

外国株式SMTBセレクション (SMA専用)

追加型投信／海外／株式

投資信託説明書 (請求目論見書)

2025年3月26日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

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

外国株式SMTBセレクション（SMA専用）の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2025年3月25日に関東財務局長に提出しており、2025年3月26日にその届出の効力が生じております。

発行者名 : 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

代表者の役職・氏名 : 代表取締役社長 菱田 賀夫

本店の所在の場所 : 東京都港区芝公園一丁目1番1号

有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
（1）【ファンドの名称】	1
（2）【内国投資信託受益証券の形態等】	1
（3）【発行（売出）価額の総額】	1
（4）【発行（売出）価格】	1
（5）【申込手数料】	1
（6）【申込単位】	1
（7）【申込期間】	2
（8）【申込取扱場所】	2
（9）【払込期日】	2
（10）【払込取扱場所】	2
（11）【振替機関に関する事項】	2
（12）【その他】	3
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
1【ファンドの性格】	4
2【投資方針】	12
3【投資リスク】	33
4【手数料等及び税金】	36
5【運用状況】	40
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】	61
3【資産管理等の概要】	63
4【受益者の権利等】	67
第3【ファンドの経理状況】	68
1【財務諸表】	71
2【ファンドの現況】	211
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	213
第三部【委託会社等の情報】	214
第1【委託会社等の概況】	214
1【委託会社等の概況】	214
2【事業の内容及び営業の概況】	215
3【委託会社等の経理状況】	216
4【利害関係人との取引制限】	250
5【その他】	250
約款	

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

外国株式SMTBセレクション（SMA専用）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額（※）とします。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

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

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

(7) 【申込期間】

2025年3月26日から2025年9月25日までとします。

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

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

<振替受益権について>

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

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

<受益権の取得申込みの方法>

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

<申込みコース>

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

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

<受益権の取得申込みの受付の中止等>

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

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<信託金限度額>

上限 5,000 億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり(部分ヘッジ)	日経225 TOPIX	ブル・ベア型 条件付運用型
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア		なし	その他 ()	ロング・ショート型/絶対収益追求型 その他 ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマージング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

(1) 株式

- ①一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- ③中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- ①一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- ②公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ③社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ④その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- ⑤格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

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

- ①資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- ②資産配分変更型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

- (1) 年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年4回…目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年6回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5) 年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6) 日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7) その他…上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

◆ESG 分類：当ファンドは ESG 投信ではありません。

<ファンドの特色>

1. 主として世界の株式^{*1}及び株式代替資産^{*2}を実質的な投資対象とする投資信託証券(以下「投資対象ファンド^{*3}」)に投資します。

- 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。
- 当ファンドでは原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

※1 「世界の株式」には、わが国の株式を含むことがあります。

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

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

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

- 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。
- 投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

ポートフォリオ構築プロセス

- 運用に当たっては三井住友信託銀行(委託会社の親会社である三井住友トラストグループ株式会社の連結子会社)から投資助言を受けます。

投資対象ファンドの 決定・見直し(随時)	STEP1	各投資対象ファンドの中長期的な期待リターン、リスク(標準偏差)、相関係数(各投資対象ファンド間の値動きの関係性を示す係数)を推定
	STEP2	ポートフォリオのリターン向上及びリスク低減を目的として、投資対象ファンドの組入れや入替え効果を検証
	STEP3	投資対象ファンドの組入れ・入替え効果の検証結果に基づき、ファンドの組入れ・入替えや投資割合を決定

※市場環境の急激な変化に応じて、リスク低減等を目的として、投資対象ファンドの投資割合の見直しを行うことがあります。

定期的なリバランスの実施 (年4回)	相対的に値上がりしたファンドの売却や値下がりしたファンドの購入を行うことなどにより、最適な投資割合からの乖離を修正
-----------------------	---

※市場環境等によっては、定期的なリバランスを行わない場合があります。また、臨時に行うこともあります。

※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



? ファンド・オブ・ファンズ方式とは

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

分配方針

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

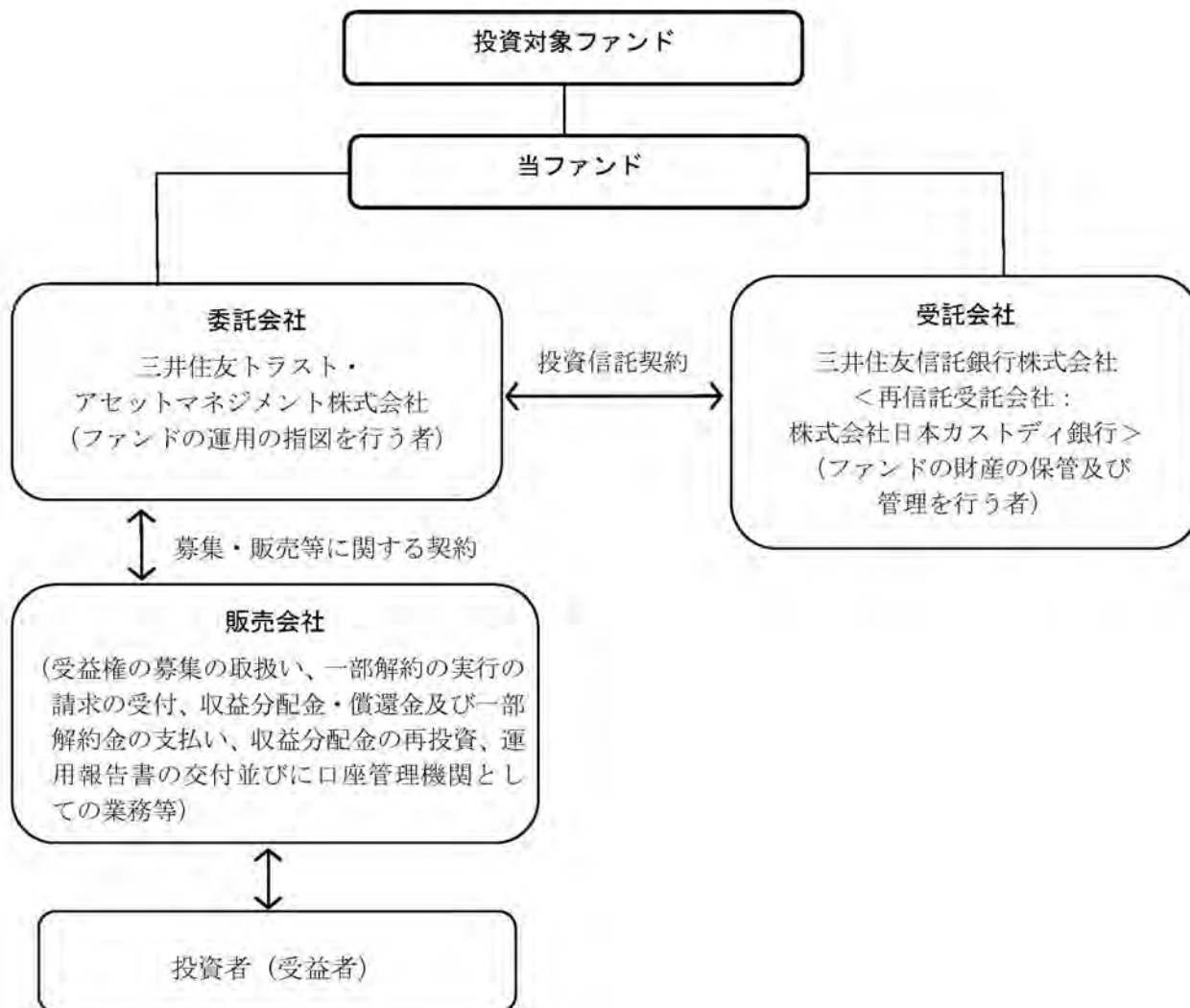
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2015年7月24日	当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
2023年9月27日	信託期間の延長（終了日を2025年6月25日から無期限へ変更）

(3) 【ファンドの仕組み】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況 (2025年 1月31日現在)

イ. 資本金の額: 20億円

ロ. 委託会社の沿革

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

ハ. 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①基本方針

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

②投資対象

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

③投資態度

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

※1 世界の株式には、わが国の株式を含むことがあります。

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

ロ. 各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

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

ニ. 投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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

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

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

ロ. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

②有価証券の指図範囲

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

1. コマーシャル・ペーパー及び短期社債等

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

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

③金融商品の指図範囲

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

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

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

④当ファンドが、当ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、下記「(参考) 投資対象ファンドの概要」に記載されている通りです。

(参考) 投資対象ファンドの概要

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。ただし、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。また、投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。

以下の内容は、2025年1月31日現在、委託会社が知り得る情報に基づいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

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

1. 外国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース) (※) に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	MSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式
投資態度	<p>①原則としてMSCI コクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>②株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。</p> <p>③外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>⑥ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p> <p>⑦投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>⑧投資信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの</p>

	<p>(以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。) への投資は、投資信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑦投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑨デリバティブ取引等（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
決算日	年 1 回：5 月 29 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2000 年 5 月 30 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

2. 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCI コクサイセレクト指数（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目指します。</p> <p>②株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）を活用することがあります。このため、有価証券の組入総額とデリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。ただし、この投資信託において取引可能なものに限り。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイセレクト指数（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：6月25日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。

信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2021年7月8日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又は MSCI 指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI 当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。MSCI 及び MSCI 指数の名称は、MSCI 又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。いかなる MSCI 当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくは MSCI 指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI 又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCI が決定、構成、計算する MSCI 指数の所有者です。いかなる MSCI 当事者も、MSCI 指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなる MSCI 当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなる MSCI 当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCI は、MSCI が信頼できると考える情報源から MSCI 指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれの MSCI 当事者も、いかなる MSCI 指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI 当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなる MSCI 指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI 当事者は、MSCI 指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。さらに、MSCI 当事者は、いかなる種類の明示的、暗示的な保証をするものではなく、MSCI 指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合も MSCI 当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCI の許諾が必要かどうかを判断するために最初に MSCI に問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するために MSCI の商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCI の事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人も MSCI との関係を主張することはできません。

3. 新興国株式インデックス マザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主として取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）（※）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
投資態度	<p>①主として、取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、MSCI エマージング・マーケット・インデックスの騰落率に償還価格が概ね連動する債券を活用することがあります。</p> <p>②株式（DR（預託証券）を含みます。）の組入比率は、原則として、高位を維持します。</p> <p>③組入外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。</p> <p>④投資信託財産に属する資産の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引、金利に係るオプション取引、通貨に係る先物取引及び通貨に係るオプション取引並びに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引、並びに金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。</p> <p>⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式（新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、投資信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）
決算日	年1回：11月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

4. ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	フランクリン・テンプルトン・ジャパン株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、主に「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの投資対象> 日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券を主要投資対象とします。
投資態度	①「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。 ②MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）（※）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③「ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド」受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ④実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。 ⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。 <マザーファンドの投資態度> ①主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券に投資を行います。 ②MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。ただし、この目標の達成を約束するものではありません。 ③マクロ分析に基づくトップダウンの投資判断と、ボトムアップの個別銘柄分析

	<p>に基づく銘柄選択を合わせて、本源的価値に比べて割安と判断される銘柄を厳選し、ポートフォリオを構築します。</p> <p>④外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑤デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。</p> <p>⑥資金動向や市場動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>⑦運用の指図に関する権限を投資顧問会社であるブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。</p>
主な投資制限	<p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以内とします。</p> <p>③同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約券証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>⑥投資信託証券（マザーファンド受益証券及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>⑨外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)
決算日	年1回：9月15日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<p>原則、毎決算時に分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。）及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。</p> <p>※分配金は、決算日から起算して5営業日以内に支払われます。</p>
信託報酬	<p>純資産総額に対し、年率0.671%（税抜 0.61%）</p> <p>このほか、信託事務の諸費用及びその他諸費用（監査費用、印刷等費用、計理及びこれに付随する業務の委託等の費用、受益権の管理費用等。純資産総額の0.05%を上限）をファンドから支弁します。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。

設定日	2021年9月24日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を含む世界の主要先進国・新興国の株式で構成されています。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、円換算ベース）は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（税引き後配当込み、ドルベース）をもとに、委託者が独自に円換算したものです。MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権は、全て MSCI Inc. に帰属します。MSCI Inc. では、かかるデータに基づく投資による損失に一切責任を負いません。

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

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を除く世界各国の株式等を主要投資対象とします。
投資態度	①主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。 ②上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。 ③MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）（※）をベンチマークとします。 ④実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑤資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として日本を除く世界各国の企業が発行する株式等を中心に投資を行います。 ②徹底的なリサーチと行動ファイナンスのアプローチに基づき、市場の懸念によりファンダメンタルズよりも割安に評価されている銘柄を選定します。 ③運用にあたっては、Sanders Capital, LLC に運用指図に関する権限（国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。）を委託します。 ④MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）をベンチマークとします。 ⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ⑥資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。 ③新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資

	<p>産総額の 20%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第 341 条ノ 3 第 1 項第 7 号及び第 8 号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。</p> <p>⑥投資信託証券（上場投資信託証券等を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。</p> <p>⑦外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>⑧デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）及び外国為替予約取引は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的並びに価格変動リスク、金利変動リスク及び為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>⑨デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>⑩一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ベンチマーク	MSCI KOKUSAI Index（円換算ベース・配当込・税引後）
決算日	年 1 回：3 月 5 日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	<ul style="list-style-type: none"> ・ 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・ 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ・ 留保益（収益分配にあてず信託財産に留保した収益）については、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
信託報酬	純資産総額に対し、年率 0.7381%（税抜 0.671%）
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022 年 3 月 7 日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

※「MSCI KOKUSAI Index（配当込・税引後）」は、MSCI Inc. が公表している指数であり、日本を除く主要先進国の株式により構成されています。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利は MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託者が独自に円換算したものです。

6. 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社（*） *2025年9月1日付で「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」へ変更いたします。
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	世界エクイティ・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 ＜マザーファンドの投資対象＞ 日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。以下同じ。）
投資態度	①主として、世界エクイティ・マザーファンド受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ②マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。 なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ③ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 ＜マザーファンドの投資態度＞ ①主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ②株式の銘柄選定にあたっては、市場動向や銘柄毎の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 ③株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ④外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ⑤ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、並びに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 ⑥運用指図権限を日興アセットマネジメント ヨーロッパ リミテッド（*）に委託します。 *2025年9月1日付で「アモーヴァ・アセットマネジメント・UKリミテッド」へ変更いたします。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②投資信託証券（マザーファンド及び上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	年1回：5月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	原則として以下の通り収益分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益及び売買益（評価益を含む）等の全額とします。 ②分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 ③留保益は、運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
信託報酬	純資産総額に応じて以下の率を乗じて得た額とします。

	<ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704% (税抜 0.64%) ・純資産総額 100 億円超、200 億円以下の部分 年率 0.649% (税抜 0.59%) ・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594% (税抜 0.54%)
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2022 年 12 月 16 日
信託期間	2022 年 12 月 16 日から 2038 年 5 月 20 日まで
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

7. G I Mグローバル・セレクト株式ファンドF B (適格機関投資家専用)

運用会社	J Pモルガン・アセット・マネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、この投資信託にかかる信託財産（以下「信託財産」といいます。）の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。
主要投資対象	G I Mグローバル・セレクト株式マザーファンド（適格機関投資家専用）（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。 <マザーファンドの主要投資対象> 日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として、マザーファンドの受益証券に投資します。</p> <p>②外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）およびみなし保有外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。</p> <p>③MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）（※）をベンチマークとします。</p> <p>④資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、上記①～③にしたがった運用が行えない場合があります。</p> <p><マザーファンドの投資態度></p> <p>①主として、日本を除く世界各国の株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。</p> <p>②外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。</p> <p>③MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）をベンチマークとします。</p> <p>④資金動向、市況動向、経済情勢、投資環境等の変化に対応するために、やむを得ない事情がある場合には、上記①～③にしたがった運用が行えない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5 %以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資割合は、制限を設けません。</p> <p>④有価証券についての有価証券関連デリバティブ取引および有価証券関連デリバティブ取引以外のデリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定します。</p>

ベンチマーク	MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）
決算日	年1回：10月9日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。
信託報酬	純資産総額に対し、年率0.55%（税抜0.5%） その他の費用 <ul style="list-style-type: none"> ・ファンド監査にかかる費用として、信託財産の純資産総額に年0.022%（税抜0.02%）の率を乗じて得た額（ただし、年間330万円（税抜300万円）を上限とします。）を当ファンドより支弁します。 ・財務諸表その他この信託の内容にかかる開示または報告を行う資料の印刷等にかかる費用、振替受益権の管理に関する費用、この信託にかかる計理事務にかかる費用等は、ファンドの純資産総額に委託者が合理的な基準により決定する一定の率（上限年率0.033%（税抜0.03%））を乗じた額をその費用の合計額とみなして、毎日信託財産に費用計上します。
信託財産留保額	解約申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
設定日	2024年10月10日
信託期間	原則として無期限
運用の外部委託先	マザーファンドの運用の指図に関する権限を「J. P. モルガン・インベストメント・マネージメント・インク」に委託します。
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社

※「MSCI コクサイ指数」は、MSCI Inc. が発表しています。同インデックスに関する情報の確実性および完結性をMSCI Inc. は何ら保証するものではありません。著作権はMSCI Inc. に帰属しています。

MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）は、MSCI コクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）を運用会社にて円ベースに換算したものです。

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

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として世界各国の金融商品取引所（これに準ずるものを含みます。）に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。</p> <p>②投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス（ESG）や社会的規範を考慮した運用を行います。</p> <p>③市場動向によっては、非上場株式及び債券等に投資を行う場合があります。</p> <p>④市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②原則として同一銘柄の転換社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③原則として同一銘柄の新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④純資産総額の10%を超えての借入れは、行いません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年12月31日
収益の分配	期中無分配とします。
信託報酬	<p>年率0.525%</p> <p>その他の費用 ファンド管理費用がかかります。</p> <p>その他、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料及びデリバティブ取引に要する費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。</p>
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2019年11月7日
信託期間	無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社 キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル ・ 投資顧問会社 キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー ・ 管理事務代行会社 J.P. モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・ 名義書換事務受託会社 J.P. モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店） ・ 保管受託銀行 J.P. モルガン・エス・イー（ルクセンブルク支店）

9. Fisher Investments Institutional Global Developed Concentrated Equity Fund JPY Class Shares
(unhedged)

投資顧問会社	Fisher Asset Management, LLC
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>①主として世界各国の株式に投資することで、ベンチマークを上回る投資成果を目指します。</p> <p>②フィッシャーグループのグローバルなリサーチ・プラットフォームを活用し、トップダウンの視点で投資対象にアプローチします。</p> <p>③主に国、セクター、その他マクロ要因が株式リターンを左右するという見解に基づき、マクロ見通しを最大限に活用して投資銘柄を選定します。</p> <p>④資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資割合は、原則として高位を維持します。</p> <p>②デリバティブの利用は行いません。</p> <p>③投資信託財産の純資産総額を超える有価証券（現物に限ります。）の空売りは行いません。</p> <p>④投資信託財産の純資産総額の 10%を超える借り入れは行いません。</p> <p>⑤一発行会社（投資法人を含みます。）の発行済株式総数の 50%を超える株式（投資法人が発行する投資証券を含みます。）を取得しないものとします。</p> <p>⑥流動性に欠ける資産への投資は、投資信託財産の純資産総額の 15%以下とします。</p>
ベンチマーク	MSCI ワールド・インデックス (※)
決算日	年 1 回：9 月 30 日
収益の分配	無分配とします。
信託報酬	年率 0.7%（上限）
信託財産留保額	該当事項はありません。
その他の費用	投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、資産の保管等に要する諸費用、立替金の利息、借入金の利息、借入枠（コミットメントライン）に係る費用、組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等およびデリバティブ取引に要する費用等ならびに投資信託証券の設立・運営・運用等に要する諸費用等が投資信託財産から支弁されることがあります。
設定日	2016 年 5 月 27 日
信託期間	原則として無期限
関係法人	<ul style="list-style-type: none"> ・ 管理会社（マネージャー） Carne Global Fund Managers (Ireland) Limited ・ 投資顧問会社（インベストメントアドバイザー） Fisher Asset Management, LLC ・ 受託会社（トラスティ） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・ 管理事務代行会社（アドミニストレーター） State Street Fund Services (Ireland) Limited ・ 名義書換事務受託会社（トランスファーエージェント） State Street Fund Services (Ireland) Limited

	・ 保管受託銀行（カストディ） State Street Custodial Services (Ireland) Limited
--	--

※「MSCI ワールド・インデックス」は、先進市場の大型株および中型株の株式市場のパフォーマンスを測定するために設計された、浮動株調整時価総額加重指数です。2025年1月31日現在で、ベンチマークには次の23の先進市場国が含まれています：オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、香港、アイルランド、イスラエル、イタリア、日本、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スウェーデン、スイス、英国、米国。

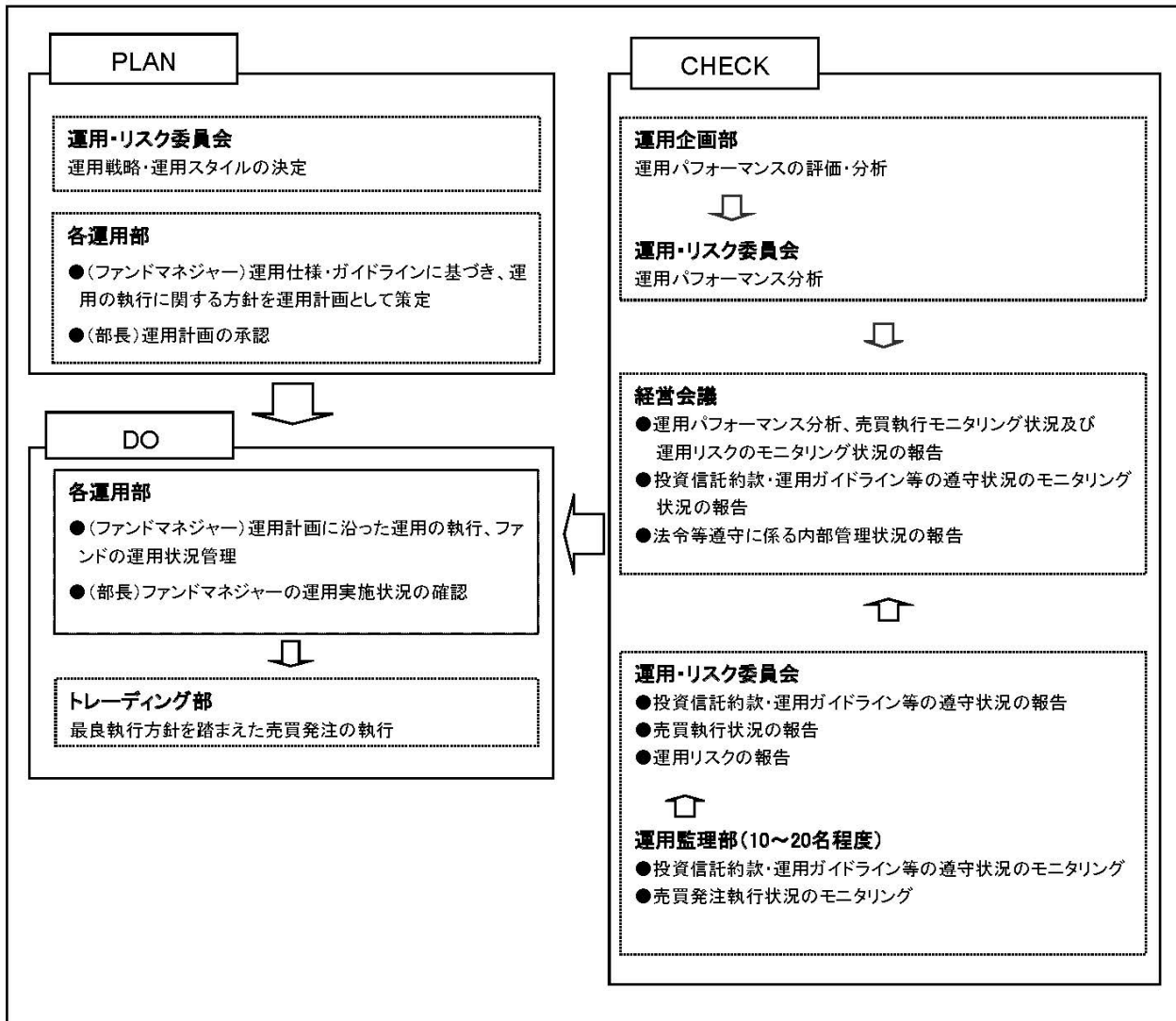
10. マネープールマザーファンド

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。また、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等にも投資します。
投資態度	<p>①主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>②公社債への投資割合は、原則として高位を維持することを基本とします。</p> <p>③株式以外の資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>④信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>⑤信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>⑥信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。</p> <p>⑦信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。</p> <p>⑧資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>①株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p>

	<p>⑤投資信託証券（上場投資信託を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑦デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
決算日	毎年11月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益の分配	該当事項はありません。
信託報酬	該当事項はありません。
信託財産留保額	該当事項はありません。
設定日	2010年2月26日
信託期間	原則として無期限
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

(3) 【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

(5) 【投資制限】

<約款に定める投資制限>

イ. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

ロ. 株式への投資

株式への直接投資は行いません。

ハ. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

ニ. デリバティブの利用

デリバティブの直接利用は行いません。

ホ. 公社債の借入れの指図、目的及び範囲

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

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

ヘ. 資金の借入れ

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

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

総額の10%を超えないこととします。

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

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

ト. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

チ. 外国為替予約取引の指図、目的及び範囲

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

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

<その他の投資制限>

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 為替変動リスク

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

③ 金利変動リスク

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

④ 信用リスク

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

⑤ 流動性リスク

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

⑥ カントリーリスク

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

⑦ 有価証券の貸付等に係るリスク

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

⑧ ESG の投資リスク

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

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

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

①同じ投資対象ファンドに投資する他のファンドによる追加設定や一部解約等があり、投資対象ファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

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

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

④ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要がある場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

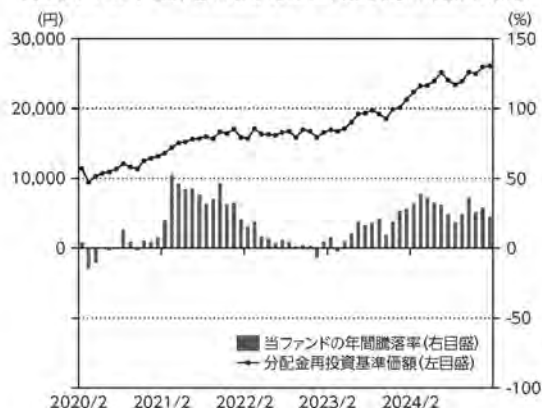
(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

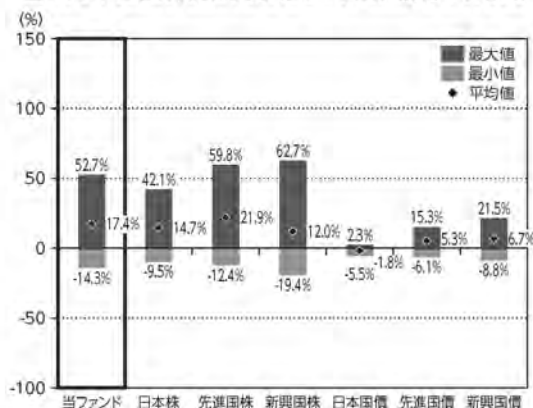
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2020年2月～2025年1月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を全面的に網羅することとし、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権限又は商標は、株式会社JPX総研又は商標は、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権限又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケットインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性・完全性・信頼性・有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのインデクサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は中断につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan 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)	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。本指数は特許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・頒布することは禁められています。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

- ①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.605%（税抜 0.55%）（※）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額×信託報酬率）。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.33% (税抜 0.3%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.22% (税抜 0.2%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.055% (税抜 0.05%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

- ②信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。
- ③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

なお上記のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬がかかります。

(参考)各投資対象ファンドの信託報酬等

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

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

なお、各投資対象ファンドとも、申込手数料、解約手数料はありません。

ファンド名	信託報酬
外国株式インデックス マザーファンド	ありません。
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	ありません。
新興国株式インデックス マザーファンド	ありません。
ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	年率 0.671% (税抜 0.61%)
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	年率 0.7381% (税抜 0.671%)
世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	<ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額 100 億円以下の部分 年率 0.704% (税抜 0.64%) ・純資産総額 100 億円超、200 億円以下の部分 年率 0.649% (税抜 0.59%) ・純資産総額 200 億円超の部分 年率 0.594% (税抜 0.54%)
GIMグローバル・セレクト株式ファンドFB（適格機関投資家専用）	年率 0.55% (税抜 0.5%)
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	年率 0.525%
Fisher Investments Institutional Global Developed Concentrated Equity Fund JPY Class Shares (unhedged)	年率 0.7% (上限)
マネープールマザーファンド	ありません。

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

◎実質的な信託報酬率：年率 0.605%～1.31%程度（税抜 0.55%～1.21%程度）

（投資対象とする投資信託証券：年率 0.0%～0.705%程度（税抜 0.0%～0.66%程度））

(4) 【その他の手数料等】

- ①投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
- ②借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。
- ③当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（※）、組入資産の保管に要する費用（※）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（投資対象ファンドにおいて負担する場合を含みます。）。
- ④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

※上記における役務提供の内容は以下の通りです。

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

投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬の中から支払うものとし、その額は、ファンドの純資産総額に年率0.055%（税抜0.05%）を乗じて得たものとします。

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

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

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

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

ロ. 一部解約金及び償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

ニ. 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

②法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

(2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。)

③個別元本について

- イ. 追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ. ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

※上記は、2025年1月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(1+2)	運用管理費用の比率 ¹	その他費用の比率 ²
1.16%	0.61%	0.55%

※対象期間は2023年6月27日～2024年6月25日です。

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

※投資先ファンドについては、入手し得る情報を基に記載しています。

※投資先ファンドにかかる費用は、その他費用に含まれています。

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

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

以下は、2025年1月31日現在の状況について記載してあります。

【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	154,461,210,574	51.54
投資証券	ルクセンブルク	69,099,151,959	23.05
親投資信託受益証券	日本	72,094,391,388	24.05
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	—	4,062,480,132	1.36
合計（純資産総額）		299,717,234,053	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 （％）
ルクセンブルク	投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	24,511,937.552	2,531.65	62,055,646,703	2,819	69,099,151,959	23.05
日本	投資信託受益証券	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュウ株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	33,497,468,940	1.8406	61,657,918,360	1.9587	65,611,492,412	21.89
日本	投資信託受益証券	ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）	28,842,547,301	1.5386	44,377,843,562	1.5618	45,046,290,374	15.03
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	6,001,135,144	6.8291	40,982,642,972	7.3806	44,291,978,043	14.78
日本	投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）	25,900,796,942	1.579	40,899,877,637	1.6912	43,803,427,788	14.61
日本	親投資信託受益証券	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	7,319,366,304	1.8101	13,248,784,947	1.9027	13,926,558,266	4.65
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	2,943,164,874	4.7132	13,871,800,080	4.7146	13,875,845,114	4.63
日本	親投資信託受益証券	マネープールマザーファンド	9,951	1.0007	9,957	1.0015	9,965	0.00

（注1）国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	51.54
投資証券	23.05
親投資信託受益証券	24.05
合計	98.64

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

		純資産総額 (円)		1 万口当たりの純資産額 (円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第 1 期計算期間末	(2016 年 6 月 27 日)	83,097,705,301	83,097,705,301	7,644	7,644
第 2 期計算期間末	(2017 年 6 月 26 日)	90,650,701,791	90,650,701,791	9,930	9,930
第 3 期計算期間末	(2018 年 6 月 25 日)	98,910,162,407	98,910,162,407	10,816	10,816
第 4 期計算期間末	(2019 年 6 月 25 日)	113,449,127,834	113,449,127,834	11,113	11,113
第 5 期計算期間末	(2020 年 6 月 25 日)	121,435,623,826	121,435,623,826	10,895	10,895
第 6 期計算期間末	(2021 年 6 月 25 日)	127,944,180,345	127,944,180,345	15,592	15,592
第 7 期計算期間末	(2022 年 6 月 27 日)	115,276,432,871	115,276,432,871	16,144	16,144
第 8 期計算期間末	(2023 年 6 月 26 日)	153,441,548,098	153,441,548,098	18,993	18,993
第 9 期計算期間末	(2024 年 6 月 25 日)	227,942,249,133	227,942,249,133	24,957	24,957
	2024 年 1 月末日	196,422,755,254	—	21,284	—
	2 月末日	208,297,509,638	—	22,384	—
	3 月末日	216,163,331,188	—	23,236	—
	4 月末日	206,625,893,369	—	23,292	—
	5 月末日	214,923,473,699	—	23,937	—
	6 月末日	229,848,905,797	—	25,170	—
	7 月末日	212,890,491,631	—	24,007	—
	8 月末日	213,637,780,937	—	23,385	—
	9 月末日	256,927,675,230	—	23,903	—
	10 月末日	294,051,596,181	—	25,223	—
	11 月末日	294,099,608,350	—	24,985	—
	12 月末日	308,639,910,642	—	25,951	—
	2025 年 1 月末日	299,717,234,053	—	26,118	—

②【分配の推移】

	期 間	1 万口当たりの分配金 (円)
第 1 期計算期間	2015 年 7 月 24 日～2016 年 6 月 27 日	0

第2期計算期間	2016年6月28日～2017年6月26日	0
第3期計算期間	2017年6月27日～2018年6月25日	0
第4期計算期間	2018年6月26日～2019年6月25日	0
第5期計算期間	2019年6月26日～2020年6月25日	0
第6期計算期間	2020年6月26日～2021年6月25日	0
第7期計算期間	2021年6月26日～2022年6月27日	0
第8期計算期間	2022年6月28日～2023年6月26日	0
第9期計算期間	2023年6月27日～2024年6月25日	0

③【収益率の推移】

	期 間	収益率 (%)
第1期計算期間	2015年7月24日～2016年6月27日	△23.6
第2期計算期間	2016年6月28日～2017年6月26日	29.9
第3期計算期間	2017年6月27日～2018年6月25日	8.9
第4期計算期間	2018年6月26日～2019年6月25日	2.7
第5期計算期間	2019年6月26日～2020年6月25日	△2.0
第6期計算期間	2020年6月26日～2021年6月25日	43.1
第7期計算期間	2021年6月26日～2022年6月27日	3.5
第8期計算期間	2022年6月28日～2023年6月26日	17.6
第9期計算期間	2023年6月27日～2024年6月25日	31.4
第10期中間計算期間	2024年6月26日～2024年12月25日	3.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第1期計算期間	2015年7月24日～2016年6月27日	126,093,324,843	17,381,346,697	108,711,978,146
第2期計算期間	2016年6月28日～2017年6月26日	25,620,095,279	43,040,023,741	91,292,049,684
第3期計算期間	2017年6月27日～2018年6月25日	30,797,173,447	30,638,095,389	91,451,127,742
第4期計算期間	2018年6月26日～2019年6月25日	31,491,912,896	20,859,263,672	102,083,776,966
第5期計算期間	2019年6月26日～2020年6月25日	42,158,524,192	32,781,101,015	111,461,200,143
第6期計算期間	2020年6月26日～2021年6月25日	16,401,038,627	45,805,791,473	82,056,447,297
第7期計算期間	2021年6月26日～2022年6月27日	21,792,471,284	32,445,893,017	71,403,025,564
第8期計算期間	2022年6月28日～2023年6月26日	23,098,117,154	13,712,585,207	80,788,557,511
第9期計算期間	2023年6月27日～2024年6月25日	38,185,724,106	27,641,682,793	91,332,598,824
第10期中間計算期間	2024年6月26日～2024年12月25日	36,618,138,111	9,158,800,339	118,791,936,596

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	626,231,972,952	72.75
	イギリス	30,310,424,119	3.52
	カナダ	27,451,087,477	3.19
	スイス	22,750,521,426	2.64
	フランス	21,656,389,891	2.52
	ドイツ	19,969,415,401	2.32
	アイルランド	15,699,328,388	1.82
	オーストラリア	13,923,847,520	1.62
	オランダ	13,511,741,412	1.57
	スウェーデン	6,745,972,115	0.78
	スペイン	5,726,977,854	0.67
	デンマーク	5,644,585,509	0.66
	イタリア	4,802,055,168	0.56
	香港	2,886,123,888	0.34
	シンガポール	2,575,587,919	0.30
	フィンランド	2,104,290,910	0.24
	イスラエル	2,001,514,580	0.23
	ベルギー	1,491,932,047	0.17
	ルクセンブルク	1,425,802,905	0.17
	ケイマン	1,249,687,051	0.15
	ノルウェー	1,240,800,186	0.14
	ジャージー	1,139,914,971	0.13
	バミューダ	900,607,035	0.10
	リベリア	810,566,592	0.09
	キュラソー	699,492,297	0.08
	ニュージーランド	604,096,530	0.07
オーストリア	401,799,133	0.05	
パナマ	382,150,072	0.04	
ポルトガル	285,995,720	0.03	
マン島	66,652,104	0.01	
	小計	834,691,333,172	96.97
新株予約権証券	カナダ	—	—
投資信託受益証券	香港	59,810,814	0.01
	オーストラリア	54,697,334	0.01
	小計	114,508,148	0.01

投資証券	アメリカ	12,845,872,271	1.49
	オーストラリア	891,550,382	0.10
	フランス	300,596,552	0.03
	シンガポール	204,445,032	0.02
	イギリス	199,067,105	0.02
	香港	151,420,836	0.02
	ベルギー	42,825,985	0.00
	カナダ	21,009,219	0.00
	小計	14,656,787,382	1.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	11,335,721,600	1.32
合計(純資産総額)		860,798,350,302	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,759,736,750	1.02
	買建	カナダ	298,832,238	0.03
	買建	ドイツ	1,412,324,544	0.16
	買建	イギリス	629,065,239	0.07
	買建	オーストラリア	263,594,565	0.03

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

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

資産の種類	買建 ／ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建	—	1,343,020,002	0.16

(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	1,217,224	29,774.75	36,242,551,961	36,691.02	44,661,194,632	5.19

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,963,841	17,634.36	34,631,082,516	19,249.69	37,803,349,116	4.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	565,406	66,389.45	37,536,997,324	64,086.90	36,235,121,004	4.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM	一般消費財・サービス流通・小売り	756,235	28,129.14	21,272,245,840	36,235.45	27,402,519,463	3.18
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	174,791	74,419.81	13,007,914,233	106,093.40	18,544,173,227	2.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	469,065	27,170.41	12,744,690,337	31,020.35	14,550,562,396	1.69
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	230,394	27,524.71	6,341,529,212	61,815.24	14,241,860,497	1.65
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	402,416	27,436.03	11,040,698,978	31,292.15	12,592,462,197	1.46
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	354,961	21,971.08	7,798,879,017	33,304.37	11,821,753,828	1.37
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	227,781	30,941.59	7,047,907,405	41,422.75	9,435,317,445	1.10
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	64,845	125,485.32	8,137,095,601	127,131.40	8,243,836,210	0.96
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	106,308	62,870.93	6,683,683,515	72,945.01	7,754,638,176	0.90
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	133,734	42,246.43	5,649,784,248	52,977.21	7,084,854,403	0.82
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	73,878	78,184.82	5,776,138,390	84,252.37	6,224,396,968	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	355,687	17,759.44	6,316,805,492	16,920.89	6,018,542,415	0.70
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サービス	66,022	69,002.41	4,555,677,285	87,408.92	5,770,912,000	0.67
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	355,106	10,120.47	3,593,839,647	15,234.51	5,409,869,282	0.63
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,586	126,054.80	4,485,786,134	151,188.51	5,380,194,470	0.63
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	34,199	100,541.65	3,438,423,940	150,297.45	5,140,022,602	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	79,596	51,013.86	4,060,499,344	64,011.23	5,095,038,261	0.59
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	187,519	25,240.03	4,732,986,911	25,853.12	4,847,952,391	0.56
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	193,182	22,402.27	4,327,716,084	23,607.71	4,560,585,425	0.53
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サ	76,537	41,628.15	3,186,093,778	53,057.51	4,060,863,033	0.47

			ービス						
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	558,868	6,081.45	3,398,729,698	7,214.96	4,032,215,630	0.47
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	141,776	24,218.20	3,433,560,534	27,125.62	3,845,763,248	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	32,142	142,774.79	4,589,067,532	113,326.41	3,642,537,534	0.42
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウ ェア・サ ービス	84,225	28,595.89	2,408,488,947	42,984.49	3,620,369,344	0.42
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	133,133	19,421.17	2,585,599,902	26,311.78	3,502,966,659	0.41
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	258,516	19,653.07	5,080,635,261	12,973.51	3,353,860,687	0.39
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギ ー	137,468	24,501.86	3,368,222,213	24,140.49	3,318,545,924	0.39

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	3.88
		素材	3.19
		資本財	6.94
		商業・専門サービス	1.57
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	2.18
		耐久消費財・アパレル	1.24
		消費者サービス	1.96
		メディア・娯楽	7.26
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.29
		生活必需品流通・小売り	1.85
		食品・飲料・タバコ	2.67
		家庭用品・パーソナル用品	1.42
		ヘルスケア機器・サービス	3.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.72
		銀行	5.86
		金融サービス	7.46
		保険	2.97
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.04
ソフトウェア・サービス	10.00		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.73
		電気通信サービス	1.12
		公益事業	2.49
		半導体・半導体製造装置	8.50
		不動産管理・開発	0.28
		小計	96.97
新株予約権証券	—	—	—
投資信託受益証券	—	—	0.01
投資証券	—	—	1.70
合計			98.68

(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	186	アメリカドル	56,900,465.6	8,787,138,902	56,723,025	8,759,736,750	1.02
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	9	カナダドル	2,725,176.5	290,204,045	2,806,200	298,832,238	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	22	スイスフラン	2,601,474	441,183,975	2,767,160	469,282,664	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	111	ユーロ	5,566,625.2	892,664,016	5,880,780	943,041,880	0.11
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	13	オーストラリアドル	2,707,016	259,521,624	2,749,500	263,594,565	0.03
	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	38	イギリスポンド	3,147,862.5	603,413,762	3,281,680	629,065,239	0.07

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

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

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	8,700,000.00	1,345,219,000	1,343,020,002	0.16

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

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

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	14,808,448,708	71.40
	イギリス	706,326,183	3.41
	カナダ	688,773,432	3.32
	フランス	563,176,694	2.72
	アイルランド	554,842,545	2.68
	スイス	480,704,888	2.32
	オランダ	388,286,587	1.87
	オーストラリア	268,588,025	1.29
	デンマーク	239,401,315	1.15
	ドイツ	233,322,855	1.12
	スウェーデン	180,185,034	0.87
	イタリア	116,693,225	0.56
	スペイン	104,208,112	0.50
	香港	87,251,207	0.42
	フィンランド	72,553,163	0.35
	ノルウェー	51,548,688	0.25
	リベリア	39,083,390	0.19
	シンガポール	34,126,355	0.16
	キュラソー	33,491,657	0.16
	バミューダ	23,614,371	0.11
	ベルギー	17,767,529	0.09
	ジャージー	15,525,377	0.07
	ニュージーランド	11,852,547	0.06
	ポルトガル	7,864,601	0.04
	オーストリア	6,347,413	0.03
	イスラエル	6,083,477	0.03
ケイマン	4,786,589	0.02	
ルクセンブルク	3,592,446	0.02	
	小計	19,748,446,413	95.21
投資信託受益証券	オーストラリア	3,502,888	0.02
投資証券	アメリカ	317,182,340	1.53
	オーストラリア	25,760,829	0.12
	イギリス	9,055,817	0.04
	シンガポール	8,317,381	0.04
	フランス	3,412,893	0.02
	ベルギー	1,850,465	0.01
		小計	365,579,725

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	623,904,672	3.01
合計(純資産総額)		20,741,433,698	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	470,953,588	2.27
	買建	ドイツ	93,454,600	0.45

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建	—	17,840,437	△0.09

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	91,339	18,523.87	1,691,952,539	19,249.69	1,758,248,303	8.48
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	26,294	68,458.81	1,800,056,186	64,086.90	1,685,101,098	8.12
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	21,817	27,241.45	594,326,758	31,020.35	676,771,065	3.26
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	10,706	30,121.57	322,481,545	61,815.24	661,793,964	3.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	18,717	27,499.35	514,705,335	31,292.15	585,695,188	2.82
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	3,009	137,898.26	414,935,890	127,131.40	382,538,409	1.84
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	6,221	43,132.29	268,326,032	52,977.21	329,571,233	1.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	金融サー ビス	3,073	71,680.22	220,273,343	87,408.92	268,607,624	1.30

アメリカ	株式	HOME DEPOT	一般消費財・サービス流通・小売り	3,699	55,617.96	205,730,850	64,011.23	236,777,558	1.14
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	8,750	26,120.29	228,552,539	25,853.12	226,214,855	1.09
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,964	23,405.41	209,806,102	23,607.71	211,619,549	1.02
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	3,560	38,088.61	135,595,470	53,057.51	188,884,754	0.91
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,488	145,167.49	216,009,230	113,326.41	168,629,701	0.81
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	12,029	20,652.96	248,434,510	12,973.51	156,058,388	0.75
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	15,244	10,058.02	153,324,546	9,891.24	150,782,085	0.73
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	9,439	19,923.01	188,053,332	15,280.84	144,235,929	0.70
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	2,327	48,690.23	113,302,176	58,799.22	136,825,791	0.66
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	3,430	28,362.61	97,283,766	39,884.63	136,804,302	0.66
アメリカ	株式	GE AEROSPACE	資本財	4,038	25,544.26	103,147,747	31,746.17	128,191,055	0.62
イギリス	株式	ASTRAZENECA	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5,773	23,687.13	136,745,821	21,687.80	125,203,708	0.60
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	1,780	69,413.19	123,555,490	68,934.46	122,703,345	0.59
アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフトウェア・サービス	768	119,663.17	91,901,318	156,398.98	120,114,419	0.58
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	5,109	26,046.16	133,069,851	23,457.91	119,846,498	0.58
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,672	41,367.16	110,533,062	44,834.11	119,796,762	0.58
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・娯楽	6,754	15,534.11	104,917,404	17,516.99	118,309,784	0.57
フランス	株式	LVMH	耐久消費財・アパレル	1,025	113,254.24	116,085,606	114,785.68	117,655,330	0.57
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエ	7,339	16,375.61	120,180,605	15,907.54	116,745,451	0.56

			ンス						
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1,639	80,890.43	132,579,421	68,875.77	112,887,403	0.54
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	6,027	24,588.34	148,193,953	18,355.54	110,628,899	0.53
イギリス	株式	HSEB HOLDINGS PLC (GB)	銀行	67,740	1,318.82	89,337,354	1,610.57	109,100,647	0.53

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.44
		素材	3.33
		資本財	6.42
		商業・専門サービス	1.62
		運輸	1.58
		自動車・自動車部品	3.33
		耐久消費財・アパレル	1.91
		消費者サービス	1.97
		メディア・娯楽	7.74
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.44
		生活必需品流通・小売り	0.78
		食品・飲料・タバコ	2.19
		家庭用品・パーソナル用品	2.46
		ヘルスケア機器・サービス	2.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.35
		銀行	3.40
		金融サービス	8.73
		保険	3.48
		エクイティ不動産投資信託 (REIT)	0.06
		ソフトウェア・サービス	14.74
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.62
電気通信サービス	0.81		
公益事業	1.55		
半導体・半導体製造装置	11.88		
不動産管理・開発	0.21		
	小計	95.21	
投資信託受益証券	—	—	0.02
投資証券	—	—	1.76
合計			96.99

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P 500 EMIN	買建	10	アメリカドル	3,065,648.5	473,428,097	3,049,625	470,953,588	2.27
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	11	ユーロ	546,190.2	87,587,060	582,780	93,454,600	0.45

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

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

種類	資産の名称	買建 ／ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	売建	100,000.00	15,440,000	15,435,808	△0.07
	ユーロ	売建	15,000.00	2,404,065	2,404,629	△0.01

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	台湾	43,625,999,622	18.91
	インド	40,391,015,298	17.51
	ケイマン	36,846,543,943	15.97
	中国	23,199,639,740	10.06
	韓国	21,112,778,571	9.15
	サウジアラビア	9,278,477,716	4.02
	ブラジル	8,443,536,358	3.66
	南アフリカ	6,097,143,573	2.64
	メキシコ	3,706,643,514	1.61
	マレーシア	3,211,709,687	1.39
	インドネシア	3,143,207,712	1.36
	アラブ首長国連邦	3,129,020,388	1.36
	タイ	3,059,119,555	1.33

	ポーランド	1,951,714,985	0.85
	香港	1,811,846,877	0.79
	カタール	1,791,681,216	0.78
	クウェート	1,728,897,302	0.75
	トルコ	1,479,142,735	0.64
	ギリシャ	1,126,070,561	0.49
	フィリピン	1,086,198,707	0.47
	チリ	1,008,171,318	0.44
	バミューダ	795,279,736	0.34
	アメリカ	718,735,085	0.31
	ハンガリー	603,655,956	0.26
	イギリス	405,447,078	0.18
	ルクセンブルク	363,332,523	0.16
	チェコ	336,051,307	0.15
	コロンビア	273,919,519	0.12
	エジプト	111,551,420	0.05
	シンガポール	79,703,355	0.03
	ペルー	72,942,648	0.03
	ロシア	—	—
	英ヴァージン諸島	—	—
	小計	220,989,178,005	95.79
投資信託受益証券	ブラジル	335,110,157	0.15
	メキシコ	119,252,253	0.05
	小計	454,362,410	0.20
投資証券	メキシコ	203,998,958	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	9,065,508,660	3.93
合計(純資産総額)		230,713,048,033	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	9,047,317,068	3.92

(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	—	63,293,012	0.03

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	4,533,389	5,139.46	23,299,199,084	5,359.69	24,297,591,423	10.53
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	1,194,800	8,329.42	9,951,997,206	7,951.78	9,500,791,523	4.12
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2,995,288	1,842.52	5,518,886,654	1,750.10	5,242,071,501	2.27
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	879,794	6,067.28	5,337,962,691	5,713.68	5,026,861,382	2.18
インド	株式	HDFC BANK LTD	銀行	1,042,664	3,151.40	3,285,852,029	3,028.85	3,158,082,240	1.37
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	904,050	3,801.47	3,436,724,378	2,937.32	2,655,487,762	1.15
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1,105,776	2,298.36	2,541,471,328	2,243.94	2,481,299,421	1.08
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	100,741	21,259.07	2,141,660,600	23,514.39	2,368,864,170	1.03
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	127,681	18,125.12	2,314,234,308	17,821.22	2,275,431,446	0.99
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	17,701,620	122.44	2,167,554,397	125.46	2,220,855,866	0.96
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	961,368	2,256.89	2,169,702,560	2,244.74	2,158,030,337	0.94
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	2,824,200	561.01	1,584,431,985	759.10	2,143,867,165	0.93
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	613,702	3,280.33	2,013,149,705	3,329.13	2,043,094,660	0.89
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	2,289,248	1,028.98	2,355,597,943	849.99	1,945,851,643	0.84
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	277,804	6,044.41	1,679,162,943	6,918.02	1,921,854,462	0.83
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	354,607	3,868.31	1,371,730,513	4,082.75	1,447,775,275	0.63
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	472,159	2,811.24	1,327,354,055	2,936.40	1,386,450,284	0.60

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	444,911	3,078.04	1,369,456,524	3,109.75	1,383,565,542	0.60
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	12,791,515	96.21	1,230,735,534	104.84	1,341,162,206	0.58
ケイマン	株式	TRIP.COM GROUP LTD	消費者サービス	114,607	10,367.68	1,188,209,741	10,861.36	1,244,787,886	0.54
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	1,075,496	1,157.01	1,244,370,102	1,146.47	1,233,026,050	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	167,114	7,429.23	1,241,528,816	7,343.38	1,227,182,524	0.53
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	14,349,200	74.72	1,072,192,313	79.67	1,143,292,599	0.50
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	338,630	2,366.50	801,370,604	3,191.02	1,080,575,103	0.47
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	1,238,000	983.69	1,217,809,826	864.15	1,069,820,176	0.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	32,598	33,931.64	1,106,103,643	32,431.93	1,057,216,237	0.46
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	500,000	2,351.96	1,175,984,450	2,075.53	1,037,769,600	0.45
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	187,000	5,525.81	1,033,327,592	5,410.86	1,011,830,820	0.44
ブラジル	株式	VALE SA	素材	621,587	1,592.52	989,893,315	1,445.43	898,463,288	0.39
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA PT	銀行	10,195,000	95.71	975,788,937	86.92	886,200,375	0.38

(注1) 国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	4.35
		素材	5.55
		資本財	4.50
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	1.70
		自動車・自動車部品	3.41
		耐久消費財・アパレル	1.14
		消費者サービス	2.75
		メディア・娯楽	6.20
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.25
		生活必需品流通・小売り	1.09
		食品・飲料・タバコ	2.75
		家庭用品・パーソナル用品	0.60
		ヘルスケア機器・サービス	0.81
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.44		

		銀行	17.29
		金融サービス	2.57
		保険	2.88
		ソフトウェア・サービス	2.50
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.46
		電気通信サービス	2.75
		公益事業	2.48
		半導体・半導体製造装置	13.83
		不動産管理・開発	1.44
		小計	95.79
投資信託受益証券	—	—	0.20
投資証券	—	—	0.09
合計			96.07

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCI EMERG M	買建	1,062	アメリカドル	58,454,093	9,027,065,581	58,585,230	9,047,317,068	3.92

(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	410,000.00	63,418,800	63,293,012	0.03

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

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

マネープールマザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	72,962,062,000	51.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	69,905,185,492	48.93
合計(純資産総額)		142,867,247,492	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1220回国庫 短期証券	45,000,000,000	99.94	44,973,360,000	99.95	44,981,550,000	—	2025/3/21	31.48
日本	国債証券	第1226回国庫 短期証券	28,000,000,000	99.91	27,974,800,000	99.93	27,980,512,000	—	2025/4/21	19.58

(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	51.07
合計	51.07

(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。

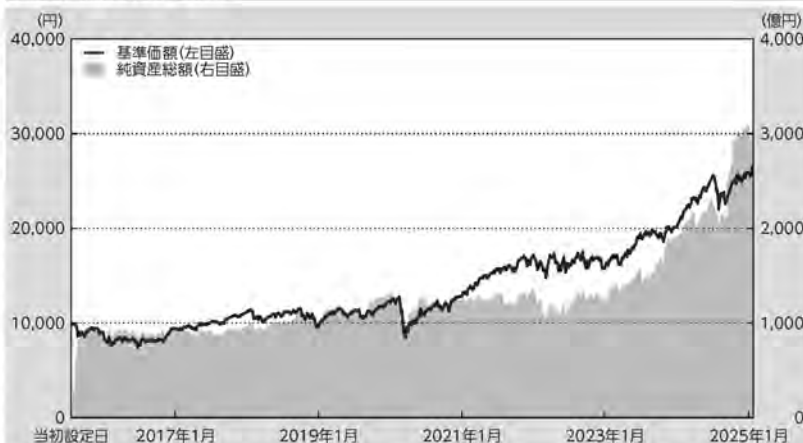
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

運用実績

当初設定日：2015年7月24日
作成基準日：2025年1月31日

基準価額・純資産の推移



基準価額 26,118円

純資産総額 2,997.17億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年6月	0円
2021年6月	0円
2022年6月	0円
2023年6月	0円
2024年6月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

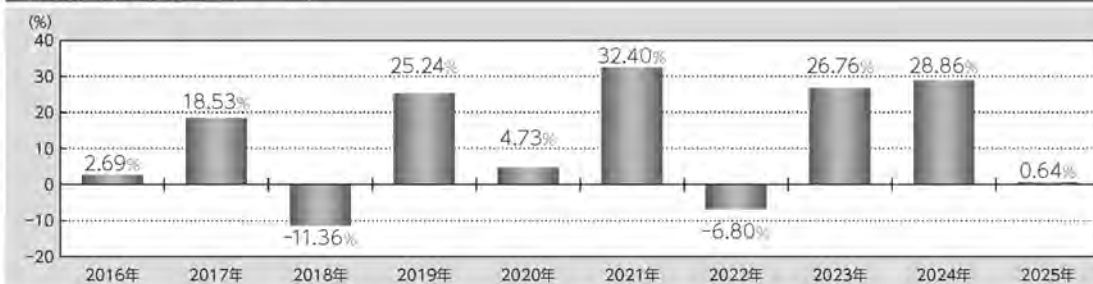
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

投資信託証券	投資比率
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	23.1%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	21.9%
ブランドワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	15.0%
外国株式インデックス マザーファンド	14.8%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	14.6%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	4.6%
新興国株式インデックス マザーファンド	4.6%
マネーボールマザーファンド	0.0%

※投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2025年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<申込手続>

受益権取得申込者は、販売会社と投資一任契約を締結されている投資者等に限るものとし、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

<申込コース>

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

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

<申込みの受付>

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

<申込単位>

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

<申込価額>

取得申込受付日の翌々営業日の基準価額とします。

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

<申込手数料>

ありません。

<申込代金の支払い>

販売会社が定める期日までにお支払いください。

<受付不可日>

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

アイルランドの銀行休業日

<申込受付の中止等>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

<一部解約手続>

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

<一部解約の受付>

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

<一部解約単位>

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<解約価額>

一部解約の実行の請求受付日の翌々営業日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

<一部解約代金の支払い>

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

<受付不可日>

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

- ニューヨーク証券取引所の休業日
- ロンドン証券取引所の休業日
- ニューヨークの銀行休業日
- ロンドンの銀行休業日
- アイルランドの銀行休業日

<一部解約受付の中止等>

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

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

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部

解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

①国内投資信託受益証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の評価方法

計算日の当日又は前営業日の基準価額で評価します。

②外国投資信託証券の評価方法

原則として計算日に入手し得る直近の純資産価格（基準価額）で評価します。

③マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

④マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

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

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

B. 公社債等

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

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

⑤外貨建資産等の円換算

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

<基準価額の照会方法>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。(2015年7月24日設定)

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとします。

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

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

(5) 【その他】

<投資信託契約の終了(償還)と手続き>

(1) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)

- ① 委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了(繰上償還)させることができます。
 - ・ 受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
 - ・ 投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
 - ・ やむを得ない事情が発生した場合
- ② 委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。
- ③ 委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。
- ④ 委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2) 投資信託契約の終了(ファンドの繰上償還)に係る書面決議の手続き

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

- ① 委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ② 受益者(委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③ 上記①の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

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

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

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

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

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

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

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

- ①委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合は除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ②受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ③上記①の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ④書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑤上記①から④までの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑥当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

<受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い>

- ①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

<運用報告書>

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

<関係法人との契約の更改手続き>

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

<公告>

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

<混蔵寄託>

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

<投資信託財産の登記等及び記載等の留保等>

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

- ①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ②収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③上記②の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- ④上記②に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ⑤受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 償還金に対する請求権

- ①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
- ②償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。
- ③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2023年6月27日から2024年6月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年9月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式SMTBセレクション（SMA専用）の2023年6月27日から2024年6月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、外国株式SMTBセレクション（SMA専用）の2024年6月25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드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

1 【財務諸表】

【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2023年6月26日現在)	第9期 (2024年6月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,495,533,974	4,066,046,334
投資信託受益証券	61,316,692,270	134,456,135,832
投資証券	15,780,131,156	34,675,702,889
親投資信託受益証券	74,967,957,036	55,614,959,233
未収入金	1,300,146,284	-
未収利息	-	7,618
流動資産合計	154,860,460,720	228,812,851,906
資産合計	154,860,460,720	228,812,851,906
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,003,268,721	247,306,911
未払受託者報酬	37,684,290	56,544,745
未払委託者報酬	376,842,831	565,447,324
未払利息	3,667	-
その他未払費用	1,113,113	1,303,793
流動負債合計	1,418,912,622	870,602,773
負債合計	1,418,912,622	870,602,773
純資産の部		
元本等		
元本	80,788,557,511	91,332,598,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	72,652,990,587	136,609,650,309
(分配準備積立金)	46,197,119,278	82,450,715,233
元本等合計	153,441,548,098	227,942,249,133
純資産合計	153,441,548,098	227,942,249,133
負債純資産合計	154,860,460,720	228,812,851,906

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2022年6月28日	至 2023年6月26日	自 2023年6月27日	至 2024年6月25日
営業収益				
受取利息		11,794		751,578
有価証券売買等損益		23,725,047,314		55,684,990,465
営業収益合計		23,725,059,108		55,685,742,043
営業費用				
支払利息		1,299,138		832,477
受託者報酬		72,436,150		101,411,634
委託者報酬		724,361,423		1,014,116,127
その他費用		2,205,030		2,494,979
営業費用合計		800,301,741		1,118,855,217
営業利益又は営業損失(△)		22,924,757,367		54,566,886,826
経常利益又は経常損失(△)		22,924,757,367		54,566,886,826
当期純利益又は当期純損失(△)		22,924,757,367		54,566,886,826
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)		1,118,079,592		5,745,920,139
期首剰余金又は期首欠損金(△)		43,873,407,307		72,652,990,587
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,494,563,851		40,467,322,580
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,494,563,851		40,467,322,580
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,521,658,346		25,331,629,545
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,521,658,346		25,331,629,545
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		72,652,990,587		136,609,650,309

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
2. その他	<p>ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月26日から翌年6月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は2023年6月27日から2024年6月25日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第8期 (2023年6月26日現在)	第9期 (2024年6月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,788,557,511口	91,332,598,824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) 1,899円 (18,993円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,495円 (24,957円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日	第9期 自 2023年6月27日 至 2024年6月25日																																																												
分配金の計算過程	分配金の計算過程																																																												
<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">1,310,217,362円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">20,496,460,413円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">26,818,707,232円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">24,390,441,503円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E=A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">73,015,826,510円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">80,788,557,511口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G=E/F×10,000</td> <td style="text-align: right;">9,037円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">-円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I=F×H/10,000</td> <td style="text-align: right;">-円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,310,217,362円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,496,460,413円	収益調整金額	C	26,818,707,232円	分配準備積立金額	D	24,390,441,503円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,015,826,510円	当ファンドの期末残存口数	F	80,788,557,511口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,037円	1万口当たり分配金額	H	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円	<table border="1" style="width: 100%;"> <thead> <tr> <th style="width: 30%;">項目</th> <th style="width: 10%;"></th> <th style="width: 60%;"></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td style="text-align: center;">A</td> <td style="text-align: right;">914,503,758円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td style="text-align: center;">B</td> <td style="text-align: right;">47,906,462,929円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td style="text-align: center;">C</td> <td style="text-align: right;">54,158,935,076円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td style="text-align: center;">D</td> <td style="text-align: right;">33,629,748,546円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td style="text-align: center;">E=A+B+C+D</td> <td style="text-align: right;">136,609,650,309円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td style="text-align: center;">F</td> <td style="text-align: right;">91,332,598,824口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td style="text-align: center;">G=E/F×10,000</td> <td style="text-align: right;">14,957円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td style="text-align: center;">H</td> <td style="text-align: right;">-円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td style="text-align: center;">I=F×H/10,000</td> <td style="text-align: right;">-円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	914,503,758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	47,906,462,929円	収益調整金額	C	54,158,935,076円	分配準備積立金額	D	33,629,748,546円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	136,609,650,309円	当ファンドの期末残存口数	F	91,332,598,824口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,957円	1万口当たり分配金額	H	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,310,217,362円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,496,460,413円																																																											
収益調整金額	C	26,818,707,232円																																																											
分配準備積立金額	D	24,390,441,503円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	73,015,826,510円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	80,788,557,511口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,037円																																																											
1万口当たり分配金額	H	-円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	914,503,758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	47,906,462,929円																																																											
収益調整金額	C	54,158,935,076円																																																											
分配準備積立金額	D	33,629,748,546円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	136,609,650,309円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	91,332,598,824口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,957円																																																											
1万口当たり分配金額	H	-円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円																																																											

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第9期 自 2023年6月27日 至 2024年6月25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9期 (2024年6月25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8期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日	第9期 自 2023年6月27日 至 2024年6月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	71,403,025,564 円	80,788,557,511 円
期中追加設定元本額	23,098,117,154 円	38,185,724,106 円
期中一部解約元本額	13,712,585,207 円	27,641,682,793 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 (2023年6月26日現在)	第9期 (2024年6月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	9,846,836,329	28,650,751,944
投資証券	2,659,134,781	9,652,262,110

親投資信託受益証券	11,047,965,717	13,965,763,893
合計	23,553,936,827	52,268,777,947

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
投資信託受益証券	世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	21,582,872,972	34,344,825,760	
	ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	17,778,527,839	33,368,518,901	
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	14,318,751,699	33,661,953,369	
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	21,319,093,770	33,080,837,802	
投資信託受益証券合計		74,999,246,280	134,456,135,832	
投資証券	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	13,429,784,233	34,675,702,889	
投資証券合計		13,429,784,233	34,675,702,889	
親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	2,287,415,109	10,910,055,103	
	外国株式インデックス マザーファンド	4,902,262,860	33,753,550,469	
	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	5,964,784,153	10,951,343,704	
	マネープールマザーファンド	9,951	9,957	
親投資信託受益証券合計		13,154,472,073	55,614,959,233	
合計			224,746,797,954	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年6月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	17,573,957,927
コール・ローン	569,561,022
株式	756,800,302,315
投資信託受益証券	130,529,675
投資証券	13,895,457,396
派生商品評価勘定	121,591,258
未収入金	8,939,599
未収配当金	803,082,124
未収利息	1,067
差入委託証拠金	7,386,683,399
流動資産合計	797,290,105,782
資産合計	797,290,105,782
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,348,283
前受金	119,477,379
未払解約金	843,665,514
流動負債合計	964,491,176
負債合計	964,491,176
純資産の部	
元本等	
元本	115,656,611,339
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	680,669,003,267
元本等合計	796,325,614,606
純資産合計	796,325,614,606
負債純資産合計	797,290,105,782

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年6月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。

	<p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)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> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2024年 6月 25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		115,656,611,339 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)	6.8853 円 (68,853 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

		2024年 6月 25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。	

2. 金融商品の時価等に関する事項

		2024年 6月 25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	121,001,727,313円
期中追加設定元本額	12,133,259,917円
期中一部解約元本額	17,478,375,891円
期末元本額	115,656,611,339円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,421,176,378円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,530,473円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,337,693,433円
世界経済インデックスファンド	14,098,496,699円
外国株式インデックス・オープン	881,216,462円
DCマイセレクション25	529,448,423円
DCマイセレクション50	2,989,713,500円
DCマイセレクション75	4,003,811,011円
DC外国株式インデックス・オープン	13,295,771,417円
DCマイセレクションS25	325,437,782円
DCマイセレクションS50	1,777,694,195円
DCマイセレクションS75	1,934,642,108円
DCターゲット・イヤーフアンド2025	12,824,023円
DCターゲット・イヤーフアンド2035	125,054,567円
DCターゲット・イヤーフアンド2045	102,534,252円
DC世界経済インデックスファンド	9,164,970,747円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	866,040,372円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,770,669円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,592,530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)	19,948,202円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	5,151,557円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	25,303,358円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	5,981,360円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	17,462,164円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	117,492,181円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	108,681,189円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	837,922,900円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	55,429,884円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,067,435円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	93,018,309円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	30,942,071円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	676,684,589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)	701,759,620円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,159,083,788円
コア投資戦略ファンド(安定型)	111,815,412円
コア投資戦略ファンド(成長型)	273,795,458円
分散投資コア戦略ファンドA	1,437,950,181円
分散投資コア戦略ファンドS	6,788,284,040円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,531,880,039円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	979,497,444円
コア投資戦略ファンド(切替型)	119,535,001円

世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	429,333,270 円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,424,443 円
SMT インデックスバランス・オープン	112,629,507 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	65,295,576 円
外国株式SMT Bセクション（SMA専用）	4,902,262,860 円
SMT 世界経済インデックス・オープン	259,069,578 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,197,281,395 円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	194,620,050 円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,447,557 円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	2,422,924,755 円
グローバル経済コア	730,944,380 円
SBI 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,574,762 円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,997,812 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	114,572,329 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	29,143,797 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	154,344,746 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	176,310,778 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	77,477,540 円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	97,919,987 円
10資産分散投資ファンド	60,929,484 円
グローバル10資産バランスファンド	16,769,150 円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	664,528 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2035	20,814 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2040	22,941 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2045	24,654 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2050	24,654 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2055	22,738 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2060	14,732 円
DCターゲット・イヤーフンド（ライフステージ対応型）2065	11,713 円
DCマイセクションS50（2024-2026リスク抑制型）	1,502 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）	47,131,471 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）	230,234,715 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）	572,147,457 円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,425,103,503 円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	118,012,863 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）	60,868,495 円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	78,072,880 円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	80,458,146 円
SMT AM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	161,828,459 円
SMT AM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	156,318,641 円
SMT AM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	155,645,401 円
SMT AM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	157,998,954 円
SMT AM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	156,432,494 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）	78,612,474 円
SMT AM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	99,558,131 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		12,321,976,636
投資信託受益証券		△4,674,507
投資証券		483,595,633

合計	12,800,897,762
----	----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年6月25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	25,235,482,954	—	25,354,960,333	119,477,379
合計		25,235,482,954	—	25,354,960,333	119,477,379

(注)1.時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2024年6月25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	51,043,200	—	51,043,616	416
	アメリカドル	51,043,200	—	51,043,616	416
	売建	415,558,000	—	414,792,820	765,180
	アメリカドル	415,558,000	—	414,792,820	765,180
合計		466,601,200	—	465,836,436	765,596

(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	評価額	備考
----	----	-----	-----	----

		(株)	単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	33,009	29.34	968,484.06	
	BAKER HUGHES CO	77,332	34.41	2,660,994.12	
	CHENIERE ENERGY INC	18,099	165.96	3,003,710.04	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	8,482	84.78	719,103.96	
	CHEVRON CORP	135,746	159.31	21,625,695.26	
	CHORD ENERGY CORP	4,800	168.90	810,720.00	
	CONOCOPHILLIPS	90,345	115.17	10,405,033.65	
	COTERRA ENERGY INC	54,546	27.65	1,508,196.90	
	DEVON ENERGY CORPORATION	50,256	47.64	2,394,195.84	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,267	198.03	2,627,264.01	
	EOG RESOURCES INC	45,763	125.30	5,734,103.90	
	EQT CORPORATION	34,139	38.52	1,315,034.28	
	EXXON MOBIL	346,986	114.05	39,573,753.30	
	HALLIBURTON CO	70,302	34.34	2,414,170.68	
	HESS CORP	21,602	150.37	3,248,292.74	
	HF SINCLAIR CORP	13,429	53.81	722,614.49	
	KINDER MORGAN INC	160,038	20.11	3,218,364.18	
	MARATHON OIL CORP	39,344	28.74	1,130,746.56	
	MARATHON PETROLEUM CORP	27,588	173.99	4,800,036.12	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	49,406	63.25	3,124,929.50	
	ONEOK INC	43,535	80.89	3,521,546.15	
	OVINTIV INC	20,398	47.21	962,989.58	
	PHILLIPS 66	32,264	138.55	4,470,177.20	
	SCHLUMBERGER	110,287	47.48	5,236,426.76	
	TARGA RESOURCES CORP	17,298	128.60	2,224,522.80	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,599	747.70	1,195,572.30	
	VALERO ENERGY CORP	26,282	150.73	3,961,485.86	
	WILLIAMS COS	97,655	43.11	4,209,907.05	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	17,479	270.90	4,735,061.10	
	ALBEMARLE CORP	8,403	96.40	810,049.20	
	AMCOR PLC	110,292	10.01	1,104,022.92	
	AVERY DENNISON CORP	6,638	229.52	1,523,553.76	
BALL CORP	25,896	61.58	1,594,675.68		
CELANESE CORP-SERIES A	8,582	139.05	1,193,327.10		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,872	75.60	973,123.20		

CLEVELAND-CLIFFS INC	43,000	14.74	633,820.00
CORTEVA INC	51,757	52.91	2,738,462.87
CROWN HOLDINGS INC	9,940	79.20	787,248.00
DOW INC	56,967	54.62	3,111,537.54
DUPONT DE NEMOURS INC	34,119	81.08	2,766,368.52
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,832	100.65	888,940.80
ECOLAB INC	20,345	244.64	4,977,200.80
FREEPORT-MCMORAN INC	110,698	50.38	5,576,965.24
INT'L PAPER CO	25,191	47.32	1,192,038.12
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,307	97.86	1,889,383.02
LINDE PLC	37,432	443.14	16,587,616.48
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,745	97.52	1,925,532.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,017	541.17	2,715,049.89
MOSAIC CO/THE	27,732	29.11	807,278.52
NEWMONT CORPORATION	86,194	42.60	3,671,864.40
NUCOR CORP	18,727	155.56	2,913,172.12
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,221	189.76	1,180,496.96
PPG INDUSTRIES INC	17,495	128.15	2,241,984.25
RELIANCE INC	4,126	282.10	1,163,944.60
RPM INTERNATIONAL INC	10,456	109.94	1,149,532.64
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,426	300.55	5,537,934.30
STEEL DYNAMICS INC	11,618	126.34	1,467,818.12
VULCAN MATERIALS CO	10,153	247.58	2,513,679.74
WESTLAKE CORP	2,222	150.46	334,322.12
WESTROCK CO	21,356	51.09	1,091,078.04
3 M COMPANY	43,663	102.99	4,496,852.37
AECOM	10,456	91.10	952,541.60
AERCAP HOLDINGS NV	14,679	93.31	1,369,697.49
ALLEGION PLC	7,721	118.39	914,089.19
AMETEK INC	17,753	171.46	3,043,929.38
AXON ENTERPRISE INC	5,367	292.70	1,570,920.90
BOEING CO	44,809	179.10	8,025,291.90
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,522	142.22	1,354,218.84
CARLISLE COS INC	3,456	426.43	1,473,742.08
CARRIER GLOBAL CORP	62,063	64.63	4,011,131.69
CATERPILLAR	38,627	330.00	12,746,910.00

CNH INDUSTRIAL NV	54,445	10.20	555,339.00	
CUMMINS INC	10,453	283.96	2,968,233.88	
DEERE&CO	20,534	378.17	7,765,342.78	
DOVER CORP	10,657	184.40	1,965,150.80	
EATON CORP	30,932	322.08	9,962,578.56	
EMCOR GROUP INC	3,640	380.78	1,386,039.20	
EMERSON ELECTRIC CO	44,010	109.32	4,811,173.20	
FASTENAL CO	44,011	65.04	2,862,475.44	
FERGUSON PLC	16,260	195.37	3,176,716.20	
FORTIVE CORP	25,894	74.24	1,922,370.56	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	10,310	67.12	692,007.20	
GE VERNOVA INC	20,868	178.14	3,717,425.52	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,159	298.53	5,421,006.27	
GENERAL ELECTRIC CO	85,192	160.54	13,676,723.68	
GRACO INC	13,378	79.79	1,067,430.62	
GRAINGER (WW) INC	3,363	915.50	3,078,826.50	
HEICO CORP	3,640	227.45	827,918.00	
HEICO CORP-CLASS A	5,700	178.71	1,018,647.00	
HONEYWELL INTL INC	51,027	215.89	11,016,219.03	
HOWMET AEROSPACE INC	31,648	78.63	2,488,482.24	
HUBBELL INC	4,458	379.56	1,692,078.48	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,433	251.20	862,369.60	
IDEX CORP	5,916	204.50	1,209,822.00	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,812	242.59	5,533,963.08	
INGERSOLL-RAND INC	31,562	92.92	2,932,741.04	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	12,700	36.76	466,852.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	54,141	68.77	3,723,276.57	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,682	225.49	3,310,644.18	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,526	547.32	1,382,530.32	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,743	471.51	7,894,491.93	
MASCO CORP	18,934	68.09	1,289,216.06	
NORDSON CORP	4,121	232.27	957,184.67	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,696	430.67	4,606,446.32	
OTIS WORLDWIDE CORP	30,717	96.87	2,975,555.79	
OWENS CORNING	6,460	178.24	1,151,430.40	
PACCAR INC	40,380	106.89	4,316,218.20	

PARKER HANNIFIN CORP	9,881	510.29	5,042,175.49
PENTAIR PLC	14,383	80.00	1,150,640.00
QUANTA SERVICES INC	11,573	274.23	3,173,663.79
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,466	265.87	2,250,855.42
RTX CORP	102,848	101.96	10,486,382.08
SMITH (A. O.) CORP	9,016	84.43	761,220.88
SNAP-ON INC	4,000	267.40	1,069,600.00
STANLEY BLACK&DECKER	12,598	84.74	1,067,554.52
TEXTRON	13,876	87.48	1,213,872.48
TORO CO	8,812	94.98	836,963.76
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,000	338.14	6,086,520.00
TRANSDIGM GROUP INC	4,240	1,328.05	5,630,932.00
UNITED RENTALS INC	5,364	645.37	3,461,764.68
VERTIV HOLDINGS CO-A	29,005	89.14	2,585,505.70
WABTEC CORP	13,304	162.01	2,155,381.04
WATSCO INC	2,656	482.47	1,281,440.32
XYLEM INC	19,668	138.34	2,720,871.12
AUTOMATIC DATA PROCESS	31,919	249.20	7,954,214.80
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	9,240	157.22	1,452,712.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	9,640	201.84	1,945,737.60
CINTAS CORP	7,043	711.00	5,007,573.00
COPART INC	69,100	54.90	3,793,590.00
DAYFORCE INC	10,668	50.21	535,640.28
EQUIFAX INC	9,160	240.33	2,201,422.80
JACOBS SOLUTIONS INC	8,836	142.09	1,255,507.24
LEIDOS HOLDINGS	9,314	148.56	1,383,687.84
PAYCHEX INC	24,118	126.08	3,040,797.44
PAYCOM SOFTWARE INC	4,235	145.00	614,075.00
PAYLOCITY HOLDING CORP	3,423	135.10	462,447.30
REPUBLIC SERVICES INC	16,455	194.66	3,203,130.30
ROLLINS INC	25,466	49.92	1,271,262.72
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,402	63.13	972,328.26
TRANSUNION	15,741	75.55	1,189,232.55
VERALTO CORP	17,691	99.75	1,764,677.25
VERISK ANALYTICS INC	10,738	271.77	2,918,266.26
WASTE CONNECTIONS INC	19,775	175.58	3,472,094.50

WASTE MANAGEMENT INC	30,660	212.44	6,513,410.40
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,367	88.49	740,395.83
CSX CORP	152,551	33.21	5,066,218.71
DELTA AIR LINES INC	15,193	49.40	750,534.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	12,280	126.98	1,559,314.40
FEDEX CORP	17,725	256.51	4,546,639.75
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	190,364	3.53	671,984.92
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,748	157.97	908,011.56
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	13,623	48.89	666,028.47
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,982	218.68	3,932,303.76
OLD DOMINION FREIGHT LINE	14,712	176.07	2,590,341.84
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,533	28.49	385,555.17
U-HAUL HOLDING CO	6,606	60.99	402,899.94
UBER TECHNOLOGIES INC	144,319	70.54	10,180,262.26
UNION PACIFIC CORP	46,736	226.36	10,579,160.96
UNITED PARCEL SERVICE B	55,567	138.60	7,701,586.20
APTIV PLC	21,896	76.09	1,666,066.64
FORD MOTOR COMPANY	290,990	12.23	3,558,807.70
GENERAL MOTORS CO	89,296	48.11	4,296,030.56
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	51,336	11.01	565,209.36
TESLA INC	221,215	182.58	40,389,434.70
DECKERS OUTDOOR CORP	2,103	978.08	2,056,902.24
DR HORTON INC	22,973	144.05	3,309,260.65
GARMIN LTD	11,170	162.29	1,812,779.30
LENNAR CORP-CL A	18,864	150.66	2,842,050.24
LULULEMON ATHLETICA INC	8,619	312.28	2,691,541.32
NIKE B	94,445	97.17	9,177,220.65
NVR INC	247	7,740.78	1,911,972.66
PULTE GROUP INC	16,747	112.68	1,887,051.96
AIRBNB INC-CLASS A	34,827	148.39	5,167,978.53
BOOKING HOLDINGS INC	2,619	3,981.20	10,426,762.80
CAESARS ENTERTAINMENT INC	17,560	38.99	684,664.40
CARNIVAL CORPORATION	71,810	16.39	1,176,965.90
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,089	3,193.74	6,671,722.86
DARDEN RESTAURANTS INC	9,207	154.13	1,419,074.91
DOMINO'S PIZZA INC	2,848	533.42	1,519,180.16

DOORDASH INC - A	21,857	110.70	2,419,569.90
DRAFTKINGS INC	32,654	40.01	1,306,486.54
EXPEDIA GROUP INC	9,628	128.16	1,233,924.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,635	217.04	4,261,580.40
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,787	150.27	569,072.49
LAS VEGAS SANDS CORP	30,565	44.84	1,370,534.60
MARRIOTT INTL A	19,516	245.66	4,794,300.56
MCDONALD'S CORP	55,965	260.38	14,572,166.70
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,462	42.45	656,361.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,429	154.52	2,847,649.08
STARBUCKS CORP	88,273	79.73	7,038,006.29
WYNN RESORTS LTD	6,702	89.10	597,148.20
YUM BRANDS INC	22,162	133.99	2,969,486.38
ALPHABET INC-CL A	455,214	179.22	81,583,453.08
ALPHABET INC-CL C	394,786	180.79	71,373,360.94
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,192	285.85	2,055,833.20
COMCAST CORP-CL A	309,993	38.48	11,928,530.64
ELECTRONIC ARTS INC	19,733	141.23	2,786,891.59
FOX CORP - CLASS A	21,544	34.46	742,406.24
FOX CORP- CLASS B	10,345	32.07	331,764.15
INTERPUBLIC GROUP OF COS	28,511	29.51	841,359.61
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	15,379	72.02	1,107,595.58
LIVE NATION ENTERTAINMENT	11,613	89.38	1,037,969.94
MATCH GROUP INC	22,730	30.80	700,084.00
META PLATFORMS INC-CLASS A	169,631	498.91	84,630,602.21
NETFLIX INC	33,607	669.02	22,483,755.14
NEWS CORP-CLASS A	33,479	27.51	921,007.29
OMNICOM GROUP	14,048	90.73	1,274,575.04
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,508	10.29	334,507.32
PINTEREST INC- CLASS A	45,767	43.12	1,973,473.04
ROBLOX CORP -CLASS A	35,113	35.19	1,235,626.47
ROKU INC	9,122	54.45	496,692.90
SEA LTD-ADR	28,338	75.89	2,150,570.82
SNAP INC - A	72,602	15.67	1,137,673.34
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,867	159.71	2,054,988.57
THE WALT DISNEY CO	142,615	101.98	14,543,877.70

TRADE DESK INC/THE -CLASS A	33,583	95.76	3,215,908.08
WARNER BROS DISCOVERY INC	177,413	7.31	1,296,889.03
AMAZON.COM	724,185	185.57	134,387,010.45
AUTOZONE INC	1,368	2,985.44	4,084,081.92
BATH & BODY WORKS INC	13,452	41.50	558,258.00
BEST BUY COMPANY INC	15,285	89.33	1,365,409.05
BURLINGTON STORES INC	5,108	242.53	1,238,843.24
CARMAX INC	10,695	73.18	782,660.10
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,950	229.78	1,137,411.00
EBAY	41,952	54.01	2,265,827.52
ETSY INC	10,294	59.95	617,125.30
GENUINE PARTS CO	9,903	142.05	1,406,721.15
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,000	32.10	224,700.00
HOME DEPOT	77,067	350.88	27,041,268.96
LKQ CORP	19,286	41.97	809,433.42
LOWES COMPANIES	44,328	228.39	10,124,071.92
MERCADOLIBRE INC	3,573	1,582.86	5,655,558.78
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,577	1,083.52	4,959,271.04
POOL CORP	2,664	337.91	900,192.24
ROSS STORES INC	25,425	149.25	3,794,681.25
TJX COMPANIES INC	88,680	111.05	9,847,914.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,846	277.37	2,176,245.02
ULTA BEAUTY INC	3,920	389.72	1,527,702.40
WILLIAMS-SONOMA INC	4,460	307.55	1,371,673.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	25,000	19.79	494,750.00
COSTCO WHOLESALE CORP	34,237	848.16	29,038,453.92
DOLLAR GENERAL CORP	16,287	130.49	2,125,290.63
DOLLAR TREE INC	16,318	107.35	1,751,737.30
KROGER CO	50,664	50.02	2,534,213.28
SYSCO CORP	40,090	74.58	2,989,912.20
TARGET (DAYTON HUDSON)	35,264	149.69	5,278,668.16
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	51,567	15.91	820,430.97
WALMART INC	342,809	68.90	23,619,540.10
ALTRIA GROUP INC	132,873	46.45	6,171,950.85
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	40,618	62.13	2,523,596.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,082	43.66	614,820.12

BUNGE GLOBAL SA	11,604	108.17	1,255,204.68
CAMPBELL SOUP CO (US)	15,869	45.27	718,389.63
CELSIUS HOLDINGS INC	13,069	59.77	781,134.13
COCA-COLA CO	316,878	63.97	20,270,685.66
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,394	75.97	1,169,482.18
CONAGRA BRANDS INC	33,324	29.34	977,726.16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,126	265.13	3,480,096.38
GENERAL MILLS INC	43,531	68.07	2,963,155.17
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,942	187.30	2,049,436.60
HORMEL FOODS CORP	23,338	30.96	722,544.48
JM SMUCKER CO	7,850	111.86	878,101.00
KELLANOVA	23,448	58.26	1,366,080.48
KEURIG DR PEPPER INC	81,153	34.67	2,813,574.51
KRAFT HEINZ CO/THE	68,964	33.21	2,290,294.44
LAMB WESTON HOLDINGS INC	11,876	84.95	1,008,866.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,092	69.20	1,251,966.40
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	14,669	51.40	753,986.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	105,431	68.42	7,213,589.02
MONSTER BEVERAGE CORP	58,348	49.49	2,887,642.52
PEPSICO INC	107,105	168.08	18,002,208.40
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	118,983	101.87	12,120,798.21
TYSON FOODS INC	23,306	57.68	1,344,290.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,346	107.48	2,079,308.08
CLOROX COMPANY	9,570	136.12	1,302,668.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,938	98.99	6,131,242.62
ESTEE LAUDER CO-CL A	18,800	115.13	2,164,444.00
KENVUE INC	148,093	18.90	2,798,957.70
KIMBERLY-CLARK CORP	26,877	139.70	3,754,716.90
PROCTER & GAMBLE CO	181,466	168.45	30,567,947.70
ABBOTT LABORATORIES	133,298	105.30	14,036,279.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,253	237.08	1,245,381.24
BAXTER INTERNATIONAL	41,576	34.19	1,421,483.44
BECTON DICKINSON & CO	22,142	235.91	5,223,519.22
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,121	76.71	8,600,801.91
CARDINAL HEALTH	19,151	104.90	2,008,939.90
CENCORA INC	14,462	239.36	3,461,624.32

CENTENE CORP	40,934	68.04	2,785,149.36
COOPER COS INC/THE	12,923	89.81	1,160,614.63
CVS HEALTH CORP	99,034	61.73	6,113,368.82
DAVITA INC	4,627	143.88	665,732.76
DEXCOM INC	28,772	110.57	3,181,320.04
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,930	90.17	4,051,338.10
ELEVANCE HEALTH INC	18,232	541.71	9,876,456.72
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	32,998	78.85	2,601,892.30
HCA HEALTHCARE INC	15,457	341.37	5,276,556.09
HENRY SCHEIN INC	8,755	67.27	588,948.85
HOLOGIC INC	18,875	72.48	1,368,060.00
HUMANA INC	9,013	358.04	3,227,014.52
IDEXX LABORATORIES INC	6,644	491.49	3,265,459.56
INSULET CORP	5,246	203.94	1,069,869.24
INTUITIVE SURGICAL INC	27,718	429.04	11,892,130.72
LABCORP HOLDINGS INC	6,548	208.00	1,361,984.00
MCKESSON CORP	10,179	607.81	6,186,897.99
MEDTRONIC PLC	102,632	81.04	8,317,297.28
MOLINA HEALTHCARE INC	4,545	308.98	1,404,314.10
QUEST DIAGNOSTICS	8,679	140.23	1,217,056.17
RESMED INC	10,920	182.20	1,989,624.00
SOLVENTUM CORP	10,915	51.30	559,939.50
STERIS PLC	8,172	216.56	1,769,728.32
STRYKER CORP	26,379	339.07	8,944,327.53
TELEFLEX INC	3,934	200.73	789,671.82
THE CIGNA GROUP	21,946	343.14	7,530,550.44
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,401	489.98	34,985,061.98
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,672	191.01	892,398.72
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,491	186.70	2,332,069.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,254	108.46	1,654,448.84
ABBVIE INC	136,294	172.74	23,543,425.56
AGILENT TECHNOLOGIES	21,791	135.08	2,943,528.28
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,643	222.90	2,149,424.70
AMGEN	41,885	318.15	13,325,712.75
AVANTOR INC	49,647	22.50	1,117,057.50
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,853	283.88	526,029.64

BIO-TECHNE CORP	12,980	74.49	966,880.20
BIOGEN INC	10,740	226.60	2,433,684.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,783	85.14	1,258,624.62
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	155,274	42.23	6,557,221.02
CATALENT INC	13,739	56.47	775,841.33
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,204	209.85	882,209.40
DANAHER CORP	54,787	256.76	14,067,110.12
ELI LILLY & CO	62,575	890.11	55,698,633.25
EXACT SCIENCES CORP	12,208	41.95	512,125.60
GILEAD SCIENCES INC	96,270	70.73	6,809,177.10
ILLUMINA INC	11,423	110.24	1,259,271.52
INCYTE CORP	15,212	63.75	969,765.00
IQVIA HOLDINGS INC	13,836	214.09	2,962,149.24
JOHNSON & JOHNSON	187,239	149.12	27,921,079.68
MERCK & CO	195,618	132.96	26,009,369.28
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,627	1,453.98	2,365,625.46
MODERNA INC	25,884	137.00	3,546,108.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,742	133.62	900,866.04
PFIZER	432,739	28.36	12,272,478.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,327	1,063.89	8,859,012.03
REPLIGEN CORP	4,353	123.65	538,248.45
REVVITY INC	8,524	106.90	911,215.60
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	30,083	27.11	815,550.13
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,141	16.49	1,519,405.09
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	29,526	565.95	16,710,239.70
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,618	318.94	1,153,924.92
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,876	474.95	9,440,106.20
VIATRIS INC	89,720	10.47	939,368.40
WATERS CORP	4,749	289.27	1,373,743.23
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,767	331.00	1,908,877.00
ZOETIS INC	35,994	171.84	6,185,208.96
BANK OF AMERICA CORP	549,785	40.02	22,002,395.70
CITIGROUP	146,698	61.34	8,998,455.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	39,522	35.39	1,398,683.58
FIFTH THIRD BANCORP	54,420	36.64	1,993,948.80
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	766	1,640.93	1,256,952.38

HUNTINGTON BANCSHARES INC	114,112	12.98	1,481,173.76
JPMORGAN CHASE & CO	222,518	198.88	44,254,379.84
KEY CORP	71,223	13.92	991,424.16
M & T BANK CORP	13,791	149.59	2,062,995.69
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31,533	154.90	4,884,461.70
REGIONS FINL CORP	70,810	19.31	1,367,341.10
TRUIST FINANCIAL CORP	106,342	37.46	3,983,571.32
US BANCORP	117,317	40.55	4,757,204.35
WELLS FARGO & CO	273,850	59.01	16,159,888.50
ALLY FINANCIAL INC	21,529	40.40	869,771.60
AMERICAN EXPRESS	45,006	231.47	10,417,538.82
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,816	440.35	3,441,775.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	29,517	118.28	3,491,270.76
ARES MANAGEMENT CORP - A	14,741	133.85	1,973,082.85
BANK NEW YORK CO	56,329	59.48	3,350,448.92
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	101,297	413.98	41,934,932.06
BLACKROCK INC	11,583	798.95	9,254,237.85
BLACKSTONE INC	55,334	125.26	6,931,136.84
BLOCK INC	42,352	64.40	2,727,468.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,097	137.68	4,143,754.96
CARLYLE GROUP INC/THE	15,669	40.47	634,124.43
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,803	171.33	1,508,217.99
CME GROUP INC	27,997	195.08	5,461,654.76
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,368	212.31	3,050,470.08
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,249	29.55	568,807.95
CORPAY INC	4,988	269.67	1,345,113.96
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,987	127.67	2,424,070.29
EQUITABLE HOLDINGS INC	27,983	41.43	1,159,335.69
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,148	424.89	1,337,553.72
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	45,470	75.55	3,435,258.50
FISERV INC	46,319	150.27	6,960,356.13
FRANKLIN RESOURCES INC	26,070	23.17	604,041.90
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,316	69.46	299,789.36
GLOBAL PAYMENTS INC	20,749	97.04	2,013,482.96
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,012	462.09	11,557,795.08
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,122	138.72	6,120,603.84

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,213	166.43	867,599.59
KKR & CO INC	47,919	107.47	5,149,854.93
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,490	277.68	1,524,463.20
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,207	196.29	629,502.03
MASTERCARD INC-CLASS A	64,241	456.96	29,355,567.36
MOODY' S CORP	12,577	425.64	5,353,274.28
MORGAN STANLEY	93,827	97.10	9,110,601.70
MSCI INC	5,952	489.16	2,911,480.32
NASDAQ INC	29,020	60.10	1,744,102.00
NORTHERN TRUST CORP	15,902	83.51	1,327,976.02
PAYPAL HOLDINGS INC	79,286	59.49	4,716,724.14
PRICE T ROWE GROUP INC	18,275	118.88	2,172,532.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	15,486	122.38	1,895,176.68
ROBINHOOD MARKETS INC - A	46,668	21.37	997,295.16
S&P GLOBAL INC	24,501	444.97	10,902,209.97
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,095	74.53	8,727,090.35
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,550	66.68	636,794.00
STATE STREET CORP	22,335	72.94	1,629,114.90
SYNCHRONY FINANCIAL	29,196	45.52	1,329,001.92
TOAST INC-CLASS A	31,526	25.59	806,750.34
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	9,061	104.40	945,968.40
VISA INC-CLASS A SHARES	122,188	276.30	33,760,544.40
AFLAC	43,196	90.43	3,906,214.28
ALLSTATE CORP	20,722	162.41	3,365,460.02
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,319	126.53	799,543.07
AMERICAN INT'L GROUP	50,875	76.01	3,867,008.75
AON PLC	15,249	298.46	4,551,216.54
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,737	102.43	3,045,960.91
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,294	265.19	4,321,005.86
ASSURANT INC	4,726	169.24	799,828.24
BROWN & BROWN INC	20,155	93.34	1,881,267.70
CHUBB LTD	30,987	266.12	8,246,260.44
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,110	116.61	1,295,537.10
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,166	362.33	784,806.78
EVEREST GROUP LTD	3,288	382.01	1,256,048.88
FNF GROUP	20,461	49.78	1,018,548.58

HARTFORD FINANCIAL SVCS	21,873	104.42	2,283,978.66
LOEWS CORP	16,402	77.33	1,268,366.66
MARKEL GROUP INC	1,007	1,591.99	1,603,133.93
MARSH & MCLENNAN COS	38,224	215.75	8,246,828.00
METLIFE INC	48,925	72.12	3,528,471.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	18,536	80.83	1,498,264.88
PROGRESSIVE CORP	45,236	210.68	9,530,320.48
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,649	119.16	3,175,494.84
TRAVELERS COS INC/THE	17,147	211.09	3,619,560.23
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,737	266.44	2,061,446.28
WR BERKLEY CORP	14,360	80.84	1,160,862.40
WEYERHAEUSER CO	52,615	29.04	1,527,939.60
ACCENTURE PLC-CL A	48,353	307.21	14,854,525.13
ADOBE INC	34,893	524.17	18,289,863.81
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	11,484	88.74	1,019,090.16
ANSYS INC	6,794	321.10	2,181,553.40
APPLOVIN CORP-CLASS A	12,260	78.05	956,893.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	2,394	200.03	478,871.82
ATLASSIAN CORP-CL A	11,436	164.75	1,884,081.00
AUTODESK INC	17,030	239.17	4,073,065.10
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	14,813	50.37	746,130.81
CADENCE DESIGN SYSTEMS	21,140	309.14	6,535,219.60
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,058	155.98	1,100,906.84
CLOUDFLARE INC - CLASS A	23,067	78.60	1,813,066.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	37,006	68.68	2,541,572.08
CONFLUENT INC-CLASS A	12,300	27.34	336,282.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,478	377.93	6,605,460.54
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,100	261.34	810,154.00
DATADOG INC - CLASS A	20,780	118.49	2,462,222.20
DOCUSIGN INC	14,969	51.69	773,747.61
DYNATRACE INC	22,028	43.85	965,927.80
EPAM SYSTEMS INC	4,768	183.09	872,973.12
FAIR ISAAC CORP	2,026	1,441.50	2,920,479.00
FORTINET INC	49,270	58.28	2,871,455.60
GARTNER INC	5,859	451.09	2,642,936.31
GEN DIGITAL INC	43,555	24.08	1,048,804.40

GODADDY INC - CLASS A	11,388	138.41	1,576,213.08
HUBSPOT INC	3,646	573.60	2,091,345.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,082	175.01	12,440,060.82
INTUIT INC	21,468	623.88	13,393,455.84
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,694	241.47	1,133,483.65
MICROSOFT CORP	546,006	447.67	244,430,506.02
MICROSTRATEGY INC-CL A	1,219	1,372.15	1,672,650.85
MONDAY.COM LTD	2,838	221.68	629,127.84
MONGODB INC	5,325	233.92	1,245,624.00
OKTA INC	11,505	88.35	1,016,466.75
ORACLE CORP	126,564	139.89	17,705,037.96
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,919	24.16	3,549,563.04
PALO ALTO NETWORKS INC	25,444	316.68	8,057,605.92
PTC INC	9,741	177.60	1,730,001.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,456	562.55	4,756,922.80
SALESFORCE INC	74,662	239.94	17,914,400.28
SAMSARA INC-CL A	13,283	29.42	390,785.86
SERVICENOW INC	15,986	739.59	11,823,085.74
SNOWFLAKE INC-CLASS A	23,538	124.80	2,937,542.40
SYNOPSYS INC	11,896	595.60	7,085,257.60
TWILIO INC - A	12,842	54.81	703,870.02
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,339	491.57	1,641,352.23
UIPATH INC - CLASS A	28,419	12.03	341,880.57
UNITY SOFTWARE INC	16,437	16.70	274,497.90
VERISIGN INC	6,723	180.00	1,210,140.00
WIX.COM LTD	5,010	158.05	791,830.50
WORKDAY INC-CLASS A	16,432	218.70	3,593,678.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	20,869	57.81	1,206,436.89
ZSCALER INC	7,204	181.06	1,304,356.24
AMPHENOL CORPORATION	91,720	67.27	6,170,004.40
APPLE INC	1,134,924	208.14	236,223,081.36
ARISTA NETWORKS INC	20,702	329.21	6,815,305.42
CDW CORP/DE	9,823	231.61	2,275,105.03
CISCO SYSTEMS	312,372	47.28	14,768,948.16
CORNING	66,604	39.90	2,657,499.60
DELL TECHNOLOGIES -C	20,331	137.56	2,796,732.36

F5 INC	4,851	168.68	818,266.68
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	97,432	20.47	1,994,433.04
HP INC	77,024	36.30	2,795,971.20
JABIL INC	9,340	112.98	1,055,233.20
JUNIPER NETWORKS INC	25,321	35.54	899,908.34
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,838	136.91	1,894,560.58
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,159	388.16	5,107,797.44
NETAPP INC	15,191	126.38	1,919,838.58
PURE STORAGE INC - CLASS A	23,875	62.82	1,499,827.50
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,548	103.33	1,503,244.84
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,216	826.98	3,486,547.68
TE CONNECTIVITY LTD	23,161	151.10	3,499,627.10
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,320	391.23	1,298,883.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	17,718	56.13	994,511.34
WESTERN DIGITAL CORP	25,790	75.40	1,944,566.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,162	306.71	1,276,527.02
AT&T INC	548,004	18.65	10,220,274.60
T-MOBILE US INC	41,896	177.95	7,455,393.20
VERIZON COMMUNICATIONS	322,255	41.17	13,267,238.35
AES CORP	54,375	18.99	1,032,581.25
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20,778	51.13	1,062,379.14
AMEREN CORPORATION	20,898	71.15	1,486,892.70
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,720	88.14	3,589,060.80
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,468	132.18	1,912,380.24
ATMOS ENERGY CORP	11,302	118.02	1,333,862.04
CENTERPOINT ENERGY INC	47,466	31.31	1,486,160.46
CMS ENERGY CORP	23,697	60.77	1,440,066.69
CONSOLIDATED EDISON INC	27,675	91.27	2,525,897.25
CONSTELLATION ENERGY	23,831	216.10	5,149,879.10
DOMINION ENERGY INC	62,863	49.90	3,136,863.70
DTE ENERGY COMPANY	15,851	112.80	1,787,992.80
DUKE ENERGY CORP	60,351	101.51	6,126,230.01
EDISON INTL	30,900	72.76	2,248,284.00
ENERGY CORP	16,181	107.73	1,743,179.13
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,399	37.94	773,938.06
EVERGY INC	18,475	53.37	986,010.75

EVERSOURCE ENERGY	27,450	58.00	1,592,100.00
EXELON CORP	81,573	35.33	2,881,974.09
FIRSTENERGY CORP	39,425	38.50	1,517,862.50
NEXTERA ENERGY INC	160,662	73.85	11,864,888.70
NISOURCE INC	32,351	28.88	934,296.88
NRG ENERGY INC	13,109	81.56	1,069,170.04
PG&E CORP	164,187	17.71	2,907,751.77
PPL CORPORATION	58,459	28.17	1,646,790.03
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	40,266	74.75	3,009,883.50
SEMPRA	49,744	76.45	3,802,928.80
SOUTHERN CO	86,109	79.34	6,831,888.06
VISTRA CORP	24,594	88.23	2,169,928.62
WEC ENERGY GROUP INC	23,447	79.35	1,860,519.45
XCEL ENERGY INC	41,562	53.98	2,243,516.76
ADVANCED MICRO DEVICES	124,711	160.25	19,984,937.75
ANALOG DEVICES	37,792	228.46	8,633,960.32
APPLIED MATERIALS	64,814	229.84	14,896,849.76
BROADCOM INC	34,017	1,592.21	54,162,207.57
ENPHASE ENERGY INC	9,617	108.02	1,038,828.34
ENTEGRIS INC	12,389	131.31	1,626,799.59
FIRST SOLAR INC	7,921	261.28	2,069,598.88
INTEL CORP	328,277	30.57	10,035,427.89
KLA CORP	10,294	793.98	8,173,230.12
LAM RESEARCH CORP	10,237	1,024.42	10,486,987.54
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	10,978	56.65	621,903.70
MARVELL TECHNOLOGY INC	67,749	67.77	4,591,349.73
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,718	89.18	3,631,231.24
MICRON TECHNOLOGY	85,302	139.01	11,857,831.02
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,911	798.14	3,121,525.54
NVIDIA CORP	1,933,750	118.11	228,395,212.50
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,310	267.27	5,160,983.70
ON SEMICONDUCTOR CORP	32,011	67.79	2,170,025.69
QORVO INC	8,678	113.53	985,213.34
QUALCOMM	85,755	200.84	17,223,034.20
SKYWORKS SOLUTIONS INC	11,242	104.96	1,179,960.32
TERADYNE INC	12,318	145.53	1,792,638.54

	TEXAS INSTRUMENTS	71,015	193.91	13,770,518.65	
	CBRE GROUP INC-A	22,995	89.26	2,052,533.70	
	COSTAR GROUP INC	33,027	74.36	2,455,887.72	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	98,700	3.21	316,827.00	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,809	47.02	555,259.18	
	アメリカドル 小計	28,024,045		3,612,451,405.70 (576,402,746,293)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	38,058	24.85	945,741.30	
	CAMECO CORP	31,793	68.89	2,190,219.77	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,204	48.73	8,050,390.92	
	CENOVUS ENERGY INC	111,293	26.31	2,928,118.83	
	ENBRIDGE	166,986	47.97	8,010,318.42	
	IMPERIAL OIL	16,202	93.95	1,522,177.90	
	KEYERA CORP	18,607	36.72	683,249.04	
	MEG ENERGY CORP	13,934	28.96	403,528.64	
	PARKLAND CORP	7,149	37.67	269,302.83	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,941	50.02	2,297,968.82	
	SUNCOR ENERGY	98,973	51.77	5,123,832.21	
	TC ENERGY CORP	82,559	53.39	4,407,825.01	
	TOURMALINE OIL CORP	25,009	62.88	1,572,565.92	
	AGNICO EAGLE MINES	40,306	89.69	3,615,045.14	
	BARRICK GOLD CORP	133,727	22.83	3,052,987.41	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,322	72.21	673,141.62	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	65,267	18.18	1,186,554.06	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,641	161.75	2,529,931.75	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	51,847	18.04	935,319.88	
	KINROSS GOLD CORP	108,451	10.46	1,134,397.46	
	LUNDIN MINING CORP	38,990	15.06	587,189.40	
	NUTRIEN LTD	37,152	71.89	2,670,857.28	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,416	27.70	620,923.20	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	35,386	65.82	2,329,106.52	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,505	105.80	370,829.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,991	72.84	2,694,424.44	
	CAE INC	25,999	26.38	685,853.62	
	STANTEC INC	9,001	113.60	1,022,513.60	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,213	119.25	621,650.25	

WSP GLOBAL INC	9,951	211.45	2,104,138.95
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	32,579	23.95	780,267.05
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,609	51.73	652,263.57
RB GLOBAL INC	14,445	106.88	1,543,881.60
THOMSON REUTERS CORP	11,495	225.74	2,594,881.30
AIR CANADA	13,805	17.01	234,823.05
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,237	161.58	6,824,654.46
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	73,125	108.90	7,963,312.50
TFI INTERNATIONAL INC	5,837	191.40	1,117,201.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	20,254	58.16	1,177,972.64
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,070	89.16	273,721.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,820	52.20	512,604.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	23,073	95.85	2,211,547.05
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,513	138.28	624,057.64
DOLLARAMA INC	22,000	126.06	2,773,320.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,865	78.42	4,537,773.30
EMPIRE CO LTD 'A'	6,930	34.46	238,807.80
LOBLAW COMPANIES LTD	12,913	156.50	2,020,884.50
METRO INC	18,840	75.53	1,422,985.20
WESTON (GEORGE) LTD	5,226	193.94	1,013,530.44
SAPUTO INC	20,898	30.20	631,119.60
BANK MONTREAL	56,278	116.40	6,550,759.20
BANK NOVA SCOTIA	97,216	62.84	6,109,053.44
CANADIAN IMPERIAL BANK	71,075	66.15	4,701,611.25
NATIONAL BANK OF CANADA	27,646	106.72	2,950,381.12
ROYAL BANK OF CANADA	109,143	145.10	15,836,649.30
TORONTO-DOMINION BANK	136,393	75.41	10,285,396.13
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	29,001	52.30	1,516,752.30
BROOKFIELD CORP	104,769	56.63	5,933,068.47
IGM FINANCIAL INC	7,685	38.34	294,642.90
ONEX CORP	6,603	97.00	640,491.00
TMX GROUP LTD	23,425	38.00	890,150.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,493	1,525.05	2,276,899.65
GREAT-WEST LIFECO INC	23,788	39.09	929,872.92
IA FINANCIAL CORP INC	6,977	86.09	600,649.93
INTACT FINANCIAL CORP	13,255	227.79	3,019,356.45

	MANULIFE FINANCIAL CORP	135,007	35.79	4,831,900.53
	POWER CORP OF CANADA	43,577	38.28	1,668,127.56
	SUN LIFE FINANCIAL INC	43,614	67.07	2,925,190.98
	CGI INC - CL A	16,084	136.08	2,188,710.72
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,553	3,848.34	5,976,472.02
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,984	129.13	901,843.92
	OPEN TEXT CORP	20,463	40.12	820,975.56
	SHOPIFY INC - CLASS A	94,130	87.82	8,266,496.60
	BCE INC	6,203	45.41	281,678.23
	QUEBECOR INC -CL B	15,200	28.96	440,192.00
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,881	51.93	1,447,860.33
	TELUS CORP	32,908	21.64	712,129.12
	ALTAGAS INCOME LTD	24,395	30.48	743,559.60
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,295	40.29	455,075.55
	CANADIAN UTILITIES LTD A	10,324	29.88	308,481.12
	EMERA INC	25,484	45.98	1,171,754.32
	FORTIS INC	35,547	53.78	1,911,717.66
	HYDRO ONE LTD	29,579	39.32	1,163,046.28
	NORTHLAND POWER INC	17,854	23.70	423,139.80
	FIRSTSERVICE CORP	2,690	208.36	560,488.40
	カナダドル 小計	3,197,926		204,124,286.25 (23,849,881,605)
ユーロ	ENI	151,339	14.12	2,137,512.03
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	39,662	19.08	756,949.27
	NESTE OIL OYJ	32,766	16.78	549,977.31
	OMV AG	12,549	39.66	497,693.34
	REPSOL SA	89,536	14.80	1,325,132.80
	TENARIS SA	40,648	14.50	589,396.00
	TOTALENERGIES SE	167,596	62.51	10,476,425.96
	AIR LIQUIDE	44,628	164.76	7,352,909.28
	AKZO NOBEL	12,357	57.88	715,223.16
	ARCELORMITTAL	29,208	22.14	646,665.12
	ARKEMA	4,369	85.30	372,675.70
	BASF SE	70,406	46.16	3,249,940.96
	COVESTRO AG	14,454	53.86	778,492.44
	DSM-FIRMENICH AG	13,707	104.50	1,432,381.50

EVONIK INDUSTRIES AG	16,037	19.09	306,146.33
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,765	95.96	1,033,009.40
OCI NV	7,248	23.25	168,516.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19,504	42.86	835,941.44
STORA ENSO OYJ R	42,169	12.58	530,486.02
SYENSCO SA	5,356	88.90	476,148.40
SYMRISE AG	10,018	114.70	1,149,064.60
UMICORE	17,605	14.82	260,906.10
UPM KYMMENE OYJ	42,324	33.05	1,398,808.20
VOESTALPINE AG	7,152	25.78	184,378.56
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	16,593	40.90	678,653.70
AIRBUS SE	46,092	148.78	6,857,567.76
ALSTOM	24,388	15.67	382,281.90
BOUYGUES ORD	16,606	31.82	528,402.92
BRENTAG SE	9,500	65.64	623,580.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	39,278	37.25	1,463,105.50
DASSAULT AVIATION SA	2,130	179.60	382,548.00
EIFFAGE	5,924	90.02	533,278.48
FERROVIAL SE	37,026	36.56	1,353,670.56
GEA GROUP AG	13,382	39.80	532,603.60
IMCD NV	4,641	134.35	623,518.35
KINGSPAN GROUP PLC	12,398	80.20	994,319.60
KNORR-BREMSE AG	5,022	71.55	359,324.10
KONE OYJ-B	26,369	47.07	1,241,188.83
LEGRAND SA	19,340	93.88	1,815,639.20
LEONARDO SPA	31,340	22.29	698,568.60
METSO CORPORATION	51,970	10.26	533,472.05
MTU AERO ENGINES AG	3,962	228.80	906,505.60
PRYSMIAN SPA	21,155	58.88	1,245,606.40
RATIONAL AG	483	830.00	400,890.00
REXEL SA	17,411	24.80	431,792.80
RHEINMETALL AG	3,203	500.40	1,602,781.20
SAFRAN SA	26,619	206.00	5,483,514.00
SAINT-GOBAIN	36,177	73.16	2,646,709.32
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,150	227.15	9,574,372.50
SIEMENS	58,485	171.04	10,003,274.40

SIEMENS ENERGY AG	47,513	24.58	1,167,869.54
THALES SA	6,657	158.10	1,052,471.70
VINCI S.A.	39,327	102.90	4,046,748.30
WARTSILA OYJ	41,917	18.66	782,171.22
BUREAU VERITAS SA	25,073	26.92	674,965.16
RANDSTAD NV	10,680	45.46	485,512.80
TELEPERFORMANCE	4,734	100.10	473,873.40
WOLTERS KLUWER	19,155	153.75	2,945,081.25
ADP	2,382	117.80	280,599.60
AENA SME SA	5,508	188.00	1,035,504.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	45,343	5.81	263,442.83
DHL GROUP	74,810	38.15	2,854,001.50
GETLINK	21,115	15.91	335,939.65
INPOST SA	15,470	16.40	253,708.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,617	89.64	2,206,667.88
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	4,991	84.00	419,244.00
CONTINENTAL AG	8,168	55.30	451,690.40
DR ING HC F PORSCHE AG	10,254	70.36	721,471.44
FERRARI NV	10,026	393.70	3,947,236.20
MERCEDES-BENZ GROUP AG	63,436	64.54	4,094,159.44
MICHELIN	49,034	37.38	1,832,890.92
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,745	42.94	504,330.30
RENAULT SA	17,081	48.71	832,015.51
STELLANTIS NV	166,407	19.38	3,225,966.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	15,328	106.20	1,627,833.60
VOLKSWAGEN STAMM	2,486	114.40	284,398.40
ADIDAS AG	12,783	220.10	2,813,538.30
HERMES INTERNATIONAL	2,420	2,178.00	5,270,760.00
KERING	5,534	324.20	1,794,122.80
LVMH	21,429	726.50	15,568,168.50
MONCLER SPA	18,908	58.26	1,101,580.08
PUMA SE	9,220	44.65	411,673.00
SEB SA	2,282	105.20	240,066.40
ACCOR	14,436	39.18	565,602.48
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	36,772	64.02	2,354,143.44
DELIVERY HERO SE	13,414	25.92	347,690.88

LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,108	32.50	263,510.00
SODEXO	6,173	85.70	529,026.10
BOLLORE SE	31,761	5.77	183,260.97
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,827	78.70	379,884.90
PUBLICIS GROUPE	17,217	103.80	1,787,124.60
SCOUT24 SE	7,536	71.45	538,447.20
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	65,826	27.98	1,841,811.48
VIVENDI SE	61,243	9.88	605,570.78
D' IETEREN GROUP	2,217	196.80	436,305.60
INDITEX	87,257	47.21	4,119,402.97
PROSUS	112,590	34.49	3,883,229.10
ZALANDO SE	17,664	21.67	382,778.88
CARREFOUR	39,746	13.80	548,693.53
JERONIMO MARTINS	21,861	19.44	424,977.84
KESKO OYJ-B SHS	20,083	16.89	339,302.28
KONINKLIJKE AHOLD NV	70,900	28.15	1,995,835.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,097	56.66	3,858,376.02
DANONE (GROUPE)	51,810	58.86	3,049,536.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	33,863	9.56	323,798.00
HEINEKEN HOLDING NV	9,512	75.65	719,582.80
HEINEKEN NV	23,160	92.50	2,142,300.00
JDE PEET'S BV	7,000	19.87	139,090.00
KERRY GROUP PLC-A	10,913	75.95	828,842.35
LOTUS BAKERIES	38	10,020.00	380,760.00
PERNOD-RICARD	15,339	133.20	2,043,154.80
REMY COINTREAU	1,032	79.35	81,889.20
BEIERSDORF AG	7,430	141.75	1,053,202.50
HENKEL AG & CO KGAA	8,780	73.75	647,525.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,880	83.24	988,891.20
LOREAL	18,546	442.10	8,199,186.60
AMPLIFON SPA	11,650	34.01	396,216.50
BIOMERIEUX	3,044	90.45	275,329.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,430	66.80	229,124.00
DIASORIN ITALIA SPA	2,070	95.96	198,637.20
ESSILORLUXOTTICA	22,901	208.90	4,784,018.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	16,985	36.35	617,404.75

FRESENIUS SE&CO KGAA	33,689	28.37	955,756.93
KONINKLIJKE PHILIPS	66,646	24.55	1,636,159.30
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,567	53.50	1,153,834.50
ARGENX SE	4,935	405.50	2,001,142.50
BAYER	78,462	26.65	2,091,404.61
EUROFINS SCIENTIFIC	10,220	44.22	451,928.40
GRIFOLS SA	27,685	9.34	258,577.90
IPSEN	3,532	116.80	412,537.60
MERCK KGAA	10,703	167.05	1,787,936.15
ORION OYJ-CLASS B	10,139	40.01	405,661.39
QIAGEN N.V.	16,526	39.20	647,819.20
RECORDATI SPA	6,099	50.10	305,559.90
SANOFI	87,091	90.36	7,869,542.76
SARTORIUS AG-VORZUG	1,824	224.80	410,035.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,582	159.45	411,699.90
UCB (GROUPE)	9,389	138.85	1,303,662.65
ABN AMRO BANK NV-CVA	26,474	15.58	412,464.92
AIB GROUP PLC	145,826	4.96	724,171.91
BANCO BILBAO VIZCAYA	448,899	9.39	4,216,059.40
BANCO BPM SPA	118,197	6.20	732,821.40
BANCO DE SABADELL SA	420,800	1.81	761,648.00
BANCO SANTANDER SA	1,223,031	4.40	5,392,343.67
BANK OF IRELAND GROUP PLC	88,378	9.79	865,750.88
BNP PARIBAS	81,615	61.27	5,000,551.05
CAIXABANK	275,085	5.00	1,377,625.68
COMMERZBANK AG	81,889	14.23	1,165,280.47
CREDIT AGRICOLE SA	87,162	13.28	1,157,947.17
ERSTE GROUP BANK AG	25,376	43.99	1,116,290.24
FINECOBANK SPA	41,585	14.38	597,992.30
ING GROEP NV-CVA	256,546	15.80	4,055,479.16
INTESA SANPAOLO	1,145,097	3.53	4,044,482.60
KBC GROEP NV	18,057	67.12	1,211,985.84
MEDIOBANCA	33,860	13.93	471,839.10
NORDEA BANK ABP	236,636	11.39	2,696,467.22
SOCIETE GENERALE	53,019	22.55	1,195,843.54
UNICREDIT SPA	116,219	35.36	4,110,084.93

ADYEN NV	1, 609	1, 140. 80	1, 835, 547. 20
AMUNDI SA	4, 626	63. 85	295, 370. 10
DEUTSCHE BANK NAMEN	140, 740	14. 84	2, 088, 863. 08
DEUTSCHE BOERSE	14, 123	194. 00	2, 739, 862. 00
EDENRED	20, 131	42. 63	858, 184. 53
EURAZEO SA	3, 357	76. 35	256, 306. 95
EURONEXT NV	6, 480	90. 10	583, 848. 00
EXOR NV	7, 825	99. 35	777, 413. 75
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8, 515	67. 60	575, 614. 00
NEXI SPA	48, 458	5. 82	282, 025. 56
SOFINA	1, 238	216. 80	268, 398. 40
AEGON LTD	101, 846	5. 97	608, 631. 69
AGEAS	11, 086	43. 80	485, 566. 80
ALLIANZ SE-REG	30, 116	261. 50	7, 875, 334. 00
ASR NEDERLAND NV	11, 959	45. 00	538, 155. 00
ASSICURAZIONI GENERALI	84, 111	23. 66	1, 990, 066. 26
AXA SA	136, 349	30. 90	4, 213, 184. 10
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4, 455	237. 10	1, 056, 280. 50
MUENCHENER RUECKVERSICH.	10, 414	467. 10	4, 864, 379. 40
NN GROUP NV	22, 941	43. 18	990, 592. 38
POSTE ITALIANE SPA	24, 923	12. 03	299, 948. 30
SAMPO OYJ-A SHS	33, 132	40. 39	1, 338, 201. 48
TALANX AG	5, 053	74. 75	377, 711. 75
BECHTLE AG	7, 659	45. 04	344, 961. 36
CAPGEMINI SA	12, 235	187. 05	2, 288, 556. 75
DASSAULT SYSTEMES SA	49, 547	34. 82	1, 725, 226. 54
NEMETSCHEK SE	5, 455	88. 65	483, 585. 75
SAP SE	81, 129	179. 46	14, 559, 410. 34
NOKIA OYJ	396, 129	3. 52	1, 395, 562. 46
CELLNEX TELECOM SA	34, 475	31. 47	1, 084, 928. 25
DEUTSCHE TELEKOM	253, 485	23. 15	5, 868, 177. 75
ELISA A	10, 227	42. 86	438, 329. 22
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	30, 375	9. 86	299, 497. 50
KPN (KON.)	290, 883	3. 61	1, 050, 378. 51
ORANGE	153, 281	9. 58	1, 468, 431. 98
TELECOM ITALIA ORD	852, 552	0. 23	197, 024. 76

	TELEFONICA	373,259	4.10	1,533,721.23	
	ACCIONA SA	2,181	115.70	252,341.70	
	E.ON SE	166,881	12.60	2,103,535.00	
	EDP RENOVAVEIS SA	21,752	13.81	300,395.12	
	ELIA GROUP SA/NV	987	92.10	90,902.70	
	ENDESA	25,972	19.05	494,896.46	
	ENEL	640,374	6.54	4,189,326.70	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	235,657	3.61	852,371.36	
	ENGIE	146,393	13.73	2,009,975.89	
	FORTUM OYJ	32,550	14.47	470,998.50	
	IBERDROLA SA	447,152	12.32	5,508,912.64	
	REDEIA CORP SA	30,678	17.32	531,342.96	
	RWE STAMM	52,507	33.47	1,757,409.29	
	SNAM SPA	147,559	4.13	609,566.22	
	TERNA SPA	95,819	7.43	712,318.44	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,781	29.16	1,451,613.96	
	VERBUND AG	6,430	75.30	484,179.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	3,856	690.80	2,663,724.80	
	ASML HOLDING NV	30,793	948.50	29,207,160.50	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,357	149.75	951,960.75	
	INFINEON TECHNOLOGIES	96,562	34.00	3,283,590.81	
	STMICROELECTRONICS NV	50,286	37.76	1,898,799.36	
	LEG IMMOBILIE SE	5,275	75.64	399,001.00	
	VONOVIA SE	61,810	26.43	1,633,638.30	
	ユーロ 小計	14,212,621		398,810,743.22 (68,312,292,206)	
イギリスポンド	BP PLC	1,315,261	4.74	6,236,310.03	
	SHELL PLC-NEW	491,663	27.94	13,739,522.53	
	ANGLO AMERICAN PLC	101,769	25.00	2,544,225.00	
	ANTOFAGASTA PLC	29,856	21.21	633,245.76	
	CRH PLC	52,103	58.74	3,060,530.22	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,924	40.98	447,665.52	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,604	16.83	296,275.32	
	GLENCORE PLC	793,369	4.59	3,645,530.55	
	MONDI PLC	37,918	15.05	570,665.90	
	RIO TINTO PLC REG	88,047	52.28	4,603,097.16	

ASHTEAD GROUP PLC	33,317	54.94	1,830,435.98
BAE SYSTEMS PLC	240,047	13.52	3,246,635.67
BUNZL PLC	29,337	30.54	895,951.98
DCC PLC	6,622	56.40	373,480.80
MELROSE INDUSTRIES PLC	101,116	5.81	588,090.65
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	635,909	4.71	2,997,039.11
SMITHS GROUP PLC	26,476	17.25	456,711.00
SPIRAX GROUP PLC	5,514	87.30	481,372.20
EXPERIAN PLC	68,159	36.87	2,513,022.33
INTERTEK GROUP PLC	13,890	47.78	663,664.20
RELX PLC	145,542	36.12	5,256,977.04
RENTOKIL INITIAL PLC	181,834	4.57	832,436.05
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	73,202	4.75	348,295.11
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,952	46.32	322,016.64
BURBERRY GROUP PLC	29,776	10.18	303,119.68
PERSIMMON PLC	25,686	13.65	350,742.33
TAYLOR WIMPEY PLC	264,104	1.44	380,309.76
COMPASS GROUP PLC	129,701	22.44	2,910,490.44
ENTAIN PLC	49,630	6.70	332,521.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,042	146.00	1,904,132.00
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,833	83.38	1,153,395.54
PEARSON	55,305	9.75	539,666.19
WHITBREAD PLC	17,434	29.61	516,220.74
AUTO TRADER GROUP PLC	72,462	8.04	583,029.25
INFORMA PLC	110,598	8.68	960,875.42
WPP PLC	85,821	7.65	656,702.29
JD SPORTS FASHION PLC	206,825	1.29	268,769.08
KINGFISHER PLC	153,717	2.47	380,142.14
NEXT PLC	8,464	92.92	786,474.88
SAINSBURY (J) PLC	148,335	2.60	385,967.67
TESCO PLC	525,585	3.08	1,620,904.14
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,740	25.19	648,390.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO	157,980	25.35	4,004,793.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	17,960	27.30	490,308.00
DIAGEO	174,682	25.78	4,503,301.96
IMPERIAL BRANDS PLC	68,478	20.64	1,413,385.92

	HALEON PLC	530,525	3.34	1,773,545.07
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,621	44.44	2,516,237.24
	UNILEVER PLC	193,307	44.37	8,577,031.59
	SMITH & NEPHEW PLC	68,595	9.96	683,343.39
	ASTRAZENECA	120,005	124.78	14,974,223.90
	GSK PLC	319,416	16.08	5,137,806.36
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	17,910	19.79	354,438.90
	BARCLAYS	1,129,529	2.07	2,344,337.43
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,446,594	6.90	9,991,624.75
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,828,476	0.55	2,688,495.43
	NATWEST GROUP PLC	506,122	3.15	1,597,827.15
	STANDARD CHARTERED PLC	161,358	7.31	1,180,817.84
	3I GROUP PLC	74,757	31.28	2,338,398.96
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	33,079	11.39	376,935.20
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	35,214	96.26	3,389,699.64
	M&G PLC	131,539	2.09	275,179.58
	SCHRODERS PLC	39,932	3.78	151,102.68
	WISE PLC - A	49,048	6.86	336,714.52
	ADMIRAL GROUP PLC	16,255	25.69	417,590.95
	AVIVA PLC	193,334	4.84	936,316.56
	LEGAL & GENERAL GROUP	498,200	2.30	1,147,852.80
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,001	5.25	268,010.25
	PRUDENTIAL	212,226	7.59	1,610,795.34
	SAGE GROUP PLC	76,660	10.66	817,578.90
	HALMA PLC	31,069	27.02	839,484.38
	BT GROUP PLC	464,863	1.45	674,283.78
	VODAFONE GROUP PLC	1,645,717	0.72	1,189,853.39
	CENTRICA PLC	453,631	1.37	622,381.73
	NATIONAL GRID PLC	371,439	8.88	3,301,349.83
	SEVERN TRENT PLC	17,468	24.74	432,158.32
	SSE PLC	81,692	18.26	1,491,695.92
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	50,580	10.14	513,134.10
	イギリスポンド 小計	20,767,751		154,627,084.66 (31,307,345,831)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	17,398	14.00	243,572.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	574	747.00	428,778.00

GIVAUDAN-REG	742	4,349.00	3,226,958.00	
HOLCIM LTD	38,804	78.78	3,056,979.12	
SIG GROUP AG	26,203	16.64	436,017.92	
SIKA AG-BR	12,257	257.20	3,152,500.40	
ABB LTD	124,889	50.12	6,259,436.68	
GEBERIT AG-REG	2,530	547.40	1,384,922.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,048	230.50	472,064.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,092	234.00	723,528.00	
VAT GROUP AG	1,956	501.40	980,738.40	
ADECCO GROUP AG-REG	14,856	31.28	464,695.68	
SGS SA	12,959	80.30	1,040,607.70	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,781	259.00	979,279.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	40,975	140.50	5,756,987.50	
SWATCH GROUP AG (BEARER)	2,483	192.50	477,977.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,938	38.10	150,037.80	
AVOLTA AG	7,820	36.60	286,212.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	280	1,566.00	438,480.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	107,600.00	860,800.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	82	10,940.00	897,080.00	
NESTLE SA - REGISTERED	205,438	94.68	19,450,869.84	
ALCON INC	38,399	80.80	3,102,639.20	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,887	273.20	1,061,928.40	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,540	108.35	925,309.00	
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,850	79.30	146,705.00	
LONZA GROUP AG-REG	5,536	487.10	2,696,585.60	
NOVARTIS	152,401	96.01	14,632,020.01	
ROCHE HOLDING AG-BR	2,215	279.00	617,985.00	
ROCHE HOLDING GENUSS	54,075	255.40	13,810,755.00	
SANDOZ GROUP AG	30,458	32.13	978,615.54	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	2,487	96.75	240,617.25	
JULIUS BAER GROUP LTD	15,289	51.42	786,160.38	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,825	1,171.00	2,137,075.00	
UBS GROUP AG	249,657	27.38	6,835,608.66	
BALOISE HOLDING AG - REG	4,264	158.60	676,270.40	
HELVETIA HOLDING AG-REG	2,955	122.50	361,987.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,119	656.00	1,390,064.00	

	SWISS RE LTD	24,330	113.10	2,751,723.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,440	487.20	5,573,568.00	
	TEMENOS AG - REG	5,150	61.75	318,012.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,006	87.38	1,049,084.28	
	SWISSCOM	1,856	506.50	940,064.00	
	BKW AG	1,744	146.20	254,972.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,679	84.75	481,295.25	
	スイスフラン 小計	1,161,275		112,937,567.31 (20,197,754,537)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	22,252	347.90	7,741,470.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,383	423.60	2,280,238.80	
	SCA SV CELLULOSA B	34,763	156.35	5,435,195.05	
	ALFA LAVAL AB	25,134	471.50	11,850,681.00	
	ASSA ABLOY AB-B	75,977	297.20	22,580,364.40	
	ATLAS COPCO A	207,097	202.30	41,895,723.10	
	ATLAS COPCO B	114,624	173.65	19,904,457.60	
	BEIJER REF AB	26,868	170.25	4,574,277.00	
	EPIROC AB-A	53,479	216.10	11,556,811.90	
	EPIROC AB-B	28,804	197.30	5,683,029.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	38,712	89.66	3,470,917.92	
	INDUTRADE AB	22,644	279.60	6,331,262.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	14,002	288.60	4,040,977.20	
	LIFCO AB-B SHS	17,970	291.80	5,243,646.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	122,848	48.16	5,916,359.68	
	SAAB AB-B	25,552	245.35	6,269,183.20	
	SANDVIK AB	87,594	217.30	19,034,176.20	
	SKANSKA B	25,507	195.55	4,987,893.85	
	SKF AB-B	21,050	213.00	4,483,650.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	16,653	421.00	7,010,913.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,514	276.60	3,737,972.40	
	VOLVO B	124,872	271.30	33,877,773.60	
	SECURITAS B	28,375	105.85	3,003,493.75	
	VOLVO CAR AB-B	49,839	33.31	1,660,137.09	
	EVOLUTION AB	13,186	1,105.50	14,577,123.00	
	HENNES & MAURITZ B	40,961	193.00	7,905,473.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	49,474	277.40	13,724,087.60	

	GETINGE AB-B SHS	17,796	180.30	3,208,618.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	14,335	276.00	3,956,460.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	114,218	153.65	17,549,595.70	
	SVENSKA HANDELSBK A	120,736	100.65	12,152,078.40	
	SWEDBANK AB-A	71,421	218.00	15,569,778.00	
	EQT AB	31,471	320.00	10,070,720.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	11,818	363.20	4,292,297.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	11,168	360.30	4,023,830.40	
	INVESTOR AB-B SHS	128,538	288.85	37,128,201.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	7,280	528.50	3,847,480.00	
	ERICSSON (LM) B	214,689	64.94	13,941,903.66	
	HEXAGON AB-B SHS	172,099	118.15	20,333,496.85	
	TELE2 AB-B SHS	46,762	106.70	4,989,505.40	
	TELIA CO AB	123,760	28.04	3,470,230.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	56,700	70.50	3,997,350.00	
	SAGAX AB-B	17,402	266.40	4,635,892.80	
	スウェーデンクローナ 小計	2,467,327		441,944,728.05 (6,726,398,760)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	29,320	265.90	7,796,188.00	
	EQUINOR ASA	66,436	293.95	19,528,862.20	
	NORSK HYDRO	100,517	66.38	6,672,318.46	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,498	305.50	3,818,139.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,304	876.50	4,648,956.00	
	MOWI ASA	31,968	184.90	5,910,883.20	
	ORKLA	39,191	88.15	3,454,686.65	
	SALMAR ASA	5,423	601.00	3,259,223.00	
	DNB BANK ASA	71,795	211.00	15,148,745.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,574	194.00	3,603,356.00	
	TELENOR ASA	51,193	122.60	6,276,261.80	
	ノルウェークローネ 小計	432,219		80,117,619.31 (1,212,179,580)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,112	432.50	13,023,440.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	755	2,766.00	2,088,330.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS A/S	83,415	178.20	14,864,553.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	219	11,460.00	2,509,740.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	306	11,690.00	3,577,140.00	

	DSV A/S	12,386	1,074.00	13,302,564.00	
	PANDORA A/S	6,512	1,067.00	6,948,304.00	
	CARLSBERG AS-B	6,810	859.20	5,851,152.00	
	COLOPLAST-B	9,737	848.60	8,262,818.20	
	DEMANT A/S	8,512	313.00	2,664,256.00	
	GENMAB A/S	4,878	1,805.00	8,804,790.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	253,029	988.40	250,093,863.60	
	DANSKE BANK A/S	53,617	209.90	11,254,208.30	
	TRYG A/S	29,772	153.30	4,564,047.60	
	ORSTED A/S	12,910	395.00	5,099,450.00	
	デンマーククローネ 小計	512,970		352,908,656.70 (8,102,782,757)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	20,629	32.21	664,460.09	
	SANTOS	224,634	7.50	1,684,755.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,135	26.97	3,806,410.95	
	BHP GROUP LTD	388,318	42.43	16,476,332.74	
	BLUESCOPE STEEL LTD	34,770	19.61	681,839.70	
	FORTESCUE LTD	137,312	21.26	2,919,253.12	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	30,758	47.44	1,459,159.52	
	MINERAL RESOURCES LTD	14,409	54.76	789,036.84	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	88,682	13.45	1,192,772.90	
	ORICA LTD	38,288	17.82	682,292.16	
	PILBARA MINERALS LTD	209,485	3.11	651,498.35	
	RIO TINTO LTD	28,272	118.99	3,364,085.28	
	SOUTH32 LTD	346,773	3.64	1,262,253.72	
	REECE LTD	16,814	25.81	433,969.34	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	12,630	37.57	474,509.10	
	BRAMBLES LTD	108,007	14.36	1,550,980.52	
	COMPUTERSHARE LIMITED	44,376	26.55	1,178,182.80	
	AURIZON HOLDINGS LTD	119,591	3.66	437,703.06	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	85,000	6.06	515,100.00	
	TRANSURBAN GROUP	224,973	12.68	2,852,657.64	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	46,210	49.01	2,264,752.10	
	LOTTERY CORP LTD/THE	182,013	5.15	937,366.95	
	CAR GROUP LTD	29,334	34.04	998,529.36	
	REA GROUP LTD	3,586	197.29	707,481.94	

	SEEK LTD	28,001	21.97	615,181.97	
	WESFARMERS LTD	82,500	65.30	5,387,250.00	
	COLES GROUP LTD	108,486	17.10	1,855,110.60	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	109,901	5.07	557,198.07	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	92,071	33.43	3,077,933.53	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	63,960	12.42	794,383.20	
	COCHLEAR LIMITED	4,783	323.75	1,548,496.25	
	PRO MEDICUS LTD	3,708	141.15	523,384.20	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,107	47.83	579,077.81	
	SONIC HEALTHCARE LTD	41,829	26.54	1,110,141.66	
	CSL LIMITED	37,640	292.01	10,991,256.40	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	238,423	28.65	6,830,818.95	
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	130,513	126.80	16,549,048.40	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	240,813	35.96	8,659,635.48	
	WESTPAC BANKING	276,117	27.15	7,496,576.55	
	ASX LTD	14,549	58.06	844,714.94	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	28,241	199.27	5,627,584.07	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	13,812	33.25	459,249.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	166,662	6.68	1,113,302.16	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	232,183	3.70	859,077.10	
	QBE INSURANCE GROUP	127,819	17.57	2,245,779.83	
	SUNCORP GROUP LIMITED	94,864	16.64	1,578,536.96	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,801	94.14	1,299,226.14	
	XERO LTD	11,340	131.33	1,489,282.20	
	TELSTRA GROUP LTD	308,467	3.62	1,116,650.54	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	155,535	10.66	1,658,003.10	
	オーストラリアドル 小計	5,214,124		132,852,282.29 (14,104,926,810)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	82,461	7.63	629,177.43	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,980	29.73	1,188,605.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,957	3.98	529,168.86	
	MERCURY NZ LTD	64,613	6.62	427,738.06	
	MERIDIAN ENERGY LTD	110,544	6.15	679,845.60	
	ニュージーランドドル 小計	430,555		3,454,535.35 (337,335,376)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	175,996	36.75	6,467,853.00	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	107,000	92.80	9,929,600.00	
	MTR CORP	125,000	24.50	3,062,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120,000	21.90	2,628,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	174,000	37.50	6,525,000.00	
	SANDS CHINA LTD	198,000	17.36	3,437,280.00	
	WH GROUP LTD	658,301	5.22	3,436,331.22	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	281,500	24.00	6,756,000.00	
	HANG SENG BANK	59,400	103.30	6,136,020.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	96,300	257.80	24,826,140.00	
	AIA GROUP LTD	864,200	55.45	47,919,890.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	37,500	42.90	1,608,750.00	
	CLP HOLDINGS	136,500	63.30	8,640,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	904,657	5.84	5,283,196.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	112,000	41.85	4,687,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	121,996	29.45	3,592,782.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	125,228	21.50	2,692,402.00	
	SINO LAND CO	315,400	8.05	2,538,970.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	105,000	69.40	7,287,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	44,500	69.50	3,092,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	96,200	12.40	1,192,880.00	
	WHARF HOLDINGS	84,000	22.20	1,864,800.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	123,000	20.55	2,527,650.00	
	香港ドル 小計	5,065,678		166,133,445.30 (3,395,767,621)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	112,800	6.54	737,712.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	147,400	4.10	604,340.00	
	SINGAPORE AIRLINES	108,332	6.77	733,407.64	
	GENTING SINGAPORE LTD	292,800	0.87	254,736.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	178,600	3.15	562,590.00	
	DBS GROUP	155,760	35.54	5,535,710.40	
	OCBC BANK	257,100	14.31	3,679,101.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	94,000	30.58	2,874,520.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	66,000	9.50	627,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	622,143	2.65	1,648,678.95	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	84,100	5.00	420,500.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	260,100	2.66	691,866.00	

シンガポールドル 小計		2,379,135		18,370,161.99 (2,167,311,711)
イスラエルシェケル	ICL LTD	59,427	16.22	963,905.94
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,146	670.80	1,439,536.80
	BANK HAPOALIM BM	98,310	33.47	3,290,435.70
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	112,512	30.55	3,437,241.60
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	99,500	18.55	1,845,725.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,503	127.80	1,597,883.40
	NICE LTD	4,991	613.90	3,063,974.90
	AZRIELI GROUP	1,537	218.50	335,834.50
イスラエルシェケル 小計		390,926		15,974,537.84 (683,579,228)
合 計		84,256,552		756,800,302,315 (756,800,302,315)

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダドル	CONSTELLATION SOFTWA WRT	1,490.00	—	
	カナダドル 小計		1,490.00	— (—)	
新株予約権証券合計				— (—)	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	83,290	698,803.10	
	オーストラリアドル 小計		83,290	698,803.10 (74,191,925)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	315,000	2,756,250.00	
	香港ドル 小計		315,000	2,756,250.00 (56,337,750)	
投資信託受益証券合計			398,290	130,529,675 (130,529,675)	
投資証券	アメリカドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,503	1,475,729.09	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24,974	919,043.20	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	36,290	7,126,993.10	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37,402	754,398.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,673	2,409,423.93	
		BOSTON PROPERTIES	11,259	700,197.21	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,749	860,913.90	
		CROWN CASTLE INC	33,735	3,286,801.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,348	3,432,389.48	
		EQUINIX INC	7,333	5,515,882.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,090	916,131.80	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	25,885	1,790,983.15	
		ESSEX PROPERTY TRUST	5,205	1,453,183.95	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,693	2,500,365.69	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,095	804,865.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,765	1,076,132.25	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	56,773	1,028,159.03	
		INVITATION HOMES INC	45,008	1,613,536.80	
		IRON MOUNTAIN INC	23,326	2,078,113.34	
		KIMCO REALTY CORP	47,897	916,748.58	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,195	1,317,827.40	
		PROLOGIS INC	71,288	7,957,879.44	
		PUBLIC STORAGE	11,847	3,462,996.57	
		REALTY INCOME CORP	64,068	3,436,607.52	
		REGENCY CENTERS CORP	12,511	778,934.86	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,933	1,761,319.61	
		SIMON PROPERTY GROUP	25,979	3,908,540.55	
		SUN COMMUNITIES INC	10,890	1,307,889.00	
		UDR INC	23,815	980,225.40	
		VENTAS INC	31,565	1,600,029.85	
		VICI PROPERTIES INC	83,762	2,381,353.66	
		WELLTOWER INC	43,994	4,530,062.18	
		WP CAREY INC	16,024	895,901.84	
		アメリカドル 小計	926,874	74,979,559.97 (11,963,738,588)	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,887	216,542.97	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,490	260,232.00	
		カナダドル 小計	20,377	476,774.97 (55,706,387)	
	ユーロ	COVIVIO(FP)	4,962	229,542.12	
		GECINA SA	3,139	290,043.60	
		KLEPIERRE	17,225	449,572.50	

		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,455	779,943.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	12,914	330,081.84	
	ユーロ 小計		48,695	2,079,183.06	(356,143,266)
イギリスポンド		LAND SECURITIES GROUP PLC	56,289	354,339.25	
		SEGRO PLC	103,047	935,048.47	
	イギリスポンド 小計		159,336	1,289,387.72	(261,062,331)
オーストラリアドル		DEXUS	94,090	624,757.60	
		GOODMAN GROUP	135,303	4,759,959.54	
		GPT GROUP	167,884	703,433.96	
		MIRVAC GROUP	266,683	509,364.53	
		SCENTRE GROUP	381,283	1,220,105.60	
		STOCKLAND	207,412	912,612.80	
		VICINITY CENTERS	305,149	572,154.37	
	オーストラリアドル 小計		1,557,804	9,302,388.40	(987,634,576)
香港ドル		LINK REIT	166,900	5,290,730.00	
	香港ドル 小計		166,900	5,290,730.00	(108,142,521)
シンガポールドル		CAPITALAND ASCENDAS REIT	284,138	721,710.52	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	338,529	660,131.55	
	シンガポールドル 小計		622,667	1,381,842.07	(163,029,727)
投資証券合計			3,502,653	13,895,457,396	(13,895,457,396)
合計				14,025,987,071	(14,025,987,071)

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券	組入投資信託 受益証券	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	---------------	----------------	----------------	----------------

			時価比率	時価比率		
アメリカドル	株式 580 銘柄	98.0%	—	—	—	74.8%
	投資証券 33 銘柄	—	—	—	2.0%	1.6%
カナダドル	株式 85 銘柄	99.8%	—	—	—	3.1%
	新株予約権 1 銘柄 証券	—	—	—	—	—
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式 218 銘柄	99.5%	—	—	—	8.9%
	投資証券 5 銘柄	—	—	—	0.5%	0.0%
イギリスポンド	株式 78 銘柄	99.2%	—	—	—	4.1%
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 45 銘柄	100.0%	—	—	—	2.6%
スウェーデンクローナ	株式 43 銘柄	100.0%	—	—	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 15 銘柄	100.0%	—	—	—	1.1%
オーストラリアドル	株式 50 銘柄	93.0%	—	—	—	1.8%
	投資信託受益証券 1 銘柄	—	—	0.5%	—	0.0%
	投資証券 7 銘柄	—	—	—	6.5%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5 銘柄	100.0%	—	—	—	0.0%
香港ドル	株式 23 銘柄	95.4%	—	—	—	0.4%
	投資信託受益証券 1 銘柄	—	—	1.6%	—	0.0%
	投資証券 1 銘柄	—	—	—	3.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 12 銘柄	93.0%	—	—	—	0.3%
	投資証券 2 銘柄	—	—	—	7.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8 銘柄	100.0%	—	—	—	0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

貸借対照表

	2024年6月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	564,371,755
コール・ローン	7,412,648
株式	16,468,560,382
投資信託受益証券	4,751,347
投資証券	299,704,511
派生商品評価勘定	3,488,304
未収入金	149,903
未収配当金	16,678,072
未収利息	13
差入委託証拠金	223,126,637
流動資産合計	17,588,243,572
資産合計	17,588,243,572
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	213,740
前受金	3,284,735
未払解約金	2,911
流動負債合計	3,501,386
負債合計	3,501,386
純資産の部	
元本等	
元本	9,577,609,205
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	8,007,132,981
元本等合計	17,584,742,186
純資産合計	17,584,742,186
負債純資産合計	17,588,243,572

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年6月25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)

	2024年6月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,577,609,205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 1.8360円 (1万口当たり純資産額) (18,360円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年6月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月 25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年 6月 25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月 27日
期首元本額	9,095,211,203円
期中追加設定元本額	2,345,349,058円
期中一部解約元本額	1,862,951,056円
期末元本額	9,577,609,205円

期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	140,997,633 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	345,177,988 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	150,284,295 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	84,973,097 円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	5,964,784,153 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	144,422,799 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	36,726,438 円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,650,642,875 円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	59,599,927 円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	3,075,332,889	
投資信託受益証券	△542,204	
投資証券	26,366,014	
合計	3,101,156,699	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年6月25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	811,003,158	—	814,287,893	3,284,735
合計		811,003,158	—	814,287,893	3,284,735

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2024年6月25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	12,183,090	—	12,172,919	△10,171

	アメリカドル	10,060,330	—	10,050,065	△10,265
	オーストラリア ドル	2,122,760	—	2,122,854	94
	合計	12,183,090	—	12,172,919	△10,171

(注)時価の算定方法

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	3,429	34.41	117,991.89	
	CHENIERE ENERGY INC	711	165.96	117,997.56	
	HALLIBURTON CO	2,908	34.34	99,860.72	
	HF SINCLAIR CORP	505	53.81	27,174.05	
	KINDER MORGAN INC	6,619	20.11	133,108.09	
	MARATHON PETROLEUM CORP	1,145	173.99	199,218.55	
	ONEOK INC	1,824	80.89	147,543.36	
	PHILLIPS 66	1,360	138.55	188,428.00	
	SCHLUMBERGER	4,395	47.48	208,674.60	
	TARGA RESOURCES CORP	636	128.60	81,789.60	
	VALERO ENERGY CORP	1,047	150.73	157,814.31	
	WILLIAMS COS	3,848	43.11	165,887.28	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	706	270.90	191,255.40	
	AVERY DENNISON CORP	251	229.52	57,609.52	
	BALL CORP	921	61.58	56,715.18	
	ECOLAB INC	818	244.64	200,115.52	
	INT'L PAPER CO	1,067	47.32	50,490.44	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	776	97.86	75,939.36	
	LINDE PLC	1,534	443.14	679,776.76	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	801	97.52	78,113.52	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	188	541.17	101,739.96		

NEWMONT CORPORATION	3,602	42.60	153,445.20
NUCOR CORP	769	155.56	119,625.64
PPG INDUSTRIES INC	779	128.15	99,828.85
STEEL DYNAMICS INC	441	126.34	55,715.94
WESTROCK CO	968	51.09	49,455.12
3 M COMPANY	1,735	102.99	178,687.65
AERCAP HOLDINGS NV	651	93.31	60,744.81
ALLEGION PLC	283	118.39	33,504.37
AXON ENTERPRISE INC	219	292.70	64,101.30
CARRIER GLOBAL CORP	2,696	64.63	174,242.48
CATERPILLAR	1,587	330.00	523,710.00
CNH INDUSTRIAL NV	2,770	10.20	28,254.00
CUMMINS INC	448	283.96	127,214.08
DEERE&CO	840	378.17	317,662.80
DOVER CORP	416	184.40	76,710.40
EATON CORP	1,271	322.08	409,363.68
EMCOR GROUP INC	150	380.78	57,117.00
FERGUSON PLC	643	195.37	125,622.91
FORTIVE CORP	1,182	74.24	87,751.68
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	438	67.12	29,398.56
GENERAL ELECTRIC CO	3,474	160.54	557,715.96
GRACO INC	519	79.79	41,411.01
GRAINGER (WW) INC	138	915.50	126,339.00
IDEX CORP	216	204.50	44,172.00
ILLINOIS TOOL WORKS	950	242.59	230,460.50
INGERSOLL-RAND INC	1,247	92.92	115,871.24
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,151	68.77	147,924.27
LENNOX INTERNATIONAL INC	108	547.32	59,110.56
OWENS CORNING	245	178.24	43,668.80
PENTAIR PLC	479	80.00	38,320.00
QUANTA SERVICES INC	487	274.23	133,550.01
ROCKWELL AUTOMATION INC	382	265.87	101,562.34
TORO CO	322	94.98	30,583.56
TRANE TECHNOLOGIES PLC	739	338.14	249,885.46
UNITED RENTALS INC	216	645.37	139,399.92
XYLEM INC	752	138.34	104,031.68

AUTOMATIC DATA PROCESS	1,288	249.20	320,969.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	350	201.84	70,644.00
CINTAS CORP	291	711.00	206,901.00
DAYFORCE INC	453	50.21	22,745.13
PAYCHEX INC	1,012	126.08	127,592.96
PAYLOCITY HOLDING CORP	129	135.10	17,427.90
TRANSUNION	597	75.55	45,103.35
VERALTO CORP	783	99.75	78,104.25
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	374	88.49	33,095.26
CSX CORP	6,407	33.21	212,776.47
DELTA AIR LINES INC	457	49.40	22,575.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	413	126.98	52,442.74
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	6,680	3.53	23,580.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	226	157.97	35,701.22
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	528	48.89	25,813.92
OLD DOMINION FREIGHT LINE	621	176.07	109,339.47
UNION PACIFIC CORP	1,938	226.36	438,685.68
UNITED PARCEL SERVICE B	2,364	138.60	327,650.40
APTIV PLC	915	76.09	69,622.35
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,859	11.01	31,477.59
TESLA INC	9,108	182.58	1,662,938.64
DECKERS OUTDOOR CORP	81	978.08	79,224.48
DR HORTON INC	949	144.05	136,703.45
LULULEMON ATHLETICA INC	397	312.28	123,975.16
NIKE B	3,851	97.17	374,201.67
NVR INC	10	7,740.78	77,407.80
PULTE GROUP INC	693	112.68	78,087.24
BOOKING HOLDINGS INC	109	3,981.20	433,950.80
DARDEN RESTAURANTS INC	379	154.13	58,415.27
DOMINO'S PIZZA INC	111	533.42	59,209.62
DOORDASH INC - A	898	110.70	99,408.60
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	799	217.04	173,414.96
MCDONALD'S CORP	2,291	260.38	596,530.58
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	775	154.52	119,753.00
YUM BRANDS INC	900	133.99	120,591.00
ALPHABET INC-CL A	18,725	179.22	3,355,894.50

ALPHABET INC-CL C	16,218	180.79	2,932,052.22
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	298	285.85	85,183.30
COMCAST CORP-CL A	12,594	38.48	484,617.12
ELECTRONIC ARTS INC	762	141.23	107,617.26
FOX CORP - CLASS A	918	34.46	31,634.28
FOX CORP- CLASS B	492	32.07	15,778.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1,160	29.51	34,231.60
OMNICOM GROUP	623	90.73	56,524.79
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	565	159.71	90,236.15
THE WALT DISNEY CO	5,798	101.98	591,280.04
AUTOZONE INC	57	2,985.44	170,170.08
BATH & BODY WORKS INC	712	41.50	29,548.00
BEST BUY COMPANY INC	593	89.33	52,972.69
BURLINGTON STORES INC	211	242.53	51,173.83
CARMAX INC	544	73.18	39,809.92
DICK'S SPORTING GOODS INC	187	229.78	42,968.86
EBAY	1,615	54.01	87,226.15
ETSY INC	377	59.95	22,601.15
GENUINE PARTS CO	499	142.05	70,882.95
HOME DEPOT	3,149	350.88	1,104,921.12
LKQ CORP	787	41.97	33,030.39
LOWES COMPANIES	1,819	228.39	415,441.41
MERCADOLIBRE INC	149	1,582.86	235,846.14
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	188	1,083.52	203,701.76
POOL CORP	111	337.91	37,508.01
TJX COMPANIES INC	3,600	111.05	399,780.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	337	277.37	93,473.69
ULTA BEAUTY INC	149	389.72	58,068.28
WILLIAMS-SONOMA INC	194	307.55	59,664.70
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	1,098	19.79	21,729.42
KROGER CO	2,283	50.02	114,195.66
TARGET (DAYTON HUDSON)	1,521	149.69	227,678.49
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,330	15.91	37,070.30
BUNGE GLOBAL SA	425	108.17	45,972.25
CAMPBELL SOUP CO (US)	623	45.27	28,203.21
COCA-COLA CO	13,014	63.97	832,505.58

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	685	75.97	52,039.45
CONAGRA BRANDS INC	1,386	29.34	40,665.24
GENERAL MILLS INC	1,790	68.07	121,845.30
HORMEL FOODS CORP	878	30.96	27,182.88
JM SMUCKER CO	330	111.86	36,913.80
KELLANOVA	944	58.26	54,997.44
KEURIG DR PEPPER INC	3,592	34.67	124,534.64
LAMB WESTON HOLDINGS INC	450	84.95	38,227.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	733	69.20	50,723.60
PEPSICO INC	4,368	168.08	734,173.44
CHURCH & DWIGHT CO INC	760	107.48	81,684.80
CLOROX COMPANY	452	136.12	61,526.24
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,485	98.99	245,990.15
KIMBERLY-CLARK CORP	1,062	139.70	148,361.40
PROCTER & GAMBLE CO	7,492	168.45	1,262,027.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	216	237.08	51,209.28
CENCORA INC	543	239.36	129,972.48
COOPER COS INC/THE	600	89.81	53,886.00
DAVITA INC	138	143.88	19,855.44
DEXCOM INC	1,251	110.57	138,323.07
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,946	90.17	175,470.82
ELEVANCE HEALTH INC	740	541.71	400,865.40
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,375	78.85	108,418.75
HCA HEALTHCARE INC	654	341.37	223,255.98
HENRY SCHEIN INC	408	67.27	27,446.16
HOLOGIC INC	714	72.48	51,750.72
HUMANA INC	378	358.04	135,339.12
IDEXX LABORATORIES INC	265	491.49	130,244.85
INSULET CORP	273	203.94	55,675.62
LABCORP HOLDINGS INC	246	208.00	51,168.00
MOLINA HEALTHCARE INC	173	308.98	53,453.54
QUEST DIAGNOSTICS	343	140.23	48,098.89
SOLVENTUM CORP	466	51.30	23,905.80
STERIS PLC	290	216.56	62,802.40
TELEFLEX INC	130	200.73	26,094.90
THE CIGNA GROUP	902	343.14	309,512.28

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	710	108.46	77,006.60
AGILENT TECHNOLOGIES	917	135.08	123,868.36
AMGEN	1,703	318.15	541,809.45
AVANTOR INC	2,087	22.50	46,957.50
BIO-TECHNE CORP	460	74.49	34,265.40
BIOGEN INC	457	226.60	103,556.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,440	42.23	271,961.20
CATALENT INC	575	56.47	32,470.25
DANAHER CORP	2,236	256.76	574,115.36
ELI LILLY & CO	2,568	890.11	2,285,802.48
GILEAD SCIENCES INC	4,033	70.73	285,254.09
IQVIA HOLDINGS INC	578	214.09	123,744.02
JOHNSON & JOHNSON	7,657	149.12	1,141,811.84
MERCK & CO	8,048	132.96	1,070,062.08
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	68	1,453.98	98,870.64
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	316	133.62	42,223.92
REPLIGEN CORP	163	123.65	20,154.95
WATERS CORP	180	289.27	52,068.60
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	250	331.00	82,750.00
ZOETIS INC	1,474	171.84	253,292.16
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,443	35.39	51,067.77
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,109	12.98	53,334.82
KEY CORP	2,947	13.92	41,022.24
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,304	154.90	201,989.60
REGIONS FINL CORP	2,685	19.31	51,847.35
TRUIST FINANCIAL CORP	4,208	37.46	157,631.68
US BANCORP	4,896	40.55	198,532.80
ALLY FINANCIAL INC	1,015	40.40	41,006.00
AMERICAN EXPRESS	1,831	231.47	423,821.57
AMERIPRISE FINANCIAL INC	319	440.35	140,471.65
BANK NEW YORK CO	2,299	59.48	136,744.52
BLACKROCK INC	473	798.95	377,903.35
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,214	137.68	167,143.52
CBOE GLOBAL MARKETS INC	310	171.33	53,112.30
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	785	127.67	100,220.95
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,127	41.43	46,691.61

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	109	424.89	46,313.01
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	1,883	75.55	142,260.65
FISERV INC	1,858	150.27	279,201.66
FRANKLIN RESOURCES INC	1,031	23.17	23,888.27
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,816	138.72	251,915.52
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	232	277.68	64,421.76
MARKETAXESS HOLDINGS INC	116	196.29	22,769.64
MASTERCARD INC-CLASS A	2,648	456.96	1,210,030.08
MOODY'S CORP	519	425.64	220,907.16
MORGAN STANLEY	3,897	97.10	378,398.70
NASDAQ INC	1,242	60.10	74,644.20
NORTHERN TRUST CORP	584	83.51	48,769.84
PAYPAL HOLDINGS INC	3,177	59.49	188,999.73
PRICE T ROWE GROUP INC	661	118.88	78,579.68
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	690	122.38	84,442.20
S&P GLOBAL INC	1,018	444.97	452,979.46
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,762	74.53	354,911.86
STATE STREET CORP	1,059	72.94	77,243.46
SYNCHRONY FINANCIAL	1,453	45.52	66,140.56
VISA INC-CLASS A SHARES	5,026	276.30	1,388,683.80
AFLAC	1,791	90.43	161,960.13
ALLSTATE CORP	809	162.41	131,389.69
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,252	102.43	128,242.36
ASSURANT INC	127	169.24	21,493.48
HARTFORD FINANCIAL SVCS	952	104.42	99,407.84
MARSH & MCLENNAN COS	1,540	215.75	332,255.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	734	80.83	59,329.22
PROGRESSIVE CORP	1,858	210.68	391,443.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,104	119.16	131,552.64
TRAVELERS COS INC/THE	704	211.09	148,607.36
WILLIS TOWERS WATSON PLC	312	266.44	83,129.28
WEYERHAEUSER CO	2,132	29.04	61,913.28
ACCENTURE PLC-CL A	1,998	307.21	613,805.58
ADOBE INC	1,424	524.17	746,418.08
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	483	88.74	42,861.42
ANSYS INC	301	321.10	96,651.10

ASPEN TECHNOLOGY INC	91	200.03	18,202.73
ATLASSIAN CORP-CL A	500	164.75	82,375.00
AUTODESK INC	681	239.17	162,874.77
CADENCE DESIGN SYSTEMS	867	309.14	268,024.38
CONFLUENT INC-CLASS A	646	27.34	17,661.64
DOCUSIGN INC	624	51.69	32,254.56
FAIR ISAAC CORP	77	1,441.50	110,995.50
GARTNER INC	242	451.09	109,163.78
GEN DIGITAL INC	1,758	24.08	42,332.64
HUBSPOT INC	160	573.60	91,776.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,913	175.01	509,804.13
INTUIT INC	890	623.88	555,253.20
MANHATTAN ASSOCIATES INC	196	241.47	47,329.10
MICROSOFT CORP	22,429	447.67	10,040,790.43
PALO ALTO NETWORKS INC	1,027	316.68	325,230.36
PTC INC	352	177.60	62,515.20
SALESFORCE INC	3,083	239.94	739,735.02
SERVICENOW INC	652	739.59	482,212.68
SYNOPSYS INC	500	595.60	297,800.00
TWILIO INC - A	549	54.81	30,090.69
UIPATH INC - CLASS A	1,391	12.03	16,733.73
WORKDAY INC-CLASS A	654	218.70	143,029.80
ZSCALER INC	334	181.06	60,474.04
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,851	20.47	78,829.97
HP INC	3,046	36.30	110,569.80
JUNIPER NETWORKS INC	1,031	35.54	36,641.74
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	534	136.91	73,109.94
NETAPP INC	661	126.38	83,537.18
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	591	103.33	61,068.03
TRIMBLE IMS HOLDINGS	733	56.13	41,143.29
WESTERN DIGITAL CORP	987	75.40	74,419.80
VERIZON COMMUNICATIONS	13,359	41.17	549,990.03
AMERICAN WATER WORKS CO INC	652	132.18	86,181.36
ATMOS ENERGY CORP	528	118.02	62,314.56
CMS ENERGY CORP	839	60.77	50,986.03
CONSOLIDATED EDISON INC	1,035	91.27	94,464.45

	EDISON INTL	1,297	72.76	94,369.72
	ESSENTIAL UTILITIES INC	767	37.94	29,099.98
	EVERSOURCE ENERGY	1,194	58.00	69,252.00
	EXELON CORP	3,057	35.33	108,003.81
	NRG ENERGY INC	623	81.56	50,811.88
	SEMPRA	1,927	76.45	147,319.15
	ADVANCED MICRO DEVICES	5,135	160.25	822,883.75
	APPLIED MATERIALS	2,641	229.84	607,007.44
	ENPHASE ENERGY INC	431	108.02	46,556.62
	FIRST SOLAR INC	323	261.28	84,393.44
	INTEL CORP	13,410	30.57	409,943.70
	LAM RESEARCH CORP	412	1,024.42	422,061.04
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	437	56.65	24,756.05
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,801	67.77	189,823.77
	NVIDIA CORP	79,440	118.11	9,382,658.40
	NXP SEMICONDUCTORS NV	816	267.27	218,092.32
	TEXAS INSTRUMENTS	2,892	193.91	560,787.72
	CBRE GROUP INC-A	950	89.26	84,797.00
	アメリカドル 小計	564,224		79,411,386.05 (12,670,880,758)
カナダドル	CAMECO CORP	1,237	68.89	85,216.93
	ENBRIDGE	6,754	47.97	323,989.38
	IMPERIAL OIL	613	93.95	57,591.35
	KEYERA CORP	573	36.72	21,040.56
	PARKLAND CORP	413	37.67	15,557.71
	PEMBINA PIPELINE CORP	2,000	50.02	100,040.00
	AGNICO EAGLE MINES	1,640	89.69	147,091.60
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,594	18.04	28,755.76
	KINROSS GOLD CORP	3,375	10.46	35,302.50
	LUNDIN MINING CORP	1,764	15.06	26,565.84
	NUTRIEN LTD	1,453	71.89	104,456.17
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	257	105.80	27,190.60
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,359	72.84	98,989.56
	CAE INC	1,167	26.38	30,785.46
	STANTEC INC	362	113.60	41,123.20
	WSP GLOBAL INC	396	211.45	83,734.20

	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	1,237	23.95	29,626.15	
	RB GLOBAL INC	570	106.88	60,921.60	
	THOMSON REUTERS CORP	488	225.74	110,161.12	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,761	161.58	284,542.38	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	546	52.20	28,501.20	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	143	138.28	19,774.04	
	DOLLARAMA INC	838	126.06	105,638.28	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,403	78.42	188,443.26	
	METRO INC	705	75.53	53,248.65	
	BANK MONTREAL	2,255	116.40	262,482.00	
	BANK NOVA SCOTIA	3,962	62.84	248,972.08	
	NATIONAL BANK OF CANADA	1,167	106.72	124,542.24	
	TORONTO-DOMINION BANK	5,619	75.41	423,728.79	
	BROOKFIELD CORP	4,194	56.63	237,506.22	
	IA FINANCIAL CORP INC	312	86.09	26,860.08	
	INTACT FINANCIAL CORP	597	227.79	135,990.63	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,748	67.07	117,238.36	
	CGI INC - CL A	656	136.08	89,268.48	
	OPEN TEXT CORP	1,049	40.12	42,085.88	
	SHOPIFY INC - CLASS A	3,906	87.82	343,024.92	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,342	51.93	69,690.06	
	TELUS CORP	1,700	21.64	36,788.00	
	FORTIS INC	1,705	53.78	91,694.90	
	HYDRO ONE LTD	1,129	39.32	44,392.28	
	FIRSTSERVICE CORP	81	208.36	16,877.16	
	カナダドル 小計	65,070		4,419,429.58 (516,366,152)	
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,436	19.08	27,406.06	
	NESTE OIL OYJ	1,576	16.78	26,453.16	
	OMV AG	448	39.66	17,767.68	
	REPSOL SA	4,227	14.80	62,559.60	
	TENARIS SA	1,751	14.50	25,389.50	
	TOTALENERGIES SE	6,826	62.51	426,693.26	
	AKZO NOBEL	535	57.88	30,965.80	
	COVESTRO AG	600	53.86	32,316.00	
	DSM-FIRMENICH AG	659	104.50	68,865.50	

EVONIK INDUSTRIES AG	657	19.09	12,542.13
HEIDELBERG MATERIALS AG	367	95.96	35,217.32
OCI NV	511	23.25	11,880.75
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	816	42.86	34,973.76
STORA ENSO OYJ R	2,074	12.58	26,090.92
SYMRISE AG	364	114.70	41,750.80
UMICORE	562	14.82	8,328.84
UPM KYMMENE OYJ	1,804	33.05	59,622.20
VOESTALPINE AG	498	25.78	12,838.44
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	766	40.90	31,329.40
BOUYGUES ORD	586	31.82	18,646.52
EIFFAGE	297	90.02	26,735.94
GEA GROUP AG	399	39.80	15,880.20
KINGSPAN GROUP PLC	591	80.20	47,398.20
KNORR-BREMSE AG	224	71.55	16,027.20
KONE OYJ-B	1,080	47.07	50,835.60
METSO CORPORATION	2,196	10.26	22,541.94
MTU AERO ENGINES AG	171	228.80	39,124.80
REXEL SA	717	24.80	17,781.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,730	227.15	392,969.50
WARTSILA OYJ	1,323	18.66	24,687.18
WOLTERS KLUWER	760	153.75	116,850.00
ADP	92	117.80	10,837.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	2,000	5.81	11,620.00
GETLINK	1,366	15.91	21,733.06
MICHELIN	2,056	37.38	76,853.28
ADIDAS AG	510	220.10	112,251.00
HERMES INTERNATIONAL	102	2,178.00	222,156.00
KERING	224	324.20	72,620.80
LVMH	877	726.50	637,140.50
MONCLER SPA	637	58.26	37,111.62
PUMA SE	276	44.65	12,323.40
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,403	64.02	89,820.06
PUBLICIS GROUPE	727	103.80	75,462.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	2,674	27.98	74,818.52
PROSUS	4,505	34.49	155,377.45

ZALANDO SE	648	21.67	14,042.16
CARREFOUR	2,101	13.80	29,004.30
JERONIMO MARTINS	863	19.44	16,776.72
KESKO OYJ-B SHS	689	16.89	11,640.65
KONINKLIJKE AHOLD NV	2,817	28.15	79,298.55
DANONE (GROUPE)	1,981	58.86	116,601.66
JDE PEET'S BV	322	19.87	6,398.14
KERRY GROUP PLC-A	457	75.95	34,709.15
LOTUS BAKERIES	1	10,020.00	10,020.00
BEIERSDORF AG	341	141.75	48,336.75
HENKEL AG & CO KGAA	380	73.75	28,025.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	525	83.24	43,701.00
LOREAL	762	442.10	336,880.20
EUROFINS SCIENTIFIC	429	44.22	18,970.38
MERCK KGAA	460	167.05	76,843.00
ORION OYJ-CLASS B	354	40.01	14,163.54
QIAGEN N.V.	703	39.20	27,557.60
SARTORIUS AG-VORZUG	83	224.80	18,658.40
BANCO DE SABADELL SA	17,286	1.81	31,287.66
BNP PARIBAS	3,283	61.27	201,149.41
COMMERZBANK AG	3,996	14.23	56,863.08
CREDIT AGRICOLE SA	3,742	13.28	49,712.47
FINECOBANK SPA	1,888	14.38	27,149.44
ING GROEP NV-CVA	10,393	15.80	164,292.54
INTESA SANPAOLO	46,473	3.53	164,142.63
KBC GROEP NV	872	67.12	58,528.64
MEDIOBANCA	1,829	13.93	25,487.11
DEUTSCHE BOERSE	610	194.00	118,340.00
EURAZEO SA	173	76.35	13,208.55
NEXI SPA	1,449	5.82	8,433.18
AGEAS	508	43.80	22,250.40
ASR NEDERLAND NV	504	45.00	22,680.00
ASSICURAZIONI GENERALI	3,503	23.66	82,880.98
AXA SA	5,630	30.90	173,967.00
MUENCHENER RUECKVERSICH.	429	467.10	200,385.90
NN GROUP NV	822	43.18	35,493.96

	POSTE ITALIANE SPA	1,615	12.03	19,436.52	
	SAMPO OYJ-A SHS	1,434	40.39	57,919.26	
	DASSAULT SYSTEMES SA	2,343	34.82	81,583.26	
	NOKIA OYJ	16,046	3.52	56,530.05	
	CELLNEX TELECOM SA	1,446	31.47	45,505.62	
	ELISA A	400	42.86	17,144.00	
	KPN (KON.)	12,772	3.61	46,119.69	
	ENEL	25,031	6.54	163,752.80	
	IBERDROLA SA	18,369	12.32	226,306.08	
	REDEIA CORP SA	1,048	17.32	18,151.36	
	VERBUND AG	197	75.30	14,834.10	
	ASML HOLDING NV	1,270	948.50	1,204,595.00	
	STMICROELECTRONICS NV	2,041	37.76	77,068.16	
	LEG IMMOBILIEN SE	314	75.64	23,750.96	
	ユーロ 小計	255,632		7,833,172.70 (1,341,744,151)	
イギリスポンド	ANGLO AMERICAN PLC	4,038	25.00	100,950.00	
	ANTOFAGASTA PLC	1,061	21.21	22,503.81	
	CRH PLC	2,249	58.74	132,106.26	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	412	40.98	16,883.76	
	ENDEAVOUR MINING PLC	600	16.83	10,098.00	
	MONDI PLC	1,465	15.05	22,048.25	
	ASHTREAD GROUP PLC	1,493	54.94	82,025.42	
	BUNZL PLC	1,074	30.54	32,799.96	
	DCC PLC	244	56.40	13,761.60	
	SMITHS GROUP PLC	1,103	17.25	19,026.75	
	SPIRAX GROUP PLC	247	87.30	21,563.10	
	INTERTEK GROUP PLC	614	47.78	29,336.92	
	RELX PLC	5,887	36.12	212,638.44	
	RENTOKIL INITIAL PLC	8,021	4.57	36,720.13	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,612	4.75	12,427.89	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	284	46.32	13,154.88	
	BURBERRY GROUP PLC	1,289	10.18	13,122.02	
	TAYLOR WIMPEY PLC	9,184	1.44	13,224.96	
	WHITBREAD PLC	586	29.61	17,351.46	
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,840	8.04	22,850.64	

	INFORMA PLC	4,350	8.68	37,792.80	
	WPP PLC	3,240	7.65	24,792.48	
	KINGFISHER PLC	5,110	2.47	12,637.03	
	SAINSBURY (J) PLC	4,524	2.60	11,771.44	
	TESCO PLC	21,572	3.08	66,528.04	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1,302	25.19	32,797.38	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	532	27.30	14,523.60	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,395	44.44	106,433.80	
	UNILEVER PLC	7,961	44.37	353,229.57	
	ASTRAZENECA	4,926	124.78	614,666.28	
	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	59,993	6.90	414,371.65	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	208,150	0.55	115,897.92	
	3I GROUP PLC	3,000	31.28	93,840.00	
	M&G PLC	7,183	2.09	15,026.83	
	SCHRODERS PLC	2,334	3.78	8,831.85	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,040	25.69	26,717.60	
	AVIVA PLC	8,603	4.84	41,664.32	
	LEGAL & GENERAL GROUP	17,346	2.30	39,965.18	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	2,320	5.25	12,191.60	
	PRUDENTIAL	8,456	7.59	64,181.04	
	SAGE GROUP PLC	3,200	10.66	34,128.00	
	BT GROUP PLC	20,577	1.45	29,846.93	
	VODAFONE GROUP PLC	74,642	0.72	53,966.16	
	NATIONAL GRID PLC	15,180	8.88	134,919.84	
	イギリスポンド 小計	533,239		3,205,315.59 (648,980,247)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	589	14.00	8,246.00	
	GIVAUDAN-REG	29	4,349.00	126,121.00	
	SIG GROUP AG	1,000	16.64	16,640.00	
	SIKA AG-BR	477	257.20	122,684.40	
	ABB LTD	5,270	50.12	264,132.40	
	GEBERIT AG-REG	100	547.40	54,740.00	
	VAT GROUP AG	83	501.40	41,616.20	
	SGS SA	475	80.30	38,142.50	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	152	259.00	39,368.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	10,940.00	65,640.00	

	ALCON INC	1,588	80.80	128,310.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	157	273.20	42,892.40	
	LONZA GROUP AG-REG	237	487.10	115,442.70	
	NOVARTIS	6,263	96.01	601,310.63	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	144	96.75	13,932.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	700	51.42	35,994.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	158.60	25,376.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	88	656.00	57,728.00	
	SWISS RE LTD	930	113.10	105,183.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	466	487.20	227,035.20	
	TEMENOS AG - REG	200	61.75	12,350.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	508	87.38	44,389.04	
	SWISSCOM	76	506.50	38,494.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	246	84.75	20,848.50	
	スイスフラン 小計	19,944		2,246,616.37 (401,784,871)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	963	347.90	335,027.70	
	HOLMEN AB-B SHARES	294	423.60	124,538.40	
	SCA SV CELLULOSE B	2,552	156.35	399,005.20	
	ALFA LAVAL AB	1,050	471.50	495,075.00	
	ASSA ABLOY AB-B	3,026	297.20	899,327.20	
	ATLAS COPCO A	8,406	202.30	1,700,533.80	
	ATLAS COPCO B	4,756	173.65	825,879.40	
	EPIROC AB-A	1,838	216.10	397,191.80	
	EPIROC AB-B	1,045	197.30	206,178.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,379	89.66	123,641.14	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,447	48.16	214,167.52	
	SANDVIK AB	3,167	217.30	688,189.10	
	SKF AB-B	1,022	213.00	217,686.00	
	VOLVO AB-A SHS	636	276.60	175,917.60	
	VOLVO B	5,047	271.30	1,369,251.10	
	EVOLUTION AB	590	1,105.50	652,245.00	
	HENNES & MAURITZ B	1,899	193.00	366,507.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,782	277.40	494,326.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	4,600	100.65	462,990.00	
	EQT AB	1,233	320.00	394,560.00	

	TELE2 AB-B SHS	1,519	106.70	162,077.30
	TELIA CO AB	7,952	28.04	222,974.08
	スウェーデンクローナ 小計	59,203		10,927,289.64 (166,313,348)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	772	265.90	205,274.80
	EQUINOR ASA	2,746	293.95	807,186.70
	NORSK HYDRO	4,021	66.38	266,913.98
	YARA INTERNATIONAL ASA	556	305.50	169,858.00
	MOWI ASA	1,979	184.90	365,917.10
	ORKLA	2,110	88.15	185,996.50
	SALMAR ASA	202	601.00	121,402.00
	DNB BANK ASA	2,602	211.00	549,022.00
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	604	194.00	117,176.00
	TELENOR ASA	2,114	122.60	259,176.40
	ノルウェークローネ 小計	17,706		3,047,923.48 (46,115,082)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1,278	432.50	552,735.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	50	2,766.00	138,300.00
	VESTAS WIND SYSEMS A/S	2,987	178.20	532,283.40
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	8	11,460.00	91,680.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	18	11,690.00	210,420.00
	DSV A/S	566	1,074.00	607,884.00
	PANDORA A/S	231	1,067.00	246,477.00
	COLOPLAST-B	468	848.60	397,144.80
	GENMAB A/S	185	1,805.00	333,925.00
	NOVO NORDISK A/S-B	10,356	988.40	10,235,870.40
	TRYG A/S	1,109	153.30	170,009.70
	ORSTED A/S	553	395.00	218,435.00
	デンマーククローネ 小計	17,809		13,735,164.30 (315,359,372)
オーストラリアドル	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,865	26.97	158,179.05
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,217	19.61	23,865.37
	FORTESCUE LTD	6,047	21.26	128,559.22
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1,295	47.44	61,434.80
	MINERAL RESOURCES LTD	565	54.76	30,939.40
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	4,039	13.45	54,324.55

	ORICA LTD	1,151	17.82	20,510.82	
	PILBARA MINERALS LTD	9,000	3.11	27,990.00	
	BRAMBLES LTD	3,949	14.36	56,707.64	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,618	26.55	42,957.90	
	AURIZON HOLDINGS LTD	4,697	3.66	17,191.02	
	TRANSURBAN GROUP	10,540	12.68	133,647.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,773	49.01	86,894.73	
	CAR GROUP LTD	1,138	34.04	38,737.52	
	REA GROUP LTD	218	197.29	43,009.22	
	SEEK LTD	725	21.97	15,928.25	
	COLES GROUP LTD	3,866	17.10	66,108.60	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	3,373	5.07	17,101.11	
	COCHLEAR LIMITED	213	323.75	68,958.75	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	705	47.83	33,720.15	
	CSL LIMITED	1,535	292.01	448,235.35	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	9,419	28.65	269,854.35	
	ASX LTD	680	58.06	39,480.80	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	1,158	199.27	230,754.66	
	QBE INSURANCE GROUP	4,340	17.57	76,253.80	
	SUNCORP GROUP LIMITED	4,460	16.64	74,214.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	530	94.14	49,894.20	
	XERO LTD	498	131.33	65,402.34	
	オーストラリアドル 小計	84,614		2,380,855.20 (252,775,396)	
ニュージーランドドル	SPARK NEW ZEALAND LTD	5,704	3.98	22,701.92	
	MERCURY NZ LTD	2,339	6.62	15,484.18	
	MERIDIAN ENERGY LTD	4,004	6.15	24,624.60	
	ニュージーランドドル 小計	12,047		62,810.70 (6,133,464)	
香港ドル	MTR CORP	4,000	24.50	98,000.00	
	HANG SENG BANK	2,400	103.30	247,920.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,800	257.80	979,640.00	
	AIA GROUP LTD	35,800	55.45	1,985,110.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	3,000	42.90	128,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	31,000	5.84	181,040.00	
	SINO LAND CO	10,000	8.05	80,500.00	

	SWIRE PACIFIC A	1,500	69.50	104,250.00	
	香港ドル 小計	91,500		3,805,160.00 (77,777,470)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	4,300	6.54	28,122.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	4,400	30.58	134,552.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,400	9.50	22,800.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	7,800	2.66	20,748.00	
	シンガポールドル 小計	18,900		206,222.00 (24,330,071)	
	合 計	1,739,888		16,468,560,382 (16,468,560,382)	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	5,334	44,752.26	
		オーストラリアドル 小計	5,334	44,752.26 (4,751,347)	
		投資信託受益証券合計	5,334	4,751,347 (4,751,347)	
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	1,516	297,727.24	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,460	29,448.20	
		BOSTON PROPERTIES	522	32,463.18	
		CROWN CASTLE INC	1,449	141,176.07	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,033	151,861.33	
		EQUINIX INC	302	227,164.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,436	47,867.40	
		IRON MOUNTAIN INC	950	84,635.50	
		PROLOGIS INC	3,003	335,224.89	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	356	70,192.52	
	WELLTOWER INC	1,823	187,714.31		
		アメリカドル 小計	14,850	1,605,475.04 (256,169,597)	
	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	550	9,240.00	
	カナダドル 小計	550	9,240.00 (1,079,601)		
	ユーロ	COVIVIO (FP)	80	3,700.80	

		GECINA SA	121	11,180.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	558	14,262.48	
		ユーロ 小計	759	29,143.68	(4,992,020)
	イギリスポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	2,248	14,151.16	
		SEGRO PLC	3,574	32,430.47	
		イギリスポンド 小計	5,822	46,581.63	(9,431,382)
	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	5,159	181,493.62	
		GPT GROUP	4,863	20,375.97	
		オーストラリアドル 小計	10,022	201,869.59	(21,432,494)
	シンガポールドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	11,900	30,226.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	13,185	25,710.75	
		シンガポールドル 小計	25,085	55,936.75	(6,599,417)
		投資証券合計	57,088	299,704,511	(299,704,511)
		合計		304,455,858	(304,455,858)

(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 291 銘柄	98.0%	—	—	75.5%
	投資証券 11 銘柄	—	—	2.0%	1.5%
カナダドル	株式 41 銘柄	99.8%	—	—	3.1%
	投資証券 1 銘柄	—	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式 95 銘柄	99.6%	—	—	8.0%
	投資証券 3 銘柄	—	—	0.4%	0.0%
イギリスポンド	株式 44 銘柄	98.6%	—	—	3.9%
	投資証券 2 銘柄	—	—	1.4%	0.1%

スイスフラン	株式 24 銘柄	100.0%	—	—	2.4%
スウェーデンクローナ	株式 22 銘柄	100.0%	—	—	1.0%
ノルウェークローネ	株式 10 銘柄	100.0%	—	—	0.3%
デンマーククローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	—	1.9%
オーストラリアドル	株式 28 銘柄	90.6%	—	—	1.5%
	投資信託受益証券 1 銘柄	—	1.7%	—	0.0%
	投資証券 2 銘柄	—	—	7.7%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式 8 銘柄	100.0%	—	—	0.5%
シンガポールドル	株式 4 銘柄	78.7%	—	—	0.1%
	投資証券 2 銘柄	—	—	21.3%	0.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年6月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,257,105,168
コール・ローン	165,348,934
株式	207,727,119,475
投資信託受益証券	443,311,995
投資証券	195,008,139
派生商品評価勘定	72,014,011
未収入金	4,127,026
未収配当金	629,340,954
未収利息	309
差入委託証拠金	1,971,330,453
流動資産合計	218,464,706,464
資産合計	218,464,706,464
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,770,176

前受金	69,352,753
未払解約金	104,140,518
流動負債合計	176,263,447
負債合計	176,263,447
純資産の部	
元本等	
元本	45,766,642,853
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	172,521,800,164
元本等合計	218,288,443,017
純資産合計	218,288,443,017
負債純資産合計	218,464,706,464

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年6月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024 年 6 月 25 日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		45,766,642,853 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)	4.7696 円 (47,696 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024 年 6 月 25 日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024 年 6 月 25 日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	42,085,141,962円
期中追加設定元本額	8,025,605,272円
期中一部解約元本額	4,344,104,381円
期末元本額	45,766,642,853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	7,172,015,895円
世界経済インデックスファンド	12,333,044,610円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,223,066,040円
DC 世界経済インデックスファンド	7,789,544,448円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	79,062,633円
コア投資戦略ファンド (安定型)	56,489,423円
コア投資戦略ファンド (成長型)	136,653,244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)	1,328,826,422円
DC 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	802,450,892円
コア投資戦略ファンド (切替型)	57,039,289円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	367,429,605円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,523,024円
SMT インデックスバランス・オープン	95,976,784円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	32,497,669円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	2,287,415,109円
SMT 世界経済インデックス・オープン	286,022,779円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,321,334,621円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	214,834,815円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,375,925円
グローバル経済コア	677,211,303円
My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	459,816,468円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	57,500,179円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	14,488,359円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	110,611,527円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	120,285,770円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	52,859,565円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	67,039,814円
10資産分散投資ファンド	17,935,218円
グローバル10資産バランスファンド	23,999,747円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	612,247円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,574,678,131円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	129,236,302円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	86,257,532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）	12,959,990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）	21,769,154円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	27,104,077,520	
投資信託受益証券	3,094,059	
投資証券	△47,696,022	
合計	27,059,475,557	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年6月25日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,955,376,819	—	10,024,729,572	69,352,753
合計		9,955,376,819	—	10,024,729,572	69,352,753

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年6月25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	185,421,103	—	185,322,681	△98,422

	アメリカドル	185,421,103	—	185,322,681	△98,422
	売建	1,872,603	—	1,883,099	△10,496
	ブラジルリアル	1,872,603	—	1,883,099	△10,496
	合計	187,293,706	—	187,205,780	△108,918

(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	1.84	256,914.20	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	36,930	17.49	645,905.70	
	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	15,912	109.98	1,750,001.76	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	72,831	22.02	1,603,738.62	
	NIO INC - ADR	231,271	4.44	1,026,843.24	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	40,826	34.17	1,395,024.42	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	79,268	10.90	864,021.20	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	66,452	32.16	2,137,096.32	
	AUTOHOME INC-ADR	12,283	27.45	337,168.35	
	IQIYI INC-ADR	59,454	3.88	230,681.52	
	KANZHUN LTD	38,815	20.12	780,957.80	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	158,547	14.28	2,264,051.16	
	VK CO LTD	19,368	0.00	—	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	7,523	0.00	—	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	104,219	141.53	14,750,115.07	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	54,676	14.15	773,665.40	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	14,788	43.09	637,214.92	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	488,730	1.56	762,418.80		

	CREDICORP LTD	10,882	161.99	1,762,775.18
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	14,044	0.00	—
	QIFU TECHNOLOGY INC	20,753	20.26	420,455.78
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	168,912	1.58	267,725.52
	KE HOLDINGS INC	114,048	15.36	1,751,777.28
	アメリカドル 小計	2,008,880		34,418,552.24 (5,491,824,195)
メキシコペソ	CEMEX SAB-SPONS	2,664,261	11.48	30,585,716.28
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	488,892	96.14	47,002,076.88
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	35,000	240.39	8,413,650.00
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	178,552	27.12	4,842,330.24
	ALFA S. A. B. -A	313,500	10.78	3,379,530.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	102,000	133.83	13,650,660.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	33,575	576.44	19,353,973.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	53,100	155.84	8,275,104.00
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	59,980	293.76	17,619,724.80
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	42,685	172.84	7,377,675.40
	WALMART DE MEXICO-SER V	941,080	60.64	57,067,091.20
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	81,875	181.64	14,871,775.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	313,140	194.20	60,811,788.00
	GRUMA S. A. B. -B	25,960	333.43	8,655,842.80
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	279,600	65.84	18,408,864.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181,800	32.62	5,930,316.00
	BANCO DEL BAJIO SA	142,700	53.96	7,700,092.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	451,600	150.04	67,758,064.00
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	271,700	43.18	11,732,006.00
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,521,340	15.16	53,383,514.40
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	221,100	16.87	3,729,957.00
	メキシコペソ 小計	10,403,440		470,549,751.00 (4,185,069,485)
ブラジルリアル	COSAN SA	162,100	13.20	2,139,720.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	634,100	39.04	24,755,264.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	841,840	37.06	31,198,590.40
	PRIO SA	130,000	42.08	5,470,400.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	151,900	22.07	3,352,433.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	99,400	12.71	1,263,374.00

GERDAU SA-PREF	186,708	17.85	3,332,737.80
SUZANO SA	121,779	49.63	6,043,891.77
VALE SA	581,587	60.90	35,418,648.30
WEG SA	314,144	40.87	12,839,065.28
CCR SA	248,600	11.95	2,970,770.00
LOCALIZA RENT A CAR	137,340	42.18	5,793,001.20
RUMO SA	244,300	20.26	4,949,518.00
LOJAS RENNER S. A.	216,447	12.75	2,759,699.25
VIBRA ENERGIA SA	173,000	21.04	3,639,920.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	132,600	9.00	1,193,400.00
RAIA DROGASIL SA	259,280	26.18	6,787,950.40
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	299,700	11.07	3,317,679.00
AMBEV SA	756,200	11.32	8,560,184.00
BRF SA	119,300	20.73	2,473,089.00
JBS SA	110,000	31.00	3,410,000.00
NATURA &CO HOLDING SA	200,308	15.41	3,086,746.28
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,045,154	3.89	4,065,649.06
REDE D'OR SAO LUIZ SA	95,700	26.61	2,546,577.00
HYPERA SA	54,500	29.24	1,593,580.00
BANCO BRADESCO S. A.	326,023	11.23	3,661,238.29
BANCO BRADESCO SA-PREF	828,182	12.44	10,302,584.08
BANCO DO BRASIL S. A.	313,000	26.81	8,391,530.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	841,481	32.34	27,213,495.54
ITAUSA SA	824,701	9.88	8,148,045.88
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,055,809	10.51	11,096,552.59
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	108,900	33.63	3,662,307.00
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	142,000	14.24	2,022,080.00
TOTVS SA	124,500	30.20	3,759,900.00
TELEFONICA BRASIL S. A.	89,400	45.21	4,041,774.00
TIM SA	96,100	15.80	1,518,380.00
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	37,000	39.26	1,452,620.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	211,700	34.99	7,407,383.00
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	275,375	10.52	2,896,945.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	50,500	77.93	3,935,465.00
COMPANHIA PARANAENSE DE ENER	204,600	9.26	1,894,596.00
CPFL ENERGIA SA	27,200	32.69	889,168.00

	ENEVA SA	102,200	12.50	1,277,500.00	
	ENGIE BRASIL SA	46,250	44.47	2,056,737.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	165,100	29.75	4,911,725.00	
	ブラジルリアル 小計	13,186,008		293,501,914.62 (8,683,635,696)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	90,423	7,299.00	659,997,477.00	
	EMPRESAS CMPC SA	135,965	1,822.00	247,728,230.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	30,645	38,750.00	1,187,493,750.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	2,461,188	60.85	149,763,289.80	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	42,366,632	12.83	543,563,888.56	
	FALABELLA SA	214,533	2,964.40	635,961,625.20	
	CENCOSUD SA	306,432	1,770.00	542,384,640.00	
	BANCO DE CHILE	7,583,203	106.65	808,748,599.95	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,989	26,490.00	185,138,610.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	11,550,169	44.50	513,982,520.50	
	ENEL AMERICAS SA	3,491,315	91.15	318,233,362.25	
	ENEL CHILE SA	2,561,278	53.55	137,156,436.90	
	チリペソ 小計	70,798,772		5,930,152,430.16 (1,000,298,111)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	50,698	35,240.00	1,786,597,520.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	61,565	34,500.00	2,123,992,500.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	50,511	18,000.00	909,198,000.00	
	コロンビアペソ 小計	162,774		4,819,788,020.00 (187,952,453)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	5,201	24.30	126,384.30	
	METLEN ENERGY & METALS SA	20,295	36.24	735,490.80	
	OPAP SA	44,643	14.56	650,002.08	
	JUMBO SA	19,341	27.00	522,207.00	
	ALPHA SERVICES AND HLD	511,806	1.50	768,476.70	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	427,661	2.10	898,088.10	
	NATIONAL BANK OF GREECE	133,931	8.02	1,074,126.62	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	113,059	3.46	391,523.31	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,207	13.66	357,987.62	
	PUBLIC POWER CORP	55,892	11.22	627,108.24	
	ユーロ 小計	1,358,036		6,151,394.77 (1,053,672,410)	

トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	142,590	171.60	24,468,444.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	258,868	53.30	13,797,664.40	
	SASA POLYESTER SANAYI	368,879	47.70	17,595,528.30	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	199,132	61.75	12,296,401.00	
	KOC HOLDING AS	89,884	223.20	20,062,108.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	298,748	48.64	14,531,102.72	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	35,097	236.90	8,314,479.30	
	TURK HAVA YOLLARI AO	86,615	310.25	26,872,303.75	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	16,370	1,087.00	17,794,190.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	31,603	339.50	10,729,218.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	81,228	560.50	45,528,294.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	20,274	791.00	16,036,734.00	
	AKBANK T. A. S.	586,183	67.15	39,362,188.45	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	211,372	93.05	19,668,164.60	
	TURKIYE IS BANKASI-C	1,876,733	16.75	31,435,277.75	
	YAPI VE KREDI BANKASI	371,127	34.22	12,699,965.94	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	143,091	100.00	14,309,100.00		
トルコリラ 小計		4,817,794		345,501,165.51 (1,675,404,251)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	13,303	770.00	10,243,310.00	
	MONETA MONEY BANK AS	60,710	98.40	5,973,864.00	
	CEZ AS	25,283	932.00	23,563,756.00	
チェココルナ 小計		99,296		39,780,930.00 (273,895,681)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	96,018	2,860.00	274,611,480.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	28,741	9,285.00	266,860,185.00	
	OTP BANK NYRT	40,021	17,600.00	704,369,600.00	
ハンガリーフォリント 小計		164,780		1,245,841,265.00 (540,039,796)	
ポーランドズロ チ	ORLEN SA	102,979	67.18	6,918,129.22	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	20,186	151.95	3,067,262.70	
	BUDIMEX	2,656	709.00	1,883,104.00	
	LPP SA	230	17,110.00	3,935,300.00	
	CD PROJEKT SA	6,704	143.15	959,677.60	
	ALLEGRO. EU SA	83,795	37.62	3,152,367.90	
	DINO POLSKA SA	9,471	414.30	3,923,835.30	

	BANK PEKAO SA	27,684	164.25	4,547,097.00	
	M BANK SA	1,423	622.40	885,675.20	
	PKO BANK POLSKI SA	159,920	61.48	9,831,881.60	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	7,343	527.60	3,874,166.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	116,529	50.10	5,838,102.90	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	99,800	6.96	694,608.00	
	ポーランドズロチ 小計	638,720		49,511,208.22 (1,975,482,354)	
ロシアルーブル	GAZPROM PJSC	1,310,610	0.00	0.13	
	LUKOIL PJSC	44,089	0.00	—	
	NOVATEK PJSC	105,900	0.00	0.01	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	134,073	0.00	0.01	
	SURGUTNEFTEGAS PJSC	1,232,060	0.00	0.12	
	TATNEFT PJSC	179,460	0.00	0.01	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC	722,000	0.00	0.07	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC	195,980	0.00	0.01	
	PHOSAGRO PJSC	8,882	0.00	—	
	POLYUS PJSC	3,969	0.00	—	
	MAGNIT PJSC	7,985	0.00	—	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	1,141,420	0.00	0.11	
	VTB BANK PJSC	756,074,000	0.00	75.60	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	79,708	0.00	—	
	ロシアルーブル 小計	761,240,136		76.07 (138)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	329,000	9.37	3,082,730.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	242,000	7.53	1,822,260.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,869,400	4.92	19,037,448.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	575,500	39.55	22,761,025.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	272,000	9.82	2,671,040.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	3,800,000	7.69	29,222,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	429,000	16.40	7,035,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,120,000	5.47	6,126,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	237,500	18.36	4,360,500.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	555,500	12.38	6,877,090.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	728,000	2.82	2,052,960.00	
	CMOC GROUP LTD-H	810,000	7.23	5,856,300.00	

GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	54,040	16.56	894,902.40	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	234,000	15.72	3,678,480.00	
MMG LIMITED	840,000	3.10	2,604,000.00	
MMG LTD-RIGHTS	336,000	0.48	161,280.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	245,000	15.84	3,880,800.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	321,000	13.64	4,378,440.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	905,000	16.76	15,167,800.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	275,000	3.52	968,000.00	
BOC AVIATION LTD	68,800	54.20	3,728,960.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	546,000	4.08	2,227,680.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	706,000	4.26	3,007,560.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	442,000	10.70	4,729,400.00	
CITIC LTD	1,038,000	7.53	7,816,140.00	
CRRC CORP LTD-H	936,000	4.56	4,268,160.00	
FOSUN INTERNATIONAL	288,000	4.31	1,241,280.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	178,000	22.45	3,996,100.00	
HORIZON CONSTRUCTION DEVELOP	44,444	1.76	78,221.44	
SINOTRUK HONG KONG LTD	166,500	18.72	3,116,880.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	408,800	13.54	5,535,152.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	62,300	28.85	1,797,355.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	385,547	11.46	4,418,368.62	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	518,050	14.02	7,263,061.00	
JD LOGISTICS INC	326,200	8.27	2,697,674.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	322,000	8.44	2,717,680.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	32,500	128.50	4,176,250.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	310,000	5.11	1,584,100.00	
BYD CO LTD-H	187,000	237.60	44,431,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	144,000	43.45	6,256,800.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	948,000	8.81	8,351,880.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	493,750	11.98	5,915,125.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	358,344	2.94	1,053,531.36	
LI AUTO INC-CLASS A	234,842	70.25	16,497,650.50	
XPENG INC - CLASS A SHARES	167,162	30.40	5,081,724.80	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	234,000	10.40	2,433,600.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	86,700	25.90	2,245,530.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	240,200	78.95	18,963,790.00	

BOSIDENG INTL HLDGS LTD	438,000	4.45	1,949,100.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	460,600	28.05	12,919,830.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	99,000	32.30	3,197,700.00	
LI NING CO LTD	380,000	17.82	6,771,600.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	158,800	80.00	12,704,000.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	234,000	14.68	3,435,120.00	
MEITUAN-CLASS B	873,750	115.40	100,830,750.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	244,500	56.35	13,777,575.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	166,800	15.96	2,662,128.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	79,000	9.82	775,780.00	
TRIP.COM GROUP LTD	96,607	377.60	36,478,803.20	
BAIDU INC-CLASS A	404,500	86.35	34,928,575.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	41,600	138.70	5,769,920.00	
CHINA LITERATURE LTD	51,600	25.55	1,318,380.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	1,268,000	2.05	2,599,400.00	
KINGSOFT CORP LTD	171,200	23.40	4,006,080.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	452,400	47.35	21,421,140.00	
NETEASE INC	338,630	140.50	47,577,515.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	1,137,400	380.40	432,666,960.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2,735,288	72.05	197,077,500.40	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	52.10	468,900.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	252,000	8.63	2,174,760.00	
JD.COM INC - CL A	414,161	110.10	45,599,126.10	
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,904	39.75	1,705,434.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	64,600	38.20	2,467,720.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	410,000	4.43	1,816,300.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	92,000	12.30	1,131,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	784,000	3.45	2,704,800.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	193,450	23.15	4,478,367.50	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	15,200	114.00	1,732,800.00	
CHINA FEIHE LTD	564,000	3.69	2,081,160.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	577,000	13.34	7,697,180.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	246,000	27.75	6,826,500.00	
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	435,000	—	—	
NONGFU SPRING CO LTD-H	348,600	40.15	13,996,290.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	195,000	9.95	1,940,250.00	

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	416,000	9.67	4,022,720.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	116,000	52.30	6,066,800.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	976,000	4.18	4,079,680.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	90,600	43.40	3,932,040.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	87,500	24.05	2,104,375.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	75,400	28.80	2,171,520.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	399,200	3.81	1,520,952.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	128,400	11.78	1,512,552.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	191,200	21.50	4,110,800.00	
AKESO INC	61,000	38.20	2,330,200.00	
BEIGENE LTD	110,905	94.40	10,469,432.00	
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	1,388,160	6.31	8,759,289.60	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	339,000	5.81	1,969,590.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	222,000	8.53	1,893,660.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	272,000	16.04	4,362,880.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	203,000	37.30	7,571,900.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,971,000	2.60	5,124,600.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	63,688	30.35	1,932,930.80	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	628,000	11.84	7,435,520.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	5,135,000	3.37	17,304,950.00	
BANK OF CHINA LTD-H	13,437,200	3.84	51,598,848.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,371,475	6.13	8,407,141.75	
CHINA CITIC BANK-H	1,565,200	4.98	7,794,696.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	16,601,620	5.78	95,957,363.60	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	375,000	2.45	918,750.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	725,423	35.40	25,679,974.20	
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,835,900	2.96	5,434,264.00	
IND&COMM BK OF CHINA-H	11,401,515	4.56	51,990,908.40	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,850,000	4.49	8,306,500.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	483,000	4.25	2,052,750.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	351,200	9.17	3,220,504.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	285,775	11.90	3,400,722.50	
FAR EAST HORIZON LTD	240,000	5.21	1,250,400.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	88,600	6.63	587,418.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	357,200	3.86	1,378,792.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	266,000	8.74	2,324,840.00	

CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,320,000	11.32	14,942,400.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	506,600	20.50	10,385,300.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	184,024	8.23	1,514,517.52	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	309,600	15.70	4,860,720.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,878,000	2.66	4,995,480.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	1,197,288	9.99	11,960,907.12	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,178,000	36.70	43,232,600.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	493,000	7.49	3,692,570.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	221,500	31.70	7,021,550.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	160,500	38.45	6,171,225.00	
LENOVO GROUP LTD	1,588,000	11.64	18,484,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	119,500	49.25	5,885,375.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	2,704,200	18.02	48,729,684.00	
ZTE CORP-H	82,908	16.80	1,392,854.40	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,082,000	0.98	6,940,360.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	59,500	25.70	1,529,150.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	610,000	2.40	1,464,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,428,000	3.42	4,883,760.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	466,400	7.14	3,330,096.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	452,000	7.18	3,245,360.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	666,000	3.95	2,630,700.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	196,800	27.95	5,500,560.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	257,400	24.05	6,190,470.00	
ENN ENERGY HOLDINGDS LIMITED	117,000	67.05	7,844,850.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	446,000	4.50	2,007,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	704,000	5.61	3,949,440.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	548,000	8.00	4,384,000.00	
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	650,000	—	—	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	64,000	12.24	783,360.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,149,000	1.21	3,810,290.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	90,000	23.30	2,097,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	895,987	4.09	3,664,586.83	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	91,454	14.60	1,335,228.40	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	584,540	14.22	8,312,158.80	
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	541,111	26.70	14,447,663.70	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	119,000	25.90	3,082,100.00	

	CHINA VANKE CO LTD-H	315,500	4.86	1,533,330.00	
	LONGFOR PROPERTIES	343,500	11.14	3,826,590.00	
	香港ドル 小計	136,455,142		2,007,000,773.94 (41,023,095,819)	
マレーシアリン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	88,400	17.46	1,543,464.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	416,400	6.57	2,735,748.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	757,600	5.83	4,416,808.00	
	GAMUDA BHD	414,102	6.54	2,708,227.08	
	SIME DARBY BERHAD	336,346	2.57	864,409.22	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	107,281	9.79	1,050,280.99	
	MISC BHD	217,540	8.50	1,849,090.00	
	GENTING BHD	271,600	4.79	1,300,964.00	
	GENTING MALAYSIA BERHAD	369,700	2.55	942,735.00	
	MR DIY GROUP M BHD	303,450	1.90	576,555.00	
	IOI CORPORATION BHD	270,340	3.75	1,013,775.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	116,562	20.44	2,382,527.28	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	18,200	123.00	2,238,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	163,480	14.56	2,380,268.80	
	QL RESOURCES BHD	124,800	6.46	806,208.00	
	SD GUTHRIE BHD	247,046	4.30	1,062,297.80	
	IHH HEALTHCARE BHD	471,400	6.30	2,969,820.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	300,700	4.25	1,277,975.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,233,202	6.68	8,237,789.36	
	HONG LEONG BANK BERHAD	121,292	19.16	2,323,954.72	
	MALAYAN BANKING BHD	881,505	9.88	8,709,269.40	
	PUBLIC BANK BERHAD	2,544,100	4.03	10,252,723.00	
	RHB BANK BHD	219,347	5.52	1,210,795.44	
	AXIATA GROUP BERHAD	541,089	2.61	1,412,242.29	
	CELCOMDIGI BHD	498,000	3.57	1,777,860.00	
	MAXIS BHD	267,900	3.55	951,045.00	
	TELECOM MALAYSIA BHD	271,552	6.73	1,827,544.96	
	PETRONAS GAS BHD	148,400	18.34	2,721,656.00	
	TENAGA NATIONAL BHD	441,775	13.72	6,061,153.00	
	YTL CORPORATION BERHAD	812,700	3.44	2,795,688.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	499,400	4.88	2,437,072.00	
INARI AMERTRON BHD	274,700	3.65	1,002,655.00		

	マレーシアリングット 小計	13,749,909		83,841,201.34 (2,839,994,933)	
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	308,100	153.00	47,139,300.00	
	PTT PCL-NVDR	1,684,600	32.50	54,749,500.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	293,605	52.75	15,487,663.75	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	206,400	20.30	4,189,920.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	486,134	30.75	14,948,620.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	202,700	34.00	6,891,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	130,400	226.00	29,470,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	654,900	58.50	38,311,650.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	817,000	7.80	6,372,600.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	810,300	3.60	2,917,080.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	848,938	30.75	26,104,843.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	182,200	30.50	5,557,100.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	840,135	9.05	7,603,221.75	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	792,400	16.30	12,916,120.00	
	CP ALL PCL-NVDR	956,400	55.75	53,319,300.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	237,910	28.50	6,780,435.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	556,400	22.80	12,685,920.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,888,100	26.50	50,034,650.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	82,700	242.00	20,013,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	133,200	127.00	16,916,400.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	438,650	17.20	7,544,780.00	
	SCB X PCL-NVDR	151,200	106.50	16,102,800.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	8,727,200	1.72	15,010,784.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	101,500	42.25	4,288,375.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	496,000	86.00	42,656,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	203,800	207.00	42,186,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	121,850	72.25	8,803,662.50	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	2,015,618	8.45	17,031,972.10	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	219,900	18.00	3,958,200.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	68,200	42.00	2,864,400.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	694,100	40.25	27,937,525.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	378,400	56.25	21,285,000.00	
	タイパーツ 小計	25,728,940		642,080,023.10 (2,799,468,900)	

フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	54,410	585.00	31,829,850.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	586,123	25.50	14,946,136.50	
	SM INVESTMENTS CORP	36,285	838.50	30,424,972.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	153,130	331.00	50,686,030.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	61,010	218.00	13,300,180.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	95,560	104.00	9,938,240.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	234,802	111.50	26,180,423.00	
	BDO UNIBANK INC	394,773	128.00	50,530,944.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	545,077	68.00	37,065,236.00	
	PLDT INC	20,460	1,360.00	27,825,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	53,180	360.40	19,166,072.00	
	AYALA LAND INC	1,280,900	27.70	35,480,930.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,553,350	27.00	41,940,450.00	
	フィリピンペソ 小計	5,069,060		389,315,064.00 (1,056,133,905)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	2,162,300	2,720.00	5,881,456,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	200,900	21,725.00	4,364,552,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	1,103,600	10,800.00	11,918,880,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK PT	985,800	1,250.00	1,232,250,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,892,209	965.00	2,790,981,685.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK	1,270,900	8,825.00	11,215,692,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	754,000	8,775.00	6,616,350,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,623,297	2,320.00	3,766,049,040.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,277,300	4,430.00	14,518,439,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	134,639,904	51.00	6,866,635,104.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,138,700	2,740.00	8,600,038,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	1,553,300	5,100.00	7,921,830,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	599,400	10,300.00	6,173,820,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	1,403,800	5,925.00	8,317,515,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,157,400	3,010.00	3,483,774,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	4,188,500	1,550.00	6,492,175,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA PT	9,369,500	9,600.00	89,947,200,000.00	
	BANK MANDIRI	6,101,792	6,000.00	36,610,752,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	2,584,600	4,540.00	11,734,084,000.00	
	PT BANK RAKYAT INDONESIA	12,030,502	4,400.00	52,934,208,800.00	
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	8,898,500	2,950.00	26,250,575,000.00		

インドネシアルピア 小計		199,936,204		327,637,257,629.00 (3,210,845,124)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	5,180	72,400.00	375,032,000.00	
	S-OIL CORPORATION	6,387	66,700.00	426,012,900.00	
	SK INNOVATION CO LTD	10,044	108,400.00	1,088,769,600.00	
	ENCHEM CO LTD	1,966	236,000.00	463,976,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	18,276	30,000.00	548,280,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	11,189	28,950.00	323,921,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,204	492,000.00	592,368,000.00	
	KUM YANG CO LTD	5,389	80,400.00	433,275,600.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,898	150,100.00	284,889,800.00	
	LG CHEM LTD	9,272	356,000.00	3,300,832,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	877	239,000.00	209,603,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	2,316	115,000.00	266,340,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	13,371	366,000.00	4,893,786,000.00	
	SKC CO LTD	1,432	167,700.00	240,146,400.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	12,098	52,500.00	635,145,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	82,003	20,800.00	1,705,662,400.00	
	ECOPRO BM CO LTD	8,232	182,100.00	1,499,047,200.00	
	ECOPRO CO LTD	15,665	91,300.00	1,430,214,500.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	2,769	95,200.00	263,608,800.00	
	GS HOLDINGS CORP	6,593	45,900.00	302,618,700.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	5,826	236,000.00	1,374,936,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	14,849	32,000.00	475,168,000.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	3,567	300,000.00	1,070,100,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	2,115	152,000.00	321,480,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	6,269	154,300.00	967,306,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9,768	31,950.00	312,087,600.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	13,416	53,600.00	719,097,600.00	
	L&F CO LTD	4,327	146,700.00	634,770,900.00	
	LG CORP	16,658	80,600.00	1,342,634,800.00	
	LG ENERGY SOLUTION	8,760	331,000.00	2,899,560,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	4,758	258,000.00	1,227,564,000.00		
POSCO INTERNATIONAL CORP	8,647	67,300.00	581,943,100.00		
SAMSUNG C&T CORP	15,406	135,900.00	2,093,675,400.00		
SAMSUNG E&A CO LTD	30,300	22,300.00	675,690,000.00		

SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	95,169	8,950.00	851,762,550.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,338	43,800.00	102,404,400.00	
SK INC	6,394	158,000.00	1,010,252,000.00	
SK SQUARE CO LTD	19,731	91,200.00	1,799,467,200.00	
HANJIN KAL CORP	7,812	66,700.00	521,060,400.00	
HMM CO LTD	35,545	18,980.00	674,644,100.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,793	219,000.00	611,667,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	26,822	21,350.00	572,649,700.00	
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	18,150	44,700.00	811,305,000.00	
HYUNDAI MOBIS	10,148	238,000.00	2,415,224,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	23,448	281,000.00	6,588,888,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	6,042	165,600.00	1,000,555,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	3,449	164,000.00	565,636,000.00	
KIA CORP	45,204	128,300.00	5,799,673,200.00	
COWAY CO LTD	9,036	58,000.00	524,088,000.00	
LG ELECTRONICS INC	17,254	110,200.00	1,901,390,800.00	
HYBE CO LTD	4,975	198,100.00	985,547,500.00	
KAKAO CORP	52,020	42,050.00	2,187,441,000.00	
KRAFTON INC	6,265	276,000.00	1,729,140,000.00	
NAVER CORP	21,578	168,900.00	3,644,524,200.00	
NCSOFT CORPORATION	2,709	186,000.00	503,874,000.00	
NETMARBLE CORP	2,465	52,800.00	130,152,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	1,839	393,000.00	722,727,000.00	
KT&G CORP	19,456	85,900.00	1,671,270,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	3,142	91,800.00	288,435,600.00	
AMOREPACIFIC CORP	3,762	172,800.00	650,073,600.00	
LG H&H CO LTD	1,321	360,000.00	475,560,000.00	
HLB INC	23,903	66,000.00	1,577,598,000.00	
ALTEOGEN INC	6,824	286,000.00	1,951,664,000.00	
CELLTRION INC	27,796	179,000.00	4,975,484,000.00	
CELLTRION PHARM INC	2,169	91,000.00	197,379,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	1,202	273,500.00	328,747,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	3,362	734,000.00	2,467,708,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,197	76,300.00	243,931,100.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,100	49,100.00	103,110,000.00	
YUHAN CORPORATION	13,854	78,000.00	1,080,612,000.00	

	HANA FINANCIAL GROUP	51,249	59,900.00	3,069,815,100.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,330	13,620.00	385,854,600.00	
	KAKAObANK CORP	35,459	21,000.00	744,639,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	64,599	80,000.00	5,167,920,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	80,543	48,000.00	3,866,064,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	113,814	14,490.00	1,649,164,860.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4,602	66,900.00	307,873,800.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	16,975	75,900.00	1,288,402,500.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,015	7,090.00	219,896,350.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	12,107	12,430.00	150,490,010.00	
	DB INSURANCE CO LTD	10,074	107,700.00	1,084,969,800.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	6,144	351,500.00	2,159,616,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	12,131	87,000.00	1,055,397,000.00	
	POSCO DX CO LTD	9,010	38,450.00	346,434,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	7,284	150,800.00	1,098,427,200.00	
	COSMOAM&T CO LTD	3,978	146,600.00	583,174,800.00	
	LG DISPLAY CO LTD	51,846	11,760.00	609,708,960.00	
	LG INNOTEK CO LTD	2,696	262,000.00	706,352,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	11,233	149,000.00	1,673,717,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	822,794	80,600.00	66,317,196,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	141,877	64,700.00	9,179,441,900.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	10,263	377,500.00	3,874,282,500.00	
	KT CORP	10,500	36,850.00	386,925,000.00	
	LG UPLUS CORP	22,125	9,850.00	217,931,250.00	
	SK TELECOM	9,563	52,400.00	501,101,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	44,240	19,350.00	856,044,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	7,238	175,400.00	1,269,545,200.00	
	SK HYNIX INC	94,417	223,000.00	21,054,991,000.00	
	韓国ウォン 小計	2,610,207		215,470,565,430.00 (24,843,756,194)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	238,240	65.80	15,676,192.00	
	ASIA CEMENT CORP	454,176	44.85	20,369,793.60	
	CHINA STEEL	2,373,261	23.40	55,534,307.40	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	542,061	51.50	27,916,141.50	
	FORMOSA PLASTICS CORP	597,824	59.50	35,570,528.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	770,752	50.10	38,614,675.20	

TCC GROUP HOLDINGS	1,268,419	34.25	43,443,350.75	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	31,557	1,030.00	32,503,710.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	362,028	36.40	13,177,819.20	
FORTUNE ELECTRIC CO LTD	20,000	900.00	18,000,000.00	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	9,000	1,820.00	16,380,000.00	
WALSIN LIHWA CORP	502,213	35.65	17,903,893.45	
CHINA AIRLINES LTD	465,000	23.55	10,950,750.00	
EVA AIRWAYS CORP	386,000	37.75	14,571,500.00	
EVERGREEN MARINE	183,215	201.00	36,826,215.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	472,000	30.05	14,183,600.00	
WAN HAI LINES LIMITED	74,635	88.80	6,627,588.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	217,000	74.20	16,101,400.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	463,061	49.60	22,967,825.60	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	39,937	538.00	21,486,106.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	78,901	164.50	12,979,214.50	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	31,000	365.50	11,330,500.00	
POU CHEN	273,780	36.75	10,061,415.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	54,060	635.00	34,328,100.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	88,544	275.50	24,393,872.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	776,395	82.90	64,363,145.50	
PHARMAESSENTIA CORP	25,000	494.00	12,350,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	608,378	18.45	11,224,574.10	
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	3,090,237	38.25	118,201,565.25	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,474,537	29.00	71,761,573.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,175,358	28.15	61,236,327.70	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,518,361	26.65	40,464,320.65	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,066,087	40.35	83,366,610.45	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,791,444	25.40	45,502,677.60	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,000,651	18.75	37,512,206.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	798,720	18.15	14,496,768.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,066,926	26.10	53,946,768.60	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	689,985	45.85	31,635,812.25	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	287,702	158.50	45,600,767.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,919,822	34.50	66,233,859.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,731,057	60.30	104,382,737.10	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,576,226	15.55	40,060,314.30	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,353,451	78.10	105,704,523.10	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,931,866	9.80	18,932,286.80	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	86,000	537.00	46,182,000.00	
ACER INC	617,803	47.00	29,036,741.00	
ADVANTECH CO LTD	76,261	375.00	28,597,875.00	
ASIA VITAL COMPONENTS	55,000	714.00	39,270,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	127,092	513.00	65,198,196.00	
AUO CORP	1,268,072	18.35	23,269,121.20	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	118,700	231.00	27,419,700.00	
COMPAL ELECTRONICS	805,760	35.25	28,403,040.00	
DELTA ELECTRONICS INC	347,903	376.50	130,985,479.50	
E INK HOLDINGS INC	144,000	234.00	33,696,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	75,000	312.00	23,400,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,185,248	206.00	450,161,088.00	
INNOLUX CORP	1,320,576	15.90	20,997,158.40	
INVENTEC CO LTD	455,511	57.00	25,964,127.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	20,040	2,605.00	52,204,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	353,452	103.50	36,582,282.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	100,000	181.50	18,150,000.00	
PEGATRON CORP	340,474	117.00	39,835,458.00	
QUANTA COMPUTER INC	463,270	304.00	140,834,080.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	202,100	74.30	15,016,030.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	211,000	186.00	39,246,000.00	
WISTRON CORP	427,000	110.00	46,970,000.00	
WIWYNN CORP	16,000	2,665.00	42,640,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	260,692	88.50	23,071,242.00	
YAGEO CORPORATION	64,588	759.00	49,022,292.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	137,922	126.00	17,378,172.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	584,315	126.50	73,915,847.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	216,000	85.10	18,381,600.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	245,200	107.00	26,236,400.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	12,000	2,600.00	31,200,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	594,315	172.50	102,519,337.50	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	12,000	2,590.00	31,080,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	13,000	1,550.00	20,150,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	42,000	530.00	22,260,000.00	

	MEDIATEK INC	266,804	1,410.00	376,193,640.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	259,000	69.10	17,896,900.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	96,045	617.00	59,259,765.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	85,944	531.00	45,636,264.00	
	SILERGY CORP	53,000	507.00	26,871,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,243,389	940.00	3,988,785,660.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,976,000	56.80	112,236,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	188,000	121.50	22,842,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	363,030	26.30	9,547,689.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	279,077	44.80	12,502,649.60	
	新台湾ドル 小計	59,687,450		8,089,921,168.55 (39,840,434,778)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	299,904	305.35	91,575,686.40	
	COAL INDIA LTD	295,479	473.80	139,997,950.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	188,229	337.75	63,574,344.75	
	INDIAN OIL CORP LTD	597,036	166.30	99,287,086.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	539,758	269.70	145,572,732.60	
	PETRONET LNG LTD	83,779	324.20	27,161,151.80	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	522,888	2,883.00	1,507,486,104.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	73,533	657.70	48,362,654.10	
	APL APOLLO TUBES LTD	26,431	1,618.00	42,765,358.00	
	ASIAN PAINTS LTD	67,203	2,895.90	194,613,167.70	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	46,843	2,514.95	117,807,802.85	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	246,890	685.45	169,230,750.50	
	JINDAL STAINLESS LTD	54,371	800.70	43,534,859.70	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	69,774	1,070.90	74,720,976.60	
	JSW STEEL LTD	99,332	934.65	92,840,653.80	
	NMDC LTD	146,261	264.00	38,612,904.00	
	PI INDUSTRIES LTD	12,797	3,802.65	48,662,512.05	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	29,160	3,107.10	90,603,036.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,387	27,315.80	37,887,014.60	
	SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	4,277	10,004.75	42,790,315.75	
	SRF LTD	33,773	2,419.40	81,710,396.20	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	10,012	5,958.25	59,653,999.00	
	TATA STEEL LTD	1,356,728	177.90	241,361,911.20	
	ULTRATECH CEMENT LTD	19,852	10,784.90	214,101,834.80	

UNITED PHOSPHORUS LTD	69,651	572.30	39,861,267.30	
VEDANTA LTD	184,749	463.30	85,594,211.70	
ABB LTD INDIA	11,720	8,459.40	99,144,168.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	33,650	3,194.50	107,494,925.00	
ASHOK LEYLAND LIMITED	241,973	240.20	58,121,914.60	
ASTRAL LTD	19,918	2,385.60	47,516,380.80	
BHARAT ELECTRONICS LTD	646,541	309.70	200,233,747.70	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	151,803	294.60	44,721,163.80	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	70,406	701.80	49,410,930.80	
CUMMINS INDIA LTD	20,968	4,046.35	84,843,866.80	
HAVELLS INDIA LTD	35,666	1,910.90	68,154,159.40	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	36,316	5,326.20	193,426,279.20	
LARSEN & TOUBRO LTD	118,675	3,531.95	419,154,166.25	
POLYCAB INDIA LTD	7,354	7,258.75	53,380,847.50	
SIEMENS INDIA LTD	16,262	7,595.60	123,519,647.20	
SUZLON ENERGY LTD	1,500,000	54.71	82,065,000.00	
THERMAX LTD	7,627	5,194.45	39,618,070.15	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	52,993	1,010.20	53,533,528.60	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	104,582	1,460.20	152,710,636.40	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	26,455	1,049.95	27,776,427.25	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCRURE	394,498	96.79	38,183,461.42	
INTERGLOBE AVIATION LTD	26,451	4,314.65	114,126,807.15	
BAJAJ AUTO LTD	9,644	9,745.15	93,982,226.60	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,831	3,224.25	28,473,351.75	
BHARAT FORGE LTD	30,322	1,741.75	52,813,343.50	
BOSCH LTD	1,235	32,991.10	40,744,008.50	
EICHER MOTORS LTD	26,253	4,871.90	127,901,990.70	
HERO MOTOCORP LTD	21,431	5,525.25	118,411,632.75	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	165,233	2,915.85	481,794,643.05	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24,350	12,176.95	296,508,732.50	
MRF LTD	432	125,275.40	54,118,972.80	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	521,235	188.40	98,200,674.00	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	59,289	638.15	37,835,275.35	
TATA MOTORS LTD	277,381	958.25	265,800,343.25	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	75,000	641.75	48,131,250.00	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	21,152	4,286.55	90,669,105.60	

TVS MOTOR CO LTD	41,254	2,438.10	100,581,377.40
PAGE INDUSTRIES LTD	886	40,342.00	35,743,012.00
TITAN CO LTD	56,531	3,413.30	192,957,262.30
INDIAN HOTELS CO LIMITED	164,497	648.55	106,684,529.35
JUBILANT FOODWORKS LTD	43,930	569.40	25,013,742.00
ZOMATO LTD	1,054,701	198.85	209,727,293.85
INFO EDGE INDIA LTD	14,356	6,596.70	94,702,225.20
TRENT LTD	37,950	5,396.30	204,789,585.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	28,592	4,838.20	138,333,814.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	22,156	5,301.30	117,455,602.80
ITC LTD	480,447	423.25	203,349,192.75
MARICO LTD	81,711	623.10	50,914,124.10
NESTLE INDIA LIMITED	51,460	2,527.80	130,080,588.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	93,239	1,101.25	102,679,448.75
UNITED SPIRITS LTD	58,580	1,297.35	75,998,763.00
VARUN BEVERAGES LTD	80,358	1,579.15	126,897,335.70
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	26,000	2,833.10	73,660,600.00
DABUR INDIA LTD	144,837	599.75	86,865,990.75
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	63,396	1,381.10	87,556,215.60
HINDUSTAN UNILEVER LTD	144,060	2,441.60	351,736,896.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	14,562	6,257.90	91,127,539.80
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	120,191	898.30	107,967,575.30
AUROBINDO PHARMA LTD	35,415	1,218.30	43,146,094.50
CIPLA LTD	88,546	1,503.30	133,111,201.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	21,932	4,518.50	99,099,742.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,321	6,067.45	111,161,751.45
LUPIN LTD	48,134	1,567.05	75,428,384.70
MANKIND PHARMA LTD	18,295	2,165.35	39,615,078.25
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	167,480	1,494.75	250,340,730.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	12,220	2,838.65	34,688,303.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	92,107	679.70	62,605,127.90
AXIS BANK LTD	391,573	1,228.10	480,890,801.30
BANDHAN BANK LTD	74,811	207.75	15,541,985.25
BANK OF BARODA	248,313	280.50	69,651,796.50
CANARA BANK	305,000	118.25	36,066,250.00
HDFC BANK LTD	485,940	1,672.10	812,540,274.00

ICICI BANK LTD	879,852	1,170.00	1,029,426,840.00
IDFC FIRST BANK LTD	531,028	82.92	44,032,841.76
INDUSIND BANK LTD	48,365	1,490.55	72,090,450.75
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	186,345	1,772.40	330,277,878.00
PUNJAB NATIONAL BANK	272,403	125.05	34,063,995.15
STATE BANK OF INDIA	314,786	832.65	262,106,562.90
UNION BANK OF INDIA	238,889	141.45	33,790,849.05
YES BANK LTD	2,352,478	23.95	56,341,848.10
BAJAJ FINANCE LTD	49,376	7,080.40	349,601,830.40
BAJAJ FINSERV LTD	76,561	1,587.20	121,517,619.20
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	2,995	8,758.80	26,232,606.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	83,998	1,434.50	120,495,131.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	14,173	3,976.20	56,354,682.60
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	471,182	355.30	167,410,964.60
MUTHOOT FINANCE LTD	12,423	1,733.00	21,529,059.00
POWER FINANCE CORPORATION	265,755	487.80	129,635,289.00
REC LTD	186,584	521.30	97,266,239.20
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	60,695	729.90	44,301,280.50
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54,695	2,883.30	157,702,093.50
SUNDARAM FINANCE LTD	11,164	4,756.45	53,101,007.80
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	207,570	579.75	120,338,707.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	33,631	1,771.75	59,585,724.25
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	45,316	605.00	27,416,180.00
PB FINTECH LTD	48,956	1,284.80	62,898,668.80
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	72,736	1,452.85	105,674,497.60
HCL TECHNOLOGIES LTD	163,324	1,440.30	235,235,557.20
INFOSYS LTD	579,880	1,527.25	885,621,730.00
LTIMINDTREE LTD	15,699	5,110.80	80,234,449.20
MPHASIS LTD	19,317	2,395.75	46,278,702.75
PERSISTENT SYSTEMS LTD	15,982	3,968.70	63,427,763.40
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	152,359	3,817.30	581,600,010.70
TATA ELXSI LTD	7,679	7,250.10	55,673,517.90
TECH MAHINDRA LTD	94,797	1,400.80	132,791,637.60
WIPRO LTD	247,008	490.45	121,145,073.60
BHARTI AIRTEL LTD	389,936	1,419.20	553,397,171.20
INDUS TOWERS LTD	127,238	339.75	43,229,110.50

	TATA COMMUNICATIONS LIMITED	19,824	1,850.25	36,679,356.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	60,702	1,812.05	109,995,059.10	
	ADANI POWER LTD	167,705	737.95	123,757,904.75	
	GAIL INDIA LTD	504,548	212.55	107,241,677.40	
	JSW ENERGY LTD	63,163	746.65	47,160,653.95	
	NHPC LTD	546,313	99.80	54,522,037.40	
	NTPC LTD	766,679	362.75	278,112,807.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	800,980	333.05	266,766,389.00	
	TATA POWER CO LTD	285,870	435.70	124,553,559.00	
	TORRENT POWER LTD	28,990	1,484.70	43,041,453.00	
	DLF LTD	126,742	840.40	106,513,976.80	
	GODREJ PROPERTIES LTD	29,762	3,110.55	92,576,189.10	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	41,942	1,547.85	64,919,924.70	
	PHOENIX MILLS LTD	17,280	3,610.25	62,385,120.00	
	インドルピー 小計	26,473,199		20,610,656,273.63 (39,572,460,045)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	59,914	14.40	862,761.60	
	QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	469,730	4.47	2,099,693.10	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	1,307,286	1.66	2,176,631.19	
	INDUSTRIES QATAR	282,919	12.49	3,533,658.31	
	COMMERCIAL BANK QSC	531,391	4.02	2,136,191.82	
	DUKHAN BANK	319,751	3.71	1,186,595.96	
	MASRAF AL RAYAN	1,143,101	2.32	2,656,566.72	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	214,533	10.14	2,175,364.62	
	QATAR ISLAMIC BANK	335,301	18.10	6,068,948.10	
	QATAR NATIONAL BANK	741,302	14.33	10,622,857.66	
	OOREDOO QSC	72,800	10.17	740,376.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	96,512	15.25	1,471,808.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	207,490	2.75	570,804.99	
	カタールリアル 小計	5,782,030		36,302,258.07 (1,591,854,016)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	34,217	176.04	6,023,560.68	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	9,991	646.12	6,455,384.92	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	67,443	438.58	29,579,150.94	
	GOLD FIELDS LTD	144,200	272.29	39,264,218.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	99,861	166.52	16,628,853.72	

	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	150,847	94.40	14,239,956.80	
	KUMBA IRON ORE LTD	17,679	454.01	8,026,442.79	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	48,069	129.85	6,241,759.65	
	SASOL LTD	88,115	138.50	12,203,927.50	
	SIBANYE STILLWATER LTD	799,465	21.15	16,908,684.75	
	BIDVEST GROUP LTD	50,303	281.43	14,156,773.29	
	NASPERS LTD-N SHS	30,591	3,684.48	112,711,927.68	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	475,578	19.50	9,273,771.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	176,316	60.52	10,670,644.32	
	BID CORP LTD	58,066	425.53	24,708,824.98	
	CLICKS GROUP LTD	35,422	338.65	11,995,660.30	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	85,224	279.41	23,812,437.84	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	56,182	239.58	13,460,083.56	
	ABSA GROUP LTD	140,135	174.19	24,410,115.65	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	14,600	2,569.00	37,507,400.00	
	NEDBANK GROUP LTD	88,111	261.00	22,996,971.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	242,949	212.00	51,505,188.00	
	FIRSTRAND LTD	816,636	74.65	60,961,877.40	
	REINET INVESTMENTS SCA	17,187	476.12	8,183,074.44	
	REMGRO LTD	74,679	141.36	10,556,623.44	
	DISCOVERY LIMITED	98,779	134.54	13,289,726.66	
	OLD MUTUAL LTD	974,656	12.19	11,881,056.64	
	OUTSURANCE GROUP LTD	237,864	45.89	10,915,578.96	
	SANLAM LTD	307,490	79.64	24,488,503.60	
	MTN GROUP LTD	350,498	85.28	29,890,469.44	
	VODACOM GROUP	166,454	97.61	16,247,574.94	
	NEPI ROCKCASTLE N. V.	67,336	132.09	8,894,412.24	
	南アフリカランド 小計	6,024,943		708,090,635.13 (6,238,278,495)	
アラブ首長国連邦 ディルハム	MULTIPLY GROUP	519,646	2.02	1,049,684.92	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	431,446	3.03	1,307,281.38	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	444,022	3.30	1,465,272.60	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	471,430	7.92	3,733,725.60	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	250,781	11.70	2,934,137.70	
	DUBAI ISLAMIC BANK	525,144	5.66	2,972,315.04	
	EMIRATES NBD PJSC	357,699	16.25	5,812,608.75	

	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	724,019	11.96	8,659,267.24	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	642,138	16.02	10,287,050.76	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	725,831	5.88	4,267,886.28	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	1,108,668	7.89	8,747,390.52	
	アラブ首長国連邦ディルハム 小計	6,200,824		51,236,620.79 (2,222,132,243)	
クウェートディ ナール	BOUBYAN BANK K. S. C	171,769	0.56	97,049.48	
	GULF BANK	162,936	0.28	45,785.01	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,794,507	0.71	1,281,277.99	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	1,404,477	0.85	1,205,041.26	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	296,830	0.44	132,979.84	
	MABANEE CO KPSC	150,334	0.86	130,038.91	
	クウェートディナール 小計	3,980,853		2,892,172.49 (1,507,602,753)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	146,700	8.47	1,242,549.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	89,000	44.25	3,938,250.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	64,000	15.85	1,014,400.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	89,500	7.35	657,825.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	100,000	10.03	1,003,000.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	96,200	27.01	2,598,362.00	
	SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	237,792	10.18	2,420,722.56	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	79,600	10.37	825,452.00	
	SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	9,900	19.31	191,169.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	31,050	22.33	693,346.50	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	28,000	37.05	1,037,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	164,300	7.41	1,217,463.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	29,440	23.14	681,241.60	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	369,500	6.57	2,427,615.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	92,200	10.70	986,540.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	20,800	16.91	351,728.00	
	CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	14,420	31.50	454,230.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	11,200	28.56	319,872.00	
	GEM CO LTD-A	289,800	6.42	1,860,516.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	24,826	18.24	452,826.24	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	37,100	13.79	511,609.00		
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	147,500	6.96	1,026,600.00		

HESTEEL CO LTD-A	832,100	1.93	1,605,953.00
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	22,400	47.17	1,056,608.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	461,000	1.38	636,180.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	60,000	3.71	222,600.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	22,300	7.88	175,724.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	10,140	55.80	565,812.00
LB GROUP CO LTD-A	15,300	18.41	281,673.00
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	47,100	9.06	426,726.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	79,200	16.83	1,332,936.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	19,500	2.52	49,140.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	47,600	16.94	806,344.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	48,450	9.48	459,306.00
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	55,475	18.12	1,005,207.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	7,252	27.75	201,243.00
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	17,940	27.05	485,277.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	286,600	3.71	1,063,286.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	16,240	14.23	231,095.20
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	109,678	4.73	518,776.94
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	137,400	3.37	463,038.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	10,800	29.21	315,468.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	49,900	13.23	660,177.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	11,400	30.10	343,140.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	9,800	15.58	152,684.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	331,600	3.51	1,163,916.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	40,300	84.28	3,396,484.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	14,752	24.76	365,259.52
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	16,485	39.80	656,103.00
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	1,820	36.85	67,067.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	4,100	33.01	135,341.00
ZANGGE MINING CO LTD-A	37,400	24.52	917,048.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	7,410	22.16	164,205.60
ZHEJIANG JUHUA CO-A	129,400	22.25	2,879,150.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269,100	17.47	4,701,177.00
AECC AVIATION POWER CO-A	11,400	36.50	416,100.00
AVICOPTER PLC-A	15,500	40.68	630,540.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	8,400	30.38	255,192.00

CHINA BAOAN GROUP-A	64,000	8.64	552,960.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	55,215	37.60	2,076,084.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	603,100	2.10	1,266,510.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	230,100	8.00	1,840,800.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	562,400	5.47	3,076,328.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	54,780	186.98	10,242,764.40
CRRC CORP LTD-A	185,800	7.09	1,317,322.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	43,200	17.96	775,872.00
EVE ENERGY CO LTD-A	39,473	41.95	1,655,892.35
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	2,400	44.83	107,592.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	20,111	6.82	137,157.02
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	5,800	19.36	112,288.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,456	48.90	560,198.40
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	41,100	15.70	645,270.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	48,100	17.22	828,282.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	330,900	3.03	1,002,627.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	83,980	24.79	2,081,864.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	8,316	75.50	627,858.00
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	12,534	49.95	626,073.30
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	163,200	5.48	894,336.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	41,900	15.98	669,562.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	486,700	3.68	1,791,056.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	28,393	50.98	1,447,475.14
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	25,060	8.01	200,730.60
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	14,000	67.65	947,100.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	40,700	15.00	610,500.00
TBEA CO LTD-A	29,274	13.87	406,030.38
WEICHAI POWER CO LTD-A	43,200	15.25	658,800.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	199,400	7.32	1,459,608.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	31,600	19.63	620,308.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	8,260	62.38	515,258.80
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	7,300	20.89	152,497.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	80,100	7.79	623,979.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	11,000	31.36	344,960.00
AIR CHINA LTD-A	225,900	7.24	1,635,516.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	397,100	5.24	2,080,804.00

CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	40,000	3.94	157,600.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	183,500	15.63	2,868,105.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	160,500	7.05	1,131,525.00
S F HOLDING CO LTD-A	53,100	35.30	1,874,430.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,319	32.33	171,963.27
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	44,400	5.62	249,528.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	55,700	15.45	860,565.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	21,840	7.59	165,765.60
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	15,120	39.69	600,112.80
BYD CO LTD -A	17,000	249.94	4,248,980.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	9,000	115.79	1,042,110.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	43,352	13.44	582,650.88
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,500	45.45	840,825.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	34,300	16.02	549,486.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	8,400	90.70	761,880.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	29,300	14.80	433,640.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	45,700	57.66	2,635,062.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	42,600	14.00	596,400.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	39,254	18.71	734,442.34
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	2,800	48.92	136,976.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	43,500	40.05	1,742,175.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	27,760	22.27	618,215.20
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	7,932	33.30	264,135.60
MIDEA GROUP CO LTD-A	50,800	64.88	3,295,904.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	7,700	56.90	438,130.00
QINGDAO HAIER CO LTD-A	101,100	29.73	3,005,703.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	8,000	50.52	404,160.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	26,200	23.33	611,246.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	33,480	8.11	271,522.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	24,500	12.79	313,355.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	53,600	8.55	458,280.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	139,400	6.02	839,188.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	16,300	20.11	327,793.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	61,500	3.34	205,410.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	20,720	64.48	1,336,025.60
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	110,500	5.13	566,865.00

DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	22,291	14.94	333,027.54	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	17,035	26.06	443,932.10	
ANGEL YEAST CO LTD-A	10,700	28.44	304,308.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	1,600	227.92	364,672.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	2,200	40.60	89,320.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	18,300	59.33	1,085,739.00	
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	3,000	72.80	218,400.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	7,900	61.88	488,852.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	54,057	35.38	1,912,536.66	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	17,000	46.95	798,150.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	78,580	23.90	1,878,062.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	34,302	25.97	890,822.94	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	17,300	48.27	835,071.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	9,100	86.43	786,513.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	11,500	24.20	278,300.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	13,000	1,476.55	19,195,150.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	18,400	149.50	2,750,800.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	33,558	43.65	1,464,806.70	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26,800	9.25	247,900.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	9,380	219.14	2,055,533.20	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	11,400	38.80	442,320.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	38,160	19.67	750,607.20	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	41,500	131.03	5,437,745.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	10,100	27.86	281,386.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	29,700	13.57	403,029.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	91,749	10.62	974,374.38	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	16,000	29.08	465,280.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	2,838	26.94	76,455.72	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	9,720	28.76	279,547.20	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	27,985	5.00	139,925.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	14,800	15.48	229,104.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	14,900	295.34	4,400,566.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	18,780	70.53	1,324,553.40	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	99,816	24.49	2,444,493.84	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	28,400	38.26	1,086,584.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	10,487	65.50	686,898.50	

BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	9,067	57.61	522,349.87
CHANGCHUN HIGH -TECH INDUST -A	2,200	95.05	209,110.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	13,260	42.63	565,273.80
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	14,850	28.07	416,839.50
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	22,193	64.00	1,420,352.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	8,000	50.46	403,680.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	18,850	16.14	304,239.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	2,912	175.39	510,735.68
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	119,102	40.29	4,798,619.58
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	64,100	7.50	480,750.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	10,880	15.82	172,121.60
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	7,000	27.50	192,500.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	9,440	15.61	147,358.40
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	11,232	30.68	344,597.76
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	17,000	11.16	189,720.00
WUXI APPTec CO LTD-A	16,464	40.42	665,474.88
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	9,940	51.26	509,524.40
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	3,900	213.13	831,207.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	9,020	17.73	159,924.60
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	34,848	19.05	663,854.40
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,032,100	4.25	4,386,425.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	58,000	5.61	325,380.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	157,400	14.79	2,327,946.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	511,900	7.27	3,721,513.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	112,700	12.71	1,432,417.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	229,740	7.31	1,679,399.40
BANK OF NANJING CO LTD -A	147,500	9.84	1,451,400.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	58,300	22.12	1,289,596.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	45,500	7.48	340,340.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	124,900	7.25	905,525.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	835,300	3.10	2,589,430.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	186,000	34.07	6,337,020.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	273,600	3.68	1,006,848.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	401,180	2.79	1,119,292.20
HUAXIA BANK CO LTD-A	119,400	6.23	743,862.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	578,600	5.57	3,222,802.00

INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	205,500	17.42	3,579,810.00
PING AN BANK CO LTD-A	119,400	9.98	1,191,612.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	141,500	4.87	689,105.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	437,300	8.15	3,563,995.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	122,500	2.23	273,175.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	79,400	9.33	740,802.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	57,330	6.77	388,124.10
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	19,900	5.04	100,296.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	46,700	6.89	321,763.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	28,660	14.23	407,831.80
CITIC SECURITIES CO-A	141,080	18.42	2,598,693.60
CSC FINANCIAL CO LTD-A	24,100	20.16	485,856.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	117,427	11.80	1,385,638.60
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,600	15.51	55,836.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	60,200	5.19	312,438.00
GF SECURITIES CO LTD-A	60,600	12.40	751,440.00
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	171,679	4.97	853,244.63
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	225,100	8.88	1,998,888.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	72,300	14.02	1,013,646.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	152,050	6.22	945,751.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	5,400	108.90	588,060.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,500	12.86	405,090.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	114,270	5.24	598,774.80
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	40,576	7.96	322,984.96
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	207,200	4.40	911,680.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	307,600	6.18	1,900,968.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	114,000	3.70	421,800.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,700	11.37	496,869.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	314,800	5.79	1,822,692.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	100,200	28.49	2,854,698.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,800	41.80	4,380,640.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	26,900	7.58	203,902.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,823	246.48	1,188,773.04
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	32,266	29.28	944,748.48
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	16,562	17.65	292,319.30
IFLYTEK CO LTD - A	10,800	41.48	447,984.00

SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,000	50.10	150,300.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	11,437	33.01	377,535.37	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	5,500	47.21	259,655.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	13,170	10.09	132,885.30	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	37,900	37.99	1,439,821.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	614,600	3.96	2,433,816.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	28,000	29.35	821,800.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	34,800	8.82	306,936.00	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	9,100	43.92	399,672.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	165,100	27.55	4,548,505.00	
GOERTEK INC -A	26,900	18.17	488,773.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	50,000	5.54	277,000.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	7,000	27.86	195,020.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	19,712	35.96	708,843.52	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	16,800	17.35	291,480.00	
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	46,450	37.88	1,759,526.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	1,728	83.51	144,305.28	
NINESTAR CORP-A	18,543	25.36	470,250.48	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	24,300	20.54	499,122.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	4,760	106.30	505,988.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,009	79.18	713,332.62	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	28,500	18.97	540,645.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	112,200	4.23	474,606.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	18,340	22.11	405,497.40	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	4,200	28.30	118,860.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	53,710	5.94	319,037.40	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	4,700	78.60	369,420.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	15,750	36.58	576,135.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	30,300	15.42	467,226.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	12,180	140.21	1,707,757.80	
ZTE CORP-A	76,400	27.00	2,062,800.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	422,800	4.55	1,923,740.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	173,800	10.54	1,831,852.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	241,300	4.33	1,044,829.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	329,880	28.89	9,530,233.20	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	55,600	20.92	1,163,152.00	

	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	315,700	5.84	1,843,688.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	176,900	18.12	3,205,428.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	92,300	18.34	1,692,782.00	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	7,097	147.51	1,046,878.47	
	AMLOGIC SHANGHAI INC-A	10,138	61.99	628,454.62	
	CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	11,422	206.31	2,356,472.82	
	CHINA RESOURCES MICROELECT-A	21,032	40.09	843,172.88	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	6,272	92.45	579,846.40	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	29,635	15.31	453,711.85	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	7,500	18.08	135,600.00	
	HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	41,125	73.62	3,027,622.50	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	7,500	56.75	425,625.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	34,202	12.01	410,766.02	
	JCET GROUP CO LTD-A	29,800	30.99	923,502.00	
	JINKO SOLAR CO LTD-A	22,986	7.90	181,589.40	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	100,340	15.03	1,508,110.20	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	21,055	57.13	1,202,872.15	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	3,100	325.70	1,009,670.00	
	SG MICRO CORP-A	4,095	87.88	359,868.60	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	3,920	95.00	372,400.00	
	SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	4,096	130.25	533,504.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	36,875	8.80	324,500.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	32,750	8.06	263,965.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	22,466	22.84	513,123.44	
	TONGWEI CO LTD-A	66,600	20.36	1,355,976.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	25,418	17.36	441,256.48	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,859	54.04	370,660.36	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	7,290	103.16	752,036.40	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	17,022	29.95	509,808.90	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	54,700	8.87	485,189.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	414,800	6.99	2,899,452.00	
	HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	522,800	3.23	1,688,644.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	81,800	9.27	758,286.00	
	オフショア人民元 小計	26,154,102		348,888,055.46 (7,643,265,074)	
サウジアラビア	ADES HOLDING CO	80,157	21.92	1,757,041.44	

リアル	SAUDI ARABIAN OIL CO	708,811	28.00	19,846,708.00
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	11,775	37.85	445,683.75
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	37,413	113.00	4,227,669.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	47,241	29.10	1,374,713.10
	SAUDI ARABIAN MINING CO	210,844	45.00	9,487,980.00
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	9,349	132.80	1,241,547.20
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	163,857	74.50	12,207,346.50
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	85,323	21.16	1,805,434.68
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	103,431	8.10	837,791.10
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	51,079	36.85	1,882,261.15
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	6,159	300.60	1,851,395.40
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	4,207	210.80	886,835.60
	JARIR MARKETING CO	125,000	12.62	1,577,500.00
	NAHDI MEDICAL CO	6,431	131.00	842,461.00
	ALMARAI CO	56,483	56.00	3,163,048.00
	SAVOLA	36,289	43.25	1,569,499.25
	DALLAH HEALTHCARE CO	6,833	160.80	1,098,746.40
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	16,399	290.80	4,768,829.20
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	15,924	120.20	1,914,064.80
	AL RAJHI BANK	346,607	81.30	28,179,149.10
	ALINMA BANK	201,652	32.05	6,462,946.60
	ARAB NATIONAL BANK	195,935	20.52	4,020,586.20
	BANK AL-JAZIRA	122,367	16.86	2,063,107.62
	BANK ALBILAD	112,127	33.65	3,773,073.55
	BANQUE SAUDI FRANSI	94,835	35.85	3,399,834.75
	RIYAD BANK	234,479	26.10	6,119,901.90
	SAUDI AWWAL BANK	147,895	39.00	5,767,905.00
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	88,300	12.78	1,128,474.00
	THE SAUDI NATIONAL BANK	490,774	36.40	17,864,173.60
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	10,957	239.60	2,625,297.20
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	14,223	238.20	3,387,918.60
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	16,655	139.40	2,321,707.00
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	4,417	282.00	1,245,594.00
ELM CO	4,094	829.00	3,393,926.00	
ETIHAD ETISALAT CO	48,844	52.20	2,549,656.80	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	90,508	11.36	1,028,170.88	

	SAUDI TELECOM CO	339,167	37.05	12,566,137.35	
	ACWA POWER CO	24,653	351.80	8,672,925.40	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	16,081	59.30	953,603.30	
	SAUDI ELECTRICITY CO	162,109	16.60	2,691,009.40	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	100,991	11.76	1,187,654.16	
	サウジアラビアリアル 小計	4,650,675		194,189,307.98 (8,270,522,626)	
	合 計	1,387,382,174		207,727,119,475 (207,727,119,475)	

(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	14,788,984.00	
	メキシコペソ 小計		97,360	14,788,984.00 (131,533,223)	
	ブラジルリアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	200,300	6,585,864.00	
		ENERGISA SA-UNITS	37,400	1,690,480.00	
		KLABIN SA-UNIT	110,000	2,261,600.00	
ブラジルリアル 小計		347,700	10,537,944.00 (311,778,772)		
投資信託受益証券合計			445,060	443,311,995 (443,311,995)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	613,700	14,072,141.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	126,346	7,853,667.36	
	メキシコペソ 小計		740,046	21,925,808.36 (195,008,139)	
投資証券合計			740,046	195,008,139 (195,008,139)	
合 計				638,320,134 (638,320,134)	

(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 26 銘柄	100.0%	—	—	2.6%
メキシコペソ	株式 21 銘柄	92.8%	—	—	2.0%
	投資信託受 益証券 1 銘柄	—	2.9%	—	0.1%
	投資証券 2 銘柄	—	—	4.3%	0.1%
ブラジルレアル	株式 45 銘柄	96.5%	—	—	4.2%
	投資信託受 益証券 3 銘柄	—	3.5%	—	0.1%
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 17 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
チェココルナ	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式 13 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
ロシアルーブル	株式 14 銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式 158 銘柄	100.0%	—	—	19.7%
マレーシアリングgit	株式 32 銘柄	100.0%	—	—	1.4%
タイバーツ	株式 32 銘柄	100.0%	—	—	1.3%
フィリピンペソ	株式 13 銘柄	100.0%	—	—	0.5%
インドネシアルピア	株式 21 銘柄	100.0%	—	—	1.5%
韓国ウォン	株式 98 銘柄	100.0%	—	—	11.9%
新台幣ドル	株式 88 銘柄	100.0%	—	—	19.1%
インドルピー	株式 146 銘柄	100.0%	—	—	19.0%
カタールリアル	株式 13 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
南アフリカランド	株式 32 銘柄	100.0%	—	—	3.0%
アラブ首長国連邦ディルハム	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	1.1%
クウェートディナール	株式 6 銘柄	100.0%	—	—	0.7%
オフショア人民元	株式 307 銘柄	100.0%	—	—	3.7%
サウジアラビアリアル	株式 42 銘柄	100.0%	—	—	4.0%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2024年6月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	74,326,957,832
国債証券	84,929,290,000
未収利息	139,266
流動資産合計	159,256,387,098
資産合計	159,256,387,098
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,197,742
流動負債合計	3,197,742
負債合計	3,197,742
純資産の部	
元本等	
元本	159,134,832,291
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	118,357,065
元本等合計	159,253,189,356
純資産合計	159,253,189,356
負債純資産合計	159,256,387,098

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年6月25日現在
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>

(貸借対照表に関する注記)

	2024年6月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	159,134,832,291 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 1.0007 円 (1 万口当たり純資産額) (10,007 円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2024年6月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2024年6月25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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年6月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年6月27日
期首元本額	222,527,923,604円
期中追加設定元本額	171,332,313,047円
期中一部解約元本額	234,725,404,360円
期末元本額	159,134,832,291円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(円コース)	4,005,348円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(ブラジル・リアルコース)	5,182,333円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド(豪ドルコース)	812,319円

オーストラリア公社債ファンド	999,601円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (豪ドルコース) (SMA専用)	9,961円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655円
ブルーベイ クレジットLSファンド (SMA専用)	9,957円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,953円
債券コア戦略ファンド	9,953円
外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9,952円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,951円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951円
SuMi TRUST マルチストラテジー/SMARS (SMA専用)	1,004,876円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990円
債券コア・セレクション	9,956円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989円
MSIMグローバル株式コンセントレイト・ファンド (SMA専用)	9,979円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,990円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (毎月決算型)	9,990円
リアルアセット関連証券ファンド (年2回決算型)	9,990円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,994円

米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,994 円
オーストラリア公社債ファンド (奇数月決算型)	9,995 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,995 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,995 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型・奇数月決算型)	9,995 円
スマート・コントロール 世界株式戦略ファンド	9,996 円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	24,620,823,586 円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	2,972,540,925 円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	14,046,281,498 円
TOPIXベアファンドF3 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,190,342,042 円
リスクプレミア α ファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872 円
TOPIXベアファンドF4 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	16,409,584,935 円
TOPIXベアファンドF5 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	12,283,806,498 円
TOPIXベアファンドF6 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,816,962,633 円
TOPIXベアファンドF7 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	9,661,941,606 円
TOPIXベアファンドF8 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	12,211,261,001 円
TOPIXベアファンドF9 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	17,881,774,675 円
TOPIXベアファンドF10 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	16,782,484,602 円
TOPIXベアファンドF11 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	5,988,905,090 円
TOPIXベアファンドF12 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821 円
TOPIXベアファンドF13 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821 円
TOPIXベアファンドF14 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,821 円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型Z) (適格機関投資家専用)	299,821 円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	246,333,890 円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		17,035,000
合計		17,035,000

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「マネープールマザーファンド」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1220回国庫短期証券	45,000,000,000	44,966,970,000	
	第1226回国庫短期証券	40,000,000,000	39,962,320,000	
合計		85,000,000,000	84,929,290,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 10 期中間計算期間(2024 年 6 月 26 日から 2024 年 12 月 25 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

2025年3月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 百瀬和政
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式 SMTB セレクション (SMA 専用) の 2024 年 6 月 26 日から 2024 年 12 月 25 日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、外国株式 SMTB セレクション (SMA 専用) の 2024 年 12 月 25 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 (2024 年 6 月 26 日から 2024 年 12 月 25 日まで) の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

ると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (2024年6月25日現在)	第10期中間計算期間 (2024年12月25日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,066,046,334	5,688,649,819
投資信託受益証券	134,456,135,832	156,014,562,918
投資証券	34,675,702,889	70,813,104,409
親投資信託受益証券	55,614,959,233	75,168,841,326
未収利息	7,618	33,776
流動資産合計	228,812,851,906	307,685,192,248
資産合計	228,812,851,906	307,685,192,248
負債の部		
流動負債		
未払解約金	247,306,911	356,517,170
未払受託者報酬	56,544,745	69,590,712
未払委託者報酬	565,447,324	695,907,042
その他未払費用	1,303,793	1,440,308
流動負債合計	870,602,773	1,123,455,232
負債合計	870,602,773	1,123,455,232
純資産の部		
元本等		
元本	91,332,598,824	118,791,936,596
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	136,609,650,309	187,769,800,420
(分配準備積立金)	82,450,715,233	74,870,995,094
元本等合計	227,942,249,133	306,561,737,016
純資産合計	227,942,249,133	306,561,737,016
負債純資産合計	228,812,851,906	307,685,192,248

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期中間計算期間 自 2023年6月27日 至 2023年12月26日	第10期中間計算期間 自 2024年6月26日 至 2024年12月25日
営業収益		
受取利息	6,107	6,814,403
有価証券売買等損益	9,875,214,408	14,718,895,657
営業収益合計	9,875,220,515	14,725,710,060
営業費用		
支払利息	736,761	-
受託者報酬	44,866,889	69,590,712
委託者報酬	448,668,803	695,907,042
その他費用	1,191,186	1,440,308
営業費用合計	495,463,639	766,938,062
営業利益又は営業損失(△)	9,379,756,876	13,958,771,998
経常利益又は経常損失(△)	9,379,756,876	13,958,771,998
中間純利益又は中間純損失(△)	9,379,756,876	13,958,771,998
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(△)	324,390,450	131,536,253
期首剰余金又は期首欠損金(△)	72,652,990,587	136,609,650,309
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,345,912,950	50,945,752,891
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,345,912,950	50,945,752,891
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,016,887,012	13,612,838,525
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,016,887,012	13,612,838,525
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金(△)	95,037,382,951	187,769,800,420

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 9 期 (2024 年 6 月 25 日現在)	第 10 期中間計算期間 (2024 年 12 月 25 日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	91,332,598,824 口	118,791,936,596 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	<p>1 口当たり純資産額 2.4957 円</p> <p>(1 万口当たり純資産額) (24,957 円)</p>	<p>1 口当たり純資産額 2.5807 円</p> <p>(1 万口当たり純資産額) (25,807 円)</p>

(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 10 期中間計算期間 (2024 年 12 月 25 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 9 期 自 2023 年 6 月 27 日	第 10 期中間計算期間 自 2024 年 6 月 26 日

	至 2024 年 6 月 25 日	至 2024 年 12 月 25 日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	80,788,557,511 円	91,332,598,824 円
期中追加設定元本額	38,185,724,106 円	36,618,138,111 円
期中一部解約元本額	27,641,682,793 円	9,158,800,339 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024 年 12 月 25 日現在
項目	金額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,404,259,823
コール・ローン	450,363,900
株式	835,701,606,738
投資信託受益証券	119,628,125
投資証券	14,819,992,253
派生商品評価勘定	13,289,106
未収入金	5,974,879
未収配当金	531,499,223
未収利息	2,674
前払金	169,609,894
差入委託証拠金	8,755,073,995
流動資産合計	868,971,300,610
資産合計	868,971,300,610
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	183,200,812
未払解約金	846,969,071
流動負債合計	1,030,169,883
負債合計	1,030,169,883
純資産の部	
元本等	
元本	117,520,605,636
剰余金	
剰余金又は欠損金 (△)	750,420,525,091
元本等合計	867,941,130,727

純資産合計	867,941,130,727
負債純資産合計	868,971,300,610

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月25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。</p>

	<p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>
--	---

(貸借対照表に関する注記)

	2024年12月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,520,605,636 口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 7.3854 円 (1万口当たり純資産額) (73,854 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

	2024年12月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年12月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年6月26日
期首元本額	115,656,611,339 円
期中追加設定元本額	8,439,657,292 円
期中一部解約元本額	6,575,662,995 円
期末元本額	117,520,605,636 円
期末元本額の内訳	

SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,287,417,539円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,063,305円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,886,352,542円
世界経済インデックスファンド	15,146,119,031円
外国株式インデックス・オープン	850,854,269円
DCマイセクション25	509,416,943円
DCマイセクション50	2,857,185,076円
DCマイセクション75	3,814,065,163円
DC外国株式インデックス・オープン	13,610,685,120円
DCマイセクションS25	386,016,651円
DCマイセクションS50	1,995,452,486円
DCマイセクションS75	2,277,533,159円
DCターゲット・イヤーフンド2025	7,805,387円
DCターゲット・イヤーフンド2035	116,705,605円
DCターゲット・イヤーフンド2045	96,965,652円
DC世界経済インデックスファンド	8,671,271,899円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	716,955,863円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,449,883円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	2,500,900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）	12,039,571円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	4,109,853円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	16,984,247円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	5,092,647円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	15,675,333円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	82,335,832円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	96,410,947円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	753,892,559円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	51,211,067円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,979,705円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	82,803,645円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	26,210,673円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	625,276,823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）	622,729,952円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,144,382,387円
コア投資戦略ファンド（安定型）	125,404,541円
コア投資戦略ファンド（成長型）	300,483,224円
分散投資コア戦略ファンドA	1,285,712,778円
分散投資コア戦略ファンドS	6,018,408,147円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,561,778,332円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	938,356,339円
コア投資戦略ファンド（切替型）	123,260,589円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	401,278,746円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	20,339,332円
SMT インデックスバランス・オープン	93,871,126円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	67,093,403円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	6,205,772,915円
SMT 世界経済インデックス・オープン	261,310,774円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,315,304,457円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	216,223,926円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,521,695円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	3,279,501,475円
グローバル経済コア	715,478,827円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,974,570円
DCターゲット・イヤーフンド2055	6,497,721円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	126,983,021円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,310,017円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	178,329,933円

DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	185,298,767円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	86,821,660円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	113,678,224円
10資産分散投資ファンド	57,934,098円
グローバル10資産バランスファンド	21,151,401円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	13,705,431円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	2,249,459円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	1,441,182円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	2,695,911円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	729,287円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	398,600円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	89,177円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	63,256円
DCマイセレクトシヨンス50（2024-2026リスク抑制型）	75,940,578円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	67,602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）	50,445,925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）	421,139,475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）	735,068,379円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,462,904,182円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	102,145,737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）	54,550,137円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,726,636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）	95,504,910円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	15,353円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	12,624円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	12,624円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	15,353円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	12,956円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	13,989円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	153,127,006円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	144,262,347円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	143,733,691円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	150,009,176円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	148,763,609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）	43,648,234円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	91,081,058円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年12月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	17,217,693,352	—	17,048,083,458	△169,609,894
合計		17,217,693,352	—	17,048,083,458	△169,609,894

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2024年12月25日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	632,205,540	—	632,507,352	△301,812
	アメリカドル	517,452,900	—	517,698,642	△245,742
	カナダドル	65,652,600	—	65,670,720	△18,120
	ユーロ	49,100,040	—	49,137,990	△37,950
合計		632,205,540	—	632,507,352	△301,812

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

貸借対照表

	2024年12月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	267,120,083
コール・ローン	5,832,376
株式	20,937,960,324
投資信託受益証券	3,796,970
投資証券	381,727,143
派生商品評価勘定	1,529
未収配当金	12,458,500
未収利息	34
前払金	5,833,739
差入委託証拠金	288,710,946
流動資産合計	21,903,441,644
資産合計	21,903,441,644
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,855,668
未払解約金	6,142,025
流動負債合計	11,997,693

負債合計	11,997,693
純資産の部	
元本等	
元本	11,352,177,384
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	10,539,266,567
元本等合計	21,891,443,951
純資産合計	21,891,443,951
負債純資産合計	21,903,441,644

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年12月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	11,352,177,384 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) 1.9284 円 (19,284 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

	2024年12月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2024年12月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年6月26日
期首元本額	9,577,609,205 円
期中追加設定元本額	2,534,455,245 円
期中一部解約元本額	759,887,066 円
期末元本額	11,352,177,384 円

期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	158,849,496 円
コア投資戦略ファンド（成長型）	392,865,967 円
コア投資戦略ファンド（切替型）	157,253,359 円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	85,559,549 円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	7,685,762,536 円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	160,478,334 円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	44,725,759 円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,602,027,932 円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	64,654,452 円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年12月25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	533,475,921	—	527,642,182	△5,833,739
合計		533,475,921	—	527,642,182	△5,833,739

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年12月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	33,091,958	—	33,112,358	△20,400
	アメリカドル	30,032,460	—	30,052,665	△20,205
	ユーロ	1,637,958	—	1,637,933	25
	スウェーデンクローナ	1,421,540	—	1,421,760	△220
合計		33,091,958	—	33,112,358	△20,400

（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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年12月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,830,167,339
コール・ローン	419,950,346
株式	223,473,093,562
投資信託受益証券	424,343,233
投資証券	198,743,830
派生商品評価勘定	4,274,276
未収配当金	192,449,447
未収利息	2,493
前払金	87,899,091
差入委託証拠金	1,663,075,320
流動資産合計	231,293,998,937
資産合計	231,293,998,937
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	91,084,834
未払解約金	134,420,416
流動負債合計	225,505,250
負債合計	225,505,250
純資産の部	
元本等	
元本	48,541,991,948
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	182,526,501,739
元本等合計	231,068,493,687
純資産合計	231,068,493,687
負債純資産合計	231,293,998,937

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月25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)

	2024年12月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	48,541,991,948 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 4.7602円 (1万口当たり純資産額) (47,602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

	2024年12月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差	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

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	2024年12月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年6月26日
期首元本額	45,766,642,853円
期中追加設定元本額	4,305,085,208円
期中一部解約元本額	1,529,736,113円
期末元本額	48,541,991,948円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	6,849,623,554円
世界経済インデックスファンド	13,896,594,499円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,422,599,605円
DC世界経済インデックスファンド	7,891,738,682円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	85,101,514円
コア投資戦略ファンド (安定型)	60,606,383円
コア投資戦略ファンド (成長型)	149,892,084円
分散投資コア戦略ファンドA	272,513,881円
分散投資コア戦略ファンドS	1,285,647,921円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,431,269,386円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	824,604,988円
コア投資戦略ファンド (切替型)	64,027,692円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	369,748,267円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,482,933円
SMT インデックスバランス・オープン	85,719,033円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	34,032,360円
外国株式SMT Bセレクション (SMA専用)	3,049,344,902円
SMT 世界経済インデックス・オープン	298,272,649円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,494,420,323円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	238,863,023円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,172,849円
グローバル経済コア	661,727,683円

My SMT 新興国株式インデックス (ノーロード)	633,535,598 円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	64,535,900 円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	17,064,297 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	129,938,141 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	134,887,696 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	63,284,499 円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	82,839,214 円
10資産分散投資ファンド	18,023,778 円
グローバル10資産バランスファンド	30,441,911 円
DC世界経済インデックスファンド (株式特化型)	13,276,059 円
DC全世界株式インデックスファンド (オール・カントリー)	12,025 円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,625,115,611 円
FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	115,826,619 円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	82,577,963 円
ファンドラップ運用戦略F (中庸型) (適格機関投資家専用)	15,432,808 円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS (適格機関投資家専用)	22,110,238 円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1 (適格機関投資家専用)	13,176 円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2 (適格機関投資家専用)	13,176 円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3 (適格機関投資家専用)	13,176 円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4 (適格機関投資家専用)	13,176 円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5 (適格機関投資家専用)	13,176 円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6 (適格機関投資家専用)	19,500 円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年12月25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	6,987,616,130	—	6,899,717,039	△87,899,091
合計		6,987,616,130	—	6,899,717,039	△87,899,091

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2024年12月25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	299,619,346	—	299,910,615	291,269
	アメリカドル	299,619,346	—	299,910,615	291,269
	売建	59,929,546	—	59,132,282	797,264
	ブラジルリアル	59,929,546	—	59,132,282	797,264

合計	359,548,892	—	359,042,897	1,088,533
----	-------------	---	-------------	-----------

(注)時価の算定方法

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

マネープールマザーファンド

貸借対照表

	2024年12月25日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	69,876,681,567
国債証券	72,969,314,000
未収利息	414,895
流動資産合計	142,846,410,462
資産合計	142,846,410,462
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,411
流動負債合計	1,411
負債合計	1,411
純資産の部	
元本等	
元本	142,646,139,466
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	200,269,585
元本等合計	142,846,409,051
純資産合計	142,846,409,051
負債純資産合計	142,846,410,462

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年12月25日現在
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>

(貸借対照表に関する注記)

	2024年12月25日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		142,646,139,466 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)	1.0014 円 (10,014 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

	2024年12月25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	2024年12月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年6月26日
期首元本額	159,134,832,291 円
期中追加設定元本額	44,961,106,547 円
期中一部解約元本額	61,449,799,372 円
期末元本額	142,646,139,466 円
期末元本額の内訳	
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (円コース)	4,005,348 円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	5,182,333 円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	812,319 円
オーストラリア公社債ファンド	999,601 円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	99,941 円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (円コース)	1,015,647 円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (ブラジル・リアルコース)	4,087,676 円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (豪ドルコース)	1,991,876 円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (アジア通貨コース)	298,995 円
世界インフラ関連好配当株式 通貨選択型ファンド (米ドルコース)	1,005,802 円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり)	105,486 円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし)	210,100 円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (トルコ・リラコース)	9,963 円
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド (メキシコ・ペソコース)	9,963 円

国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	1,992,033 円
バンクローン・オープン (円コース) (SMA専用)	9,961 円
バンクローン・オープン (米ドルコース) (SMA専用)	9,961 円
債券総合型ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	9,961 円
債券総合型ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	9,961 円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジあり)	49,791 円
MLP関連証券ファンド (為替ヘッジなし)	796,655 円
バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	19,911 円
バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	696,865 円
国内株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,953 円
債券コア戦略ファンド	9,953 円
外国債券SMTBセレクション (SMA専用)	9,952 円
外国株式SMTBセレクション (SMA専用)	9,951 円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (毎月決算型)	9,951 円
オーストラリアREIT・リサーチ・オープン (年2回決算型)	1,990 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	9,950 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,950 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (年2回決算型)	1,990 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (年2回決算型)	1,990 円
債券コア・セレクション	9,956 円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,962 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (毎月決算型)	997 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (毎月決算型)	997 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジあり) (年2回決算型)	997 円
PIMCO 世界不動産関連債券ファンド (為替ヘッジなし) (年2回決算型)	997 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (毎月決算型)	4,985 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (毎月決算型)	9,970 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	9,970 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	9,970 円
世界スタートアップ&イノベーション株式ファンド	9,972 円
次世代通信関連 アジア株式戦略ファンド	4,989 円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983 円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,983 円
脱炭素関連 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,983 円
DC脱炭素関連 世界株式戦略ファンド	9,987 円
DC次世代通信関連 世界株式戦略ファンド	9,987 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (資産成長型)	9,990 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型)	9,990 円
リアルアセット関連証券ファンド (毎月決算型)	9,990 円
リアルアセット関連証券ファンド (年2回決算型)	9,990 円
半導体関連 世界株式戦略ファンド	9,993 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,994 円
米国地方債ファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,994 円
オーストラリア公社債ファンド (奇数月決算型)	9,995 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジあり (奇数月決算型)	9,995 円
NWQフレキシブル・インカムファンド 為替ヘッジなし (奇数月決算型)	9,995 円
イノベーション・インサイト 世界株式戦略ファンド (予想分配金提示型・奇数月決算型)	9,995 円
スマート・コントロール 世界株式戦略ファンド	9,996 円
ダイナミック・マルチエクスポージャー・コントロールファンド (適格機関投資家専用)	24,620,823,586 円
ダイナミック・エクスポージャー・コントロール株式ファンド (適格機関投資家専用)	2,972,540,925 円
ダイナミック・為替エクスポージャー・コントロール債券ファンド (適格機関投資家専用)	13,501,015,451 円
リスクプレミア α ファンド (適格機関投資家専用)	2,995,805,872 円
TOPIXベアファンドF4 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	15,716,568,481 円

TOPIXベアファンドF5 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,508,486,049 円
TOPIXベアファンドF6 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	13,273,749,460 円
TOPIXベアファンドF7 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	9,647,120,614 円
TOPIXベアファンドF8 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	11,787,776,851 円
TOPIXベアファンドF9 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,187,198,113 円
TOPIXベアファンドF10 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	478,634,545 円
TOPIXベアファンドF11 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	6,176,470,429 円
TOPIXベアファンドF12 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	5,099,163,481 円
TOPIXベアファンドF13 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,076,933,151 円
TOPIXベアファンドF14 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	8,337,412,035 円
米国国債ベアファンド (建玉比率非調整型Z) (適格機関投資家専用)	299,821 円
TOPIXベアファンドF15 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,795 円
TOPIXベアファンドF16 (建玉数量固定型/リセットありZ) (適格機関投資家専用)	299,795 円
私募マネープールファンドAL (適格機関投資家専用)	241,791,631 円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

2 【ファンドの現況】

【外国株式SMTBセレクション（SMA専用）】

【純資産額計算書】

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	300,161,612,325円
II 負債総額	444,378,272円
III 純資産総額（I－II）	299,717,234,053円
IV 発行済口数	114,754,907,528口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6118円
(1万口当たり純資産額)	(26,118円)

(参考)

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	861,491,407,158円
II 負債総額	693,056,856円
III 純資産総額（I－II）	860,798,350,302円
IV 発行済口数	116,629,119,145口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	7.3806円
(1万口当たり純資産額)	(73,806円)

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	20,754,836,440円
II 負債総額	13,402,742円
III 純資産総額（I－II）	20,741,433,698円
IV 発行済口数	10,900,824,330口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.9027円
(1万口当たり純資産額)	(19,027円)

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	230,786,603,507円
II 負債総額	73,555,474円
III 純資産総額 (I - II)	230,713,048,033円
IV 発行済口数	48,935,525,610口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	4.7146円
(1万口当たり純資産額)	(47,146円)

マネープールマザーファンド

純資産額計算書

(2025年1月31日現在)

I 資産総額	142,867,248,452円
II 負債総額	960円
III 純資産総額 (I - II)	142,867,247,492円
IV 発行済口数	142,656,379,917口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	1.0015円
(1万口当たり純資産額)	(10,015円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限

該当事項はありません。

(4) 振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 受益証券の不発行

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

② 受益権の譲渡

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

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

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

④ 受益権の再分割

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

⑤ 償還金

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

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2025年1月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

また、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に對して会日の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、ファンドマネージャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定しま

す。

[DO (実行)]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK (検証・評価)]

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

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

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

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

委託会社の機構は 2025 年 3 月 25 日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2025 年 1 月 31 日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	527	15,887,722
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	56	202,010
単位型公社債投資信託	52	168,562
合計	635	16,258,294

3【委託会社等の経理状況】

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は財務諸表等規則並びに同規則第 2 条、第 282 条及び第 306 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年内閣府令第 52 号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 38 期事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期事業年度の中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の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2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 255	※1 219
器具備品	※1 560	※1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	△510	△1,071
評価・換算差額等合計	△460	△710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077
その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	—	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	—	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	—
その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	—
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	—	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	—	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	—	—	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	49	△510	△460	66,134
当期変動額				
剰余金の配当				△3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	△560	△250	△250
当期変動額合計	310	△560	△250	968
当期末残高	360	△1,071	△710	67,103

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。

(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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建 物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	〃	823	〃
計	866	〃	1,044	〃

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (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

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23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

当事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

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

2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の 種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株 式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(リース取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
前事業年度 (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)				
株式関連取引	(10)	—	—	(10)
通貨関連取引	—	(136)	—	(136)
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 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。

当事業年度 (2024年3月31日)

区 分	貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	—	17,579
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	—	4,517	—	4,517
資産計	1,530	20,565	—	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	—	(530)
通貨関連取引	—	21	—	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	—	(509)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等 (貸借対照表計上額 1,017 百万円) は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は 18,596 百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式 (貸借対照表計上額 876 百万円) 及び組合出資金等 (貸借対照表計上額 359 百万円) は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間 (1 年以内) で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスク

の対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(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

当事業年度(2024年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	14,909	—	—	—
未収委託者報酬	10,943	—	—	—
未収運用受託報酬	5,967	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	1,829	807	—

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

2. その他有価証券

前事業年度 (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

当事業年度 (2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	△287
小計	1,123	1,410	△287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度 (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

当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	185	1	33

(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 (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)
店頭	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。

当事業年度 (2024年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	—	4	4
	英ポンド	288	—	0	0
	カナダドル	145	—	△0	△0
	スイスフラン	180	—	0	0
	香港ドル	217	—	0	0
	ユーロ	664	—	3	3
	合計	8,231	—	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度（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。

当事業年度（2024年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,306	—	△268	△268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	—	△262	△262
合計		14,490	—	△530	△530

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

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（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	—	△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

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	—	1
	英ポンド		4,586	—	7
	スイスフラン		28	—	0
	香港ドル		83	—	0
	ユーロ		63	—	0
	シンガポールドル		448	—	1
合計			7,337	—	10

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	△57	△85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	△6	△17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	—	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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 109 百万円、当事業年度 122 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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	58	百万円	63	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187	〃	220	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	277	〃	298	〃
税務上の費用認識差額	412	〃	256	〃
繰延ヘッジ損益	225	〃	472	〃
その他	75	〃	78	〃
繰延税金資産 合計	1,236	〃	1,390	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△21	〃	△159	〃
その他	△32	〃	△35	〃
繰延税金負債 合計	△54	〃	△194	〃
繰延税金資産の純額	1,181	〃	1,196	〃

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、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 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

当事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223 百万円

[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 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。

当事業年度（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有 (被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	—	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

① 運用受託報酬

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

② 投信販売代行手数料等

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

(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（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）

当事業年度（2024 年 3 月 31 日）

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

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
1 株当たり純資産額	22,044,962 円 63 銭	22,367,677 円 92 銭
1 株当たり当期純利益金額	1,816,227 円 49 銭	1,528,527 円 02 銭

(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	当事業年度 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
当期純利益	5,448 百万円	4,585 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	5,448 百万円	4,585 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

2024年12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 洋 一

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2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024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、分析的な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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、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. XBR 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 39 期中間会計期間末

(2024 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268
固定資産		
有形固定資産	※1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047
投資その他の資産		
投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850
固定資産合計		21,491
資産合計		80,759
負債の部		
流動負債		
未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	※2	2,306
流動負債合計		12,364
固定負債		
退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154
その他		53
固定負債合計		1,244
負債合計		13,608

(単位：百万円)

第 39 期中間会計期間末

(2024 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		45,816
利益剰余金合計		48,416
株主資本合計		67,655
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		453
繰延ヘッジ損益		△958
評価・換算差額等合計		△504
純資産合計		67,150
負債・純資産合計		80,759

中間損益計算書

(単位：百万円)

第 39 期中間会計期間

(自 2024 年 4 月 1 日

至 2024 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169
営業費用		18,985
一般管理費	※1	7,504
営業利益		4,678
営業外収益	※2	193
営業外費用	※3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		△129
法人税等調整額		△22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

中間株主資本等変動計算書

第 39 期中間会計期間（自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			△2,943	△2,943	△2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
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	—	—	△157	△157	△157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	360	△1,071	△710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				△2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	△958	△504	67,150

注記事項

(重要な会計方針)

第 39 期中間会計期間
(自 2024 年 4 月 1 日
至 2024 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。

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

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しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理

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

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

第 39 期中間会計期末 (2024 年 9 月 30 日)	
※1 有形固定資産の減価償却累計額	1,128 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
※1 減価償却実施額	
有形固定資産	83 百万円
無形固定資産	1,211 百万円
※2 営業外収益の主要項目	
投資有価証券売却益	149 百万円
※3 営業外費用の主要項目	
金銭の信託運用損	263 百万円
投資有価証券償還損	239 百万円
為替差損	146 百万円
デリバティブ費用	138 百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間(自2024年4月1日至2024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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(2) 基準日が当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39期中間会計期間末(2024年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区 分	中間貸借対照表計上額 (百万円) (*1)			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託	2,561	15,657	—	18,219
投資有価証券(*2)				
その他有価証券	—	3,269	—	3,269
資産計	2,561	18,927	—	21,488
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(281)	(230)	—	(511)
通貨関連取引	—	(286)	—	(286)
デリバティブ取引計	(281)	(517)	—	(798)

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 投資有価証券のうち、非上場株式（中間貸借対照表計上額 876 百万円）、時価算定適用指針第 24-3 項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額 1,991 百万円）及び第 24-16 項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額 478 百万円）は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1 年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。時価算定適用指針第 24-3 項の取扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル 1 の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンズワップの時価は、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	876
関係会社株式	6,077

(注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報
第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	△8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末(2024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	6,077

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	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,249	2,306	△57
小計	2,249	2,306	△57
合計	5,260	4,613	647

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額876百万円)及び組合出資金等(中間貸借対照表計上額478百万円)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39期中間会計期間(自2024年4月1日至2024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	5,053	—	△83	△83
	英ポンド	173	—	△5	△5
	カナダドル	130	—	△2	△2
	スイスフラン	74	—	△1	△1
	香港ドル	120	—	△1	△1
	ユーロ	461	—	△9	△9
	買建				
	米ドル	42	—	△0	△0
	ユーロ	11	—	△0	△0
合計		6,068	—	△104	△104

(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	10,399	—	△281	△281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	—	△230	△230
合計		15,923	—	△511	△511

(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		1,833	—	△30
	英ポンド		4,463	—	△137
	スイスフラン		49	—	△0
	香港ドル		95	—	△1
	ユーロ		31	—	△0
	シンガポールドル		433	—	△11
合計			6,906	—	△182

(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39期中間会計期間(自2024年4月1日至2024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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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	5,620 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

	第 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)
1 株当たり純資産額	22,383,579 円 15 銭
1 株当たり中間純利益	928,397 円 37 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 39 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)
中間純利益	2,785 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	2,785 百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000 株

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

(1) 自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2025年3月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

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

1. 基本方針

この投資信託は、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

別に定める投資信託証券（以下「投資対象ファンド」といいます。）を主要投資対象とします。

このほか、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券並びに短期金融商品等に直接投資することもあります。

(2) 投資態度

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

※1 世界の株式には、わが国の株式を含むことがあります。

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

②各投資対象ファンドへの投資割合は、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性及び相関係数等を基に決定します。各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての投資対象ファンドに投資するとは限りません。

③投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されることや新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

④投資対象ファンドへの投資割合は、原則として高位を維持します。

⑤この投資信託では原則として為替ヘッジを行いません。ただし、外貨建資産について為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れる場合があります。

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

(3) 運用制限

①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

②株式への直接投資は行いません。

③外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

④デリバティブの直接利用は行いません。

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

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

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

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

(信託の種類、委託者及び受託者)

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

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

(信託事務の委託)

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

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

(信託の目的及び金額)

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

(信託金の限度額)

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

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

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

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

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

(当初の受益者)

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

(受益権の分割及び再分割)

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

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

(追加信託の価額及び口数、基準価額の計算方法)

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

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

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

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

④第 22 条に規定する為替予約の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（信託日時異なる受益権の内容）

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

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

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

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

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

（受益権の設定に係る受託者の通知）

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

（受益権の申込単位及び価額）

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

②前項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金（第 4 項又は第 5 項

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

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

(受益権の譲渡に係る記載又は記録)

第14条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

(受益権の譲渡の対抗要件)

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

(投資の対象とする資産の種類)

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

- 1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. 金銭債権
 - ハ. 約束手形
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第17条 委託者は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券に投資するほか、次に掲げる有価証券(金

融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

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

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

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

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（利害関係人等との取引等）

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

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

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

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

（運用の基本方針）

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

います。

(公社債の借入れの指図、目的及び範囲)

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

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

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

④第 1 項の借入れに係る品借料は、投資信託財産中から支弁します。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 21 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約取引の指図、目的及び範囲)

第 22 条 委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産について当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(信託業務の委託等)

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

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

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

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

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

(混蔵寄託)

第 24 条 金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で

混蔵寄託することができるものとします。

(投資信託財産の登記等及び記載等の留保等)

第 25 条 信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

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

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

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

(一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図)

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

(再投資の指図)

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

(資金の借入れ)

第 28 条 委託者は、投資信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

②一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の 10%を超えないこととします。

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

④借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

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

(受託者による資金の立替え)

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

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

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

(信託の計算期間)

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

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

(投資信託財産に関する報告等)

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

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

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

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

(信託事務の諸費用)

第 33 条 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。

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

(信託報酬等の総額及び支弁の方法)

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

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

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

(収益の分配方式)

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

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

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

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金及び一部解約金の支払い)

第 36 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

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

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

④一部解約金（第 39 条第 4 項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第 39 条第 1 項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、7 営業日目から当該受益者に支払います。

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

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

(収益分配金、償還金及び一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

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

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

(収益分配金及び償還金の時効)

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

す。

(投資信託契約の一部解約)

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

- ②受益者が前項の一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③委託者は、第 1 項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。なお、第 1 項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌々営業日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、ニューヨーク証券取引所もしくはロンドン証券取引所の休業日又はニューヨーク、ロンドンもしくはアイルランドの銀行休業日においては、第 1 項による一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。
- ⑥委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖、その他やむを得ない事情があるときは、第 1 項による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑦前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、第 4 項の規定に準じて計算された価額とします。

(質権口記載又は記録の受益権の取扱い)

第 40 条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、この投資信託約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(投資信託契約の解約)

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

- ②委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③委託者は、前 2 項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに投資信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、この投資信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ④前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しな

いときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

⑤第3項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。

⑥第3項から前項までの規定は、委託者が投資信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項から前項までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

(投資信託契約に関する監督官庁の命令)

第42条 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第43条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

(委託者の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い)

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

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

(受託者の辞任及び解任に伴う取扱い)

第45条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者又は受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、又は裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第46条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(投資信託約款の変更等)

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

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議

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

- ③前項の書面決議において、受益者（委託者及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑤書面決議の効力は、この信託の全ての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

（信託期間の延長）

第47条 （削除）

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

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

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

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

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

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

（公告）

第50条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

（投資信託約款に関する疑義の取扱い）

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

（付則）

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

上記条項により投資信託契約を締結します。

投資信託契約締結日 平成 27 年 7 月 24 日

委託者 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

1. 別に定める投資信託証券

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

親投資信託 外国株式インデックス マザーファンド

親投資信託 外国株式 ESG リーダーズインデックスマザーファンド

親投資信託 新興国株式インデックス マザーファンド

追加型証券投資信託 ブランディワイン・グローバル株式ファンド（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）

追加型証券投資信託 世界エクイティ・ファンド（適格機関投資家向け）

追加型証券投資信託 GIM グローバル・セレクト株式ファンドFB（適格機関投資家専用）

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

外国籍円建投資信託証券 Fisher Investments Institutional Global Developed Concentrated Equity Fund JPY Class Shares (unhedged)

親投資信託 マネープールマザーファンド