140.00	
	INVESTOR AB-B SHS	140,493	217.20	30,515,079.60	
	KINNEVIK AB - B	18,792	158.70	2,982,290.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	465.00	3,385,200.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	56.61	12,153,544.29	
	HEXAGON AB-B SHS	168,352	127.55	21,473,297.60	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	94.32	4,410,591.84	
	TELIA CO AB	230,643	24.60	5,673,817.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	43.12	2,444,904.00	
	SAGAX AB-B	17,402	232.50	4,045,965.00	
	スウェーデンクローナ 小計	2,959,643		437,080,483.48 (5,620,855,017)	
ノルウェークロ	AKER BP ASA	27,755	262.30	7,280,136.50	

一ネ	EQUINOR ASA	73,436	313.65	23,033,201.40	
	NORSK HYDRO	100,517	69.60	6,995,983.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	427.20	5,339,145.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	8,645	462.00	3,993,990.00	
	ADEVINTA ASA	19,117	77.50	1,481,567.50	
	MOWI ASA	31,968	182.70	5,840,553.60	
	ORKLA	69,804	77.80	5,430,751.20	
	SALMAR ASA	5,423	454.00	2,462,042.00	
	DNB BANK ASA	71,795	194.20	13,942,589.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	179.90	3,341,462.60	
	TELENOR ASA	51,193	109.70	5,615,872.10	
ノルウェークローネ 小計		490,725		84,757,294.70 (1,096,759,393)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	8,483	502.20	4,260,162.60	
	NOVOZYMES A/S	17,111	331.50	5,672,296.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	1,780.50	1,344,277.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	81,654	198.66	16,221,383.64	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	12,190.00	2,669,610.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	434	12,315.00	5,344,710.00	
	DSV A/S	14,203	1,338.50	19,010,715.50	
	PANDORA A/S	7,957	552.00	4,392,264.00	
	CARLSBERG AS-B	8,329	1,051.50	8,757,943.50	
	COLOPLAST-B	9,208	860.40	7,922,563.20	
	DEMANT A/S	8,512	282.40	2,403,788.80	
	GENMAB A/S	5,250	2,676.00	14,049,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,448	1,091.60	143,488,636.80	
	DANSKE BANK A/S	56,132	160.65	9,017,605.80	
	TRYG A/S	29,772	156.35	4,654,852.20	
ORSTED A/S	15,439	659.40	10,180,476.60		
デンマーククローネ 小計		394,906		259,390,286.64 (5,216,338,664)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	20,629	30.84	636,198.36	
	SANTOS	265,406	7.39	1,961,350.34	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	32.38	447,232.56	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	157,787	34.73	5,479,942.51	
	BHP GROUP LTD	408,249	44.72	18,256,895.28	

BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.84	689,836.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	138,592	20.79	2,881,327.68
IGO LTD	56,345	14.58	821,510.10
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	36,948	37.87	1,399,220.76
MINERAL RESOURCES LTD	14,409	69.78	1,005,460.02
NEWCREST MINING LIMITED	73,939	26.41	1,952,728.99
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	101,628	13.35	1,356,733.80
ORICA LTD	38,288	15.05	576,234.40
PILBARA MINERALS LTD	209,485	4.75	995,053.75
RIO TINTO LTD	28,272	114.58	3,239,405.76
SOUTH32 LTD	346,773	3.89	1,348,946.97
REECE LTD	16,814	18.66	313,749.24
BRAMBLES LTD	108,007	13.54	1,462,414.78
COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	22.78	1,010,885.28
AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.57	426,939.87
QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.19	526,150.00
TRANSURBAN GROUP	249,674	14.32	3,575,331.68
ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	38.07	1,759,214.70
IDP EDUCATION LTD	17,793	23.76	422,761.68
LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.01	911,885.13
REA GROUP LTD	3,586	130.89	469,371.54
SEEK LTD	28,001	21.60	604,821.60
WESFARMERS LTD	92,975	47.58	4,423,750.50
COLES GROUP LTD	108,486	17.72	1,922,371.92
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	6.05	664,901.05
WOOLWORTHS GROUP LTD	101,437	37.57	3,810,988.09
TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	11.49	734,900.40
COCHLEAR LIMITED	4,783	239.48	1,145,432.84
RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	57.70	698,573.90
SONIC HEALTHCARE LTD	37,251	34.94	1,301,549.94
CSL LIMITED	39,127	305.30	11,945,473.10
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	236,293	22.85	5,399,295.05
COMMONWEALTH BANK OF AUST	134,440	95.80	12,879,352.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	247,090	25.20	6,226,668.00
WESTPAC BANKING	272,224	20.25	5,512,536.00
ASX LTD	14,549	61.42	893,599.58

	MACQUARIE GROUP LIMITED	29,094	172.10	5,007,077.40
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	5.11	851,642.82
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.55	824,249.65
	QBE INSURANCE GROUP	126,465	14.99	1,895,710.35
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	13.12	1,244,615.68
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	75.88	1,047,219.88
	XERO LTD	11,340	109.08	1,236,967.20
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	4.31	1,329,492.77
	ORIGIN ENERGY LIMITED	151,467	8.40	1,272,322.80
	オーストラリアドル 小計	5,455,363		126,800,294.50 (11,930,639,709)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	8.75	721,533.75
	EBOS GROUP LTD	14,283	35.85	512,045.55
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	23.62	944,327.60
	SPARK NEW ZEALAND LTD	173,118	5.13	888,095.34
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.22	401,892.86
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	5.36	592,515.84
	ニュージーランドドル 小計	484,999		4,060,410.94 (346,637,281)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	213,996	49.30	10,550,002.80
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	74.45	7,966,150.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	92,000	12.32	1,133,440.00
	MTR CORP	125,000	37.05	4,631,250.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	14.26	1,711,200.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	50.60	8,804,400.00
	SANDS CHINA LTD	198,000	27.30	5,405,400.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	145,900	21.05	3,071,195.00
	WH GROUP LTD	658,301	4.10	2,699,034.10
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.45	6,882,675.00
	HANG SENG BANK	59,400	112.80	6,700,320.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,400	308.80	29,150,720.00
	AIA GROUP LTD	931,200	80.75	75,194,400.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	42.55	1,595,625.00
	CLP HOLDINGS	137,500	56.95	7,830,625.00
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	6.97	6,305,459.29
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	42.20	4,726,400.00

	CK ASSET HOLDINGS LTD	164,496	45.15	7,426,994.40	
	ESR GROUP LTD	157,000	14.26	2,238,820.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	173,000	13.20	2,283,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	23.95	2,999,210.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	136,375	20.00	2,727,500.00	
	SINO LAND CO	315,400	10.16	3,204,464.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	102.70	10,783,500.00	
	SWIRE PACIFIC A	40,500	54.00	2,187,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	19.92	1,916,304.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	42.20	5,190,600.00	
	香港ドル 小計	5,828,553		225,316,289.19 (4,008,376,784)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	33.07	264,560.00	
	KEPPEL CORP LTD	112,800	6.45	727,560.00	
	SEATRUM LTD	2,152,791	0.12	262,640.50	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	3.66	539,484.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	7.25	785,407.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	634,000	0.94	599,130.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.97	709,042.00	
	DBS GROUP	140,400	30.91	4,339,764.00	
	OCBC BANK	257,100	12.39	3,185,469.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	105,700	28.16	2,976,512.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.60	633,600.00	
	VENTURE CORP LTD	25,700	14.70	377,790.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	680,943	2.43	1,654,691.49	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	223,500	3.33	744,255.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	42,800	6.88	294,464.00	
	UOL GROUP LIMITED	47,500	6.56	311,600.00	
	シンガポールドル 小計	4,931,566		18,405,968.99 (1,909,987,402)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	19.50	1,158,826.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	746.00	1,600,916.00	
	BANK HAPOALIM BM	98,310	32.35	3,180,328.50	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	28.15	3,167,212.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	19.39	1,929,305.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	130.50	1,631,641.50	

	NICE LTD	4,991	780.00	3,892,980.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	10,000	141.10	1,411,000.00	
	AZRIELI GROUP	1,537	211.80	325,536.60	
	イスラエルシェケル 小計	400,926		18,297,746.90 (712,029,373)	
	合 計	89,114,128		563,169,012,011 (563,169,012,011)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	オーストラ リアドル	APA GROUP	83,290	845,393.50	
		LENDLEASE GROUP	64,786	456,741.30	
	オーストラリアドル 小計		148,076	1,302,134.80 (122,517,863)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	3,020,850.00	
	香港ドル 小計		315,000	3,020,850.00 (53,740,921)	
投資信託受益証券合計			463,076	176,258,784 (176,258,784)	
投資証券	アメリカド ル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,507,736.77	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	877,586.36	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	37,446	7,013,635.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	748,040.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,332	2,133,928.92	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	609,224.49	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	877,496.76	
		CROWN CASTLE INC	35,462	4,041,249.52	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,431	2,442,681.75	
		EQUINIX INC	7,399	5,502,562.31	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	916,695.40	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29,464	1,949,927.52	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,219,531.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,868	1,570,426.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	900,950.05	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,400	599,184.00			
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45,265	936,532.85			



		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,006,585.29	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,543,324.32	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	1,307,888.82	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	929,201.80	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,418,512.65	
		PROLOGIS INC	73,426	8,907,308.06	
		PUBLIC STORAGE	12,878	3,694,054.30	
		REALTY INCOME CORP	53,932	3,284,998.12	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	758,291.71	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,583	1,923,621.96	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,472	2,819,750.40	
		SUN COMMUNITIES INC	10,227	1,334,009.88	
		UDR INC	23,815	1,013,328.25	
		VENTAS INC	31,565	1,443,151.80	
		VICI PROPERTIES INC	82,862	2,676,442.60	
		WELLTOWER INC	39,775	3,225,752.50	
		WP CAREY INC	16,024	1,135,460.64	
		アメリカドル 小計	935,613	72,269,073.10 (10,076,476,862)	
カナダドル		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	242,199.72	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	312,898.00	
		カナダドル 小計	20,377	555,097.72 (58,002,160)	
ユーロ		COVIVIO(FP)	4,962	233,313.24	
		GECINA SA	3,139	310,447.10	
		KLEPIERRE	17,225	389,974.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	490,025.85	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	345,836.92	
		ユーロ 小計	48,695	1,769,597.11 (265,121,039)	
イギリスポ ンド		BRITISH LAND CO PLC	79,414	275,566.58	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	345,389.30	
		SEGRO PLC	103,383	827,684.29	
		イギリスポンド 小計	239,086	1,448,640.17 (253,975,594)	
オーストラ		DEXUS	94,090	765,892.60	

リアドル	GOODMAN GROUP	133,807	2,623,955.27	
	GPT GROUP	167,884	673,214.84	
	MIRVAC GROUP	266,683	597,369.92	
	SCENTRE GROUP	381,283	995,148.63	
	STOCKLAND	207,412	850,389.20	
	VICINITY CENTERS	305,149	569,102.88	
オーストラリアドル 小計		1,556,308	7,075,073.34 (665,693,650)	
香港ドル	LINK REIT	208,900	9,880,970.00	
香港ドル 小計		208,900	9,880,970.00 (175,782,456)	
シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	747,282.94	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	660,131.55	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283,189	461,598.07	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220,000	354,200.00	
シンガポールドル 小計		1,125,856	2,223,212.56 (230,702,767)	
投資証券合計		4,134,835	11,725,754,528 (11,725,754,528)	
合計			11,902,013,312 (11,902,013,312)	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 605 銘柄	97.6%	—	—	72.0%
	投資証券 34 銘柄	—	—	2.4%	1.8%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.7%	—	—	3.4%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.3%	0.0%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.5%	—	—	9.8%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 79 銘柄	99.0%	—	—	4.4%

	投資証券 3 銘柄	—	—	1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 44 銘柄	100.0%	—	—	3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46 銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.8%	—	—	2.1%
	投資信託受 2 銘柄 益証券	—	1.0%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	5.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	株式 27 銘柄	94.6%	—	—	0.7%
	投資信託受 1 銘柄 益証券	—	1.3%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	89.2%	—	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	—	10.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	436,384,648
コール・ローン	1,365,887,940
国債証券	267,981,707,240
派生商品評価勘定	3,359,984
未収入金	46,074,615
未収利息	1,547,673,564
前払金	1,568,114
前払費用	139,246,703
差入委託証拠金	147,903,783

流動資産合計	271,669,806,591
資産合計	271,669,806,591
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,529,214
未払金	123,932,826
未払解約金	56,147,509
未払利息	2,778
流動負債合計	184,612,327
負債合計	184,612,327
純資産の部	
元本等	
元本	85,391,300,001
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	186,093,894,263
元本等合計	271,485,194,264
純資産合計	271,485,194,264
負債純資産合計	271,669,806,591

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月12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>

(2)為替予約取引による為替差損益  
約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2023年6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		85,391,300,001口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1793円 (31,793円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

		2023年6月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2023年6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月11日
期首元本額	99,895,494,586円
期中追加設定元本額	17,258,171,889円
期中一部解約元本額	31,762,366,474円
期末元本額	85,391,300,001円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	1,206,953,153円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	530,987,257円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	368,681,116円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,275,353,515円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,215,790円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,721,258,168円
世界経済インデックスファンド	16,813,117,677円
DCマイセクション25	1,928,699,371円
DCマイセクション50	1,780,948,918円
DCマイセクション75	1,198,439,079円
DC外国債券インデックス・オープン	2,276,492,772円
DCマイセクションS25	1,062,784,130円
DCマイセクションS50	937,754,843円
DCマイセクションS75	494,892,100円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	21,618,926円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	97,991,939円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	51,841,395円
DC世界経済インデックスファンド	13,319,848,406円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	392,547,818円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	992,969円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,033,203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)	18,991,220円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	32,046,114円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	55,087,701円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	59,237,508円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	56,568,164円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	999,731,170円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	390,788,925円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,593,367,193円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	57,176,414円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	35,855,465円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	382,628,500円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	145,975,185円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	189,190,494円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	669,981,912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)	2,580,094,890円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	662,469,971円

外国債券ファンド・シリーズ1	737,250,852円
分散投資コア戦略ファンドA	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドS	604,847,674円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	643,246,253円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,248,968,888円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	240,144,017円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	103,407,970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)	1,337,152,142円
SMT インデックスバランス・オープン	180,391,206円
SMT 世界経済インデックス・オープン	336,587,955円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	433,165,697円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	688,769,421円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,009,543円
グローバル経済コア	765,423,081円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	20,167,380円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,152,786円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	48,371,915円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	56,195,134円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	24,549,633円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	30,236,937円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	199,019,428円
10資産分散投資ファンド	26,180,121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)	11,959,731,300円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	190,991,870円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	633,693,735円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	120,229,521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)	57,385,474円

(有価証券に関する注記)

#### 売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		1,855,019,273
合計		1,855,019,273

(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

(2023年6月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,400,373,640	—	1,398,805,526	△1,568,114
合計		1,400,373,640	—	1,398,805,526	△1,568,114

(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

(2023年6月12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	1,393,671,032	—	1,394,069,916	398,884
	アメリカドル	740,753,479	—	740,022,840	△730,639
	カナダドル	55,763,443	—	56,401,380	637,937
	ユーロ	453,423,483	—	453,815,220	391,737
	イギリスポンド	65,959,961	—	66,594,240	634,279
	オフショア人民 元	77,770,666	—	77,236,236	△534,430
	合計	1,393,671,032	—	1,394,069,916	398,884

(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	3,582,667.95	
		T 0.25% 06/15/24	9,000,000.00	8,563,779.81	
		T 0.25% 06/30/25	3,800,000.00	3,484,421.85	
		T 0.25% 07/31/25	5,200,000.00	4,753,125.00	
		T 0.25% 09/30/25	3,000,000.00	2,730,761.73	
		T 0.25% 10/31/25	3,600,000.00	3,264,820.30	
		T 0.375% 01/31/26	8,000,000.00	7,222,500.00	
		T 0.375% 04/30/25	8,000,000.00	7,387,812.48	
		T 0.375% 07/15/24	9,010,000.00	8,553,692.78	



T 0.375% 07/31/27	5,500,000.00	4,736,123.04	
T 0.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,729,394.55	
T 0.375% 09/15/24	6,600,000.00	6,224,238.30	
T 0.375% 09/30/27	9,880,000.00	8,464,188.29	
T 0.375% 11/30/25	3,000,000.00	2,722,089.84	
T 0.375% 12/31/25	4,000,000.00	3,625,234.36	
T 0.5% 02/28/26	4,500,000.00	4,065,380.86	
T 0.5% 03/31/25	7,220,000.00	6,698,806.25	
T 0.5% 04/30/27	2,940,000.00	2,565,437.12	
T 0.5% 05/31/27	3,500,000.00	3,045,888.68	
T 0.5% 06/30/27	6,960,000.00	6,041,742.21	
T 0.5% 08/31/27	4,660,000.00	4,024,801.97	
T 0.5% 10/31/27	7,500,000.00	6,446,337.90	
T 0.625% 03/31/27	7,500,000.00	6,592,822.27	
T 0.625% 05/15/30	9,100,000.00	7,336,519.55	
T 0.625% 07/31/26	8,000,000.00	7,170,156.24	
T 0.625% 08/15/30	11,950,000.00	9,581,939.48	
T 0.625% 10/15/24	5,080,000.00	4,791,174.21	
T 0.625% 11/30/27	2,500,000.00	2,156,250.00	
T 0.625% 12/31/27	9,600,000.00	8,262,187.48	
T 0.75% 01/31/28	8,500,000.00	7,343,701.14	
T 0.75% 03/31/26	6,000,000.00	5,454,140.64	
T 0.75% 04/30/26	9,500,000.00	8,603,808.57	
T 0.75% 05/31/26	4,000,000.00	3,614,140.64	
T 0.75% 08/31/26	1,830,000.00	1,642,746.67	
T 0.75% 11/15/24	10,860,000.00	10,232,156.25	
T 0.875% 06/30/26	8,000,000.00	7,251,875.04	
T 0.875% 09/30/26	6,000,000.00	5,400,117.18	
T 0.875% 11/15/30	11,150,000.00	9,082,458.95	
T 1.125% 01/15/25	6,800,000.00	6,412,453.10	
T 1.125% 02/15/31	4,080,000.00	3,376,996.86	
T 1.125% 02/28/25	8,500,000.00	7,993,154.26	
T 1.125% 02/29/28	8,000,000.00	7,022,343.76	
T 1.125% 05/15/40	1,710,000.00	1,109,061.91	
T 1.125% 08/15/40	5,200,000.00	3,343,742.16	
T 1.125% 08/31/28	7,410,000.00	6,428,175.00	

T 1.25% 03/31/28	8,480,000.00	7,474,821.83	
T 1.25% 04/30/28	8,000,000.00	7,039,843.76	
T 1.25% 05/15/50	5,550,000.00	3,085,778.29	
T 1.25% 05/31/28	6,000,000.00	5,270,390.64	
T 1.25% 06/30/28	4,000,000.00	3,508,125.00	
T 1.25% 08/15/31	9,230,000.00	7,607,539.06	
T 1.25% 09/30/28	9,500,000.00	8,281,699.19	
T 1.25% 11/30/26	7,000,000.00	6,351,132.83	
T 1.25% 12/31/26	7,130,000.00	6,460,448.43	
T 1.375% 01/31/25	4,000,000.00	3,784,296.88	
T 1.375% 08/15/50	5,700,000.00	3,272,490.21	
T 1.375% 10/31/28	3,520,000.00	3,084,400.00	
T 1.375% 11/15/31	11,030,000.00	9,136,373.01	
T 1.375% 11/15/40	6,000,000.00	4,013,203.14	
T 1.375% 12/31/28	4,900,000.00	4,281,375.00	
T 1.5% 01/31/27	6,000,000.00	5,472,421.86	
T 1.5% 02/15/30	6,470,000.00	5,586,693.34	
T 1.5% 08/15/26	7,500,000.00	6,903,515.62	
T 1.5% 09/30/24	8,500,000.00	8,122,480.49	
T 1.5% 11/30/24	8,800,000.00	8,374,265.59	
T 1.5% 11/30/28	7,500,000.00	6,608,642.55	
T 1.625% 02/15/26	5,600,000.00	5,221,781.26	
T 1.625% 05/15/26	2,270,000.00	2,106,932.41	
T 1.625% 05/15/31	5,960,000.00	5,092,075.00	
T 1.625% 08/15/29	6,750,000.00	5,929,980.43	
T 1.625% 10/31/26	2,800,000.00	2,578,351.55	
T 1.625% 11/15/50	6,900,000.00	4,235,279.27	
T 1.625% 11/30/26	4,780,000.00	4,395,452.72	
T 1.75% 01/31/29	6,000,000.00	5,343,867.18	
T 1.75% 03/15/25	2,100,000.00	1,994,015.62	
T 1.75% 06/30/24	3,110,000.00	3,000,695.34	
T 1.75% 08/15/41	4,680,000.00	3,287,700.00	
T 1.75% 11/15/29	3,000,000.00	2,650,664.07	
T 1.875% 02/15/32	11,720,000.00	10,088,356.25	
T 1.875% 02/15/41	7,900,000.00	5,740,615.26	
T 1.875% 02/15/51	6,600,000.00	4,321,582.05	

T 1.875% 02/28/27	4,000,000.00	3,693,984.36	
T 1.875% 07/31/26	5,190,000.00	4,838,965.42	
T 1.875% 08/31/24	6,000,000.00	5,769,609.36	
T 1.875% 11/15/51	3,300,000.00	2,153,056.65	
T 1% 07/31/28	7,000,000.00	6,045,976.58	
T 1% 12/15/24	8,000,000.00	7,545,624.96	
T 2.125% 05/15/25	4,230,000.00	4,035,436.53	
T 2.125% 05/31/26	3,600,000.00	3,389,765.61	
T 2.125% 07/31/24	4,800,000.00	4,639,874.97	
T 2.125% 09/30/24	5,000,000.00	4,816,796.90	
T 2.25% 02/15/27	5,550,000.00	5,199,873.03	
T 2.25% 02/15/52	4,300,000.00	3,076,095.68	
T 2.25% 03/31/26	7,500,000.00	7,104,492.15	
T 2.25% 05/15/41	6,460,000.00	4,977,101.96	
T 2.25% 08/15/27	7,530,000.00	7,016,136.30	
T 2.25% 08/15/46	1,640,000.00	1,193,964.83	
T 2.25% 08/15/49	5,500,000.00	3,966,552.75	
T 2.25% 10/31/24	6,300,000.00	6,069,164.09	
T 2.25% 11/15/24	10,150,000.00	9,771,555.62	
T 2.25% 11/15/25	4,400,000.00	4,182,750.00	
T 2.25% 11/15/27	7,650,000.00	7,103,443.37	
T 2.25% 12/31/24	5,400,000.00	5,187,375.00	
T 2.375% 02/15/42	5,500,000.00	4,280,439.46	
T 2.375% 03/31/29	4,900,000.00	4,508,000.00	
T 2.375% 04/30/26	2,600,000.00	2,468,375.00	
T 2.375% 05/15/27	11,690,000.00	10,972,160.93	
T 2.375% 05/15/29	8,010,000.00	7,360,439.06	
T 2.375% 05/15/51	8,150,000.00	6,004,735.32	
T 2.375% 08/15/24	5,000,000.00	4,841,699.20	
T 2.375% 11/15/49	4,100,000.00	3,039,525.40	
T 2.5% 01/31/25	5,000,000.00	4,817,187.50	
T 2.5% 02/15/45	2,810,000.00	2,167,925.98	
T 2.5% 02/15/46	2,450,000.00	1,880,279.30	
T 2.5% 03/31/27	7,100,000.00	6,704,369.11	
T 2.5% 05/15/46	1,450,000.00	1,111,543.94	
T 2.625% 01/31/26	4,690,000.00	4,493,056.62	

T 2.625% 02/15/29	3,340,000.00	3,118,398.81	
T 2.625% 03/31/25	7,250,000.00	6,989,311.53	
T 2.625% 05/31/27	2,400,000.00	2,273,109.38	
T 2.625% 12/31/25	5,820,000.00	5,579,015.62	
T 2.75% 02/15/28	6,550,000.00	6,204,333.96	
T 2.75% 05/31/29	5,700,000.00	5,349,093.75	
T 2.75% 06/30/25	5,500,000.00	5,304,384.74	
T 2.75% 08/15/32	13,800,000.00	12,713,250.00	
T 2.75% 08/15/42	8,700,000.00	7,166,455.08	
T 2.75% 08/15/47	4,050,000.00	3,245,062.50	
T 2.75% 08/31/25	6,900,000.00	6,647,449.23	
T 2.75% 11/15/42	6,020,000.00	4,948,745.69	
T 2.75% 11/15/47	3,050,000.00	2,444,348.62	
T 2.875% 04/30/25	4,000,000.00	3,870,234.36	
T 2.875% 04/30/29	3,300,000.00	3,119,531.25	
T 2.875% 05/15/28	7,260,000.00	6,906,642.15	
T 2.875% 05/15/32	10,100,000.00	9,411,937.50	
T 2.875% 05/15/43	2,750,000.00	2,298,774.41	
T 2.875% 05/15/49	6,080,000.00	4,996,168.73	
T 2.875% 05/15/52	7,600,000.00	6,244,171.85	
T 2.875% 05/31/25	3,820,000.00	3,695,029.31	
T 2.875% 07/31/25	5,460,000.00	5,277,217.98	
T 2.875% 08/15/28	3,920,000.00	3,721,396.88	
T 2.875% 08/15/45	2,300,000.00	1,893,501.95	
T 2.875% 11/15/46	2,500,000.00	2,053,369.15	
T 2% 02/15/25	8,460,000.00	8,081,778.52	
T 2% 02/15/50	2,750,000.00	1,867,475.58	
T 2% 06/30/24	5,500,000.00	5,321,091.05	
T 2% 08/15/25	3,450,000.00	3,271,974.61	
T 2% 08/15/51	7,850,000.00	5,293,383.81	
T 2% 11/15/26	3,220,000.00	2,999,757.02	
T 2% 11/15/41	6,200,000.00	4,534,960.92	
T 3.125% 02/15/42	1,050,000.00	922,072.26	
T 3.125% 02/15/43	2,000,000.00	1,743,710.94	
T 3.125% 05/15/48	5,930,000.00	5,093,198.24	
T 3.125% 08/15/44	1,840,000.00	1,589,695.30	

T 3.125% 08/31/29	7,150,000.00	6,846,962.90	
T 3.125% 11/15/28	8,400,000.00	8,068,757.84	
T 3.25% 05/15/42	4,150,000.00	3,704,037.09	
T 3.375% 05/15/33	5,000,000.00	4,846,875.00	
T 3.375% 05/15/44	3,010,000.00	2,711,880.66	
T 3.375% 11/15/48	5,300,000.00	4,765,755.86	
T 3.5% 02/15/33	6,000,000.00	5,873,437.49	
T 3.5% 02/15/39	770,000.00	739,455.66	
T 3.625% 02/15/44	2,400,000.00	2,249,859.38	
T 3.625% 02/15/53	4,800,000.00	4,572,750.00	
T 3.625% 08/15/43	2,000,000.00	1,880,117.18	
T 3.75% 11/15/43	3,000,000.00	2,870,214.84	
T 3.875% 01/15/26	6,500,000.00	6,424,208.96	
T 3.875% 08/15/40	1,450,000.00	1,441,475.58	
T 3.875% 09/30/29	3,540,000.00	3,534,745.29	
T 3.875% 11/30/29	3,500,000.00	3,497,128.91	
T 3% 02/15/47	1,600,000.00	1,342,906.25	
T 3% 02/15/48	1,000,000.00	839,238.28	
T 3% 02/15/49	1,000,000.00	840,917.97	
T 3% 05/15/42	2,450,000.00	2,105,660.14	
T 3% 05/15/45	700,000.00	589,736.32	
T 3% 05/15/47	3,210,000.00	2,694,456.44	
T 3% 07/15/25	6,900,000.00	6,686,396.49	
T 3% 08/15/48	3,250,000.00	2,728,286.14	
T 3% 08/15/52	5,200,000.00	4,384,250.00	
T 3% 09/30/25	4,200,000.00	4,066,617.19	
T 3% 10/31/25	5,000,000.00	4,838,476.55	
T 3% 11/15/44	2,800,000.00	2,364,960.94	
T 4.125% 10/31/27	3,100,000.00	3,111,080.08	
T 4.125% 11/15/32	7,550,000.00	7,757,035.19	
T 4.25% 05/15/39	900,000.00	943,207.02	
T 4.25% 10/15/25	6,900,000.00	6,869,408.22	
T 4.25% 11/15/40	740,000.00	770,510.54	
T 4.375% 02/15/38	1,000,000.00	1,066,660.16	
T 4.375% 05/15/40	1,900,000.00	2,012,626.94	
T 4.375% 05/15/41	1,950,000.00	2,054,393.56	

	T 4.375% 11/15/39	960,000.00	1,018,425.00	
	T 4.5% 02/15/36	1,090,000.00	1,180,925.58	
	T 4.5% 05/15/38	550,000.00	593,559.57	
	T 4.5% 08/15/39	1,700,000.00	1,832,679.69	
	T 4.625% 02/15/40	1,380,000.00	1,507,218.75	
	T 4.75% 02/15/41	750,000.00	828,940.43	
	T 4% 02/15/26	6,500,000.00	6,446,679.72	
	T 4% 02/28/30	6,200,000.00	6,247,468.75	
	T 4% 10/31/29	6,550,000.00	6,588,123.03	
	T 4% 11/15/52	7,800,000.00	7,956,000.00	
	T 5.0% 05/15/37	400,000.00	454,414.06	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,379,320.30	
	T 5.375% 02/15/31	1,950,000.00	2,153,988.29	
	T 6.0% 02/15/26	1,700,000.00	1,771,453.12	
	T 6.125% 11/15/27	1,450,000.00	1,573,419.92	
	T 6.25% 05/15/30	1,050,000.00	1,202,085.93	
	アメリカドル 小計	1,064,040,000.00	950,289,206.58 (132,498,824,073)	
カナダドル	CAN 0.25% 03/01/26	2,280,000.00	2,056,735.76	
	CAN 0.5% 09/01/25	3,010,000.00	2,768,923.08	
	CAN 0.5% 12/01/30	1,910,000.00	1,544,631.17	
	CAN 0.75% 10/01/24	700,000.00	664,842.47	
	CAN 1.25% 03/01/25	1,440,000.00	1,363,263.66	
	CAN 1.25% 03/01/27	1,880,000.00	1,713,494.04	
	CAN 1.25% 06/01/30	3,980,000.00	3,445,363.01	
	CAN 1.5% 04/01/25	1,460,000.00	1,384,184.78	
	CAN 1.5% 06/01/26	910,000.00	848,120.62	
	CAN 1.5% 06/01/31	3,970,000.00	3,442,468.10	
	CAN 1.5% 09/01/24	1,200,000.00	1,153,511.55	
	CAN 1.5% 12/01/31	2,190,000.00	1,884,405.75	
	CAN 1.75% 12/01/53	2,890,000.00	2,054,796.35	
	CAN 1% 06/01/27	810,000.00	730,724.40	
	CAN 1% 09/01/26	1,530,000.00	1,396,600.01	
	CAN 2.25% 06/01/25	1,280,000.00	1,229,154.75	
	CAN 2.25% 06/01/29	240,000.00	224,442.14	
	CAN 2.25% 12/01/29	510,000.00	474,627.93	

	CAN 2.5% 06/01/24	450,000.00	439,843.96	
	CAN 2.5% 12/01/32	2,300,000.00	2,135,688.02	
	CAN 2.75% 06/01/33	320,000.00	303,180.66	
	CAN 2.75% 08/01/24	840,000.00	820,279.91	
	CAN 2.75% 09/01/27	1,600,000.00	1,537,356.80	
	CAN 2.75% 12/01/48	1,050,000.00	952,462.92	
	CAN 2.75% 12/01/55	460,000.00	412,048.56	
	CAN 2.75% 12/01/64	620,000.00	547,686.31	
	CAN 2% 06/01/28	410,000.00	381,505.18	
	CAN 2% 06/01/32	1,520,000.00	1,356,619.44	
	CAN 2% 12/01/51	3,400,000.00	2,601,280.43	
	CAN 3.5% 03/01/28	1,160,000.00	1,150,855.82	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,050,000.00	1,076,783.85	
	CAN 3.75% 02/01/25	2,030,000.00	2,001,572.81	
	CAN 3% 04/01/26	170,000.00	165,165.26	
	CAN 3% 10/01/25	510,000.00	495,554.04	
	CAN 3% 11/01/24	2,160,000.00	2,109,162.75	
	CAN 4.0% 06/01/41	740,000.00	801,852.62	
	CAN 5.75% 06/01/29	1,490,000.00	1,669,359.22	
	CAN 5.75% 06/01/33	1,380,000.00	1,652,232.35	
	CAN 5% 06/01/37	890,000.00	1,048,890.46	
	カナダドル 小計	56,740,000.00	52,039,670.94 (5,437,625,216)	
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	8,550,000.00	9,302,314.50	
	MBONO 10% 12/05/24	30,560,000.00	30,328,801.07	
	MBONO 5.5% 03/04/27	20,300,000.00	17,977,883.00	
	MBONO 5.75% 03/05/26	45,330,000.00	41,315,386.17	
	MBONO 5% 03/06/25	17,480,000.00	16,077,055.20	
	MBONO 7.5% 05/26/33	13,190,000.00	12,031,786.10	
	MBONO 7.5% 06/03/27	27,110,000.00	25,658,530.60	
	MBONO 7.75% 05/29/31	40,630,000.00	38,136,130.60	
	MBONO 7.75% 11/13/42	28,610,000.00	25,100,983.50	
	MBONO 7.75% 11/23/34	8,850,000.00	8,148,283.50	
	MBONO 8.5% 05/31/29	30,400,000.00	29,937,920.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	14,670,000.00	13,996,500.30	
	MBONO 8% 07/31/53	8,850,000.00	7,860,393.00	

	MBONO 8% 09/05/24	22,160,000.00	21,437,312.76	
	MBONO 8% 11/07/47	24,600,000.00	22,059,804.00	
	メキシコペソ 小計	341,290,000.00	319,369,084.30 (2,576,510,087)	
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,040,000.00	862,655.04	
	BGB 0.35% 06/22/32	1,390,000.00	1,105,243.21	
	BGB 0.4% 06/22/40	510,000.00	315,064.23	
	BGB 0.5% 10/22/24	1,420,000.00	1,370,576.90	
	BGB 0.65% 06/22/71	440,000.00	174,291.92	
	BGB 0.8% 06/22/25	2,240,000.00	2,145,855.04	
	BGB 0.8% 06/22/27	1,690,000.00	1,563,304.08	
	BGB 0.8% 06/22/28	1,600,000.00	1,457,507.20	
	BGB 0.9% 06/22/29	1,630,000.00	1,464,679.41	
	BGB 0% 10/22/27	780,000.00	692,804.18	
	BGB 0% 10/22/31	1,670,000.00	1,313,588.60	
	BGB 1.25% 04/22/33	870,000.00	747,208.20	
	BGB 1.4% 06/22/53	1,050,000.00	653,718.45	
	BGB 1.45% 06/22/37	800,000.00	639,302.40	
	BGB 1.6% 06/22/47	1,080,000.00	759,364.20	
	BGB 1.7% 06/22/50	820,000.00	571,298.10	
	BGB 1.9% 06/22/38	650,000.00	542,856.60	
	BGB 1% 06/22/26	1,460,000.00	1,382,973.32	
	BGB 1% 06/22/31	1,270,000.00	1,101,110.32	
	BGB 2.15% 06/22/66	880,000.00	638,519.20	
	BGB 2.25% 06/22/57	670,000.00	515,186.45	
	BGB 2.6% 06/22/24	950,000.00	943,247.59	
	BGB 2.75% 04/22/39	400,000.00	371,112.00	
	BGB 3.3% 06/22/54	600,000.00	574,479.60	
	BGB 3.45% 06/22/43	360,000.00	360,439.20	
	BGB 3.75% 06/22/45	930,000.00	978,192.60	
	BGB 3% 06/22/33	1,120,000.00	1,115,560.84	
	BGB 3% 06/22/34	950,000.00	941,575.40	
BGB 4.25% 03/28/41	1,850,000.00	2,062,239.40		
BGB 4.5% 03/28/26	1,140,000.00	1,188,994.92		
BGB 4% 03/28/32	1,080,000.00	1,166,903.28		
BGB 5.5% 03/28/28	2,040,000.00	2,292,080.76		



BGB 5% 03/28/35	1,590,000.00	1,874,603.64	
BKO 0.2% 06/14/24	1,060,000.00	1,029,623.58	
BKO 0.4% 09/13/24	1,820,000.00	1,760,456.88	
BKO 2.2% 12/12/24	1,390,000.00	1,373,265.79	
BKO 2.5% 03/13/25	1,630,000.00	1,617,445.74	
BKO 2.8% 06/12/25	800,000.00	798,384.00	
BTPS 0.25% 03/15/28	1,680,000.00	1,443,835.68	
BTPS 0.35% 02/01/25	580,000.00	552,154.18	
BTPS 0.45% 02/15/29	2,070,000.00	1,738,762.74	
BTPS 0.5% 02/01/26	1,910,000.00	1,770,274.58	
BTPS 0.5% 07/15/28	1,300,000.00	1,119,010.10	
BTPS 0.6% 08/01/31	3,160,000.00	2,458,690.14	
BTPS 0.85% 01/15/27	2,250,000.00	2,056,932.00	
BTPS 0.9% 04/01/31	2,920,000.00	2,358,828.29	
BTPS 0.95% 03/01/37	1,020,000.00	680,513.40	
BTPS 0.95% 06/01/32	1,550,000.00	1,210,872.40	
BTPS 0.95% 08/01/30	2,230,000.00	1,845,360.68	
BTPS 0.95% 09/15/27	1,490,000.00	1,344,845.69	
BTPS 0.95% 12/01/31	2,140,000.00	1,697,950.90	
BTPS 0% 04/01/26	2,240,000.00	2,036,861.12	
BTPS 0% 08/01/26	1,280,000.00	1,151,302.40	
BTPS 0% 08/15/24	1,500,000.00	1,442,064.13	
BTPS 0% 12/15/24	750,000.00	713,090.01	
BTPS 1.1% 04/01/27	2,550,000.00	2,340,140.10	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,950,000.00	1,814,182.50	
BTPS 1.35% 04/01/30	1,850,000.00	1,591,508.75	
BTPS 1.45% 03/01/36	700,000.00	512,804.60	
BTPS 1.45% 05/15/25	2,300,000.00	2,218,244.20	
BTPS 1.45% 11/15/24	1,970,000.00	1,917,745.75	
BTPS 1.5% 04/30/45	1,250,000.00	757,696.38	
BTPS 1.5% 06/01/25	2,410,000.00	2,323,682.59	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,080,000.00	1,024,890.84	
BTPS 1.65% 03/01/32	2,100,000.00	1,763,916.00	
BTPS 1.65% 12/01/30	2,540,000.00	2,193,810.70	
BTPS 1.7% 09/01/51	1,680,000.00	980,557.20	
BTPS 1.75% 07/01/24	1,000,000.00	982,412.00	

	BTPS 1.8% 03/01/41	660,000.00	456,826.26	
	BTPS 1.85% 07/01/25	2,700,000.00	2,618,767.80	
	BTPS 2.05% 08/01/27	2,740,000.00	2,594,286.80	
	BTPS 2.1% 07/15/26	1,440,000.00	1,385,020.80	
	BTPS 2.15% 03/01/72	590,000.00	337,228.59	
	BTPS 2.15% 09/01/52	1,020,000.00	651,358.74	
	BTPS 2.2% 06/01/27	2,280,000.00	2,177,217.60	
	BTPS 2.25% 09/01/36	2,050,000.00	1,647,513.25	
	BTPS 2.45% 09/01/33	2,200,000.00	1,915,819.40	
	BTPS 2.45% 09/01/50	1,010,000.00	704,712.35	
	BTPS 2.5% 11/15/25	2,200,000.00	2,155,819.60	
	BTPS 2.5% 12/01/24	2,950,000.00	2,912,915.55	
	BTPS 2.5% 12/01/32	3,050,000.00	2,710,461.19	
	BTPS 2.65% 12/01/27	1,760,000.00	1,700,494.40	
	BTPS 2.7% 03/01/47	1,110,000.00	844,734.42	
	BTPS 2.8% 03/01/67	830,000.00	576,020.00	
	BTPS 2.8% 06/15/29	2,610,000.00	2,493,463.50	
	BTPS 2.8% 12/01/28	1,420,000.00	1,368,198.40	
	BTPS 2.95% 09/01/38	1,180,000.00	1,005,482.72	
	BTPS 2% 02/01/28	2,260,000.00	2,118,994.08	
	BTPS 2% 12/01/25	3,220,000.00	3,114,538.56	
	BTPS 3.1% 03/01/40	1,420,000.00	1,212,949.80	
	BTPS 3.25% 03/01/38	960,000.00	849,609.73	
	BTPS 3.25% 09/01/46	2,270,000.00	1,905,764.88	
	BTPS 3.35% 03/01/35	1,120,000.00	1,035,532.40	
	BTPS 3.45% 03/01/48	1,820,000.00	1,567,453.16	
	BTPS 3.5% 01/15/26	910,000.00	911,533.35	
	BTPS 3.5% 03/01/30	2,360,000.00	2,338,807.20	
	BTPS 3.75% 09/01/24	2,150,000.00	2,158,675.25	
	BTPS 3.85% 09/01/49	1,470,000.00	1,340,413.62	
	BTPS 3.85% 12/15/29	900,000.00	907,482.60	
	BTPS 3% 08/01/29	2,170,000.00	2,097,840.99	
	BTPS 4.4% 05/01/33	400,000.00	413,604.64	
	BTPS 4.45% 09/01/43	850,000.00	850,039.95	
	BTPS 4.5% 03/01/26	2,080,000.00	2,138,185.92	
	BTPS 4.5% 10/01/53	450,000.00	449,640.00	

	BTPS 4.75% 09/01/28	2,630,000.00	2,781,908.80	
	BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,565,049.00	
	BTPS 4% 02/01/37	2,850,000.00	2,783,959.80	
	BTPS 4% 04/30/35	1,150,000.00	1,131,494.94	
	BTPS 4% 10/30/31	1,250,000.00	1,266,146.25	
	BTPS 5.0% 08/01/39	2,680,000.00	2,881,927.28	
	BTPS 5.25% 11/01/29	2,710,000.00	2,963,298.28	
	BTPS 5.75% 02/01/33	2,280,000.00	2,600,522.40	
	BTPS 5% 03/01/25	3,130,000.00	3,212,093.64	
	BTPS 5% 08/01/34	3,080,000.00	3,315,576.88	
	BTPS 5% 09/01/40	2,450,000.00	2,639,436.45	
	BTPS 6.5% 11/01/27	2,700,000.00	3,036,141.90	
	BTPS 6% 05/01/31	1,140,000.00	1,314,230.76	
	BTPS 7.25% 11/01/26	1,400,000.00	1,570,336.60	
	DBR 0.25% 02/15/27	1,940,000.00	1,788,344.38	
	DBR 0.25% 02/15/29	2,410,000.00	2,144,785.93	
	DBR 0.25% 08/15/28	2,630,000.00	2,361,811.01	
	DBR 0.5% 02/15/25	3,080,000.00	2,958,158.89	
	DBR 0.5% 02/15/26	3,000,000.00	2,833,278.00	
	DBR 0.5% 02/15/28	2,860,000.00	2,624,184.42	
	DBR 0.5% 08/15/27	530,000.00	489,783.07	
	DBR 0% 02/15/30	1,470,000.00	1,261,717.17	
	DBR 0% 02/15/31	1,130,000.00	948,343.46	
	DBR 0% 02/15/32	3,660,000.00	3,002,038.14	
	DBR 0% 05/15/35	2,380,000.00	1,780,627.94	
	DBR 0% 05/15/36	2,230,000.00	1,620,074.93	
	DBR 0% 08/15/26	2,350,000.00	2,167,752.80	
	DBR 0% 08/15/29	2,950,000.00	2,559,030.60	
	DBR 0% 08/15/30	2,350,000.00	1,995,730.45	
	DBR 0% 08/15/30	1,480,000.00	1,258,750.36	
	DBR 0% 08/15/31	3,330,000.00	2,764,209.69	
	DBR 0% 08/15/50	4,580,000.00	2,389,486.76	
	DBR 0% 08/15/52	1,800,000.00	890,748.00	
	DBR 0% 11/15/27	2,420,000.00	2,178,091.96	
	DBR 0% 11/15/28	1,990,000.00	1,754,493.45	
	DBR 1.25% 08/15/48	3,080,000.00	2,394,478.24	

	DBR 1.7% 08/15/32	3,160,000.00	2,996,229.84	
	DBR 1.8% 08/15/53	1,380,000.00	1,173,865.26	
	DBR 1% 05/15/38	1,910,000.00	1,545,295.05	
	DBR 1% 08/15/24	2,000,000.00	1,952,152.00	
	DBR 1% 08/15/25	2,430,000.00	2,338,070.67	
	DBR 2.1% 11/15/29	3,160,000.00	3,111,367.60	
	DBR 2.3% 02/15/33	3,130,000.00	3,110,396.81	
	DBR 2.5% 07/04/44	2,780,000.00	2,767,209.22	
	DBR 2.5% 08/15/46	2,890,000.00	2,897,381.06	
	DBR 3.25% 07/04/42	1,830,000.00	2,017,703.10	
	DBR 4.0% 01/04/37	2,440,000.00	2,854,324.20	
	DBR 4.25% 07/04/39	1,900,000.00	2,317,464.20	
	DBR 4.75% 07/04/28	1,430,000.00	1,590,727.71	
	DBR 4.75% 07/04/34	2,130,000.00	2,608,753.71	
	DBR 4.75% 07/04/40	1,770,000.00	2,299,589.31	
	DBR 5.5% 01/04/31	2,840,000.00	3,456,048.54	
	DBR 5.625% 01/04/28	2,360,000.00	2,686,563.82	
	DBR 6.25% 01/04/30	1,250,000.00	1,544,827.00	
	DBR 6.5% 07/04/27	1,880,000.00	2,168,241.60	
	FRTR 0.25% 11/25/26	4,680,000.00	4,290,090.48	
	FRTR 0.5% 05/25/25	3,590,000.00	3,419,941.70	
	FRTR 0.5% 05/25/26	4,500,000.00	4,201,389.00	
	FRTR 0.5% 05/25/29	3,950,000.00	3,471,741.90	
	FRTR 0.5% 05/25/40	2,690,000.00	1,734,428.61	
	FRTR 0.5% 05/25/72	990,000.00	370,717.92	
	FRTR 0.5% 06/25/44	1,480,000.00	862,730.48	
	FRTR 0.75% 02/25/28	4,700,000.00	4,289,440.90	
	FRTR 0.75% 05/25/28	4,790,000.00	4,352,912.50	
	FRTR 0.75% 05/25/52	2,940,000.00	1,561,522.20	
	FRTR 0.75% 05/25/53	3,160,000.00	1,636,352.28	
	FRTR 0.75% 11/25/28	5,850,000.00	5,266,175.85	
	FRTR 0% 02/25/25	2,240,000.00	2,126,456.19	
	FRTR 0% 02/25/26	3,340,000.00	3,091,838.00	
	FRTR 0% 02/25/27	4,560,000.00	4,117,204.61	
	FRTR 0% 03/25/25	4,790,000.00	4,539,116.56	
	FRTR 0% 05/25/32	3,280,000.00	2,554,575.52	

	FRTR 0% 11/25/29	2,930,000.00	2,462,546.32	
	FRTR 0% 11/25/30	6,500,000.00	5,305,384.50	
	FRTR 0% 11/25/31	5,500,000.00	4,355,862.50	
	FRTR 1.25% 05/25/34	4,330,000.00	3,631,497.39	
	FRTR 1.25% 05/25/36	4,450,000.00	3,572,820.45	
	FRTR 1.25% 05/25/38	1,100,000.00	845,751.50	
	FRTR 1.5% 05/25/31	5,170,000.00	4,714,781.50	
	FRTR 1.5% 05/25/50	2,490,000.00	1,695,876.75	
	FRTR 1.75% 05/25/66	1,480,000.00	982,098.40	
	FRTR 1.75% 06/25/39	2,920,000.00	2,400,400.60	
	FRTR 1.75% 11/25/24	4,160,000.00	4,079,046.40	
	FRTR 1% 05/25/27	4,650,000.00	4,344,453.15	
	FRTR 1% 11/25/25	4,280,000.00	4,088,566.30	
	FRTR 2.5% 05/25/30	5,130,000.00	5,055,813.47	
	FRTR 2.5% 05/25/43	520,000.00	457,856.36	
	FRTR 2.5% 09/24/26	900,000.00	889,110.90	
	FRTR 2.75% 02/25/29	500,000.00	499,143.00	
	FRTR 2.75% 10/25/27	3,330,000.00	3,329,027.64	
	FRTR 2% 05/25/48	2,860,000.00	2,226,670.16	
	FRTR 2% 11/25/32	2,900,000.00	2,694,285.60	
	FRTR 3.25% 05/25/45	3,080,000.00	3,051,565.44	
	FRTR 3.5% 04/25/26	4,730,000.00	4,810,093.09	
	FRTR 3% 05/25/33	950,000.00	956,876.10	
	FRTR 3% 05/25/54	1,040,000.00	961,548.64	
	FRTR 4.5% 04/25/41	3,100,000.00	3,618,109.20	
	FRTR 4.75% 04/25/35	2,440,000.00	2,845,259.60	
	FRTR 4% 04/25/55	2,020,000.00	2,270,401.22	
	FRTR 4% 04/25/60	1,780,000.00	2,024,039.78	
	FRTR 4% 10/25/38	2,750,000.00	3,017,289.00	
	FRTR 5.5% 04/25/29	5,920,000.00	6,785,219.84	
	FRTR 5.75% 10/25/32	3,590,000.00	4,431,000.58	
	FRTR 6.0% 10/25/25	1,900,000.00	2,030,963.20	
	IRISH 0.2% 05/15/27	670,000.00	607,750.63	
	IRISH 0.2% 10/18/30	780,000.00	651,916.20	
	IRISH 0.35% 10/18/32	470,000.00	378,055.78	
	IRISH 0.4% 05/15/35	610,000.00	456,730.79	

IRISH 0.55% 04/22/41	360,000.00	232,243.98	
IRISH 0.9% 05/15/28	770,000.00	706,913.90	
IRISH 0% 10/18/31	850,000.00	680,200.60	
IRISH 1.1% 05/15/29	1,060,000.00	969,105.00	
IRISH 1.3% 05/15/33	430,000.00	373,278.70	
IRISH 1.35% 03/18/31	470,000.00	428,301.60	
IRISH 1.5% 05/15/50	800,000.00	550,504.00	
IRISH 1.7% 05/15/37	580,000.00	489,885.40	
IRISH 1% 05/15/26	1,000,000.00	950,854.60	
IRISH 2.4% 05/15/30	790,000.00	776,103.90	
IRISH 2% 02/18/45	980,000.00	789,580.12	
IRISH 3% 10/18/43	340,000.00	332,233.38	
IRISH 5.4% 03/13/25	1,160,000.00	1,209,224.36	
NETHER 0.25% 07/15/25	1,450,000.00	1,373,302.25	
NETHER 0.25% 07/15/29	950,000.00	825,230.80	
NETHER 0.5% 01/15/40	1,380,000.00	958,866.78	
NETHER 0.5% 07/15/26	1,420,000.00	1,326,823.15	
NETHER 0.5% 07/15/32	1,020,000.00	843,787.86	
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	834,208.20	
NETHER 0.75% 07/15/28	1,700,000.00	1,550,322.14	
NETHER 0% 01/15/26	1,190,000.00	1,107,166.48	
NETHER 0% 01/15/27	1,840,000.00	1,671,498.32	
NETHER 0% 01/15/29	1,610,000.00	1,391,552.13	
NETHER 0% 01/15/38	960,000.00	638,463.38	
NETHER 0% 01/15/52	1,740,000.00	820,238.46	
NETHER 0% 07/15/30	1,350,000.00	1,123,934.40	
NETHER 0% 07/15/31	1,410,000.00	1,143,232.50	
NETHER 2.5% 01/15/30	400,000.00	395,969.60	
NETHER 2.5% 01/15/33	1,550,000.00	1,525,382.90	
NETHER 2.5% 07/15/33	560,000.00	551,096.00	
NETHER 2.75% 01/15/47	1,840,000.00	1,837,229.88	
NETHER 2% 01/15/54	630,000.00	531,645.03	
NETHER 2% 07/15/24	1,990,000.00	1,966,319.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,700,000.00	1,925,999.70	
NETHER 4% 01/15/37	1,720,000.00	1,944,412.87	
NETHER 5.5% 01/15/28	1,530,000.00	1,713,973.32	

OBL 0% 04/10/26	3,070,000.00	2,849,856.44	
OBL 0% 04/11/25	1,250,000.00	1,186,203.75	
OBL 0% 04/16/27	2,550,000.00	2,319,735.00	
OBL 0% 10/09/26	2,400,000.00	2,205,451.20	
OBL 0% 10/10/25	4,000,000.00	3,752,408.00	
OBL 0% 10/18/24	2,410,000.00	2,313,362.29	
OBL 1.3% 10/15/27	3,550,000.00	3,385,067.46	
OBL 2.2% 04/13/28	2,400,000.00	2,376,439.20	
RAGB 0.25% 10/20/36	600,000.00	410,266.80	
RAGB 0.5% 02/20/29	1,410,000.00	1,237,686.72	
RAGB 0.5% 04/20/27	1,090,000.00	998,879.27	
RAGB 0.7% 04/20/71	280,000.00	122,116.68	
RAGB 0.75% 02/20/28	880,000.00	800,505.20	
RAGB 0.75% 03/20/51	740,000.00	417,120.98	
RAGB 0.75% 10/20/26	2,080,000.00	1,943,337.76	
RAGB 0.85% 06/30/20	230,000.00	92,470.12	
RAGB 0.9% 02/20/32	1,230,000.00	1,036,950.27	
RAGB 0% 02/20/30	1,100,000.00	908,701.20	
RAGB 0% 02/20/31	1,420,000.00	1,137,189.96	
RAGB 0% 04/20/25	1,030,000.00	974,939.29	
RAGB 0% 07/15/24	580,000.00	560,694.70	
RAGB 0% 10/20/28	730,000.00	628,438.75	
RAGB 0% 10/20/40	470,000.00	271,428.76	
RAGB 1.2% 10/20/25	1,190,000.00	1,144,390.27	
RAGB 1.5% 02/20/47	1,080,000.00	781,753.68	
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	157,129.74	
RAGB 1.65% 10/21/24	990,000.00	971,445.42	
RAGB 1.85% 05/23/49	460,000.00	353,120.84	
RAGB 2.1% 09/20/17	650,000.00	461,804.89	
RAGB 2.4% 05/23/34	730,000.00	685,294.80	
RAGB 2.9% 02/20/33	550,000.00	544,074.30	
RAGB 2.9% 05/23/29	220,000.00	220,376.75	
RAGB 3.15% 06/20/44	700,000.00	692,829.90	
RAGB 3.8% 01/26/62	420,000.00	478,573.20	
RAGB 4.15% 03/15/37	1,570,000.00	1,729,637.60	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,070,000.00	1,124,241.51	

RAGB 6.25% 07/15/27	1,180,000.00	1,332,692.00	
RFGB 0.125% 04/15/36	440,000.00	299,379.52	
RFGB 0.125% 04/15/52	460,000.00	208,412.66	
RFGB 0.125% 09/15/31	370,000.00	295,621.12	
RFGB 0.25% 09/15/40	300,000.00	184,404.00	
RFGB 0.5% 04/15/26	620,000.00	581,284.10	
RFGB 0.5% 04/15/43	490,000.00	298,729.97	
RFGB 0.5% 09/15/27	540,000.00	490,970.70	
RFGB 0.5% 09/15/28	730,000.00	649,199.95	
RFGB 0.5% 09/15/29	530,000.00	460,469.30	
RFGB 0.75% 04/15/31	470,000.00	400,438.59	
RFGB 0.875% 09/15/25	440,000.00	420,542.67	
RFGB 0% 09/15/24	420,000.00	404,292.00	
RFGB 0% 09/15/26	300,000.00	273,941.55	
RFGB 0% 09/15/30	640,000.00	521,594.24	
RFGB 1.125% 04/15/34	370,000.00	305,348.86	
RFGB 1.375% 04/15/27	350,000.00	331,994.25	
RFGB 1.375% 04/15/47	510,000.00	366,195.81	
RFGB 1.5% 09/15/32	570,000.00	504,391.29	
RFGB 2.625% 07/04/42	520,000.00	481,552.86	
RFGB 2.75% 04/15/38	290,000.00	274,116.70	
RFGB 2.75% 07/04/28	550,000.00	550,046.75	
RFGB 3% 09/15/33	350,000.00	350,232.05	
RFGB 4% 07/04/25	580,000.00	592,137.66	
SPGB 0.1% 04/30/31	2,200,000.00	1,734,331.96	
SPGB 0.25% 07/30/24	1,650,000.00	1,594,586.40	
SPGB 0.5% 04/30/30	2,750,000.00	2,311,908.50	
SPGB 0.5% 10/31/31	2,570,000.00	2,064,729.44	
SPGB 0.6% 10/31/29	1,220,000.00	1,047,370.00	
SPGB 0.7% 04/30/32	2,200,000.00	1,773,739.00	
SPGB 0.8% 07/30/27	2,440,000.00	2,231,075.00	
SPGB 0.8% 07/30/29	2,200,000.00	1,920,452.60	
SPGB 0.85% 07/30/37	1,460,000.00	1,011,426.41	
SPGB 0% 01/31/25	2,280,000.00	2,168,505.72	
SPGB 0% 01/31/26	2,660,000.00	2,456,785.30	
SPGB 0% 01/31/27	2,910,000.00	2,608,855.74	



	SPGB 0% 01/31/28	2,430,000.00	2,114,683.20	
	SPGB 0% 05/31/24	2,110,000.00	2,043,533.28	
	SPGB 0% 05/31/25	2,310,000.00	2,172,749.04	
	SPGB 1.2% 10/31/40	1,960,000.00	1,325,416.68	
	SPGB 1.25% 10/31/30	1,990,000.00	1,744,049.93	
	SPGB 1.3% 10/31/26	2,650,000.00	2,505,227.16	
	SPGB 1.4% 04/30/28	2,170,000.00	2,011,893.80	
	SPGB 1.4% 07/30/28	1,980,000.00	1,828,193.40	
	SPGB 1.45% 04/30/29	2,690,000.00	2,460,427.33	
	SPGB 1.45% 10/31/27	1,890,000.00	1,768,427.64	
	SPGB 1.45% 10/31/71	660,000.00	310,686.34	
	SPGB 1.5% 04/30/27	1,500,000.00	1,417,737.00	
	SPGB 1.6% 04/30/25	1,450,000.00	1,410,426.26	
	SPGB 1.85% 07/30/35	2,180,000.00	1,827,988.86	
	SPGB 1.9% 10/31/52	1,190,000.00	770,262.01	
	SPGB 1.95% 04/30/26	2,300,000.00	2,230,379.00	
	SPGB 1.95% 07/30/30	2,020,000.00	1,869,559.40	
	SPGB 1% 07/30/42	890,000.00	555,620.77	
	SPGB 1% 10/31/50	1,880,000.00	984,411.24	
	SPGB 2.15% 10/31/25	1,570,000.00	1,538,468.12	
	SPGB 2.35% 07/30/33	1,440,000.00	1,316,418.39	
	SPGB 2.55% 10/31/32	1,980,000.00	1,861,502.94	
	SPGB 2.7% 10/31/48	1,710,000.00	1,388,749.90	
	SPGB 2.75% 10/31/24	1,350,000.00	1,344,690.45	
	SPGB 2.8% 05/31/26	1,000,000.00	991,324.00	
	SPGB 2.9% 10/31/46	1,960,000.00	1,679,137.88	
	SPGB 3.15% 04/30/33	1,700,000.00	1,671,434.90	
	SPGB 3.45% 07/30/43	730,000.00	687,543.20	
	SPGB 3.45% 07/30/66	1,380,000.00	1,226,985.60	
	SPGB 3.9% 07/30/39	670,000.00	680,284.76	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,950,000.00	2,074,712.25	
	SPGB 4.65% 07/30/25	2,840,000.00	2,929,113.52	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,700,000.00	1,904,302.60	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,730,000.00	1,982,295.06	
	SPGB 5.15% 10/31/28	3,140,000.00	3,460,402.46	
	SPGB 5.15% 10/31/44	1,490,000.00	1,772,343.08	

	SPGB 5.75% 07/30/32	2,860,000.00	3,420,886.04	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,060,000.00	2,231,148.92	
	SPGB 6.0% 01/31/29	1,050,000.00	1,208,342.10	
	ユーロ 小計	643,410,000.00	591,241,280.40 (88,579,768,629)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/30/26	1,260,000.00	1,126,503.00	
	UKT 0.125% 01/31/28	1,510,000.00	1,247,710.47	
	UKT 0.25% 01/31/25	2,960,000.00	2,746,222.88	
	UKT 0.25% 07/31/31	2,710,000.00	1,985,481.50	
	UKT 0.375% 10/22/26	2,580,000.00	2,247,825.00	
	UKT 0.375% 10/22/30	2,150,000.00	1,639,203.00	
	UKT 0.5% 01/31/29	2,180,000.00	1,769,200.80	
	UKT 0.5% 10/22/61	1,740,000.00	521,826.00	
	UKT 0.625% 06/07/25	1,400,000.00	1,297,870.00	
	UKT 0.625% 07/31/35	1,700,000.00	1,110,531.30	
	UKT 0.625% 10/22/50	1,070,000.00	429,775.34	
	UKT 0.875% 01/31/46	1,620,000.00	795,471.84	
	UKT 0.875% 07/31/33	1,630,000.00	1,182,157.50	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,400,000.00	1,145,173.12	
	UKT 1.125% 01/31/39	1,950,000.00	1,225,380.00	
	UKT 1.125% 10/22/73	1,050,000.00	389,919.60	
	UKT 1.25% 07/22/27	950,000.00	840,639.80	
	UKT 1.25% 07/31/51	2,620,000.00	1,287,556.55	
	UKT 1.25% 10/22/41	1,960,000.00	1,178,310.66	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,600,000.00	1,464,710.40	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,700,000.00	957,909.20	
	UKT 1.5% 07/31/53	970,000.00	500,423.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,070,000.00	937,705.20	
	UKT 1.625% 10/22/54	1,340,000.00	709,945.40	
	UKT 1.625% 10/22/71	1,180,000.00	559,636.47	
	UKT 1.75% 01/22/49	600,000.00	353,239.20	
	UKT 1.75% 07/22/57	1,560,000.00	846,892.80	
UKT 1.75% 09/07/37	1,890,000.00	1,363,170.81		
UKT 1% 01/31/32	3,150,000.00	2,429,752.50		
UKT 2.5% 07/22/65	1,420,000.00	929,830.20		
UKT 2.75% 09/07/24	1,440,000.00	1,404,816.19		

	UKT 2% 09/07/25	2,380,000.00	2,247,900.33	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,910,000.00	1,593,022.51	
	UKT 3.25% 01/31/33	2,030,000.00	1,874,705.00	
	UKT 3.5% 01/22/45	1,970,000.00	1,699,534.76	
	UKT 3.5% 07/22/68	1,530,000.00	1,291,687.20	
	UKT 3.5% 10/22/25	140,000.00	135,628.44	
	UKT 3.75% 01/29/38	900,000.00	832,518.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,320,000.00	1,169,122.68	
	UKT 3.75% 10/22/53	1,170,000.00	1,030,898.70	
	UKT 4.125% 01/29/27	2,150,000.00	2,113,471.50	
	UKT 4.25% 03/07/36	1,890,000.00	1,875,184.66	
	UKT 4.25% 06/07/32	1,500,000.00	1,513,575.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,270,000.00	1,240,155.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	1,850,000.00	1,841,639.11	
	UKT 4.25% 12/07/40	1,450,000.00	1,412,826.06	
	UKT 4.25% 12/07/46	1,590,000.00	1,533,507.30	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,110,000.00	1,069,562.70	
	UKT 4.25% 12/07/55	1,780,000.00	1,729,494.28	
	UKT 4.5% 09/07/34	1,390,000.00	1,418,275.38	
	UKT 4.5% 12/07/42	1,800,000.00	1,806,455.52	
	UKT 4.75% 12/07/30	1,460,000.00	1,517,202.21	
	UKT 4.75% 12/07/38	1,400,000.00	1,449,973.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,250,000.00	1,171,553.75	
	UKT 4% 10/22/63	460,000.00	430,568.25	
	UKT 5% 03/07/25	1,180,000.00	1,184,242.92	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,350,000.00	1,461,553.87	
	イギリスポンド 小計	90,590,000.00	73,269,047.86 (12,845,529,470)	
スウェーデン クローナ	SGB 0.125% 05/12/31	4,470,000.00	3,746,548.38	
	SGB 0.75% 05/12/28	6,430,000.00	5,915,535.70	
	SGB 0.75% 11/12/29	4,600,000.00	4,149,326.40	
	SGB 1.75% 11/11/33	2,700,000.00	2,550,116.03	
	SGB 1% 11/12/26	7,980,000.00	7,538,068.95	
	SGB 2.25% 06/01/32	5,510,000.00	5,452,028.79	
	SGB 2.5% 05/12/25	7,730,000.00	7,653,556.94	
	SGB 3.5% 03/30/39	4,200,000.00	4,720,044.00	

スウェーデンクローナ 小計		43,620,000.00	41,725,225.19 (536,586,395)	
ノルウェークローネ	NGB 1.25% 09/17/31	3,680,000.00	3,076,608.80	
	NGB 1.375% 08/19/30	5,200,000.00	4,484,171.12	
	NGB 1.5% 02/19/26	4,090,000.00	3,864,002.96	
	NGB 1.75% 02/17/27	4,230,000.00	3,961,691.10	
	NGB 1.75% 03/13/25	6,260,000.00	6,043,685.70	
	NGB 1.75% 09/06/29	4,250,000.00	3,828,166.25	
	NGB 2.125% 05/18/32	3,360,000.00	2,990,769.60	
	NGB 2% 04/26/28	2,370,000.00	2,205,048.00	
	NGB 3% 08/15/33	2,830,000.00	2,696,640.77	
ノルウェークローネ 小計		36,270,000.00	33,150,784.30 (428,971,148)	
デンマーククローネ	DGB 0.25% 11/15/52	5,170,000.00	2,699,851.55	
	DGB 0.5% 11/15/27	6,850,000.00	6,250,670.21	
	DGB 0.5% 11/15/29	6,100,000.00	5,358,234.51	
	DGB 0% 11/15/24	3,840,000.00	3,672,576.13	
	DGB 0% 11/15/31	5,640,000.00	4,549,239.78	
	DGB 1.75% 11/15/25	6,560,000.00	6,384,289.08	
	DGB 4.5% 11/15/39	10,570,000.00	13,037,766.27	
デンマーククローネ 小計		44,730,000.00	41,952,627.53 (843,667,339)	
ポーランドズロチ	POLGB 0.25% 10/25/26	1,240,000.00	1,035,710.00	
	POLGB 0.75% 04/25/25	3,560,000.00	3,245,652.00	
	POLGB 0% 07/25/24	1,310,000.00	1,229,376.71	
	POLGB 1.25% 10/25/30	4,150,000.00	3,044,606.00	
	POLGB 1.75% 04/25/32	2,790,000.00	2,011,032.00	
	POLGB 2.25% 10/25/24	3,930,000.00	3,739,788.00	
	POLGB 2.5% 07/25/26	4,900,000.00	4,456,060.00	
	POLGB 2.5% 07/25/27	4,760,000.00	4,210,458.00	
	POLGB 2.75% 04/25/28	2,100,000.00	1,842,120.00	
	POLGB 2.75% 10/25/29	6,000,000.00	5,066,700.00	
	POLGB 3.25% 07/25/25	4,030,000.00	3,825,199.43	
	POLGB 3.75% 05/25/27	2,460,000.00	2,291,194.80	
	POLGB 5.75% 04/25/29	600,000.00	600,180.00	
POLGB 6% 10/25/33	810,000.00	818,505.00		

	POLGB 7.5% 07/25/28	730,000.00	785,772.14	
	ポーランドズロチ 小計	43,370,000.00	38,202,354.08 (1,288,351,469)	
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	2,800,000.00	2,650,996.96	
	ACGB 0.25% 11/21/25	2,100,000.00	1,924,703.10	
	ACGB 0.5% 09/21/26	1,210,000.00	1,087,687.31	
	ACGB 1.25% 05/21/32	2,440,000.00	1,949,007.14	
	ACGB 1.5% 06/21/31	2,170,000.00	1,812,035.93	
	ACGB 1.75% 06/21/51	1,670,000.00	978,738.93	
	ACGB 1.75% 11/21/32	1,820,000.00	1,507,278.17	
	ACGB 1% 11/21/31	2,780,000.00	2,199,978.79	
	ACGB 1% 12/21/30	2,020,000.00	1,641,775.80	
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,480,000.00	1,378,021.10	
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,070,000.00	1,898,892.25	
	ACGB 2.75% 05/21/41	1,180,000.00	956,433.71	
	ACGB 2.75% 06/21/35	1,200,000.00	1,054,647.40	
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,930,000.00	1,848,390.45	
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,660,000.00	1,574,879.18	
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,460,000.00	1,369,437.98	
	ACGB 3.25% 04/21/25	2,070,000.00	2,042,698.27	
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,680,000.00	1,630,068.68	
	ACGB 3.25% 06/21/39	1,120,000.00	994,895.22	
	ACGB 3.5% 12/21/34	1,450,000.00	1,382,714.89	
	ACGB 3.75% 04/21/37	1,160,000.00	1,114,298.43	
	ACGB 3.75% 05/21/34	1,490,000.00	1,459,987.16	
	ACGB 3% 03/21/47	1,450,000.00	1,171,149.13	
ACGB 3% 11/21/33	1,840,000.00	1,689,109.91		
ACGB 4.25% 04/21/26	1,600,000.00	1,618,131.68		
ACGB 4.5% 04/21/33	2,690,000.00	2,810,071.64		
ACGB 4.75% 04/21/27	2,320,000.00	2,398,393.49		
	オーストラリアドル 小計	48,860,000.00	44,144,422.70 (4,153,548,731)	
ニュージー ランドドル	NZGB 0.25% 05/15/28	590,000.00	481,906.50	
	NZGB 0.5% 05/15/26	670,000.00	595,510.82	
	NZGB 1.5% 05/15/31	590,000.00	474,463.06	
	NZGB 1.75% 05/15/41	460,000.00	296,314.95	

		NZGB 2.75% 04/15/25	850,000.00	816,492.31	
		NZGB 2.75% 04/15/37	630,000.00	509,356.08	
		NZGB 2.75% 05/15/51	520,000.00	369,632.44	
		NZGB 2% 05/15/32	530,000.00	433,666.94	
		NZGB 3.5% 04/14/33	600,000.00	552,005.58	
		NZGB 3% 04/20/29	650,000.00	602,015.86	
		NZGB 4.25% 05/15/34	320,000.00	311,910.40	
		NZGB 4.5% 04/15/27	840,000.00	839,814.31	
		NZGB 4.5% 05/15/30	370,000.00	371,151.10	
		ニュージーランドドル 小計	7,620,000.00	6,654,240.35 (568,072,498)	
シンガポールドル		SIGB 0.5% 11/01/25	590,000.00	552,535.00	
		SIGB 1.25% 11/01/26	810,000.00	759,456.00	
		SIGB 1.625% 07/01/31	560,000.00	506,240.00	
		SIGB 1.875% 03/01/50	770,000.00	679,833.00	
		SIGB 1.875% 10/01/51	320,000.00	287,625.60	
		SIGB 2.125% 06/01/26	630,000.00	609,840.00	
		SIGB 2.25% 08/01/36	650,000.00	607,425.00	
		SIGB 2.375% 06/01/25	900,000.00	882,562.50	
		SIGB 2.375% 07/01/39	470,000.00	447,249.65	
		SIGB 2.625% 05/01/28	510,000.00	501,929.25	
		SIGB 2.625% 08/01/32	230,000.00	223,776.20	
		SIGB 2.75% 03/01/46	640,000.00	662,912.00	
		SIGB 2.75% 04/01/42	630,000.00	642,559.05	
		SIGB 2.875% 07/01/29	650,000.00	645,450.00	
		SIGB 2.875% 09/01/27	420,000.00	417,480.00	
		SIGB 2.875% 09/01/30	630,000.00	625,590.00	
		SIGB 3.375% 09/01/33	660,000.00	685,410.00	
		SIGB 3.5% 03/01/27	740,000.00	749,250.00	
		SIGB 3% 08/01/72	220,000.00	259,490.00	
		SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	892,980.00	
		シンガポールドル 小計	11,930,000.00	11,639,593.25 (1,207,840,591)	
マレーシア リンギット		MGS 2.632% 04/15/31	1,650,000.00	1,520,782.21	
		MGS 3.478% 06/14/24	1,920,000.00	1,924,267.96	
		MGS 3.502% 05/31/27	1,510,000.00	1,506,392.24	

	MGS 3.582% 07/15/32	710,000.00	701,671.11	
	MGS 3.733% 06/15/28	2,930,000.00	2,947,035.31	
	MGS 3.757% 05/22/40	2,360,000.00	2,252,405.33	
	MGS 3.828% 07/05/34	1,770,000.00	1,757,870.38	
	MGS 3.844% 04/15/33	1,880,000.00	1,884,955.10	
	MGS 3.882% 03/14/25	1,370,000.00	1,383,069.80	
	MGS 3.885% 08/15/29	2,160,000.00	2,187,554.04	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,130,000.00	1,142,568.42	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,970,000.00	1,996,517.18	
	MGS 3.9% 11/30/26	2,470,000.00	2,502,467.16	
	MGS 3.906% 07/15/26	600,000.00	607,855.68	
	MGS 3.955% 09/15/25	1,690,000.00	1,708,456.82	
	MGS 4.059% 09/30/24	1,280,000.00	1,291,812.48	
	MGS 4.065% 06/15/50	2,390,000.00	2,356,348.86	
	MGS 4.181% 07/15/24	1,280,000.00	1,290,733.82	
	MGS 4.232% 06/30/31	2,490,000.00	2,570,547.51	
	MGS 4.254% 05/31/35	1,750,000.00	1,797,031.07	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,910,000.00	1,959,766.96	
	MGS 4.498% 04/15/30	580,000.00	610,054.78	
	MGS 4.642% 11/07/33	870,000.00	932,269.29	
	MGS 4.696% 10/15/42	1,050,000.00	1,134,425.04	
	MGS 4.736% 03/15/46	980,000.00	1,062,293.44	
	MGS 4.762% 04/07/37	2,280,000.00	2,463,500.55	
	MGS 4.893% 06/08/38	1,840,000.00	2,023,883.89	
	MGS 4.921% 07/06/48	1,680,000.00	1,885,770.43	
	MGS 4.935% 09/30/43	1,030,000.00	1,142,385.46	
	マレーシアリングット 小計	47,530,000.00	48,544,692.32 (1,465,525,425)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.4% 10/31/24	3,090,000.00	2,929,614.16	
	ILGOV 0.5% 02/27/26	1,130,000.00	1,030,645.08	
	ILGOV 0.5% 04/30/25	2,420,000.00	2,255,345.62	
	ILGOV 1.3% 04/30/32	950,000.00	771,892.57	
	ILGOV 1.5% 05/31/37	1,770,000.00	1,300,254.03	
	ILGOV 1.75% 08/31/25	1,240,000.00	1,174,758.14	
	ILGOV 1% 03/31/30	870,000.00	724,057.50	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	2,700,000.00	2,505,008.16	

	ILGOV 2.8% 11/29/52	500,000.00	377,658.90	
	ILGOV 2% 03/31/27	1,600,000.00	1,491,440.00	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	2,680,000.00	2,500,574.00	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,880,000.00	2,224,998.04	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	1,340,000.00	1,432,652.69	
	イスラエルシェケル 小計	22,170,000.00	20,718,898.89 (806,244,871)	
オフショア 人民元	CGB 1.99% 04/09/25	53,870,000.00	53,722,438.75	
	CGB 2.18% 06/25/24	19,130,000.00	19,172,757.46	
	CGB 2.28% 11/25/25	30,220,000.00	30,286,928.23	
	CGB 2.29% 12/25/24	19,350,000.00	19,417,879.80	
	CGB 2.3% 05/15/26	15,000,000.00	15,045,135.00	
	CGB 2.35% 03/15/25	15,900,000.00	15,978,615.96	
	CGB 2.44% 10/15/27	9,300,000.00	9,305,294.49	
	CGB 2.46% 02/15/26	25,500,000.00	25,672,576.35	
	CGB 2.47% 09/02/24	32,480,000.00	32,650,253.66	
	CGB 2.48% 04/15/27	20,000,000.00	20,072,276.00	
	CGB 2.5% 07/25/27	23,060,000.00	23,130,662.75	
	CGB 2.6% 09/01/32	21,800,000.00	21,568,717.47	
	CGB 2.62% 09/25/29	20,000,000.00	19,983,205.00	
	CGB 2.64% 01/15/28	10,520,000.00	10,615,451.11	
	CGB 2.68% 05/21/30	15,030,000.00	15,044,328.09	
	CGB 2.69% 08/12/26	63,900,000.00	64,654,690.95	
	CGB 2.69% 08/15/32	9,320,000.00	9,291,453.58	
	CGB 2.75% 02/17/32	14,500,000.00	14,532,555.40	
	CGB 2.75% 06/15/29	12,640,000.00	12,741,149.06	
	CGB 2.79% 12/15/29	13,000,000.00	13,111,013.50	
	CGB 2.8% 03/24/29	23,080,000.00	23,378,943.70	
	CGB 2.8% 03/25/30	20,000,000.00	20,191,122.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	4,000,000.00	4,027,588.40	
	CGB 2.85% 06/04/27	29,530,000.00	30,048,263.31	
	CGB 2.88% 02/25/33	11,300,000.00	11,484,112.03	
	CGB 2.89% 11/18/31	24,210,000.00	24,534,658.51	
CGB 2.91% 10/14/28	29,200,000.00	29,788,429.63		
CGB 3.01% 05/13/28	14,000,000.00	14,379,745.80		
CGB 3.02% 05/27/31	21,690,000.00	22,212,867.81		



	CGB 3.03% 03/11/26	18,800,000.00	19,227,421.76	
	CGB 3.12% 10/25/52	8,400,000.00	8,460,126.36	
	CGB 3.19% 04/15/53	2,600,000.00	2,671,351.54	
	CGB 3.27% 11/19/30	6,850,000.00	7,158,482.21	
	CGB 3.28% 12/03/27	14,110,000.00	14,657,218.25	
	CGB 3.32% 04/15/52	9,000,000.00	9,354,908.70	
	CGB 3.39% 03/16/50	11,730,000.00	12,278,254.33	
	CGB 3.53% 10/18/51	7,450,000.00	8,026,069.01	
	CGB 3.72% 04/12/51	7,940,000.00	8,820,750.85	
	CGB 3.81% 09/14/50	13,300,000.00	14,969,268.36	
	CGB 3.86% 07/22/49	11,980,000.00	13,549,508.18	
	CGB 4.08% 10/22/48	9,060,000.00	10,581,775.58	
	オフショア人民元 小計	742,750,000.00	755,798,248.93 (14,744,641,298)	
	合計		267,981,707,240 (267,981,707,240)	

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 205 銘柄	100.0%	49.4%
カナダドル	国債証券 39 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15 銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 359 銘柄	100.0%	33.1%
イギリスポンド	国債証券 57 銘柄	100.0%	4.8%
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 9 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 15 銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.0%	1.5%
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 20 銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングgit	国債証券 29 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 41 銘柄	100.0%	5.5%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,980,090,401
コール・ローン	68,186,342
株式	151,437,166,593
投資信託受益証券	436,525,713
投資証券	125,907,216
派生商品評価勘定	154,525,697
未収入金	4,694,201
未収配当金	315,773,208
差入委託証拠金	1,228,855,580
流動資産合計	157,751,724,951
資産合計	157,751,724,951
負債の部	
流動負債	
前受金	154,523,297
未払解約金	62,612,894
未払利息	138
流動負債合計	217,136,329
負債合計	217,136,329
純資産の部	
元本等	
元本	42,049,511,619
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	115,485,077,003
元本等合計	157,534,588,622
純資産合計	157,534,588,622
負債純資産合計	157,751,724,951

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年6月12日現在

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

<p>1. 計算期間の末日における受益権の総数</p>	<p>2023年6月12日現在</p> <p>42,049,511,619口</p>
-----------------------------	--

2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,7464円 (37,464円)
----------------------------	---------------------------	----------------------

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年6月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月12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	2023年6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月11日
期首元本額	30,557,293,977円
期中追加設定元本額	12,742,751,008円
期中一部解約元本額	1,250,533,366円
期末元本額	42,049,511,619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	7,822,338,077円
世界経済インデックスファンド	8,886,399,431円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,894,976,535円
DC世界経済インデックスファンド	7,023,298,762円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	117,967,352円
コア投資戦略ファンド (安定型)	109,036,912円
コア投資戦略ファンド (成長型)	264,234,197円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,063,110,191円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	756,126,882円
コア投資戦略ファンド (切替型)	122,627,005円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	395,235,820円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,369,626円
SMT インデックスバランス・オープン	97,438,011円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	68,809,082円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	3,781,789,917円
SMT 世界経済インデックス・オープン	221,409,748円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	892,246,839円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	153,134,195円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,132,529円
グローバル経済コア	403,326,574円
My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	148,283,390円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	100,944,337円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	22,104,370円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	80,550,072円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	71,810,141円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	27,841,532円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	30,681,197円
10資産分散投資ファンド	13,176,286円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,388,916,425円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	101,367,436円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	78,966,811円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	10,660,898円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	49,368,536円

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,978,898,715
投資信託受益証券	31,793,816

投資証券	5, 110, 692
合計	10, 015, 803, 223

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2023年6月12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	5, 395, 063, 985	—	5, 549, 587, 282	154, 523, 297
合計		5, 395, 063, 985	—	5, 549, 587, 282	154, 523, 297

(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

(2023年6月12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 アメリカドル	55, 752, 000 55, 752, 000	— —	55, 754, 400 55, 754, 400	2, 400 2, 400
合計		55, 752, 000	—	55, 754, 400	2, 400

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	1.36	189,584.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	16,930	7.06	119,525.80	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	4	0.00	—	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	171	0.00	—	
	SEVERSTAL - GDR REG S	38,773	0.00	—	
	SOUTHERN COPPER CORP	15,749	71.28	1,122,588.72	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	63,831	27.10	1,729,820.10	
	NIO INC - ADR	235,578	7.73	1,821,017.94	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	30,159	43.07	1,298,948.13	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	6.19	490,668.92	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	59.72	3,968,513.44	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	30.08	369,472.64	
	IQIYI INC-ADR	59,454	4.92	292,513.68	
	JOYY INC	6,185	28.93	178,932.05	
	KANZHUN LTD	38,815	15.30	593,869.50	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	113,547	7.78	883,395.66	
	VK CO LTD	19,368	0.00	—	
	WEIBO CORP-SPON ADR	5,249	14.38	75,480.62	
	YANDEX NV-A	32,725	0.00	—	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	10,726	17.14	183,843.64	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	80,974	76.10	6,162,121.40	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	73,380	17.48	1,282,682.40	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	1	0.00	—	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	12,386	67.62	837,541.32	
	COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	403,900	1.14	462,061.60	
	CREDICORP LTD	10,882	140.50	1,528,921.00	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	114,133	1.58	180,330.14	
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	16.25	337,236.25	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	140,760	2.68	377,799.84		

	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	7,835	41.58	325,779.30	
	KE HOLDINGS INC	113,384	16.70	1,893,512.80	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	152,432	0.65	99,385.66	
	アメリカドル 小計	2,137,054		26,805,546.55 (3,737,497,355)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,657,761	12.06	32,052,597.66	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	85.38	41,741,598.96	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	292.16	10,225,600.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	37.67	6,726,053.84	
	ALFA S. A. B. -A	313,500	11.44	3,586,440.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	115.62	11,793,240.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	492.16	16,524,272.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	307.22	18,427,055.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	183.63	7,838,246.55	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	590,690	17.28	10,207,123.20	
	WALMART DE MEXICO-SER V	827,280	67.47	55,816,581.60	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	179.12	14,665,450.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	185.56	58,106,258.40	
	GRUMA S. A. B. -B	25,960	278.37	7,226,485.20	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	181,800	94.22	17,129,196.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	38.43	6,986,574.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	55.91	7,978,357.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	412,300	140.87	58,080,701.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	399,400	44.04	17,589,576.00	
AMERICA MOVIL SAB DE CV	4,969,540	19.37	96,259,989.80		
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.33	3,610,563.00		
	メキシコペソ 小計	12,259,530		502,571,959.81 (4,054,499,285)	
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	17.65	2,861,065.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	638,000	33.75	21,532,500.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	728,040	30.28	22,045,051.20	
	PRIOR SA	130,000	34.48	4,482,400.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	75,600	18.10	1,368,360.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	13.02	1,294,188.00	
	GERDAU SA-PREF	214,790	25.30	5,434,187.00	
	SUZANO SA	121,779	45.24	5,509,281.96	



VALE SA	557,687	68.36	38,123,483.32
WEG SA	255,844	37.80	9,670,903.20
CCR SA	248,600	14.25	3,542,550.00
LOCALIZA RENT A CAR	93,140	68.18	6,350,285.20
RUMO SA	244,300	22.40	5,472,320.00
LOJAS RENNER S. A.	216,447	21.83	4,725,038.01
MAGAZINE LUIZA SA	305,500	3.97	1,212,835.00
VIBRA ENERGIA SA	173,000	17.53	3,032,690.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	11.28	1,495,728.00
RAIA DROGASIL SA	189,280	28.66	5,424,764.80
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	151,800	12.96	1,967,328.00
AMBEV SA	756,200	15.14	11,448,868.00
JBS SA	110,000	17.74	1,951,400.00
NATURA &CO HOLDING SA	100,308	15.95	1,599,912.60
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	4.24	4,431,452.96
REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	32.24	3,085,368.00
HYPERA SA	54,500	45.84	2,498,280.00
BANCO BRADESCO S. A.	326,023	14.54	4,740,374.42
BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	16.86	13,963,148.52
BANCO DO BRASIL S. A.	156,500	47.74	7,471,310.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	780,281	27.80	21,691,811.80
ITAUSA SA	774,657	9.23	7,150,084.11
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,060,409	14.70	15,588,012.30
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	31.07	3,383,523.00
TOTVS SA	57,900	29.86	1,728,894.00
TELEFONICA BRASIL S. A.	89,400	43.47	3,886,218.00
TIM SA	96,100	14.62	1,404,982.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	43.21	1,598,770.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	38.55	8,161,035.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	211,827	12.55	2,658,428.85
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	54.48	2,751,240.00
CPFL ENERGIA SA	27,200	31.36	852,992.00
ENEVA SA	102,200	12.38	1,265,236.00
ENGIE BRASIL SA	46,250	43.92	2,031,300.00
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	30.41	5,020,691.00
ブラジルリアル 小計	12,029,898		275,908,291.25

				(7,878,009,440)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	5,869.00	530,692,587.00
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,464.90	199,175,128.50
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	21,251	55,800.00	1,185,805,800.00
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	55.88	137,531,185.44
	FALABELLA SA	70,837	1,850.00	131,048,450.00
	CENCOSUD SA	306,432	1,570.00	481,098,240.00
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,385	6,297.00	46,503,345.00
	BANCO DE CHILE	7,583,203	84.45	640,401,493.35
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,193	24,000.00	148,632,000.00
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	37.28	430,590,300.32
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	111.80	390,329,017.00
	ENEL CHILE SA	2,561,278	49.25	126,142,941.50
	チリペソ 小計	28,285,639		4,447,950,488.11 (786,019,570)
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	69,778	33,190.00	2,315,931,820.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	29,950.00	1,843,871,750.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	17,200.00	868,789,200.00
	コロンビアペソ 小計	181,854		5,028,592,770.00 (167,411,910)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	23.60	122,743.60
	MYTILINEOS S. A.	20,295	31.00	629,145.00
	OPAP SA	38,972	16.08	626,669.76
	JUMBO SA	19,341	24.42	472,307.22
	ALPHA SERVICES AND HLD	263,668	1.57	415,540.76
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	1.50	642,346.82
	NATIONAL BANK OF GREECE	73,640	5.97	439,630.80
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	14.65	383,932.55
	PUBLIC POWER CORP	55,892	10.15	567,303.80
	TERNA ENERGY SA	13,651	20.56	280,664.56
	ユーロ 小計	944,528		4,580,284.87 (686,218,279)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	77.50	11,050,725.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	37.14	9,614,357.52
	HEKTAS TICARET T. A. S	133,067	32.02	4,260,805.34
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	346,418	24.94	8,639,664.92

	SASA POLYESTER SANAYI	118,024	65.55	7,736,473.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	99,566	55.60	5,535,869.60	
	KOC HOLDING AS	89,884	103.60	9,311,982.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	44.92	13,419,760.16	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	7,181	580.20	4,166,416.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	176.90	15,322,193.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	692.30	11,332,951.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	231.50	7,316,094.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	163.60	13,288,900.80	
	AKBANK T. A. S.	586,183	18.46	10,820,938.18	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	43.60	9,215,819.20	
	TURKIYE IS BANKASI-C	384,463	13.45	5,171,027.35	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	12.38	4,594,552.26	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	37.34	5,343,017.94	
	トルコリラ 小計	3,406,398		156,141,549.07 (931,103,285)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	665.00	8,846,495.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	79.20	4,808,232.00	
	CEZ AS	25,283	1,030.00	26,041,490.00	
	チェココルナ 小計	99,296		39,696,217.00 (250,935,666)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	44,523	3,000.00	133,569,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	8,360.00	240,274,760.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	11,580.00	463,443,180.00	
	ハンガリーフォリント 小計	113,285		837,286,940.00 (341,045,390)	
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	102,979	65.24	6,718,349.96	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	114.15	2,304,231.90	
	LPP SA	124	13,810.00	1,712,440.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	129.35	867,162.40	
	CYFROWY POLSAT SA	36,098	16.51	596,158.47	
	ALLEGRO. EU SA	83,795	34.56	2,896,374.17	
	PEPCO GROUP NV	22,887	38.54	882,064.98	
	DINO POLSKA SA	9,471	460.30	4,359,501.30	
	BANK PEKAO SA	27,684	108.70	3,009,250.80	
	M BANK SA	1,423	397.70	565,927.10	

	PKO BANK POLSKI SA	130,297	35.79	4,663,329.63
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	389.20	2,857,895.60
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	86,529	40.96	3,544,227.84
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	277,921	7.14	1,984,355.94
	ポーランドズロチ 小計	813,441		36,961,270.09 (1,246,496,657)
ロシアグループ	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	—
	ロシアグループ 小計	760,525,356		76.00 (128)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	6.55	2,154,950.00
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	8.16	1,974,720.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,411,400	5.17	22,806,938.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	560,500	26.05	14,601,025.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	350,000	7.40	2,590,000.00
	PETROCHINA CO LTD-H	3,218,000	5.77	18,567,860.00
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	286,000	21.00	6,006,000.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	340,000	3.63	1,234,200.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	21.35	5,070,625.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	6.04	3,355,220.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	4.76	3,465,280.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	288,000	3.18	915,840.00
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	4.31	3,491,100.00
	DONGYUE GROUP	147,000	7.10	1,043,700.00

GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	54.50	2,945,180.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	12.56	2,939,040.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	364,000	4.71	1,714,440.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	95,000	15.76	1,497,200.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	181,000	11.38	2,059,780.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	11.62	10,516,100.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.87	1,064,250.00	
BOC AVIATION LTD	23,800	62.80	1,494,640.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	196,000	4.10	803,600.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	243,000	10.94	2,658,420.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	128,000	5.31	679,680.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	5.33	3,762,980.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	9.22	4,075,240.00	
CITIC LTD	1,038,000	9.90	10,276,200.00	
CRRC CORP LTD-H	936,000	4.88	4,567,680.00	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	5.40	1,555,200.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	78,000	17.22	1,343,160.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	160,000	9.91	1,585,600.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	11.14	4,554,032.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	31.65	1,971,795.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	385,074	3.19	1,228,386.06	
AIR CHINA LIMITED-H	214,000	5.75	1,230,500.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	248,000	5.54	1,373,920.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	165,547	10.96	1,814,395.12	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	598,000	4.49	2,685,020.00	
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	518,050	7.29	3,776,584.50	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	250,774	5.00	1,253,870.00	
JD LOGISTICS INC	326,200	12.68	4,136,216.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	7.84	2,524,480.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	17,500	102.90	1,800,750.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	142,387	6.70	953,992.90	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	6.05	1,875,500.00	
BYD CO LTD-H	158,000	251.20	39,689,600.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	266,000	3.78	1,005,480.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,400	30.50	1,781,200.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	9.54	9,043,920.00	

GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	8.61	4,251,187.50
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	4.58	1,641,215.52
LI AUTO INC-CLASS A	189,942	125.10	23,761,744.20
MINIH GROUP LTD	176,000	21.70	3,819,200.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	34.55	5,775,447.10
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	17.38	4,066,920.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	198,800	85.00	16,898,000.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	3.64	1,594,320.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	410,800	23.50	9,653,800.00
LI NING CO LTD	380,000	46.40	17,632,000.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	122,100	68.30	8,339,430.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	165,000	8.34	1,376,100.00
EAST BUY HOLDING LTD	44,000	33.00	1,452,000.00
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDI	234,000	17.36	4,062,240.00
Jiumaojiu INTERNATIONAL HOLD	235,000	13.70	3,219,500.00
MEITUAN-CLASS B	815,350	127.10	103,630,985.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	33.95	8,300,775.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	17.80	2,969,040.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	14.88	1,175,520.00
TRIP.COM GROUP LTD	87,657	284.80	24,964,713.60
BAIDU INC-CLASS A	371,850	132.70	49,344,495.00
BILIBILI INC-CLASS Z	26,600	129.90	3,455,340.00
CHINA LITERATURE LTD	51,600	33.10	1,707,960.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	1.83	2,320,440.00
KINGSOFT CORP LTD	171,200	31.05	5,315,760.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	372,400	58.40	21,748,160.00
NETEASE INC	313,630	146.30	45,884,069.00
TENCENT HOLDINGS LTD	1,000,100	336.00	336,033,600.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,659,588	83.90	223,139,433.20
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	104,000	9.40	977,600.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	121.20	1,090,800.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	14.30	3,603,600.00
JD.COM INC - CL A	378,061	145.00	54,818,845.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	16.80	1,085,280.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	6.80	2,788,000.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	29.45	2,709,400.00

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	4.80	3,763,200.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	50.90	9,846,605.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	53,700	19.56	1,050,372.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	133.72	2,032,544.00	
CHINA FEIHE LTD	564,000	4.53	2,554,920.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	538,000	30.05	16,166,900.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	53.00	13,038,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	246,000	2.61	642,060.00	
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
NONGFU SPRING CO LTD-H	282,600	42.70	12,067,020.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	7.96	1,552,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	11.86	4,933,760.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	69.30	8,038,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	80,000	6.92	553,600.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,039,000	5.05	5,246,950.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	48,000	17.90	859,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	34.55	3,023,125.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	25,000	19.24	481,000.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	47.50	3,581,500.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	14.00	924,000.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	11.60	4,630,720.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	15.80	2,028,720.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	26.85	5,133,720.00	
3SBIO INC	445,500	7.64	3,403,620.00	
AKESO INC	61,000	35.55	2,168,550.00	
BEIGENE LTD	110,905	129.80	14,395,469.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	247,000	12.06	2,978,820.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.74	9,356,198.40	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	7.58	2,569,620.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	486,000	3.79	1,841,940.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	132,000	18.66	2,463,120.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	5,100	50.70	258,570.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	122,000	13.12	1,600,640.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	37.65	7,642,950.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	33,450	27.65	924,892.50	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	73,000	20.55	1,500,150.00	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	3.86	7,608,060.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	66.90	4,260,727.20	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	631,000	44.85	28,300,350.00	
ZAI LAB LTD	128,250	23.45	3,007,462.50	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	4,735,000	3.10	14,678,500.00	
BANK OF CHINA LTD-H	13,174,200	3.19	42,025,698.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	5.31	7,282,532.25	
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.35	6,808,620.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	15,086,620	5.14	77,545,226.80	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.50	937,500.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	621,923	37.85	23,539,785.55	
CHINA MINSHENG BANKING-H	674,400	3.19	2,151,336.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	8,728,515	4.34	37,881,755.10	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,576,000	5.34	8,415,840.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	832,000	0.87	723,840.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.34	2,096,220.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	14.32	5,029,184.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	15.08	4,309,487.00	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	6.79	1,629,600.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	11.00	974,600.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	5.27	1,882,444.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	9.95	2,646,700.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,296,000	13.54	17,547,840.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	386,600	21.10	8,157,260.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.44	1,553,162.56	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	225,300	21.45	4,832,685.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	3.15	5,915,700.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.66	11,565,802.08	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,004,000	53.45	53,663,800.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	116,100	21.90	2,542,590.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	276,000	4.86	1,341,360.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	126,700	11.10	1,406,370.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	11.00	5,423,000.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	71,500	16.26	1,162,590.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	23.90	3,835,950.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	67,000	21.75	1,457,250.00	



KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	69,000	7.35	507,150.00	
LENOVO GROUP LTD	1,188,000	7.60	9,028,800.00	
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	77.50	9,261,250.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	2,404,200	10.84	26,061,528.00	
ZTE CORP-H	82,908	25.45	2,110,008.60	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.90	6,373,800.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	31.75	1,889,125.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	1.92	1,171,200.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	1.92	2,741,760.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	9.33	4,351,512.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	8.55	3,864,600.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	2.93	1,951,380.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	197,600	28.50	5,631,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	18.04	4,643,496.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	101.70	11,898,900.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	7.11	3,171,060.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	4.95	3,484,800.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	6.19	3,392,120.00	
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	22.20	1,420,800.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.49	4,692,010.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	26.30	2,367,000.00	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	43,000	18.72	804,960.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	8.40	7,526,290.80	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	85,000	18.86	1,603,100.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	625,900	1.28	801,152.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	17.70	10,346,358.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	225,000	8.63	1,941,750.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	32.30	17,477,885.30	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	38.25	4,551,750.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	11.16	3,520,980.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,852,654	1.70	3,149,511.80	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	341,000	10.02	3,416,820.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	72,500	8.30	601,750.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	180,000	4.09	736,200.00	
LONGFOR PROPERTIES	343,500	19.14	6,574,590.00	

	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	132,500	4.42	585,650.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	320,600	9.24	2,962,344.00	
	香港ドル 小計	135,520,729		1,964,131,685.14 (34,941,902,678)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	413,668	2.09	864,566.12	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	21.46	1,897,064.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.40	2,664,960.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	4.65	3,522,840.00	
	GAMUDA BHD	159,500	4.25	677,875.00	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.00	672,692.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	6.93	743,457.33	
	MISC BHD	217,540	7.23	1,572,814.20	
	GENTING BHD	271,600	4.11	1,116,276.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.53	935,341.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.55	470,347.50	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.77	1,019,181.80	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	114,246	21.70	2,479,138.20	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,200	132.00	950,400.00	
	PPB GROUP BERHAD	73,480	15.80	1,160,984.00	
	QL RESOURCES BHD	124,800	5.28	658,944.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	247,046	4.23	1,045,004.58	
	IHH HEALTHCARE BHD	229,300	5.73	1,313,889.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	504,900	1.07	540,243.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	3.57	1,073,499.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,204,302	4.95	5,961,294.90	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	18.66	2,263,308.72	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	16,633	17.30	287,750.90	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	8.62	7,598,573.10	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,503,200	3.82	9,562,224.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.29	1,160,345.63	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.78	1,504,227.42	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	4.28	2,131,440.00	
	MAXIS BHD	267,900	4.08	1,093,032.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	4.97	1,349,613.44	
PETRONAS GAS BHD	148,400	16.62	2,466,408.00		
TENAGA NATIONAL BHD	441,775	9.18	4,055,494.50		

	INARI AMERTRON BHD	274,700	2.49	684,003.00
	マレーシアリングット 小計	12,703,192		65,497,232.34 (1,977,309,046)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,713,200	8.75	14,990,500.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	200,800	151.50	30,421,200.00
	PTT PCL-NVDR	1,731,900	31.75	54,987,825.00
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	46.00	13,505,830.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	33.25	6,862,800.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	38.50	18,716,159.00
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	38.50	7,803,950.00
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	333.00	43,423,200.00
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	72.25	47,316,525.00
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	8.35	6,821,950.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	809,500	7.35	5,949,825.00
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	5.00	4,051,500.00
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	362,738	33.75	12,242,407.50
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	40.75	7,424,650.00
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	13.80	11,593,863.00
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	20.80	16,481,920.00
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	177,600	36.25	6,438,000.00
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	63.25	60,492,300.00
	SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	237,910	38.25	9,100,057.50
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	46,300	65.00	3,009,500.00
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	21.50	11,962,600.00
	OSOTSPA PCL-NVDR	293,100	30.00	8,793,000.00
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	28.75	54,282,875.00
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	235.00	19,434,500.00
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	83,200	132.50	11,024,000.00
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	19.50	8,553,675.00
	SCB X PCL-NVDR	185,600	107.50	19,952,000.00
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	53.00	5,379,500.00
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	89,800	41.25	3,704,250.00
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	76,300	55.00	4,196,500.00
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	98.00	48,608,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	219.00	44,632,200.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	74.75	9,108,287.50	

	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	7.05	14,210,106.90	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	321,000	37.50	12,037,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	71,200	143.50	10,217,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	64.00	14,073,600.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	58.75	4,006,750.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	402,900	47.00	18,936,300.00	
	RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	356,050	37.50	13,351,875.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	67.75	25,636,600.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	872,000	8.60	7,499,200.00	
	タイパーツ 小計	20,974,790		751,234,481.40 (3,019,962,615)	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	237,940	55.00	13,086,700.00	
	AYALA CORPORATION	54,410	679.50	36,971,595.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	48.20	28,251,128.60	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	910.00	33,019,350.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	198.00	30,319,740.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	235.60	14,373,956.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	142.00	13,569,520.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	398,724	104.30	41,586,913.20	
	BDO UNIBANK INC	394,773	140.00	55,268,220.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	161,287	56.05	9,040,136.35	
	PLDT INC	10,460	1,280.00	13,388,800.00	
	ACEN CORP	821,840	5.98	4,914,603.20	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	328.00	17,443,040.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	24.85	31,830,365.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	2,074,750	32.80	68,051,800.00	
	フィリピンペン 小計	6,420,372		411,115,867.35 (1,022,691,831)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,190.00	4,735,437,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	23,075.00	4,635,767,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,975.00	1,946,955,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	710.00	2,053,468,390.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	244,200	7,400.00	1,807,080,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	3,100.00	5,032,220,700.00	
	PT VALE INDONESIA TBK	304,200	6,350.00	1,931,670,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	394,904	5,925.00	2,339,806,200.00	

	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	6,800.00	22,285,640,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	127.00	17,099,267,808.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,138,700	2,700.00	5,774,490,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,845,000	5,025.00	9,271,125,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	11,375.00	6,818,175,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	429,100	7,425.00	3,186,067,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	4,550.00	5,266,170,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	2,050.00	8,586,425,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	8,689,300	9,100.00	79,072,630,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	5,125.00	31,271,684,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	1,292,300	9,225.00	11,921,467,500.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	10,960,402	5,425.00	59,460,180,850.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,840,600	1,015.00	2,883,209,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,475,800	4,150.00	35,174,570,000.00	
	インドネシアルピア 小計	195,443,308		322,553,506,448.00 (3,032,002,960)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	60,100.00	311,318,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	75,200.00	480,302,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	9,224	200,500.00	1,849,412,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	48,300.00	882,730,800.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	33,900.00	379,307,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	496,000.00	597,184,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	132,300.00	251,105,400.00	
	LG CHEM LTD	8,087	752,000.00	6,081,424,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	387,500.00	339,837,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	172,900.00	400,436,400.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	386,500.00	1,838,967,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	11,785	394,000.00	4,643,290,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	98,300.00	229,825,400.00	
	SKC CO LTD	5,430	110,300.00	598,929,000.00	
	CJ CORP	1,230	84,700.00	104,181,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,308	62,000.00	267,096,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	18,970.00	1,555,596,910.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	267,000.00	2,197,944,000.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	39,400.00	259,764,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	107,100.00	623,964,600.00	

HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	124,900.00	264,163,500.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	9,667	103,700.00	1,002,467,900.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	39,300.00	383,882,400.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,883	80,700.00	232,658,100.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	52,900.00	709,706,400.00	
LG CORP	16,658	90,400.00	1,505,883,200.00	
LG ENERGY SOLUTION	5,668	609,000.00	3,451,812,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	13,780	36,750.00	506,415,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	11,910	110,200.00	1,312,482,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	18,516	28,650.00	530,483,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	6,470.00	615,743,430.00	
SK INC	6,394	173,100.00	1,106,801,400.00	
HMM CO LTD	35,545	19,730.00	701,302,850.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	180,900.00	505,253,700.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	44,008	22,500.00	990,180,000.00	
STX PAN OCEAN CO LTD	29,736	5,250.00	156,114,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	7,066	35,750.00	252,609,500.00	
HANON SYSTEMS	19,000	9,360.00	177,840,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	222,500.00	2,257,930,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	22,724	197,100.00	4,478,900,400.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	107,900.00	651,931,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	107,800.00	371,802,200.00	
KIA CORP	43,979	82,900.00	3,645,859,100.00	
COWAY CO LTD	9,036	48,200.00	435,535,200.00	
F&F CO LTD / NEW	3,017	131,300.00	396,132,100.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	126,200.00	2,177,454,800.00	
KANGWON LAND INC	28,528	18,180.00	518,639,040.00	
HYBE CO LTD	2,474	280,500.00	693,957,000.00	
KAKAO CORP	52,020	56,400.00	2,933,928,000.00	
KAKAO GAMES CORP	3,021	39,800.00	120,235,800.00	
KRAFTON INC	5,809	199,700.00	1,160,057,300.00	
NAVER CORP	21,578	200,500.00	4,326,389,000.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	315,000.00	853,335,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	55,900.00	137,793,500.00	
PEARL ABYSS CORP	4,605	48,800.00	224,724,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	4,363	76,900.00	335,514,700.00	

BGF RETAIL CO LTD/NEW	1,632	186,100.00	303,715,200.00	
EMART	3,594	82,100.00	295,067,400.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	321,500.00	591,238,500.00	
KT&G CORP	18,829	83,100.00	1,564,689,900.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	125,100.00	393,064,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	107,200.00	403,286,400.00	
LG H&H CO LTD	1,321	540,000.00	713,340,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	15,360	71,900.00	1,104,384,000.00	
HLB INC	22,765	36,350.00	827,507,750.00	
CELLTRION INC	17,544	169,000.00	2,964,936,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,066	83,000.00	171,478,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,179	320,000.00	377,280,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	2,675	801,000.00	2,142,675,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	73,900.00	236,258,300.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	80,100.00	168,210,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,195	60,400.00	796,978,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	51,249	42,200.00	2,162,707,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	10,360.00	293,498,800.00	
KAKAOBANK CORP	35,459	25,850.00	916,615,150.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	49,450.00	3,194,420,550.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	67,778	35,700.00	2,419,674,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	77,054	12,180.00	938,517,720.00	
KAKAOPAY CORP	3,065	55,000.00	168,575,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	56,200.00	258,632,400.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	44,650.00	757,933,750.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,560.00	234,473,400.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	9,810.00	118,769,670.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15,947	37,100.00	591,633,700.00	
DB INSURANCE CO LTD	10,074	78,900.00	794,838,600.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	4,139	235,000.00	972,665,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	68,000.00	824,908,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	126,600.00	922,154,400.00	
COSMOAM&T CO LTD	3,780	218,000.00	824,040,000.00	
L&F CO LTD	4,327	273,000.00	1,181,271,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	38,301	16,200.00	620,476,200.00	
LG INNOTEK CO LTD	2,696	311,000.00	838,456,000.00	

	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,166	61,000.00	132,126,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	9,233	147,200.00	1,359,097,600.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	768,162	72,000.00	55,307,664,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	132,120	61,200.00	8,085,744,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	8,823	735,000.00	6,484,905,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	11,250.00	248,906,250.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,080.00	844,099,200.00	
	SK HYNIX INC	87,413	115,400.00	10,087,460,200.00	
	SK SQUARE CO LTD	11,660	46,400.00	541,024,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,475,508		179,197,930,070.00 (19,371,296,240)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	223,240	88.90	19,846,036.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	44.60	20,256,249.60	
	CHINA STEEL	1,779,261	29.75	52,933,014.75	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	69.30	37,564,827.30	
	FORMOSA PLASTICS CORP	708,824	94.10	66,700,338.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	79.90	61,583,084.80	
	TAIWAN CEMENT	913,419	38.45	35,120,960.55	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	18,557	1,000.00	18,557,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	652,028	32.55	21,223,511.40	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,900.00	17,100,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	502,213	45.30	22,750,248.90	
	CHINA AIRLINES LTD	465,000	22.70	10,555,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	386,000	35.85	13,838,100.00	
	EVERGREEN MARINE	183,215	155.00	28,398,325.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	32.90	15,528,800.00	
	WAN HAI LINES LIMITED	74,635	61.80	4,612,443.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	62.90	13,649,300.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	177,061	38.80	6,869,966.80	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	487.50	19,469,287.50	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	70,448	194.00	13,666,912.00	
	GIANT MANUFACTURING	35,713	205.00	7,321,165.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	362.50	11,237,500.00	
	POU CHEN	273,780	32.15	8,802,027.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	53,000	828.00	43,884,000.00	
	MOMO.COM INC	6,000	677.00	4,062,000.00	



PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	284.00	25,146,496.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	76.00	59,006,020.00	
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	336.50	8,412,500.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	593,540	18.40	10,921,136.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	2,641,237	25.20	66,559,172.40	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,929,455	26.50	51,130,557.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,605,202	27.95	44,865,395.90	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	22.25	33,783,532.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,671,622	37.65	62,936,568.30	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,756,318	17.40	30,559,933.20	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,920,011	19.05	36,576,209.55	
TAIWAN BUSINESS BANK	780,000	14.25	11,115,000.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,442,787	28.35	40,903,011.45	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	46.25	31,911,806.25	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	264,375	211.50	55,915,312.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,814,633	24.60	44,639,971.80	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,531,057	44.60	68,285,142.20	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	13.00	33,490,938.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,270,906	61.20	77,779,447.20	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	8.96	17,309,519.36	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	70,000	343.00	24,010,000.00	
ACER INC	617,803	34.20	21,128,862.60	
ADVANTECH CO LTD	69,336	405.00	28,081,080.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	315.00	40,033,980.00	
AUO CORP	1,268,072	18.25	23,142,314.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	190.50	22,612,350.00	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	1,390,080	14.70	20,434,176.00	
COMPAL ELECTRONICS	805,760	28.85	23,246,176.00	
DELTA ELECTRONICS INC	302,903	323.00	97,837,669.00	
E INK HOLDINGS INC	144,000	227.00	32,688,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,938,248	108.00	209,330,784.00	
INVENTEC CO LTD	280,511	38.65	10,841,750.15	
LARGAN PRECISION CO LTD	15,040	2,220.00	33,388,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	97.60	34,496,915.20	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	185.00	18,500,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	21,000	284.50	5,974,500.00	

	PEGATRON CORP	340,474	78.10	26,591,019.40	
	QUANTA COMPUTER INC	408,270	131.50	53,687,505.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	59.00	11,923,900.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	171.50	36,186,500.00	
	WISTRON CORP	344,000	73.00	25,112,000.00	
	WIWYNN CORP	16,000	1,160.00	18,560,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	260,692	53.60	13,973,091.20	
	YAGEO CORPORATION	61,588	492.50	30,332,090.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	107.50	14,826,615.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	125.50	73,331,532.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	78.60	16,977,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	103.00	25,255,600.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	514,315	126.00	64,803,690.00	
	EEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,175.00	26,100,000.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,405.00	18,265,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	511.00	21,462,000.00	
	MEDIATEK INC	241,804	764.00	184,738,256.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	71.30	18,466,700.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	463.00	44,468,835.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,080.00	8,640,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	576,000	30.90	17,798,400.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	61,944	403.00	24,963,432.00	
	SILERGY CORP	53,000	360.00	19,080,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,955,389	565.00	2,234,794,785.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,899,000	52.30	99,317,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	93.40	17,559,200.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	32,000	175.50	5,616,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	349,000	28.10	9,806,900.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	310,086	36.10	11,194,104.60	
	新台湾ドル 小計	55,145,981		5,206,358,080.51 (23,604,586,265)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	164,999	359.60	59,333,640.40	
	COAL INDIA LTD	295,619	227.70	67,312,446.30	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	59,425	262.10	15,575,292.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	90.31	53,918,321.16	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	154.25	83,257,671.50	

PETRONET LNG LTD	83,779	222.80	18,665,961.20
RELIANCE INDUSTRIES LTD	485,097	2,481.90	1,203,962,244.30
ACC LTD	14,288	1,838.15	26,263,487.20
AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	455.65	33,505,311.45
ASIAN PAINTS LTD	64,662	3,180.40	205,651,024.80
BERGER PAINTS INDIA LTD	29,449	647.60	19,071,172.40
GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	1,715.45	80,356,824.35
HINDALCO INDUSTRIES LTD	243,575	415.05	101,095,803.75
JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	524.15	36,572,042.10
JSW STEEL LTD	99,332	748.30	74,330,135.60
PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,619.20	46,314,902.40
PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	2,613.50	76,209,660.00
SHREE CEMENT LTD	1,387	25,460.40	35,313,574.80
SRF LTD	19,164	2,427.85	46,527,317.40
TATA STEEL LTD	1,137,948	108.90	123,922,537.20
ULTRATECH CEMENT LTD	16,690	8,151.30	136,045,197.00
UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	679.60	47,334,819.60
VEDANTA LTD	107,173	276.80	29,665,486.40
ABB LTD INDIA	5,256	4,148.90	21,806,618.40
ADANI ENTERPRISES LTD	34,272	2,450.90	83,997,244.80
BHARAT ELECTRONICS LTD	507,405	120.35	61,066,191.75
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	379.95	26,750,759.70
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,346.40	48,020,702.40
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	10,646	3,734.90	39,761,745.40
LARSEN & TOUBRO LTD	107,590	2,363.90	254,332,001.00
SIEMENS INDIA LTD	11,025	3,657.65	40,325,591.25
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,993	640.20	14,720,118.60
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	735.20	76,888,686.40
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	674.00	17,830,670.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	2,461.80	65,117,071.80
BAJAJ AUTO LTD	9,644	4,743.60	45,747,278.40
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	2,264.70	19,999,565.70
BHARAT FORGE LTD	30,322	815.60	24,730,623.20
EICHER MOTORS LTD	17,872	3,582.10	64,019,291.20
HERO MOTOCORP LTD	22,772	2,899.30	66,022,859.60
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	150,112	1,369.20	205,533,350.40

MARUTI SUZUKI INDIA LTD	21,329	9,626.85	205,331,083.65
MRF LTD	432	98,385.35	42,502,471.20
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	81.74	42,605,748.90
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	536.85	31,829,299.65
TATA MOTORS LTD	277,381	562.20	155,943,598.20
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	2,846.45	60,208,110.40
TVS MOTOR CO LTD	41,254	1,337.25	55,166,911.50
PAGE INDUSTRIES LTD	886	38,332.95	33,962,993.70
TITAN CO LTD	56,531	2,876.85	162,631,207.35
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	381.90	62,821,404.30
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	479.85	21,079,810.50
ZOMATO LTD	842,242	77.57	65,332,711.94
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	4,140.40	59,439,582.40
TRENT LTD	37,950	1,595.80	60,560,610.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	3,631.70	103,837,566.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	20,292	4,877.70	98,978,288.40
ITC LTD	480,447	438.45	210,651,987.15
MARICO LTD	81,711	533.70	43,609,160.70
NESTLE INDIA LIMITED	5,146	22,087.95	113,664,590.70
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	800.60	74,647,143.40
UNITED SPIRITS LTD	32,483	888.50	28,861,145.50
VARUN BEVERAGES LTD	40,179	1,593.40	64,021,218.60
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	1,595.70	41,488,200.00
DABUR INDIA LTD	79,726	550.20	43,865,245.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,035.50	65,646,558.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	129,502	2,635.70	341,328,421.40
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	19,568	4,925.25	96,377,292.00
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	570.55	68,574,975.05
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	669.15	23,697,947.25
CIPLA LTD	88,546	968.65	85,770,082.90
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	3,426.90	75,158,770.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	4,669.55	85,550,825.55
LUPIN LTD	26,552	807.05	21,428,791.60
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	145,156	983.15	142,710,121.40
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	1,806.80	22,079,096.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	30,134	762.45	22,975,668.30

AXIS BANK LTD	359,795	974.45	350,602,237.75
BANDHAN BANK LTD	74,811	256.60	19,196,502.60
BANK OF BARODA	248,313	184.90	45,913,073.70
ICICI BANK LTD	812,223	937.85	761,743,340.55
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	168,114	1,871.90	314,692,596.60
STATE BANK OF INDIA	268,868	578.60	155,567,024.80
YES BANK LTD	2,352,478	16.59	39,027,610.02
BAJAJ FINANCE LTD	44,172	7,036.45	310,814,069.40
BAJAJ FINSERV LTD	55,000	1,466.05	80,632,750.00
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	6,694	6,753.90	45,210,606.60
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	54,812	1,065.85	58,421,370.20
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	274,646	2,651.95	728,347,459.70
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,116.95	13,875,869.85
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	925.85	56,194,465.75
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	38,585	1,417.55	54,696,166.75
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	178,719	581.60	103,942,970.40
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,215.55	40,880,162.05
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	89,699	495.00	44,401,005.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,230.65	89,512,558.40
HCL TECHNOLOGIES LTD	161,045	1,110.30	178,808,263.50
INFOSYS LTD	533,921	1,266.00	675,943,986.00
LTIMINDTREE LTD	15,699	4,824.60	75,741,395.40
MPHASIS LTD	19,317	1,851.70	35,769,288.90
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	143,181	3,210.45	459,675,441.45
TATA ELXSI LTD	4,179	7,816.45	32,664,944.55
TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,064.80	100,939,845.60
WIPRO LTD	249,294	397.85	99,181,617.90
BHARTI AIRTEL LTD	358,975	832.70	298,918,482.50
ADANI GREEN ENERGY LTD	42,580	963.95	41,044,991.00
ADANI POWER LTD	85,623	276.20	23,649,072.60
GAIL INDIA LTD	504,548	104.85	52,901,857.80
INDRAPRASTHA GAS LTD	26,724	462.80	12,367,867.20
NTPC LTD	664,141	182.70	121,338,560.70
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	600,735	244.75	147,029,891.25
TATA POWER CO LTD	199,512	221.15	44,122,078.80
DLF LTD	87,983	485.05	42,676,154.15

	GODREJ PROPERTIES LTD	12,724	1,429.95	18,194,683.80
	インドルピー 小計	18,176,043		12,505,854,147.02 (21,259,952,049)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	16.20	970,606.80
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	469,730	3.97	1,865,297.83
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	443,925	1.99	884,742.52
	INDUSTRIES QATAR	282,919	11.65	3,296,006.35
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	5.99	3,187,283.21
	DUKHAN BANK	319,751	3.85	1,233,599.35
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.61	2,985,779.81
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	9.88	2,121,516.83
	QATAR ISLAMIC BANK	259,565	17.82	4,625,448.30
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	16.00	11,860,832.00
	OOREDOO QSC	72,800	10.55	768,040.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	17.25	1,664,832.00
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.60	540,511.45
	カタールリアル 小計	4,842,933		36,004,496.45 (1,378,612,169)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	172.94	5,917,487.98
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	14,670	211.91	3,108,719.70
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	1,097.29	10,963,024.39
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	67,443	455.15	30,696,681.45
	GOLD FIELDS LTD	144,200	290.43	41,880,006.00
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	86.50	8,637,976.50
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	156.20	23,562,301.40
	KUMBA IRON ORE LTD	5,372	496.00	2,664,512.00
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	153.28	7,368,016.32
	SASOL LTD	88,115	258.65	22,790,944.75
	SIBANYE STILLWATER LTD	394,924	33.62	13,277,344.88
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	259.62	13,059,664.86
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,529	95.78	3,881,867.62
	MR PRICE GROUP LTD	28,510	141.70	4,039,867.00
	NASPERS LTD-N SHS	33,040	3,109.70	102,744,488.00
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	16.30	7,751,921.40
	THE FOSCHINI GROUP LIMITED	37,554	93.00	3,492,522.00
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	67.76	11,947,172.16	

	BID CORP LTD	58,066	415.25	24,111,906.50	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	260.16	9,215,387.52	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	224.28	19,114,038.72	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	179.30	10,073,432.60	
	ABSA GROUP LTD	140,135	164.14	23,001,758.90	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	1,502.18	21,931,828.00	
	NEDBANK GROUP LTD	63,111	223.08	14,078,801.88	
	STANDARD BANK GROUP LTD	203,619	171.95	35,012,287.05	
	FIRSTRAND LTD	816,636	68.04	55,563,913.44	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	410.42	7,053,888.54	
	REMGRO LTD	74,679	142.36	10,631,302.44	
	DISCOVERY LIMITED	98,821	145.76	14,404,148.96	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	11.77	11,471,701.12	
	OUTSURANCE GROUP LTD	72,133	33.91	2,446,030.03	
	SANLAM LTD	307,490	59.08	18,166,509.20	
	MTN GROUP LTD	255,377	136.64	34,894,713.28	
	VODACOM GROUP	129,637	117.00	15,167,529.00	
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	63,952	112.00	7,162,624.00	
	南アフリカランド 小計	5,366,466		651,286,319.59 (4,845,570,217)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	3.23	1,678,456.58	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.90	1,682,639.40	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	4.11	1,824,930.42	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	8.05	3,795,011.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	185,781	10.28	1,909,828.68	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.38	2,825,274.72	
	EMIRATES NBD PJSC	270,260	14.15	3,824,179.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	12.92	9,354,325.48	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	558,536	22.26	12,433,011.36	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.07	3,679,963.17	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	6.05	6,707,441.40	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	5,964,783		49,715,061.71 (1,890,166,646)	
クウェートディ ナール	AGILITY	323,386	0.61	198,882.39	
	BOUBYAN BANK K. S. C	162,047	0.62	100,955.28	
	GULF BANK	144,000	0.25	37,008.00	

	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,292,981	0.73	947,755.07	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,205,064	0.93	1,127,939.90	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.51	151,976.96	
	MABANEE CO KPSC	141,825	0.77	110,198.02	
	クウェートディナール 小計	3,566,133		2,674,715.62 (1,216,353,675)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	6.03	884,601.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	29.45	2,621,050.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	12.11	775,040.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.35	657,825.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	7.86	786,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	17.75	1,707,550.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	158,528	12.67	2,008,549.76	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	10.31	820,676.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	16.77	166,023.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	24.26	679,280.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	20,700	28.22	584,154.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	5.58	916,794.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	26.21	771,622.40	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	5.91	2,183,745.00	
	CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	20,930	37.96	794,502.80	
	CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	20,600	34.65	713,790.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	13.93	1,284,346.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	23.90	497,120.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	10,300	63.67	655,801.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	63.91	715,792.00	
	GEM CO LTD-A	289,800	6.93	2,008,314.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	40.03	993,784.78	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	14.10	523,110.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.65	980,875.00	
	HESTEEL CO LTD-A	832,100	2.28	1,897,188.00	
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	2,400	68.95	165,480.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	10,000	13.17	131,700.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.82	839,020.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	4.11	246,600.00	
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	11.18	249,314.00	



JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	7,800	83.57	651,846.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	15.95	244,035.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	14.34	675,414.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	12.59	997,128.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	3.96	77,220.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	19.38	922,488.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	11.53	558,628.50
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	14.34	795,511.50
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	25.40	184,200.80
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	29.70	532,818.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.11	891,326.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	33.94	551,185.60
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	7.24	794,068.72
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.94	541,356.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	49,300	12.69	625,617.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	47.00	507,600.00
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	960	103.49	99,350.40
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	19.22	959,078.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	7,100	95.60	678,760.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	74.98	854,772.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	12.83	125,734.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	2.91	964,956.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	87.35	3,520,205.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	28.39	418,809.28
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	11,775	80.70	950,242.50
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	65.49	119,191.80
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	92.38	378,758.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	23.98	896,852.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	47.13	349,233.30
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	13.34	1,726,196.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	11.71	3,151,161.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	40.19	458,166.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	39.00	604,500.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	24.41	205,044.00
CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	11.66	746,240.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	27.80	1,534,977.00

CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.40	1,447,440.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.29	1,907,529.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	6.18	3,475,632.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	39,780	212.04	8,434,951.20
CRRC CORP LTD-A	185,800	6.53	1,213,274.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	18.27	789,264.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	58.62	2,313,907.26
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	22,800	6.30	143,640.00
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	95.25	228,600.00
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	3,770	156.42	589,703.40
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	25.61	148,538.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	6,300	66.46	418,698.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	26,320	28.71	755,647.20
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	5,320	72.07	383,412.40
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	55.50	635,808.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.48	636,228.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	14.48	696,488.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	4.09	1,353,381.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	36,200	17.12	619,744.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	69,984	26.68	1,867,173.12
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	5,940	123.82	735,490.80
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	50.73	635,849.82
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	11,675	54.42	635,353.50
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	40,400	17.20	694,880.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.75	938,400.00
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	2,752	191.85	527,971.20
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.49	649,031.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	4.57	2,224,219.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	57.04	1,619,536.72
SHUANGLIANG ECO-ENERGY SYS-A	170,800	12.50	2,135,000.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	17,900	14.94	267,426.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	10,000	103.72	1,037,200.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	15.67	637,769.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	140.00	573,440.00
TBEA CO LTD-A	22,519	22.99	517,711.81
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	11.82	510,624.00

XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	6.15	1,226,310.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	20,111	10.73	215,791.03
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	26.28	830,448.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	47.03	388,467.80
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	87,700	24.20	2,122,340.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	90,200	9.22	831,644.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	6.47	518,247.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	42.30	465,300.00
AIR CHINA LTD-A	25,900	8.22	212,898.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.64	2,239,644.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	4.79	191,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	10.66	1,956,110.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.74	1,242,270.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	48.08	2,553,048.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	46.97	249,833.43
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.40	239,760.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	14.95	832,715.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	10.04	219,273.60
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	10,800	67.45	728,460.00
BYD CO LTD -A	17,000	258.00	4,386,000.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	106.58	959,220.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	12.07	523,258.64
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	32.99	610,315.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	17.71	607,453.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	114.20	959,280.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	16.23	475,539.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	700	63.98	44,786.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	13.80	587,880.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	21.72	852,596.88
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	68.63	192,164.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	35.20	1,531,200.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	24.53	680,952.80
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	38.31	303,874.92
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	95.81	737,737.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	22.80	2,305,080.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	3.90	437,580.00

ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	46.84	374,720.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	48.07	1,259,434.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	79,300	4.76	377,468.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	12.96	433,900.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	34.21	838,145.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	9.10	487,760.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.76	942,344.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	2,900	525.00	1,522,500.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	119,600	19.79	2,366,884.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	31.85	519,155.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	22,800	18.33	417,924.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	7.57	465,555.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	116.80	2,420,096.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	7.38	815,490.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	26.84	598,290.44
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	14,196	34.80	494,020.80
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	36.63	391,941.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	245.87	393,392.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	52.53	115,566.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	55.65	1,018,395.00
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	151.20	453,600.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	59,500	6.54	389,130.00
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	90.49	714,871.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	4,600	23.73	109,158.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	48.75	2,635,278.75
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	27,400	19.16	524,984.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	47.04	799,680.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	24.74	1,944,069.20
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	29.84	1,023,571.68
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	54.26	938,698.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	136.26	1,239,966.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	5,600	87.23	488,488.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	35.56	408,940.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	7,000	36.62	256,340.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	11,500	1,666.00	19,159,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	205.94	3,789,296.00

MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	40.79	1,368,830.82
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	11.84	317,312.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	50,200	33.18	1,665,636.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	204.20	1,915,396.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	57.82	659,148.00
TOLY BREAD CO LTD-A	147,600	10.43	1,539,468.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	16.97	647,575.20
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	164.59	6,830,485.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	40.45	408,545.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	5,300	15.18	80,454.00
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	22.64	672,408.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	19.78	1,814,795.22
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	33.61	537,760.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	73.20	207,741.60
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	39.90	387,828.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	12,350	24.76	305,786.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	10,400	15.65	162,760.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	23.18	343,064.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	24,840	6.97	173,134.80
OVCTEK CHINA INC-A	7,209	29.58	213,242.22
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	15,500	302.00	4,681,000.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	2,000	96.72	193,440.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	280	134.80	37,744.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	83,180	25.90	2,154,362.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	56.28	1,598,352.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	66.45	696,861.15
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	16,100	51.69	832,209.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	5,500	55.87	307,285.00
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	88.97	806,690.99
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	2,200	137.04	301,488.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	10,200	61.69	629,238.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	9,900	66.64	659,736.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	51.48	1,142,495.64
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	71.54	572,320.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	21.80	410,930.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,080	426.50	887,120.00

JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	88,302	45.79	4,043,348.58
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	11,116	45.30	503,554.80
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	27,682	12.40	343,256.80
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	19,078	42.24	805,854.72
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.08	453,828.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	25.61	278,636.80
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	33.42	233,940.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	26.85	253,464.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	30.10	338,083.20
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	27.16	461,720.00
WUXI APTEC CO LTD-A	16,464	67.44	1,110,332.16
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	52.55	522,347.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	285.15	1,112,085.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	18.01	162,450.20
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	66,500	28.60	1,901,900.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	15.55	541,886.40
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	9,700	33.74	327,278.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	3.68	3,798,128.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	4.89	283,620.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	12.88	2,027,312.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	6.05	3,096,995.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	12.21	1,376,067.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.60	1,746,024.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	8.72	1,286,200.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	26.76	1,560,108.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	6.29	286,195.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	6.58	821,842.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.29	2,748,137.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	33.74	6,275,640.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	4.01	1,097,136.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	308,600	2.88	888,768.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	5.97	712,818.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	5.07	2,933,502.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	17.10	3,514,050.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	11.88	1,418,472.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	5.51	779,665.00

SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	7.56	3,305,988.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	3.89	476,525.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	10.49	832,906.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	7.44	426,535.20
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	6.02	119,798.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	8.48	396,016.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	13.88	397,800.80
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	20.18	2,846,994.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	24.03	579,123.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	14.23	1,670,986.21
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	16.03	57,708.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.77	347,354.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	14.94	905,364.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	6.83	1,172,567.57
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	9.14	2,057,414.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.88	1,075,824.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.67	1,014,173.50
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	165.74	894,996.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	13.76	433,440.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	6.17	705,045.90
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	9.94	403,325.44
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.58	948,976.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	7.16	2,202,416.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.73	425,220.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	10.03	438,311.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	6.87	2,162,676.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	29.81	2,986,962.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	49.48	5,185,504.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	14.30	384,670.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	70,200	37.69	2,645,838.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	494.50	2,384,973.50
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	26,460	18.99	502,475.40
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	48.49	1,564,578.34
DHC SOFTWARE CO LTD -A	55,700	7.49	417,193.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	41.80	692,291.60
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	66.35	716,580.00

NAVINFO CO LTD-A	33,200	11.59	384,788.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	123.45	370,350.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	9,531	45.50	433,660.50
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	97.27	534,985.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	20.44	269,194.80
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	25.09	950,911.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	114,600	4.00	458,400.00
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	20,100	29.32	589,332.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	28.77	805,560.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	14.14	492,072.00
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	83.47	759,577.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	45,100	19.64	885,764.00
GOERTEK INC -A	26,900	18.18	489,042.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	6.37	318,500.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	64.00	448,000.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	45.67	900,247.04
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	11.53	193,704.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	46,450	27.18	1,262,511.00
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	104.71	180,938.88
NINESTAR CORP-A	18,543	35.81	664,024.83
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	14.83	360,369.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	76.30	363,188.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,435	134.55	865,829.25
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	23.77	677,445.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	47,000	9.35	439,450.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	32.99	605,036.60
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	49.49	207,858.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	41,316	9.60	396,633.60
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	130.89	615,183.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	35.65	561,487.50
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	18.75	568,125.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	8,700	115.20	1,002,240.00
ZTE CORP-A	76,400	36.40	2,780,960.00
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	5.31	2,245,068.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	6.88	1,195,744.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	5.45	1,315,085.00



CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	179,880	22.86	4,112,056.80
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	19.23	1,069,188.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	3.90	1,231,230.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	12.76	2,257,244.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	15.37	1,418,651.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	152.29	1,080,802.13
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	90.58	918,300.04
ASR MICROELECTRONICS CO LT-A	33,053	82.92	2,740,754.76
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	226.78	2,590,281.16
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	53.92	1,134,045.44
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	103.25	647,584.00
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	21,168	28.95	612,813.60
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	30.12	225,900.00
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	88.16	661,200.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	37.00	1,265,474.00
JCET GROUP CO LTD-A	29,800	31.80	947,640.00
JINKO SOLAR CO LTD-A	184,413	12.71	2,343,889.23
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	27.60	2,769,384.00
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	58.19	1,225,190.45
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	307.00	951,700.00
SG MICRO CORP-A	3,150	103.66	326,529.00
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	7,900	91.48	722,692.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	2,800	211.00	590,800.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	29,500	36.39	1,073,505.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	9.29	304,247.50
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	25.60	575,129.60
TONGWEI CO LTD-A	31,600	31.82	1,005,512.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	37.75	959,529.50
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	87.06	597,144.54
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	96.01	699,912.90
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	14,200	41.95	595,690.00
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	64.78	1,102,685.16
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	13.33	729,151.00
CHINA VANKE CO LTD -A	53,700	14.67	787,779.00
GEMDALE CORP-A	45,500	7.63	347,165.00
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	4.21	2,200,988.00

	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	13.39	1,095,302.00	
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	12,800	14.59	186,752.00	
	オフショア人民元 小計	26,116,985		383,219,350.31 (7,476,111,339)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	44,939	11.22	504,215.58	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	416,274	32.35	13,466,463.90	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	45.25	532,818.75	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	31,928	14.94	477,004.32	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	129.20	4,833,759.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	36.55	1,726,658.55	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	43.30	9,129,545.20	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	142.00	1,327,558.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	143,934	88.90	12,795,732.60	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	25.90	2,209,865.70	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	13.44	1,390,112.64	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	46.55	2,377,727.45	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	188.20	791,757.40	
	JARIR MARKETING CO	125,000	16.76	2,095,000.00	
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	172.20	1,107,418.20	
	ALMARAI CO	30,130	57.90	1,744,527.00	
	SAVOLA	65,641	39.00	2,559,999.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	165.40	1,130,178.20	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	11,717	269.20	3,154,216.40	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	7,962	241.00	1,918,842.00	
	AL RAJHI BANK	311,351	73.50	22,884,298.50	
	ALINMA BANK	161,322	34.05	5,493,014.10	
	ARAB NATIONAL BANK	86,031	26.50	2,279,821.50	
	BANK AL-JAZIRA	97,894	18.48	1,809,081.12	
	BANK ALBILAD	89,702	38.85	3,484,922.70	
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	41.20	3,907,202.00	
	RIYAD BANK	234,479	33.80	7,925,390.20	
	SAUDI BRITISH BANK	147,895	37.85	5,597,825.75	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	70,640	17.20	1,215,008.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	474,809	37.45	17,781,597.05	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	169.80	1,860,498.60		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	185.80	2,642,633.40		

	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	334.00	1,475,278.00	
	ELM CO	2,436	557.00	1,356,852.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	48,844	46.15	2,254,150.60	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	14.12	1,277,972.96	
	SAUDI TELECOM CO	301,319	43.10	12,986,848.90	
	ACWA POWER CO	16,922	153.60	2,599,219.20	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	22.42	3,634,483.78	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	15.98	1,613,836.18	
	EMAAR ECONOMIC CITY	46,187	9.53	440,162.11	
	サウジアラビアリアル 小計	4,019,322		169,793,497.14 (6,321,411,898)	
	合 計	1,317,532,824		151,437,166,593 (151,437,166,593)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	メキシコペ ソ	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	97,360	14,939,892.00	
		メキシコペソ 小計	97,360	14,939,892.00 (120,527,578)	
	ブラジルレ アル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	5,826,727.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	1,414,638.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,698,708.00	
		KLABIN SA-UNIT	100,000	2,127,000.00	
		ブラジルリアル 小計	383,600	11,067,073.00 (315,998,135)	
	投資信託受益証券合計	480,960	436,525,713 (436,525,713)		
投資証券	メキシコペ ソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	10,078,441.00	
		メキシコペソ 小計	391,700	10,078,441.00 (81,307,822)	
	香港ドル	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	19,877	36,374.91	
		香港ドル 小計	19,877	36,374.91 (647,109)	
	南アフリカ ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	5,907,565.22	
		南アフリカランド 小計	478,733	5,907,565.22	

		(43,952,285)
投資証券合計	890,310	125,907,216 (125,907,216)
合計		562,432,929 (562,432,929)

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 34 銘柄	100.0%	—	—	2.5%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	95.3%	—	—	2.7%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	2.8%	—	0.1%
	投資証券 1 銘柄	—	—	1.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 43 銘柄	96.1%	—	—	5.2%
	投資信託受 益証券 4 銘柄	—	3.9%	—	0.2%
チリペソ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	0.5%
コロンビアペソ	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ユーロ	株式 10 銘柄	100.0%	—	—	0.5%
トルコリラ	株式 18 銘柄	100.0%	—	—	0.6%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式 14 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ロシアルーブル	株式 14 銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式 196 銘柄	100.0%	—	—	23.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	0.0%	0.0%
マレーシアリングギット	株式 33 銘柄	100.0%	—	—	1.3%
タイバーツ	株式 42 銘柄	100.0%	—	—	2.0%
フィリピンペソ	株式 15 銘柄	100.0%	—	—	0.7%
インドネシアルピア	株式 22 銘柄	100.0%	—	—	2.0%
韓国ウォン	株式 101 銘柄	100.0%	—	—	12.7%
新台湾ドル	株式 90 銘柄	100.0%	—	—	15.5%
インドルピー	株式 114 銘柄	100.0%	—	—	14.0%

カタールリアル	株式 13 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
南アフリカランド	株式 36 銘柄	99.1%	—	—	3.2%
	投資証券 1 銘柄	—	—	0.9%	0.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	1.2%
クウェートディナール	株式 7 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
オフショア人民元	株式 356 銘柄	100.0%	—	—	4.9%
サウジアラビアリアル	株式 41 銘柄	100.0%	—	—	4.2%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年6月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	969,294,178
コール・ローン	1,125,925,644
国債証券	102,949,332,081
未収利息	1,743,244,039
前払費用	160,645,350
流動資産合計	106,948,441,292
資産合計	106,948,441,292
負債の部	
流動負債	
前受収益	681,380
未払金	148,875,900
未払解約金	30,371,881
未払利息	2,290
流動負債合計	179,931,451
負債合計	179,931,451
純資産の部	
元本等	
元本	52,846,131,448
剰余金	

剰余金又は欠損金 (△)	53,922,378,393
元本等合計	106,768,509,841
純資産合計	106,768,509,841
負債純資産合計	106,948,441,292

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年6月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取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>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)

	2023年6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	52,846,131,448 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 2.0204 円 (1万口当たり純資産額) (20,204 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2023年6月12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、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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。</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</p>

等を含む)と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月12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	2023年6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年6月11日
期首元本額	46,386,185,089円
期中追加設定元本額	12,594,934,839円
期中一部解約元本額	6,134,988,480円
期末元本額	52,846,131,448円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,865,370,326円
世界経済インデックスファンド	17,426,629,978円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,605,982,657円
DC世界経済インデックスファンド	13,804,504,942円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	11,733,271円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	494,740,113円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	666,272,726円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,403,093,001円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	248,910,785円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	107,197,862円
SMT インデックスバランス・オープン	187,015,966円
SMT 世界経済インデックス・オープン	434,440,585円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	559,137,994円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	889,182,580円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,029,629円

グローバル経済コア	793,863,051円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	79,695,125円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	65,004,810円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,972,556円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	25,577,211円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	70,213,537円
10資産分散投資ファンド	42,868,856円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	248,105,675円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	155,181,072円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,466,768円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	252,421,427円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	244,878,189円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	243,636,550円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	245,711,535円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	243,276,298円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	157,879,265円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年6月12日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,903,190,847
合計		3,903,190,847

（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）

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	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	31,800,000.00	34,598,082.00	
		MBONO 10% 12/05/24	86,250,000.00	85,597,483.38	
		MBONO 5.5% 03/04/27	102,000,000.00	90,332,220.00	
		MBONO 5.75% 03/05/26	175,300,000.00	159,774,700.99	
		MBONO 5% 03/06/25	57,500,000.00	52,885,050.00	
		MBONO 7.5% 05/26/33	38,000,000.00	34,663,220.00	
		MBONO 7.5% 06/03/27	139,000,000.00	131,557,940.00	
		MBONO 7.75% 05/29/31	176,100,000.00	165,290,982.00	
		MBONO 7.75% 11/13/42	84,500,000.00	74,136,075.00	



		MBONO 7.75% 11/23/34	28,100,000.00	25,871,951.00	
		MBONO 8.5% 05/31/29	92,100,000.00	90,700,080.00	
		MBONO 8.5% 11/18/38	98,300,000.00	93,787,047.00	
		MBONO 8% 07/31/53	46,000,000.00	40,856,280.00	
		MBONO 8% 09/05/24	128,400,000.00	124,212,588.38	
		MBONO 8% 11/07/47	96,000,000.00	86,087,040.00	
		メキシコペソ 小計	1,379,350,000.00	1,290,350,739.75 (10,409,904,592)	
ブラジルレアル		BLTN 0% 01/01/24	95,100,000.00	88,792,833.87	
		BLTN 0% 01/01/26	76,500,000.00	58,962,131.73	
		BLTN 0% 07/01/24	37,250,000.00	33,099,935.03	
		BLTN 0% 07/01/25	46,400,000.00	37,624,812.03	
		BLTN 0% 07/01/26	15,000,000.00	11,026,211.40	
		BNTNF 10% 01/01/25	32,300,000.00	31,783,054.26	
		BNTNF 10% 01/01/27	65,400,000.00	64,348,388.78	
		BNTNF 10% 01/01/29	31,700,000.00	30,584,252.18	
		BNTNF 10% 01/01/31	13,850,000.00	13,166,018.96	
		BNTNF 10% 01/01/33	9,500,000.00	8,894,178.99	
		BRAZIL 10.25% 01/10/28	1,400,000.00	1,361,500.00	
		BRAZIL 8.5% 01/05/24	1,900,000.00	1,855,217.00	
		ブラジルレアル 小計	426,300,000.00	381,498,534.23 (10,892,927,647)	
チリペソ		BTPCL 2.3% 10/01/28	625,000,000.00	535,383,133.75	
		BTPCL 2.5% 03/01/25	2,985,000,000.00	2,761,110,689.91	
		BTPCL 4.5% 03/01/26	2,060,000,000.00	1,985,327,822.20	
		BTPCL 4.7% 09/01/30	2,160,000,000.00	2,086,747,889.76	
		BTPCL 5% 03/01/35	2,210,000,000.00	2,186,039,756.81	
		BTPCL 5% 10/01/28	820,000,000.00	798,714,354.72	
		BTPCL 6% 01/01/43	1,900,000,000.00	2,123,477,739.70	
		BTPCL 6% 04/01/33	1,500,000,000.00	1,586,474,961.00	
		BTPCL 7% 05/01/34	490,000,000.00	563,033,013.34	
		チリペソ 小計	14,750,000,000.00	14,626,309,361.19 (2,584,688,258)	
コロンビアペソ		COLOM 9.85% 06/28/27	65,300,000,000.00	63,137,295,997.00	
		COLTES 6.25% 11/26/25	15,200,000,000.00	14,022,176,928.00	
		COLTES 7.25% 10/18/34	48,100,000,000.00	37,528,792,197.00	

	COLTES 7.25% 10/26/50	34,900,000,000.00	24,012,737,694.00	
	コロンビアペソ 小計	163,500,000,000.00	138,701,002,816.00 (4,617,633,785)	
ペルーソル	PERUGB 5.35% 08/12/40	4,950,000.00	4,040,609.40	
	PERUGB 5.4% 08/12/34	8,350,000.00	7,192,045.29	
	PERUGB 5.7% 08/12/24	3,700,000.00	3,688,584.05	
	PERUGB 5.94% 02/12/29	9,700,000.00	9,356,191.93	
	PERUGB 6.15% 08/12/32	8,300,000.00	7,769,123.28	
	PERUGB 6.35% 08/12/28	8,850,000.00	8,785,835.02	
	PERUGB 6.9% 08/12/37	9,550,000.00	9,251,708.23	
	PERUGB 6.95% 08/12/31	11,250,000.00	11,200,200.18	
	PERUGB 8.2% 08/12/26	7,050,000.00	7,475,475.03	
	ペルーソル 小計	71,700,000.00	68,759,772.41 (2,625,420,010)	
ウルグアイペソ	URUGUA 8.25% 05/21/31	25,000,000.00	22,825,000.00	
	URUGUA 8.5% 03/15/28	17,000,000.00	16,073,166.29	
	ウルグアイペソ 小計	42,000,000.00	38,898,166.29 (139,838,907)	
ドミニカペソ	DOMREP 13.625% 02/03/33	32,000,000.00	38,954,055.04	
	DOMREP 9.75% 06/05/26	41,000,000.00	41,287,000.00	
	ドミニカペソ 小計	73,000,000.00	80,241,055.04 (204,622,714)	
チェココルナ	CZGB 0.05% 11/29/29	26,100,000.00	19,769,340.60	
	CZGB 0.25% 02/10/27	69,200,000.00	58,807,544.00	
	CZGB 0.95% 05/15/30	68,900,000.00	54,877,334.20	
	CZGB 0% 12/12/24	24,000,000.00	22,116,000.00	
	CZGB 1.2% 03/13/31	98,000,000.00	77,689,500.00	
	CZGB 1.25% 02/14/25	58,500,000.00	54,790,807.50	
	CZGB 1.5% 04/24/40	22,700,000.00	14,783,375.00	
	CZGB 1.75% 06/23/32	51,500,000.00	41,789,417.50	
	CZGB 1.95% 07/30/37	20,500,000.00	15,293,000.00	
	CZGB 1% 06/26/26	53,800,000.00	47,941,180.00	
	CZGB 2.4% 09/17/25	75,700,000.00	71,070,490.80	
	CZGB 2.5% 08/25/28	78,700,000.00	71,277,016.00	
	CZGB 2.75% 07/23/29	80,500,000.00	73,107,282.50	
	CZGB 2% 10/13/33	74,500,000.00	60,166,796.00	

		CZGB 3.5% 05/30/35	22,000,000.00	20,300,500.00	
		CZGB 4.2% 12/04/36	34,500,000.00	33,820,005.00	
		CZGB 5.5% 12/12/28	28,000,000.00	29,538,740.00	
		CZGB 5.7% 05/25/24	45,200,000.00	45,183,954.00	
		CZGB 5% 09/30/30	45,000,000.00	46,642,500.00	
		CZGB 6% 02/26/26	48,000,000.00	49,584,000.00	
		チェココロナ 小計	1,025,300,000.00	908,548,783.10 (5,743,300,277)	
ハンガリー フォロント		HGB 1.5% 04/22/26	610,500,000.00	497,954,325.00	
		HGB 1.5% 08/26/26	514,000,000.00	412,382,200.00	
		HGB 1% 11/26/25	835,000,000.00	686,077,750.00	
		HGB 2.25% 04/20/33	712,000,000.00	483,270,000.00	
		HGB 2.25% 06/22/34	256,000,000.00	169,113,600.00	
		HGB 2.5% 10/24/24	578,000,000.00	513,957,600.00	
		HGB 2.75% 12/22/26	580,500,000.00	476,706,019.50	
		HGB 2% 05/23/29	403,000,000.00	301,363,400.00	
		HGB 3.25% 10/22/31	812,000,000.00	625,037,000.00	
		HGB 3% 04/25/41	371,000,000.00	229,843,775.00	
		HGB 3% 06/26/24	292,500,000.00	267,144,637.50	
		HGB 3% 08/21/30	615,000,000.00	474,869,175.00	
		HGB 3% 10/27/27	822,000,000.00	667,464,000.00	
		HGB 3% 10/27/38	380,000,000.00	248,216,000.00	
		HGB 4.5% 03/23/28	493,000,000.00	420,916,991.00	
		HGB 4.75% 11/24/32	570,000,000.00	480,709,500.00	
		HGB 5.5% 06/24/25	660,000,000.00	602,533,140.00	
		HGB 6.75% 10/22/28	767,000,000.00	724,677,170.10	
		ハンガリーフォロント 小計	10,271,500,000.00	8,282,236,283.10 (3,373,537,047)	
ポーランド ズロチ		POLGB 0.25% 10/25/26	18,500,000.00	15,452,125.00	
		POLGB 0.75% 04/25/25	14,300,000.00	13,037,310.00	
		POLGB 1.25% 10/25/30	18,700,000.00	13,719,068.00	
		POLGB 1.75% 04/25/32	24,800,000.00	17,875,840.00	
		POLGB 2.25% 10/25/24	18,950,000.00	18,032,820.00	
		POLGB 2.5% 04/25/24	24,500,000.00	23,791,460.00	
		POLGB 2.5% 07/25/26	21,300,000.00	19,370,220.00	
		POLGB 2.5% 07/25/27	17,600,000.00	15,568,080.00	

		POLGB 2.75% 04/25/28	21,000,000.00	18,421,200.00	
		POLGB 2.75% 10/25/29	26,100,000.00	22,040,145.00	
		POLGB 3.25% 07/25/25	23,050,000.00	21,878,622.05	
		POLGB 3.75% 05/25/27	21,100,000.00	19,652,118.00	
		POLGB 6% 10/25/33	4,700,000.00	4,749,350.00	
		POLGB 7.5% 07/25/28	10,600,000.00	11,409,842.12	
		ポーランドズロチ 小計	265,200,000.00	234,998,200.17 (7,925,173,301)	
	ルーマニア レイ	ROMGB 2.5% 10/25/27	3,000,000.00	2,538,724.92	
		ROMGB 3.25% 04/29/24	7,300,000.00	7,109,287.50	
		ROMGB 3.25% 06/24/26	6,500,000.00	5,936,795.66	
		ROMGB 3.5% 11/25/25	4,000,000.00	3,739,851.12	
		ROMGB 3.65% 07/28/25	10,400,000.00	9,862,697.31	
		ROMGB 3.65% 09/24/31	8,800,000.00	7,111,896.00	
		ROMGB 3.7% 11/25/24	10,000,000.00	9,653,066.60	
		ROMGB 4.15% 01/26/28	9,000,000.00	8,119,294.11	
		ROMGB 4.15% 10/24/30	7,400,000.00	6,281,974.84	
		ROMGB 4.25% 04/28/36	5,300,000.00	4,124,460.00	
		ROMGB 4.5% 06/17/24	2,200,000.00	2,160,466.00	
		ROMGB 4.75% 02/24/25	8,600,000.00	8,371,326.00	
		ROMGB 4.75% 10/11/34	7,200,000.00	6,027,624.00	
		ROMGB 4.85% 04/22/26	4,700,000.00	4,498,041.00	
		ROMGB 4.85% 07/25/29	7,800,000.00	7,071,948.00	
		ROMGB 5.8% 07/26/27	10,100,000.00	9,779,173.50	
		ROMGB 5% 02/12/29	6,000,000.00	5,545,410.00	
		ROMGB 6.7% 02/25/32	6,800,000.00	6,743,807.65	
		ROMGB 8.25% 09/29/32	5,500,000.00	6,015,868.65	
		ROMGB 8.75% 10/30/28	4,500,000.00	4,906,075.05	
		ルーマニアレイ 小計	135,100,000.00	125,597,787.91 (3,805,072,903)	
	マレーシア リンギット	MGS 2.632% 04/15/31	34,300,000.00	31,613,836.31	
		MGS 3.478% 06/14/24	9,650,000.00	9,671,450.98	
		MGS 3.502% 05/31/27	9,650,000.00	9,626,943.83	
		MGS 3.582% 07/15/32	13,500,000.00	13,341,633.93	
		MGS 3.733% 06/15/28	19,000,000.00	19,110,467.90	
		MGS 3.757% 05/22/40	27,350,000.00	26,103,087.24	

	MGS 3.828% 07/05/34	8,200,000.00	8,143,806.30	
	MGS 3.882% 03/14/25	15,200,000.00	15,345,008.00	
	MGS 3.885% 08/15/29	20,300,000.00	20,558,956.95	
	MGS 3.899% 11/16/27	15,500,000.00	15,708,637.75	
	MGS 3.9% 11/30/26	17,450,000.00	17,679,373.27	
	MGS 3.906% 07/15/26	9,100,000.00	9,219,144.48	
	MGS 3.955% 09/15/25	28,700,000.00	29,013,438.44	
	MGS 4.059% 09/30/24	15,450,000.00	15,592,580.32	
	MGS 4.065% 06/15/50	13,250,000.00	13,063,440.39	
	MGS 4.181% 07/15/24	9,100,000.00	9,176,310.78	
	MGS 4.254% 05/31/35	20,050,000.00	20,588,841.74	
	MGS 4.504% 04/30/29	14,600,000.00	15,265,030.00	
	MGS 4.696% 10/15/42	8,800,000.00	9,507,562.24	
	MGS 4.762% 04/07/37	16,300,000.00	17,611,868.01	
	MGS 4.893% 06/08/38	7,400,000.00	8,139,533.06	
	MGS 4.921% 07/06/48	7,800,000.00	8,755,362.72	
	マレーシアリングット 小計	340,650,000.00	342,836,314.64 (10,349,954,069)	
タイバーツ	THAIGB 0.75% 06/17/24	102,500,000.00	101,187,660.72	
	THAIGB 0.95% 06/17/25	142,200,000.00	139,080,558.60	
	THAIGB 1.45% 12/17/24	184,000,000.00	182,315,069.68	
	THAIGB 1.585% 12/17/35	59,800,000.00	52,527,141.94	
	THAIGB 1.6% 06/17/35	65,100,000.00	57,796,926.41	
	THAIGB 1.6% 12/17/29	99,100,000.00	94,755,051.67	
	THAIGB 1% 06/17/27	163,000,000.00	155,532,112.62	
	THAIGB 2.125% 12/17/26	203,100,000.00	202,866,556.86	
	THAIGB 2.35% 06/17/26	142,000,000.00	142,877,616.80	
	THAIGB 2.65% 06/17/28	70,000,000.00	71,324,533.00	
	THAIGB 2.875% 06/17/46	102,100,000.00	96,729,381.74	
	THAIGB 2.875% 12/17/28	101,000,000.00	104,085,499.50	
	THAIGB 2% 06/17/42	78,600,000.00	67,276,787.32	
	THAIGB 2% 12/17/31	58,000,000.00	56,181,541.08	
	THAIGB 3.3% 06/17/38	148,700,000.00	156,646,052.16	
	THAIGB 3.35% 06/17/33	71,000,000.00	75,796,838.10	
	THAIGB 3.39% 06/17/37	14,000,000.00	14,868,449.40	
	THAIGB 3.4% 06/17/36	157,200,000.00	166,375,543.92	

	THAIGB 3.45% 06/17/43	35,000,000.00	36,956,654.00	
	THAIGB 3.65% 06/20/31	142,500,000.00	155,865,516.75	
	THAIGB 3.775% 06/25/32	180,000,000.00	199,575,702.00	
	THAIGB 3.85% 12/12/25	105,400,000.00	109,835,326.86	
	THAIGB 4.875% 06/22/29	119,500,000.00	136,665,505.80	
	タイバーツ 小計	2,543,800,000.00	2,577,122,026.93 (10,360,030,548)	
フィリピン ペソ	PHILIP 6.25% 01/14/36	30,000,000.00	29,244,812.40	
	フィリピンペソ 小計	30,000,000.00	29,244,812.40 (72,749,395)	
インドネシ アルピア	INDOGB 10.5% 08/15/30	7,300,000,000.00	9,025,568,160.00	
	INDOGB 11% 09/15/25	7,500,000,000.00	8,308,182,000.00	
	INDOGB 5.125% 04/15/27	63,000,000,000.00	61,893,720,000.00	
	INDOGB 5.5% 04/15/26	50,000,000,000.00	49,910,000,000.00	
	INDOGB 6.125% 05/15/28	16,000,000,000.00	16,073,600,000.00	
	INDOGB 6.25% 06/15/36	17,800,000,000.00	17,634,460,000.00	
	INDOGB 6.375% 04/15/32	62,000,000,000.00	62,135,160,000.00	
	INDOGB 6.375% 07/15/37	16,100,000,000.00	15,914,012,800.00	
	INDOGB 6.375% 08/15/28	26,500,000,000.00	27,020,195,000.00	
	INDOGB 6.5% 02/15/31	62,500,000,000.00	63,184,068,750.00	
	INDOGB 6.5% 06/15/25	50,000,000,000.00	50,750,000,000.00	
	INDOGB 6.625% 05/15/33	20,000,000,000.00	20,342,000,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/38	16,000,000,000.00	16,845,440,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/42	28,300,000,000.00	29,587,650,000.00	
	INDOGB 7.125% 06/15/43	13,500,000,000.00	14,212,057,500.00	
	INDOGB 7.5% 04/15/40	41,000,000,000.00	44,333,300,000.00	
	INDOGB 7.5% 05/15/38	19,700,000,000.00	21,307,520,000.00	
	INDOGB 7.5% 06/15/35	43,700,000,000.00	47,257,180,000.00	
	INDOGB 7.5% 08/15/32	18,400,000,000.00	19,805,760,000.00	
	INDOGB 7% 02/15/33	50,000,000,000.00	52,440,500,000.00	
	INDOGB 7% 05/15/27	38,600,000,000.00	40,035,920,000.00	
	INDOGB 7% 09/15/30	55,000,000,000.00	57,084,500,000.00	
	INDOGB 8.125% 05/15/24	46,800,000,000.00	47,869,380,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/29	31,200,000,000.00	34,441,680,000.00	
	INDOGB 8.25% 05/15/36	33,700,000,000.00	38,620,200,000.00	

		INDOGB 8.25% 06/15/32	13,400,000,000.00	15,079,810,600.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/24	35,600,000,000.00	36,322,680,000.00	
		INDOGB 8.375% 03/15/34	44,000,000,000.00	50,421,800,000.00	
		INDOGB 8.375% 04/15/39	21,200,000,000.00	24,772,200,000.00	
		INDOGB 8.375% 09/15/26	40,100,000,000.00	43,107,500,000.00	
		INDOGB 8.75% 05/15/31	23,700,000,000.00	27,186,270,000.00	
		INDOGB 9.5% 07/15/31	11,400,000,000.00	13,497,123,480.00	
		INDOGB 9% 03/15/29	28,700,000,000.00	32,597,460,000.00	
	インドネシアルピア 小計		1,052,700,000,000.00	1,109,016,898,290.00 (10,424,758,843)	
南アフリカ ランド		SAGB 10.5% 12/21/26	210,400,000.00	216,643,620.00	
		SAGB 6.25% 03/31/36	72,200,000.00	45,449,900.00	
		SAGB 6.5% 02/28/41	64,100,000.00	37,665,160.00	
		SAGB 7% 02/28/31	104,700,000.00	82,524,540.00	
		SAGB 8.25% 03/31/32	165,500,000.00	137,166,400.00	
		SAGB 8.5% 01/31/37	136,700,000.00	103,495,570.00	
		SAGB 8.75% 01/31/44	112,000,000.00	81,676,000.00	
		SAGB 8.75% 02/28/48	181,700,000.00	131,596,225.00	
		SAGB 8.875% 02/28/35	151,000,000.00	122,219,400.00	
		SAGB 8% 01/31/30	190,600,000.00	165,774,350.00	
		SAGB 9% 01/31/40	130,300,000.00	99,757,680.00	
	南アフリカランド 小計		1,519,200,000.00	1,223,968,845.00 (9,106,328,206)	
オフショア 人民元		CGB 1.99% 04/09/25	13,600,000.00	13,562,746.74	
		CGB 2.18% 08/25/25	10,200,000.00	10,199,677.87	
		CGB 2.26% 02/24/25	3,000,000.00	3,007,990.50	
		CGB 2.44% 10/15/27	21,000,000.00	21,011,955.30	
		CGB 2.46% 02/15/26	16,000,000.00	16,108,283.20	
		CGB 2.48% 04/15/27	5,400,000.00	5,419,514.52	
		CGB 2.5% 07/25/27	6,000,000.00	6,018,385.80	
		CGB 2.6% 09/01/32	16,900,000.00	16,720,702.99	
		CGB 2.62% 04/15/28	6,800,000.00	6,865,913.08	
		CGB 2.62% 09/25/29	5,000,000.00	4,995,801.25	
		CGB 2.64% 01/15/28	10,000,000.00	10,090,733.00	
		CGB 2.68% 05/21/30	27,300,000.00	27,326,025.09	
		CGB 2.69% 08/12/26	10,000,000.00	10,118,105.00	

	CGB 2.69% 08/15/32	10,000,000.00	9,969,370.80	
	CGB 2.75% 02/17/32	7,700,000.00	7,717,288.04	
	CGB 2.75% 06/15/29	10,900,000.00	10,987,225.07	
	CGB 2.76% 05/15/32	4,500,000.00	4,511,883.15	
	CGB 2.79% 12/15/29	12,000,000.00	12,102,474.00	
	CGB 2.8% 03/24/29	12,000,000.00	12,155,430.00	
	CGB 2.8% 11/15/32	9,900,000.00	9,968,281.29	
	CGB 2.84% 04/08/24	11,700,000.00	11,789,675.82	
	CGB 2.85% 06/04/27	18,400,000.00	18,722,927.36	
	CGB 2.88% 02/25/33	7,200,000.00	7,317,310.32	
	CGB 2.89% 11/18/31	8,000,000.00	8,107,280.80	
	CGB 2.91% 10/14/28	6,000,000.00	6,120,910.20	
	CGB 2.94% 10/17/24	23,000,000.00	23,284,098.30	
	CGB 3.01% 05/13/28	9,800,000.00	10,065,822.06	
	CGB 3.02% 05/27/31	8,500,000.00	8,704,904.40	
	CGB 3.02% 10/22/25	7,300,000.00	7,446,878.92	
	CGB 3.03% 03/11/26	7,500,000.00	7,670,514.00	
	CGB 3.12% 10/25/52	2,800,000.00	2,820,042.12	
	CGB 3.12% 12/05/26	20,000,000.00	20,541,356.00	
	CGB 3.13% 11/21/29	8,300,000.00	8,568,010.32	
	CGB 3.19% 04/11/24	24,100,000.00	24,364,270.96	
	CGB 3.22% 12/06/25	21,600,000.00	22,149,797.76	
	CGB 3.25% 06/06/26	22,000,000.00	22,676,742.00	
	CGB 3.25% 11/22/28	10,300,000.00	10,750,134.72	
	CGB 3.27% 11/19/30	22,000,000.00	22,990,745.80	
	CGB 3.28% 12/03/27	9,700,000.00	10,076,188.31	
	CGB 3.29% 05/23/29	14,200,000.00	14,810,203.82	
	CGB 3.32% 04/15/52	3,200,000.00	3,326,189.76	
	CGB 3.53% 10/18/51	8,800,000.00	9,480,457.36	
	CGB 3.72% 04/12/51	8,500,000.00	9,442,869.30	
	CGB 3.81% 09/14/50	16,500,000.00	18,570,896.85	
	オフショア人民元 小計	517,600,000.00	528,656,013.95 (10,313,391,579)	
	合計		102,949,332,081 (102,949,332,081)	



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 15 銘柄	100.0%	10.1%
ブラジルリアル	国債証券 12 銘柄	100.0%	10.6%
チリペソ	国債証券 9 銘柄	100.0%	2.5%
コロンビアペソ	国債証券 4 銘柄	100.0%	4.5%
ペルーソル	国債証券 9 銘柄	100.0%	2.6%
ウルグアイペソ	国債証券 2 銘柄	100.0%	0.1%
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 20 銘柄	100.0%	5.6%
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%	7.7%
ルーマニアレイ	国債証券 20 銘柄	100.0%	3.7%
マレーシアリングgit	国債証券 22 銘柄	100.0%	10.1%
タイバーツ	国債証券 23 銘柄	100.0%	10.1%
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 33 銘柄	100.0%	10.1%
南アフリカランド	国債証券 11 銘柄	100.0%	8.8%
オフショア人民元	国債証券 44 銘柄	100.0%	10.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和 52 年大蔵省令第 38 号)」並びに同規則第 38 条の 3 及び第 57 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成 12 年総理府令第 133 号)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 7 期中間計算期間(2023 年 6 月 13 日から 2023 年 12 月 12 日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

# 独立監査人の中間監査報告書

2024年2月21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 中島紀子  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているSMT世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2023年6月13日から2023年12月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、SMT世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）の2023年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月13日から2023年12月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 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。

【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2023年6月12日現在)	第7期中間計算期間 (2023年12月12日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	132,905,207	146,233,826
親投資信託受益証券	10,958,894,668	13,180,672,333
未収入金	26,435,040	75,614,438
流動資産合計	11,118,234,915	13,402,520,597
資産合計	11,118,234,915	13,402,520,597
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	21,599,204	11,219,223
未払受託者報酬	2,678,030	3,416,766
未払委託者報酬	26,780,219	34,167,618
未払利息	270	48
その他未払費用	267,747	341,616
流動負債合計	51,325,470	49,145,271
負債合計	51,325,470	49,145,271
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,050,089,441	7,942,661,909
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	4,016,820,004	5,410,713,417
(分配準備積立金)	1,705,354,657	1,576,764,876
元本等合計	11,066,909,445	13,353,375,326
純資産合計	11,066,909,445	13,353,375,326
負債純資産合計	11,118,234,915	13,402,520,597

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 6 期中間計算期間 自 2022 年 6 月 11 日 至 2022 年 12 月 10 日	第 7 期中間計算期間 自 2023 年 6 月 13 日 至 2023 年 12 月 12 日
営業収益		
受取利息	153	380
有価証券売買等損益	△57,337,243	857,953,086
営業収益合計	△57,337,090	857,953,466
営業費用		
支払利息	24,547	36,539
受託者報酬	2,267,706	3,416,766
委託者報酬	22,676,972	34,167,618
その他費用	226,713	341,620
営業費用合計	25,195,938	37,962,543
営業利益又は営業損失 (△)	△82,533,028	819,990,923
経常利益又は経常損失 (△)	△82,533,028	819,990,923
中間純利益又は中間純損失 (△)	△82,533,028	819,990,923
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 (△)	△3,603,706	41,936,579
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	2,497,468,016	4,016,820,004
剰余金増加額又は欠損金減少額	517,660,607	955,322,795
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	517,660,607	955,322,795
剰余金減少額又は欠損金増加額	140,287,680	339,483,726
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	140,287,680	339,483,726
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	2,795,911,621	5,410,713,417

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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6月11日から翌年6月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期中間計算期間は2023年6月13日から2023年12月12日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第6期 (2023年6月12日現在)	第7期中間計算期間 (2023年12月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,050,089,441口	7,942,661,909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) 1,5698円 (15,698円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,6812円 (16,812円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第7期中間計算期間 (2023年12月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第6期 自2022年6月11日 至2023年6月12日	第7期中間計算期間 自2023年6月13日 至2023年12月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,243,847,332円	7,050,089,441円
期中追加設定元本額	2,441,482,388円	1,483,215,320円
期中一部解約元本額	635,240,279円	590,642,852円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,308,363,417
株式	583,994,342,210
派生商品評価勘定	15,620,700
未収入金	376,900
未収配当金	251,084,768
差入委託証拠金	196,300,818
流動資産合計	588,766,088,813
資産合計	588,766,088,813
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,100
前受金	15,584,000
未払金	18,412,221
未払解約金	652,676,595
未払利息	1,417
流動負債合計	686,715,333
負債合計	686,715,333
純資産の部	
元本等	
元本	243,616,329,149
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	344,463,044,331
元本等合計	588,079,373,480
純資産合計	588,079,373,480
負債純資産合計	588,766,088,813



注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,616,329,149 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 2,4140 円 (1万口当たり純資産額) (24,140 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引

のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月13日
期首元本額	253,755,785,513円
期中追加設定元本額	12,938,544,627円
期中一部解約元本額	23,078,000,991円
期末元本額	243,616,329,149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)	309,619,193円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,423,980,750円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,094,963円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,029,994,756円
世界経済インデックスファンド	5,183,815,086円
日本株式インデックス・オープン	2,963,223,391円
DCマイセレクション25	5,346,989,548円
DCマイセレクション50	17,256,229,417円
DCマイセレクション75	18,633,711,318円
DC日本株式インデックス・オープン	6,012,794,109円
DCマイセレクションS25	3,165,070,713円
DCマイセレクションS50	9,550,985,540円
DCマイセレクションS75	8,276,536,673円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,159,961,526円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	91,582,985円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	621,840,409円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	487,679,216円
DC世界経済インデックスファンド	3,797,824,116円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	861,173,742円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,504,090円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	10,124,653円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,704,323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)	146,024,854円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,043,492円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	15,523,066円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	70,516,841円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,046,582円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	42,929,946円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	507,129,553円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	320,611,953円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,142,119,294円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	30,004,333円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,562,183円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	332,395,816円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	182,287,222円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	249,263,166円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	20,204,568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)	420,022,670円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,536,242,081円

日本株式ファンド・シリーズ2	1,922,303,988円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	602,178,473円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	409,284,985円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,219,002,091円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	199,104,687円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,991,289円
SMT インデックスバランス・オープン	48,881,127円
国内株式SMT Bセレクション(SMA専用)	19,763,215,485円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,816,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,249,858円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	216,423,849円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	37,268,650円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,219,423円
グローバル経済コア	217,244,401円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,654,909円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	1,305,671,355円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,392,042円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	964,175,269円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	242,306,554円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	53,036,145円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,721,567円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,986,739円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	25,790,349円
10資産分散投資ファンド	92,513,578円
グローバル10資産バランスファンド	3,694,879円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	20,340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)	41,900,806,504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)	494,439,705円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	300,608,051円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,113,119円
SMT AM9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
SMT AM日本株式インデックスファンドVLP(適格機関投資家専用)	47,165,716,820円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,688,069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)	213,977,148円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年12月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,070,806,000	—	4,086,390,000	15,584,000
合計		4,070,806,000	—	4,086,390,000	15,584,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 国内債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	369,531,885
国債証券	542,471,807,850
地方債証券	32,579,641,142
特殊債券	36,936,051,864
社債券	29,421,111,000
未収入金	527,645,000
未収利息	1,480,794,071
前払費用	65,888,199
流動資産合計	643,852,471,011
資産合計	643,852,471,011
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	372,481,591
未払利息	121
流動負債合計	672,481,712
負債合計	672,481,712
純資産の部	
元本等	
元本	483,501,933,016
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	159,678,056,283
元本等合計	643,179,989,299
純資産合計	643,179,989,299
負債純資産合計	643,852,471,011

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	483,501,933,016 口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 99,450,000 円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3303 円 (1万口当たり純資産額) (13,303 円)

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月12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る場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月13日
期首元本額	469,662,622,453 円
期中追加設定元本額	28,503,854,553 円
期中一部解約元本額	14,664,543,990 円
期末元本額	483,501,933,016 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)	5,309,662,871 円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,577,989 円

SMT 国内債券インデックス・オープン	17,647,048,900 円
世界経済インデックスファンド	6,299,960,973 円
DCマイセレクション25	28,510,632,321 円
DCマイセレクション50	34,581,997,922 円
DCマイセレクション75	10,941,894,285 円
DC日本債券インデックス・オープン	407,983,690 円
DC日本債券インデックス・オープンS	89,547,491,817 円
DC日本債券インデックス・オープンP	63,624,203,542 円
DCマイセレクションS25	16,492,884,518 円
DCマイセレクションS50	19,295,076,435 円
DCマイセレクションS75	4,856,008,269 円
DCターゲット・イヤーフンド2025	476,339,781 円
DCターゲット・イヤーフンド2035	2,795,608,418 円
DCターゲット・イヤーフンド2045	1,110,575,691 円
DC世界経済インデックスファンド	4,556,662,782 円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	2,110,023 円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	19,928,786 円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	8,474,766 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)	56,713,843 円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	103,013,462 円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	27,937,740 円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	21,798,088 円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,137,163,361 円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	723,770,883 円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	3,085,055,693 円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	65,293,196 円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	50,129,910 円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	900,839,436 円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	991,530,225 円
バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,330,725,891 円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	96,453,068 円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,778,919,746 円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,672,026,732 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)	292,020,218 円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,817,909,413 円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	94,078,309 円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	44,572,258 円
SMT インデックスバランス・オープン	70,397,231 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,395,739 円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	105,194,349 円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	167,548,796 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,668,017 円
グローバル経済コア	238,680,550 円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	42,859,999 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	33,998,823 円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	131,961,890 円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	73,750,145 円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	21,967,384 円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	15,262,917 円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	692,172,477 円
10資産分散投資ファンド	322,433,444 円
グローバル10資産バランスファンド	46,558,409 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)	93,933,752,584 円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	38,563,750 円

私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,882,236 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）	469,103,619 円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,407,330,098
コール・ローン	403,541,864
株式	604,641,688,346
投資信託受益証券	120,033,193
投資証券	12,229,906,217
派生商品評価勘定	713,093,023
未収入金	17,575,004
未収配当金	813,173,371
差入委託証拠金	4,863,037,843
流動資産合計	630,209,378,959
資産合計	630,209,378,959
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,290,851
前受金	710,828,224
未払解約金	334,782,261
未払利息	132
流動負債合計	1,047,901,468
負債合計	1,047,901,468
純資産の部	
元本等	
元本	116,361,852,442
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	512,799,625,049
元本等合計	629,161,477,491
純資産合計	629,161,477,491
負債純資産合計	630,209,378,959

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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



	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月12日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		116,361,852,442 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)	5.4069 円 (54,069 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月13日
期首元本額	121,623,869,603 円
期中追加設定元本額	7,170,401,629 円
期中一部解約元本額	12,432,418,790 円
期末元本額	116,361,852,442 円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,566,587,947 円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,013,265 円

SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,633,438,356円
世界経済インデックスファンド	13,072,459,041円
外国株式インデックス・オープン	881,899,418円
DCマイセレクション25	637,318,125円
DCマイセレクション50	3,467,005,779円
DCマイセレクション75	4,333,494,667円
DC外国株式インデックス・オープン	12,728,162,089円
DCマイセレクションS25	402,274,277円
DCマイセレクションS50	1,903,366,162円
DCマイセレクションS75	1,918,345,959円
DCターゲット・イヤーフンド2025	20,738,851円
DCターゲット・イヤーフンド2035	140,789,494円
DCターゲット・イヤーフンド2045	110,416,025円
DC世界経済インデックスファンド	9,530,800,188円
外国株式インデックス・オープン (SMA専用)	991,827,202円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	1,991,576円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	3,142,957円
外国株式インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	21,884,538円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	7,064,750円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	33,182,785円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	7,257,873円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	19,430,905円
バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	158,381,100円
バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	130,907,963円
バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	985,423,242円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	67,523,430円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	16,962,785円
バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	113,355,013円
バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	36,711,759円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	787,426,934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)	841,316,544円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,180,201,332円
コア投資戦略ファンド(安定型)	135,892,093円
コア投資戦略ファンド(成長型)	307,825,343円
分散投資コア戦略ファンドA	1,605,660,699円
分散投資コア戦略ファンドS	7,339,764,093円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,487,556,744円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,020,135,019円
コア投資戦略ファンド(切替型)	143,320,748円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	484,318,178円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,198,590円
SMT インデックスバランス・オープン	121,842,892円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	77,417,800円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,125,761,114円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,768,685円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,029,029,755円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	180,349,089円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,518,864円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	1,300,038,742円
グローバル経済コア	535,597,594円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,241,396円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,903,687円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	124,430,320円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,671,774円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	144,110,176円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	137,038,605円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	60,117,663円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	70,159,261円
10資産分散投資ファンド	51,253,414円
グローバル10資産バランスファンド	1,680,628円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	57,816,046円
外株インデックス・ファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	202,316,358円
外株インデックス・ファンド2（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	624,662,280円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,442,050,540円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	100,097,232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）	85,769,080円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	82,692,653円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	186,731,857円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	180,617,821円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	179,700,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	181,779,484円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	179,977,573円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	91,791,755円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	116,188,483円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年12月12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	11,398,146,275	—	12,108,974,499	710,828,224
合計		11,398,146,275	—	12,108,974,499	710,828,224

(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

（2023年12月12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	34,875,750	—	34,874,973	△777
	スイスフラン	34,875,750	—	34,874,973	△777
	売建	7,267,500	—	7,292,775	△25,275
	アメリカドル	7,267,500	—	7,292,775	△25,275
合計		42,143,250	—	42,167,748	△26,052

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	795,258,853
コール・ローン	1,860,964,890
国債証券	293,494,516,895
派生商品評価勘定	4,736,585
未収入金	1,263,227,858
未収利息	1,853,264,005
前払費用	176,695,808
差入委託証拠金	229,873,723
流動資産合計	299,678,538,617
資産合計	299,678,538,617
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,400,446
前受金	2,610,920
未払金	24,720,036
未払解約金	1,700,820,482
未払利息	612
流動負債合計	1,760,552,496
負債合計	1,760,552,496
純資産の部	
元本等	
元本	88,790,449,328
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	209,127,536,793
元本等合計	297,917,986,121
純資産合計	297,917,986,121
負債純資産合計	299,678,538,617

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>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</p> <p>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</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)

	2023年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,790,449,328 円
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 3.3553 円 (1 万口当たり純資産額) (33,553 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p>

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月13日
期首元本額	85,391,300,001円
期中追加設定元本額	7,337,343,622円
期中一部解約元本額	3,938,194,295円
期末元本額	88,790,449,328円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン (毎月決算型)	1,147,985,996円
グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	519,264,658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)	2,450,390,264円
SBI資産設計オープン (分配型)	9,204,018円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,658,855,597円
世界経済インデックスファンド	19,037,694,390円
DCマイセレクション25	1,957,695,313円
DCマイセレクション50	1,763,107,704円
DCマイセレクション75	1,364,806,010円
DC外国債券インデックス・オープン	2,247,837,805円
DCマイセレクションS25	1,054,442,146円
DCマイセレクションS50	964,658,265円
DCマイセレクションS75	539,015,390円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,201,873円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	100,089,017円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,947,127円
DC世界経済インデックスファンド	13,861,768,273円
外国債券インデックス・オープン (SMA専用)	654,549,323円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	1,028,294円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	1,011,151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)	15,962,521円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	26,499,579円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	51,554,161円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	55,393,147円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	49,400,636円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	840,604,571円
バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	380,885,156円

バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	1,543,456,886円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	53,944,503円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	31,626,708円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	360,286,145円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	131,598,706円
バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)	179,772,106円
FOFs用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	640,853,306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)	1,501,285,321円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,367,705円
外国債券ファンド・シリーズ1	780,952,333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)	706,693,230円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,421,708,890円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	230,972,590円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	108,280,828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)	1,314,500,927円
SMT インデックスバランス・オープン	172,978,948円
SMT 世界経済インデックス・オープン	369,083,603円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	490,038,943円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	780,624,876円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,798,352円
グローバル経済コア	792,400,744円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	21,482,472円
DCターゲット・イヤーフンド2055	2,563,416円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2030	53,802,918円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2040	72,555,672円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2050	36,036,298円
DCターゲット・イヤーフンド (6資産・運用継続型) 2060	46,047,071円
My SMT グローバル債券インデックス (ノーロード)	409,619,187円
10資産分散投資ファンド	26,021,747円
グローバル10資産バランスファンド	2,641,426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)	12,333,440,514円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	182,915,003円
SMTAM9資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)	49,614,561円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	124,240,576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)	129,977,670円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2023年12月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	1,373,535,630	—	1,376,146,550	2,610,920
	合計	1,373,535,630	—	1,376,146,550	2,610,920

(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

(2023年12月12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	1,468,161,650	—	1,442,903,233	△25,258,417
	アメリカドル	719,474,835	—	711,535,720	△7,939,115
	カナダドル	60,718,849	—	60,172,336	△546,513
	ユーロ	469,555,973	—	456,700,929	△12,855,044
	イギリスポンド	87,575,970	—	86,087,033	△1,488,937
	オフショア人民 元	130,836,023	—	128,407,215	△2,428,808
	売建	1,509,265,565	—	1,514,281,929	△5,016,364
	アメリカドル	734,017,500	—	736,570,275	△2,552,775
	カナダドル	32,095,800	—	32,245,050	△149,250
	メキシコペソ	13,685,931	—	13,719,775	△33,844
	ユーロ	493,999,212	—	495,430,773	△1,431,561
	イギリスポンド	76,254,904	—	76,586,503	△331,599
	ポーランドズロ チ	10,859,478	—	10,897,373	△37,895
	オーストラリア ドル	23,888,250	—	23,956,925	△68,675
	イスラエルシェ ケル	3,962,230	—	3,958,775	3,455
	オフショア人民 元	120,502,260	—	120,916,480	△414,220
	合計		2,977,427,215	—	2,957,185,162

(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。



## 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,805,529,255
コール・ローン	126,682,509
株式	158,067,404,853
投資信託受益証券	493,438,176
投資証券	178,131,919
派生商品評価勘定	118,758,063
未収配当金	183,616,432
差入委託証拠金	1,244,874,711
流動資産合計	163,218,435,918
資産合計	163,218,435,918
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,910,380
前受金	105,674,743
未払解約金	69,261,064
未払利息	41
流動負債合計	187,846,228
負債合計	187,846,228
純資産の部	
元本等	
元本	42,227,040,517
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	120,803,549,173
元本等合計	163,030,589,690
純資産合計	163,030,589,690
負債純資産合計	163,218,435,918

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月12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</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,227,040,517 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 3.8608 円 (1 万口当たり純資産額) (38,608 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月12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>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月13日
期首元本額	42,049,511,619円
期中追加設定元本額	3,368,778,364円
期中一部解約元本額	3,191,249,466円
期末元本額	42,227,040,517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	7,693,397,797円
世界経済インデックスファンド	10,088,645,547円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,084,047,407円
DC世界経済インデックスファンド	7,318,626,899円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	91,709,620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)	1,173,989,799円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	787,965,151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)	380,074,972円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	19,277,936円
SMT インデックスバランス・オープン	93,309,337円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	35,711,445円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	2,322,850,351円
SMT 世界経済インデックス・オープン	243,907,024円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,025,126,510円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	174,010,835円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,807,662円
グローバル経済コア	417,942,770円
My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	242,981,568円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	57,500,179円

コア投資戦略ファンド（積極成長型）	14,175,859円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	96,821,941円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	92,077,823円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	40,395,872円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	47,153,651円
10資産分散投資ファンド	13,095,775円
グローバル10資産バランスファンド	2,275,187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）	1,447,737,517円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	96,978,334円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	81,664,101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）	12,403,948円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	25,767,251円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年12月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,328,778,203	—	4,434,452,946	105,674,743
合計		4,328,778,203	—	4,434,452,946	105,674,743

（注）1. 時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 通貨関連

（2023年12月12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 アメリカドル	205,457,100 205,457,100	— —	205,630,040 205,630,040	172,940 172,940
合計		205,457,100	—	205,630,040	172,940

（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。

## 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,229,796,899
コール・ローン	349,490,780
国債証券	120,131,016,676
未収利息	1,751,860,289
前払費用	205,511,857
流動資産合計	123,667,676,501
資産合計	123,667,676,501
負債の部	
流動負債	
未払金	279,577,145
未払解約金	63,801,539
未払利息	114
流動負債合計	343,378,798
負債合計	343,378,798
純資産の部	
元本等	
元本	57,392,149,241
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	65,932,148,462
元本等合計	123,324,297,703
純資産合計	123,324,297,703
負債純資産合計	123,667,676,501

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
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

4. 収益及び費用の計上基準	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。  為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。
----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	2023 年 12 月 12 日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		57,392,149,241 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)	2.1488 円 (21,488 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 12 月 12 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

(その他の注記)

元本の移動

区分	2023 年 12 月 12 日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023 年 6 月 13 日
期首元本額	52,846,131,448 円
期中追加設定元本額	5,650,780,004 円
期中一部解約元本額	1,104,762,211 円
期末元本額	57,392,149,241 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	5,213,325,197 円
世界経済インデックスファンド	19,631,674,514 円
DC 新興国債券インデックス・オープン	5,855,753,163 円
DC 世界経済インデックスファンド	14,341,424,814 円
新興国債券インデックス・オープン (SMA 専用)	8,848,639 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)	729,159,571 円
DC 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,568,778,182 円

世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	239,782,374円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,013,374円
SMT インデックスバランス・オープン	179,640,697円
SMT 世界経済インデックス・オープン	474,619,374円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	629,368,971円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,002,448,377円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,259,375円
グローバル経済コア	820,634,837円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	94,115,518円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	80,147,497円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	33,329,037円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	37,200,111円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	162,791,164円
10資産分散投資ファンド	42,621,612円
グローバル10資産バランスファンド	4,123,156円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	238,136,903円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	160,113,123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）	22,566,940円
SMT AM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	230,204,334円
SMT AM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
SMT AM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
SMT AM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	224,099,208円
SMT AM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	221,877,764円
SMT AM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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）】

#### 【純資産額計算書】

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	13,678,599,565円
II 負債総額	32,566,053円
III 純資産総額（I－II）	13,646,033,512円
IV 発行済口数	8,010,556,112口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.7035円
(1万口当たり純資産額)	(17,035円)

(参考)

#### 国内株式インデックス マザーファンド

##### 純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	594,166,725,557円
II 負債総額	287,749,566円
III 純資産総額（I－II）	593,878,975,991円
IV 発行済口数	244,296,624,247口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4310円
(1万口当たり純資産額)	(24,310円)

#### 国内債券インデックス マザーファンド

##### 純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	656,697,328,362円
II 負債総額	6,940,305,719円
III 純資産総額（I－II）	649,757,022,643円
IV 発行済口数	484,133,624,230口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3421円
(1万口当たり純資産額)	(13,421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

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	634,263,010,203円
II 負債総額	463,467,182円
III 純資産総額 (I - II)	633,799,543,021円
IV 発行済口数	116,009,010,515口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	5.4634円
(1万口当たり純資産額)	(54,634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

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	302,074,794,805円
II 負債総額	205,827,710円
III 純資産総額 (I - II)	301,868,967,095円
IV 発行済口数	89,034,389,708口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	3.3905円
(1万口当たり純資産額)	(33,905円)

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	168,122,356,183円
II 負債総額	229,415,845円
III 純資産総額 (I - II)	167,892,940,338円
IV 発行済口数	42,510,882,266口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	3.9494円
(1万口当たり純資産額)	(39,494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

(2023年12月29日現在)

I 資産総額	124,902,319,014円
II 負債総額	5,851,385円
III 純資産総額 (I - II)	124,896,467,629円
IV 発行済口数	57,718,061,151口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2.1639円
(1万口当たり純資産額)	(21,639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）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（2023年12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 3 月 12 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。

2023 年 12 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	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	218,373
単位型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

### 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. XBRL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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	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おりません。

(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げすることとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,797	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

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

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



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

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通 株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (金融商品関係)

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

##### ①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

##### ②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

##### 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(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	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おりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 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) 通常の見取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

##### (4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

##### (5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5 【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

2024年3月12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  
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）  
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 19 条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 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、先進国及び新興国の株式並びに債券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。
- ②株式と債券の基本資産配分比率は、株式 75%、債券 25%とします。
- 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））総額の比率に基づき決定します。また、各マザーファンド受益証券の組入比率には一定の変動許容幅を設けます。
- ④各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、年 1 回見直しを行います。
- ⑤各マザーファンドは、インデックスの動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

- ⑥実質組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- ⑦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への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の 85%以下とします。

- ②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ④有価証券先物取引等は、投資信託約款第22条の範囲で行います。
- ⑤スワップ取引は、投資信託約款第23条の範囲で行います。
- ⑥金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引は、投資信託約款第24条の範囲で行います。
- ⑦一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑧デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

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

追加型証券投資信託  
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）  
投資信託約款

**（信託の種類、委託者及び受託者）**

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

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

**（信託事務の委託）**

第 2 条 受託者は、信託法第 28 条第 1 号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 1 条第 1 項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第 2 条第 1 項にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第 18 条第 1 項、第 18 条第 2 項及び第 30 条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

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

**（信託の目的及び金額）**

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

**（信託金の限度額）**

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

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

**（信託期間）**

第 5 条 この信託の期間は、投資信託契約締結日から第 48 条第 1 項、第 48 条第 2 項、第 49 条第 1 項、第 50 条第 1 項及び第 52 条第 2 項の規定による信託終了の日までとします。

**（受益権の取得申込みの勧誘の種類）**

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

**（当初の受益者）**

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

**（受益権の分割及び再分割）**

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

②委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

**（追加信託の価額及び口数、基準価額の計算方法）**

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

②この投資信託約款において基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び第 27 条に規定する借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評

価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。

③投資信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

④第 29 条に規定する為替予約の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

#### （信託日時異なる受益権の内容）

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

#### （受益権の帰属と受益証券の不発行）

第 11 条 この信託の全ての受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第 2 条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第 2 条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

②委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

③委託者は、第 8 条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。

#### （受益権の設定に係る受託者の通知）

第 12 条 受託者は、この投資信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### （受益権の申込単位及び価額）

第 13 条 販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び委託者の指定する金融商品取引法第 2 条第 11 項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第 8 条第 1 項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、販売会社と別に定める分配金再投資に関する契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に係る収益分配金の再投資の場合は、1 円以上 1 円単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。

②前項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金（第 4 項又は第 6 項

の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。)の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。

- ③第1項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づき収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。
- ④第1項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、手数料並びに当該手数料に係る消費税及び地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額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円に手数料及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。
- ⑤前項の手数料の額は、販売会社が別に定めるところによるものとします。
- ⑥第4項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第38条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所等(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、委託者は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

#### (受益権の譲渡に係る記載又は記録)

- 第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
  - ③委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### (受益権の譲渡の対抗要件)

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

#### (投資の対象とする資産の種類)

- 第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ.有価証券
  - ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第22条、第23条及び第24条に定めるものに限ります。)
  - 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

(運用の指図範囲等)

第 17 条 委託者は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「国内株式インデックス マザーファンド」、「国内債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国債券インデックス マザーファンド」（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。）並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証書と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 19 号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
17. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）

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

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

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、信託金を前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券及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、新株引受権証券及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、投資信託財産の純資産総額の 100 分の 85 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（上場投資信託証券（金融商品取引所等に上場等され、かつ当該金融商品取引所等において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下本項において同じ。）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前 2 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各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 18 条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、投資信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託者の利害関係人、第 30 条第 1 項に定める信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託者における他の信託財産との間で、前 2 条に掲げる資産への投資等並びに第 21 条から第 27 条まで、第 29 条及び第 33 条から第 35 条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。



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

③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役及び委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項及び同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等並びに第21条から第27条まで、第29条及び第33条から第35条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

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

#### （運用の基本方針）

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

#### （投資する株式等の範囲）

第20条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

②前項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21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。

②前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新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### （先物取引等の運用指図、目的及び範囲）

第22条 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保

有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の金融商品取引所等における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）並びに委託者が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）

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、わが国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の金融商品取引所等における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことを指図することができます。

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、わが国の金融商品取引所等における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の金融商品取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。

#### （スワップ取引の運用指図、目的及び範囲）

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及び為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことを指図することができます。

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 5 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。

④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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の運用指図、目的及び範囲）

第 24 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及び為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うことを指図することができます。

②金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第 5 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、為替先渡取引及び直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④委託者は、金利先渡取引、為替先渡取引及び直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （有価証券の貸付の指図、目的及び範囲）

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。

②前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する

契約の一部の解約を指図するものとします。

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、目的及び範囲)

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、投資信託財産において有しない公社債又は第 27 条の規定により借り入れた公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売り付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②前項の売付の指図は、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、前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、委託者は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### (公社債の借入れの指図、目的及び範囲)

第 27 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

②前項の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

③投資信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

④第 1 項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 28 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### (外国為替予約取引の指図、目的及び範囲)

第 29 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 30 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合する者（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

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

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合してい

ることを確認するものとします。

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

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

#### （混蔵寄託）

第 31 条 金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### （投資信託財産の登記等及び記載等の留保等）

第 32 条 信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

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

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

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

#### （一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図）

第 33 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及び投資信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### （再投資の指図）

第 34 条 委託者は、前条の規定による一部解約代金及び売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

#### （資金の借入れ）

第 35 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託

財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

③収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

#### (損益の帰属)

第 36 条 委託者の指図に基づく行為により投資信託財産に生じた利益及び損失は、全て受益者に帰属します。

#### (受託者による資金の立替え)

第 37 条 投資信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行又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、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて投資信託財産に繰り入れることができます。

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

#### (信託の計算期間)

第 38 条 この信託の計算期間は、毎年 6 月 11 日から翌年 6 月 10 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 29 年 8 月 25 日から平成 30 年 6 月 11 日までとします。

②前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、第 5 条に定める信託期間の終了日とします。

#### (投資信託財産に関する報告等)

第 39 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、投資信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

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

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

#### (信託事務の諸費用)

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

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

#### (信託報酬等の総額及び支弁の方法)

第 41 条 委託者及び受託者の信託報酬の総額は、第 38 条に規定する計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 55 の率を乗じて得た額とします。

②前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のとき投資信託財産中から支弁するものとし、委託者及び受託者間の配分は別に定めます。

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

#### (収益の分配方式)

第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. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の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た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### (収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い)

第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又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載又は記録されます。

③償還金（信託終了時における投資信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

④一部解約金（第46条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第46条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、6営業日目から当該受益者に支払います。

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

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

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

第 44 条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第 3 項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第 4 項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

**(収益分配金及び償還金の時効)**

第 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、並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、委託者に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

②受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

③委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第 1 項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に 0.1% の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

⑤委託者は、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨークもしくはロンドンの銀行休業日においては、第 1 項による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

⑥委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

⑦前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第 4 項の規定に準じて計算された価額とします。

**(質権口記載又は記録の受益権の取扱い)**

第 47 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

**(投資信託契約の解約)**

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

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ④前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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 項から前項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第 3 項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

#### （投資信託契約に関する監督官庁の命令）

第 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、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款の変更をしようとするときは、第 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、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 53 条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

#### （委託者の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い）

第 51 条 委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

#### （受託者の辞任及び解任に伴う取扱い）

第 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、委託者又は受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、又は裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第 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又はやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又はこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この投資信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託約款に係る知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前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第 2 項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第 2 項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### （他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第 54 条 この信託の受益者は、委託者又は受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

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

#### （運用報告書に記載すべき事項の提供）

第 55 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

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

#### （公告）

第 56 条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### （投資信託約款に関する疑義の取扱い）

第 57 条 この投資信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

#### （付則）

第 1 条 第 24 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」といいます。）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又は海外において代表的利率として公表される預金契約又は金銭の貸借契約に基づく債権の利率（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及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。

第 2 条 第 24 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及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又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。

第 3 条 第 24 条に規定する「直物為替先渡取引」は、当事者間において、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の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

第 4 条 第 43 条第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、各受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「各受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成29年8月25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